

华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型发起式证券投资 基金

2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 华泰紫金周周购 12 个月滚动债发起 |
| 基金主代码 | 009638 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 6 月 18 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 262,025,040.81 份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 在基金合同约定的投资范围内，本基金将通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，结合定量分析方法， |

| | | |
|-----------------|--|----------------------|
| | 确定资产在利率债和信用债之间的配置比例。同时，根据市场利率的水平和本基金距下一运作期到期日剩余期限，确定采取持有到期投资策略的债券配置比例。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富（总值）指数收益率×95%+沪深 300 指数收益率×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 华泰证券（上海）资产管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华泰紫金周周购 12 个月滚动债发起 A | 华泰紫金周周购 12 个月滚动债发起 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 009638 | 009639 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 249,114,462.49 份 | 12,910,578.32 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日) | |
|----------------|---|----------------------|
| | 华泰紫金周周购 12 个月滚动债发起 A | 华泰紫金周周购 12 个月滚动债发起 C |
| 1.本期已实现收益 | 2,792,421.36 | 132,668.05 |
| 2.本期利润 | 2,603,803.68 | 123,106.15 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0105 | 0.0097 |
| 4.期末基金资产净值 | 251,680,737.00 | 13,032,409.57 |

| | | |
|------------|--------|--------|
| 5.期末基金份额净值 | 1.0103 | 1.0094 |
|------------|--------|--------|

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、华泰紫金周周购 12 个月滚动债发起 A:

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 1.05% | 0.02% | -0.07% | 0.08% | 1.12% | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.03% | 0.02% | 0.28% | 0.08% | 0.75% | -0.06% |

2、华泰紫金周周购 12 个月滚动债发起 C:

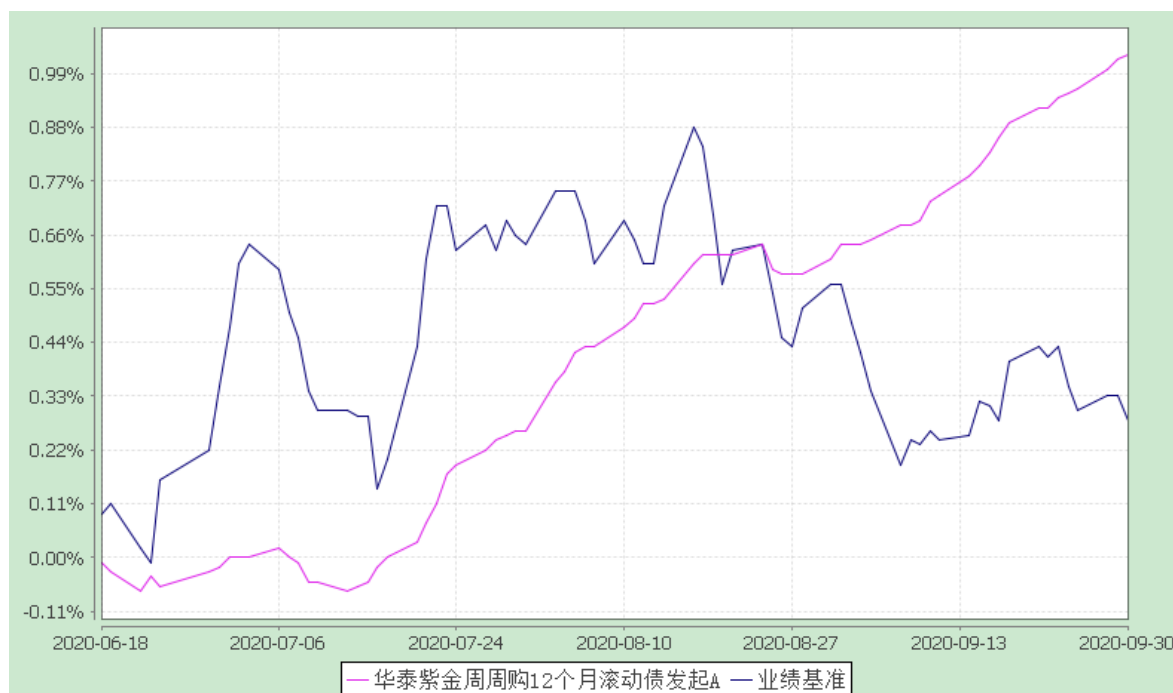
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.97% | 0.02% | -0.07% | 0.08% | 1.04% | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.94% | 0.02% | 0.28% | 0.08% | 0.66% | -0.06% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

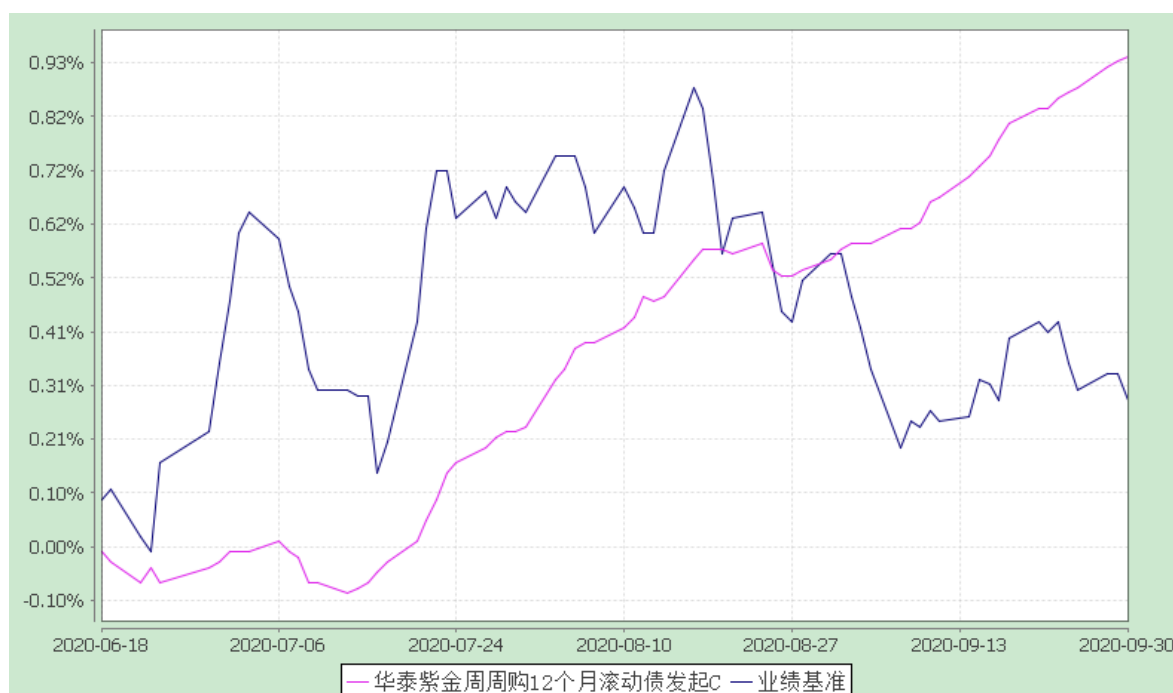
华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 6 月 18 日至 2020 年 9 月 30 日)

1. 华泰紫金周周购 12 个月滚动债发起 A:



2. 华泰紫金周周购 12 个月滚动债发起 C:



注：1、本基金的合同生效日为 2020 年 6 月 18 日，自基金成立起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金尚处于建仓期，且运作未满 1 年。

2、本基金业绩比较基准=中债综合财富(总值)指数收益率*95%+沪深 300 指数收益率*5%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈晨 | 本基金的基金经理 | 2020-06-18 | - | 11 | 曾任职于巴克莱资本（香港），从事海外可转债市场的交易和投资工作。2011 年至 2014 年，曾先后任职于申银万国研究所和中投证券研究所，从事债券研究工作。2014 年加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，担任固定收益投资经理。2019 年 3 月起陆续担任华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金等基金的基金经理。 |
| 陈利 | 本基金的基金经理 | 2020-08-05 | - | 9 | 历任德邦证券股份有限公司研究所研究员，德邦基金管理有限公司投资研究部研究员、基金经理助理、基金经理。2017 年 1 月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，2018 年 5 月起陆续担任华泰紫金天天金交易型货币市场基金、华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金等基金的基金经理。 |

注：1.上述基金经理的任职日期及离任日期均以基金公告为准；首任基金经理的任职日期为基金合同的生效日期。

2. 证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

公司建立了公募基金投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司股票池和债券库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得到公平对待，各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年三季度，PMI 指数维持在 50% 以上，7、8、9 月分别为 51.1%、51%、51.5%，连续 7 个月处于扩张区间，供需共振向上，显示经济内生动能有所增强。三季度经济继续延续前期的修复，前期市场对总需求不足的担忧有所缓解，生产供给到消费需求的内循环格局初步打通。

金融数据方面，8 月、9 月金融数据都超预期，9 月新增社会融资规模 34800 亿元，市场预期 29500 亿元，前值 35823 亿元；9 月新增人民币贷款 19000 亿元，市场预期 17500 亿元，前值 12800 亿元。信贷、政府融资带动社融走高，展望四季度，由于基数原因和政府融资在四季度回落，四季度社融规模亦将回落。

三季度，CPI 逐月下行，中国 9 月 CPI 同比增长 1.7%，预期 1.9%，前值 2.4%。

整体而言，四季度，预计 CPI 将持续下行，猪价年内仍然处于高位，但市场预期明年年初开始会进入下跌周期，对 CPI 食品项造成拖累，导致明年 CPI 中枢整体降低。可见，CPI 对债市尚不构成不利因素。

此外，三季度，政府债务融资金额巨大，且银行压缩结构性存款比例，负债端压力较大，虽然央行不断进行短期流动性投放，但是，总体而言，市场流动性收紧持续压制债市，曲线熊平。

三季度，本基金完成建仓操作，考虑市场存在一定的变化和组合负债端情况，保持中短久期策略，同时，在合同允许范围积极参与可转债投资，努力赚取收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 级基金净值收益率为 1.05%，C 级基金净值收益率为 0.97%，同期业绩比较基准收益率为-0.07%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；

2、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|---------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 327,222,417.76 | 97.55 |
| | 其中：债券 | 302,351,917.76 | 90.13 |
| | 资产支持证券 | 24,870,500.00 | 7.41 |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 908,049.66 | 0.27 |
| 7 | 其他各项资产 | 7,324,145.43 | 2.18 |
| 8 | 合计 | 335,454,612.85 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 14,050,650.00 | 5.31 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 168,217,424.90 | 63.55 |
| 5 | 企业短期融资券 | 69,229,700.00 | 26.15 |
| 6 | 中期票据 | 50,199,500.00 | 18.96 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 654,642.86 | 0.25 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 302,351,917.76 | 114.22 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|------------|---------------|--------------|
| 1 | 101800246 | 18 海正 MTN001 | 150,000.00 | 15,109,500.00 | 5.71 |
| 2 | 019640 | 20 国债 10 | 141,000.00 | 14,050,650.00 | 5.31 |
| 3 | 112866 | 19 金科 01 | 130,000.00 | 13,062,400.00 | 4.93 |
| 4 | 1680103 | 16 资阳水务 | 200,000.00 | 11,724,000.00 | 4.43 |
| 5 | 1480117 | 14 遂川中 | 500,000.00 | 10,260,000.00 | 3.88 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比（%） |
|----|--------|----------|------------|--------------|-------------|
| 1 | 168529 | 时宁 01 优 | 100,000.00 | 9,942,000.00 | 3.76 |
| 2 | 168504 | 碧胜 01 优 | 100,000.00 | 9,937,000.00 | 3.75 |
| 3 | 138784 | 20 联荣 1A | 50,000.00 | 4,991,500.00 | 1.89 |

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 6,083.72 |
| 2 | 应收证券清算款 | 92,401.78 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,225,659.93 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,324,145.43 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华泰紫金周周购12 | 华泰紫金周周购12 |
|----|-----------|-----------|
| | | |

| | 个月滚动债发起A | 个月滚动债发起C |
|---------------|----------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 249,082,548.21 | 12,674,166.18 |
| 本报告期基金总申购份额 | 31,914.28 | 236,412.14 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - | - |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 249,114,462.49 | 12,910,578.32 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 华泰紫金周周购12个月 滚动债发起A | 华泰紫金周周购12个月 滚动债发起C |
|----------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 报告期期初管理人持有的 本基金份额 | 10,003,200.27 | - |
| 本报告期买入/申购总份额 | - | - |
| 本报告期卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的 本基金份额 | 10,003,200.27 | - |
| 报告期期末持有的本基金 份额占基金总份额比例 (%) | 4.02 | - |

注：期末持有的基金份额占基金总份额比例为期末持有份额占基金同类份额的比例。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内管理人运用固有资金投资本基金份额未发生变动。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份 额总数 | 持有份 额占基 金总 份额比 例 | 发起份 额总数 | 发起份 额占 基金总 份额 比例 | 发起份 额承 诺持 有期 限 |
|-----------|---------------|------------------------------|---------------|------------------------------|----------------------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,003,200.27 | 3.82% | 10,000,500.00 | 3.82% | 3 年 |

| | | | | | |
|-------------|---------------|-------|---------------|-------|-----|
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,003,200.27 | 3.82% | 10,000,500.00 | 3.82% | 3 年 |

注：1、持有份额总数部分包含利息结转的份额。

2、占基金总份额比例为持有基金份额与各类基金份额合计数的比例。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人根据监管规定要求于 2020 年 09 月 01 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了本基金《基金产品资料概要》，敬请投资者查阅。

2、根据本基金管理人于 2020 年 8 月 5 日在本公司官网和证监会规定报刊、规定网站上发布的《华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告》，自 2020 年 8 月 5 日起，增聘陈利女士为本基金基金经理，与陈晨女士共同管理本基金。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会准予华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金注册的文件；

2、《华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、基金托管人业务资格批件、营业执照；

6、关于申请募集注册华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型证券投资基金之法

律意见书；

7、《华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金招募说明书》；

8、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二〇年十月二十八日