

华泰紫金智盈债券型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	华泰紫金智盈债券
基金主代码	005467
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 15 日
报告期末基金份额总额	1,854,944,715.66 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金主要通过采取信用债投资策略、收益率曲线策略、杠杆放大策略、资产支持证券投资策略、中小企业私募债券投资策略、国债期货投资策略等投资策略来实现投资目标。
业绩比较基准	中债信用债总指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货

	币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。	
基金管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金智盈债券 A	华泰紫金智盈债券 C
下属分级基金的交易代码	005467	005468
报告期末下属分级基金的份额总额	1,542,864,623.79 份	312,080,091.87 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)	
	华泰紫金智盈债券 A	华泰紫金智盈债券 C
1.本期已实现收益	22,183,052.02	4,207,907.57
2.本期利润	15,951,067.39	2,898,594.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.0096	0.0082
4.期末基金资产净值	1,814,979,282.04	348,963,813.38
5.期末基金份额净值	1.1764	1.1182

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、华泰紫金智盈债券 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	0.87%	0.02%	-0.40%	0.04%	1.27%	-0.02%
过去六个月	1.48%	0.03%	-0.85%	0.05%	2.33%	-0.02%
过去一年	4.49%	0.03%	0.38%	0.05%	4.11%	-0.02%
自基金合同生效起至今	17.64%	0.19%	4.54%	0.04%	13.10%	0.15%

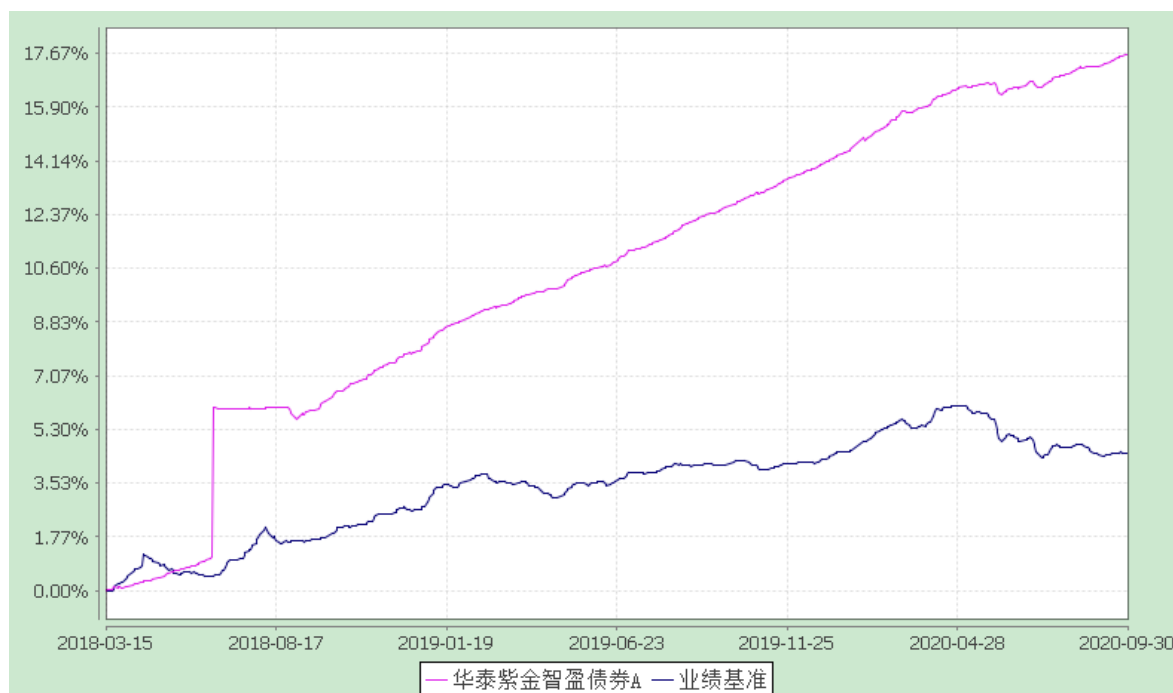
2、华泰紫金智盈债券 C:

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	0.78%	0.02%	-0.40%	0.04%	1.18%	-0.02%
过去六个月	1.32%	0.03%	-0.85%	0.05%	2.17%	-0.02%
过去一年	4.20%	0.03%	0.38%	0.05%	3.82%	-0.02%
自基金合同生效起至今	11.82%	0.03%	4.54%	0.04%	7.28%	-0.01%

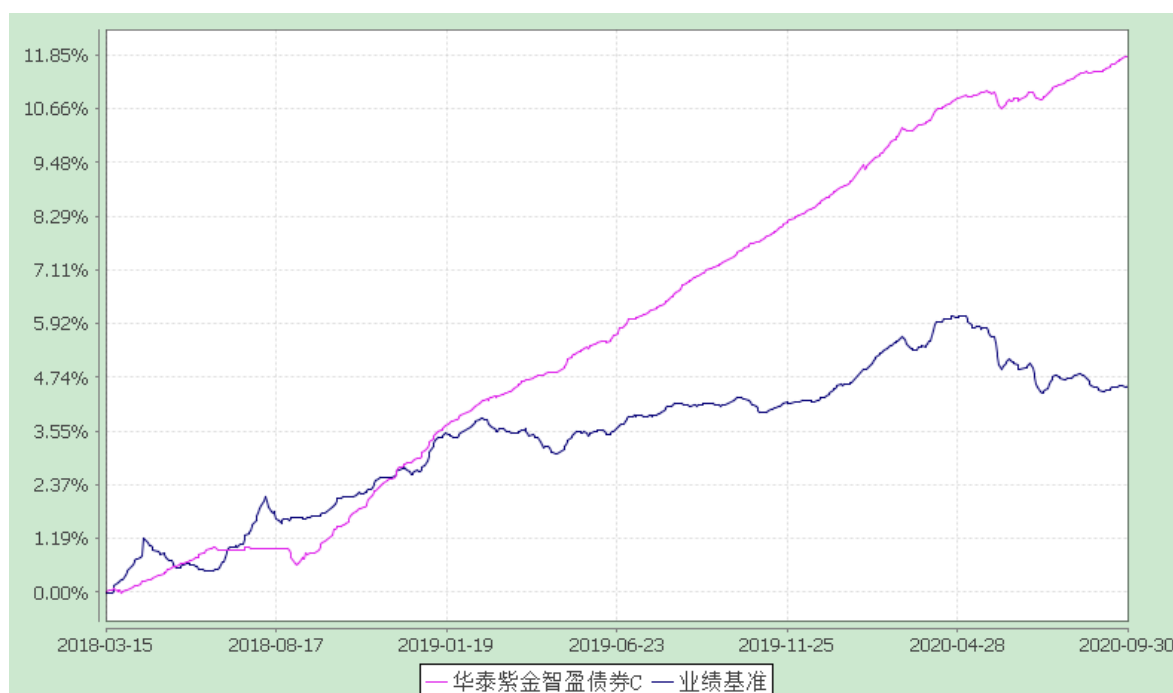
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰紫金智盈债券型证券投资基金
 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
 (2018 年 3 月 15 日至 2020 年 9 月 30 日)

1. 华泰紫金智盈债券 A:



2. 华泰紫金智盈债券 C:



注：1、本基金的合同生效日为 2018 年 3 月 15 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例均符合合同约定；

2、本基金业绩比较基准=中债信用债总指数（全价）收益率；

§ 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		
阮毅	本基金的基金经理	2018-10-31	-	9	2011 年 6 月加入上海浦东发展银行总行资产管理部，历任债券交易员、产品经理、投资经理和固收专户投资主管，专户管理规模超过 1000 亿，管理产品曾获证券时报评选最佳开放式产品奖项，2018 年 5 月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司。2018 年 10 月起陆续担任华泰紫金智盈债券型证券投资基金、华泰紫金智惠定期开放债券型证券投资基金、华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金智鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金等基金的基金经理。
李博良	本基金的基金经理	2018-03-15	-	7	2013 年加入华泰证券从事资产管理业务，2015 年进入华泰证券(上海)资产管理有限公司从事固定收益产品投资及交易工作。2017 年 8 月起陆续担任华泰紫金零钱宝货币市场基金、华泰紫金智盈债券型证券投资基金、华泰紫金丰泰纯债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《华泰紫金智盈债券型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

7 月以来，复工复产的持续推进以及内外部需求的缓慢改善令国内经济增长逐渐回归正常轨道，尽管生产和需求改善的不同步令边际改善的力度逐步弱化，但相较于全球而言，疫情防控的良好态势成就了国内优于全球的经济复苏成果。8 月起，或受益于失业率的下行和居民收入增长，消费也表现出加速修复的现象，核心 CPI 环比增速为正。

央行货币政策回归常态，市场短期、中期资金利率已经回复到政策利率附近。8 月份以来，央行对流动性的呵护比较明显，比如 OMO 的持续供应及 MLF 的超额续作。不过，政策对于稳定宏观杠杆率的取向或将加强，货币政策短期调整空间不大。

7 月初股市大涨，市场风险偏好随之上升，“股债跷跷板”效应明显，债市收益震荡上行。7 月中旬之后股市开始降温，中美摩擦加剧，债券市场迎来反弹。此后在经济继续边际回暖和债市供给压力等多种利空因素作用下，债券收益率震荡上行。分品种来看，信用债走势好于利率债，中低等级信用债好于高等级。信用债套息和杠杆策略依然是市场较为一致的选择，信用利差的维持低位。

产品操作上，组合投资以信用债配置为主。灵活控制组合久期和杠杆，关注短久期高收益债及中高等级信用债的套息机会。

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 0.87%，C 级基金净值收益率为 0.78%，同期业绩比较基准收益率为-0.40%。

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	2,094,287,900.00	96.08
	其中：债券	1,919,495,800.00	88.06
	资产支持证券	174,792,100.00	8.02
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	20,720,271.08	0.95

	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	6,208,401.31	0.28
7	其他各项资产	58,423,447.51	2.68
8	合计	2,179,640,019.90	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,584,000.00	5.53
	其中：政策性金融债	119,584,000.00	5.53
4	企业债券	683,010,400.00	31.56
5	企业短期融资券	690,212,400.00	31.90
6	中期票据	357,517,000.00	16.52
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	69,172,000.00	3.20
9	其他	-	-
10	合计	1,919,495,800.00	88.70

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	072000230	20 招商证券 CP016BC	1,000,000.00	100,010,000. 00	4.62
2	012002568	20 滨建投 SCP003	1,000,000.00	99,760,000.0 0	4.61
3	160206	16 国开 06	700,000.00	70,049,000.0 0	3.24
4	012000727	20 云能投 SCP002	500,000.00	50,125,000.0 0	2.32
5	200211	20 国开 11	500,000.00	49,535,000.0 0	2.29

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	168006	亚特 01A	300,000.00	29,619,000.00	1.37
2	159588	融信 01 优	200,000.00	19,920,000.00	0.92
3	138688	中南 20 优	200,000.00	19,908,000.00	0.92
4	142801	17 九通 A6	100,000.00	10,540,000.00	0.49
5	138941	建银 4 优 A	100,000.00	10,013,000.00	0.46
6	138715	20 荣发 B	100,000.00	9,977,000.00	0.46
7	138633	海诺 2A1	100,000.00	9,964,000.00	0.46
8	138678	创恒 02A	100,000.00	9,957,000.00	0.46
9	138623	时联 03 优	100,000.00	9,925,000.00	0.46
10	168326	融信 03 优	100,000.00	9,823,000.00	0.45

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	29,379.72
2	应收证券清算款	5,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	40,876,831.77
5	应收申购款	12,517,236.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,423,447.51

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	华泰紫金智盈债券A	华泰紫金智盈债券C
本报告期期初基金份额总额	2,078,101,533.60	528,310,655.09
本报告期基金总申购份额	307,004,260.87	78,673,088.59
减：本报告期基金总赎回份额	842,241,170.68	294,903,651.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,542,864,623.79	312,080,091.87

§ 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

本基金管理人未使用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人未使用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

8.2 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 9 月 16 日在本公司官网和证监会规定报刊、规定网站上发布的《关于公司旗下华泰紫金智盈债券型证券投资基金在北京蛋卷基金销售有限公司开展申购费率优惠活动的公告》，在不低于原费率一折的前提下，自 2020 年 9 月 16 日起投资者通过蛋卷基金申购本基金，享受申购费率优惠。优惠后，费率

不得低于基金销售成本。具体折扣费率以蛋卷基金官方公告为准。原基金申购费率按笔收取固定费用的不再享有费率优惠。基金原费率详见基金合同、招募说明书。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《华泰紫金智盈债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金智盈债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金智盈债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、报告期内披露的各项公告；
- 6、法律意见书；
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 8、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 9、中国证监会规定的其他备查文件。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

部分备查文件可通过本基金管理人公司网站查询，也可咨询本基金管理人。客服电话：4008895597；公司网址：<https://htamc.htsc.com.cn/>。

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