

# 华泰紫金货币增利货币市场基金

## 2023 年第 4 季度报告

### 2023 年 12 月 31 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：二〇二四年一月九日

## § 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 2024 年 1 月 8 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 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华泰紫金货币增利
基金主代码	940037
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 5 月 9 日
报告期末基金份额总额	15,604,760,255.83 份
投资目标	在控制投资组合风险，保持相对流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将资产配置和精选个券相结合，在动态调整现金类资产与固定收益类资产的投资比例的基础上，精选优质个券构建投资组合，在严格控制风险的基础上，实现基金资产的保值增值。

	1、大类资产配置策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略			
业绩比较基准	活期存款利率（税后）			
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。			
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			
下属四级基金的基金简称	华泰紫金货币增利 A	华泰紫金货币增利 B	华泰紫金货币增利 C	华泰紫金货币增利 E
下属四级基金的交易代码	015649	015650	940037	015651
报告期末下属四级基金的份额总额	1,348,950,951.63 份	10,077,604,929.21 份	2,662,076,997.95 份	1,516,127,377.04 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(2023年10月1日-2023年12月31日)			
	华泰紫金货币增利 A	华泰紫金货币增利 B	华泰紫金货币增利 C	华泰紫金货币增利 E
1. 本期已实现收益	5,534,349.72	27,874,281.37	14,735,339.76	8,914,468.80
2. 本期利润	5,534,349.72	27,874,281.37	14,735,339.76	8,914,468.80
3. 期末基金资产净值	1,348,950,951.63	10,077,604,929.21	2,662,076,997.95	1,516,127,377.04

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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金收益分配按日结转为份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1、华泰紫金货币增利 A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5442%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.4560%	0.0010%
过去六个月	1.0688%	0.0010%	0.1764%	0.0000%	0.8924%	0.0010%
过去一年	2.1616%	0.0010%	0.3500%	0.0000%	1.8116%	0.0010%
自基金合同生效起至今	3.3423%	0.0011%	0.5763%	0.0000%	2.7660%	0.0011%

注：A级份额初始日期为2022年5月10日。

##### 2、华泰紫金货币增利 B:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5442%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.4560%	0.0010%
过去六个月	1.0688%	0.0010%	0.1764%	0.0000%	0.8924%	0.0010%
过去一年	2.1616%	0.0010%	0.3500%	0.0000%	1.8116%	0.0010%

自基金合同生效起至今	3.3423%	0.0011%	0.5763%	0.0000%	2.7660%	0.0011%
------------	---------	---------	---------	---------	---------	---------

注：B级份额初始日期为2022年5月10日。

### 3、华泰紫金货币增利 C：

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5442%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.4560%	0.0010%
过去六个月	1.0687%	0.0010%	0.1764%	0.0000%	0.8923%	0.0010%
过去一年	2.1616%	0.0010%	0.3500%	0.0000%	1.8116%	0.0010%
自基金合同生效起至今	3.3463%	0.0011%	0.5773%	0.0000%	2.7690%	0.0011%

注：C级份额初始日期为2022年5月9日。

### 4、华泰紫金货币增利 E：

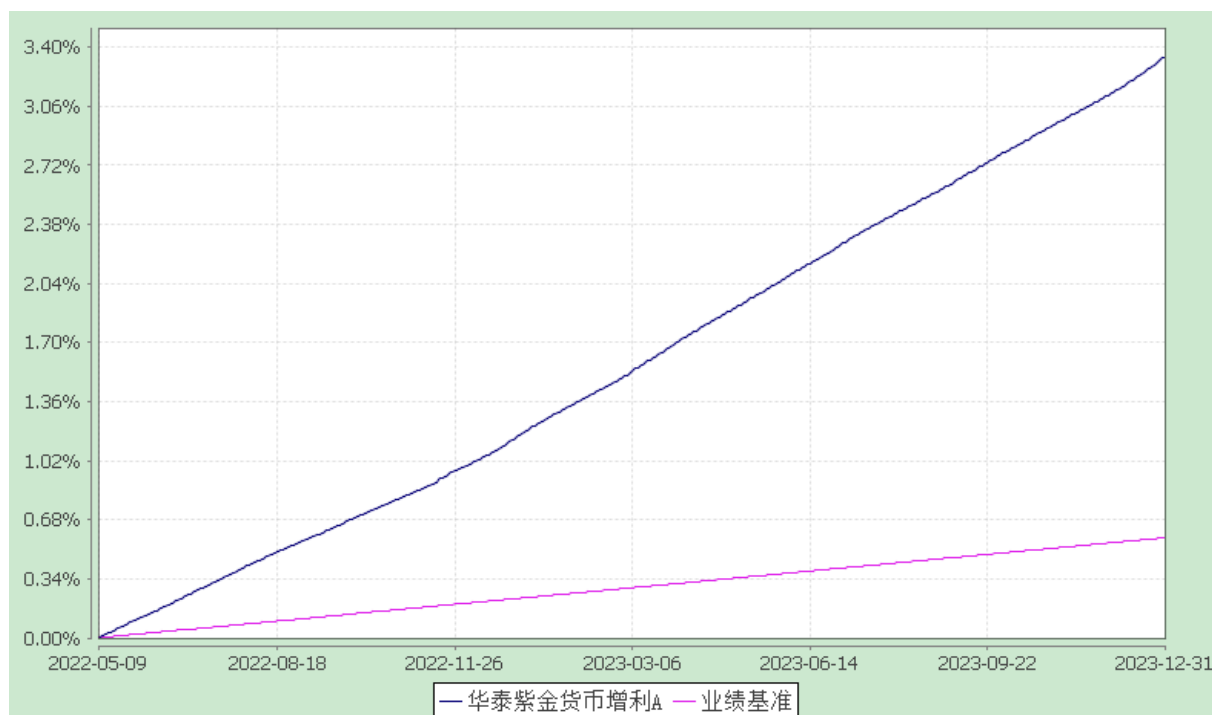
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4831%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.3949%	0.0010%
过去六个月	0.9462%	0.0010%	0.1764%	0.0000%	0.7698%	0.0010%
过去一年	1.9162%	0.0010%	0.3500%	0.0000%	1.5662%	0.0010%
自基金合同生效起至今	2.9057%	0.0013%	0.5763%	0.0000%	2.3294%	0.0013%

注：E级份额初始日期为2022年5月10日。

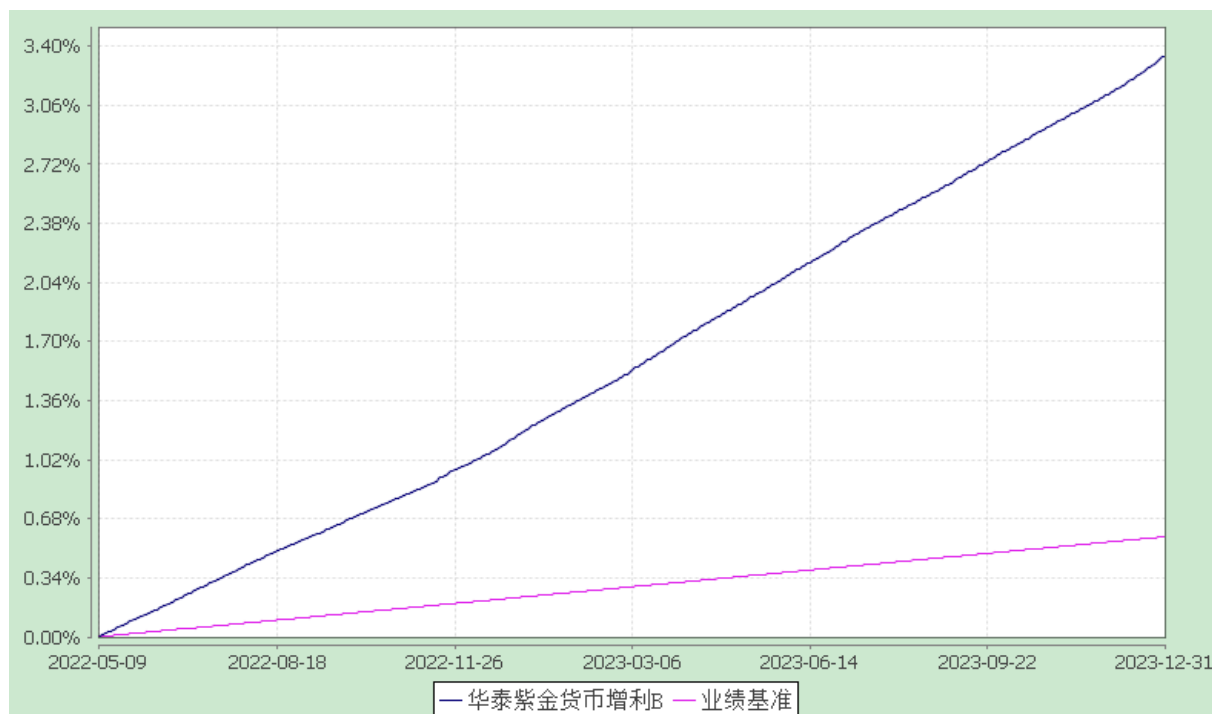
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰紫金货币增利货币市场基金  
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年5月9日至2023年12月31日)

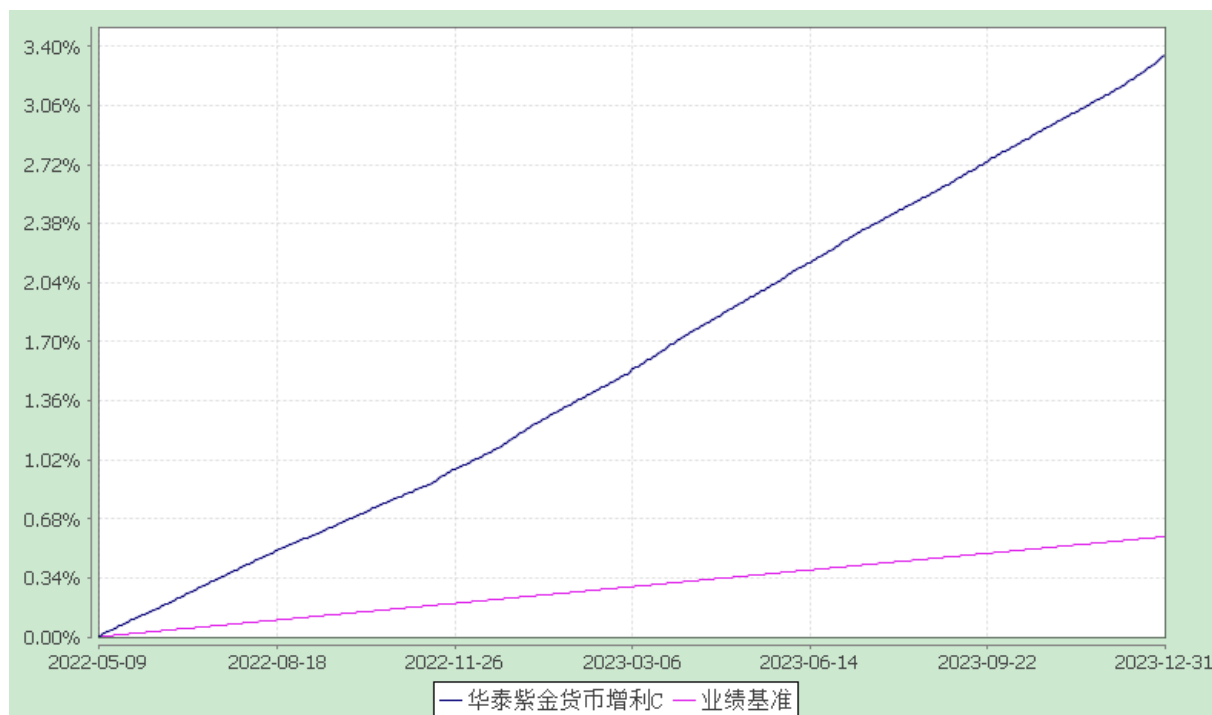
### 1、华泰紫金货币增利 A



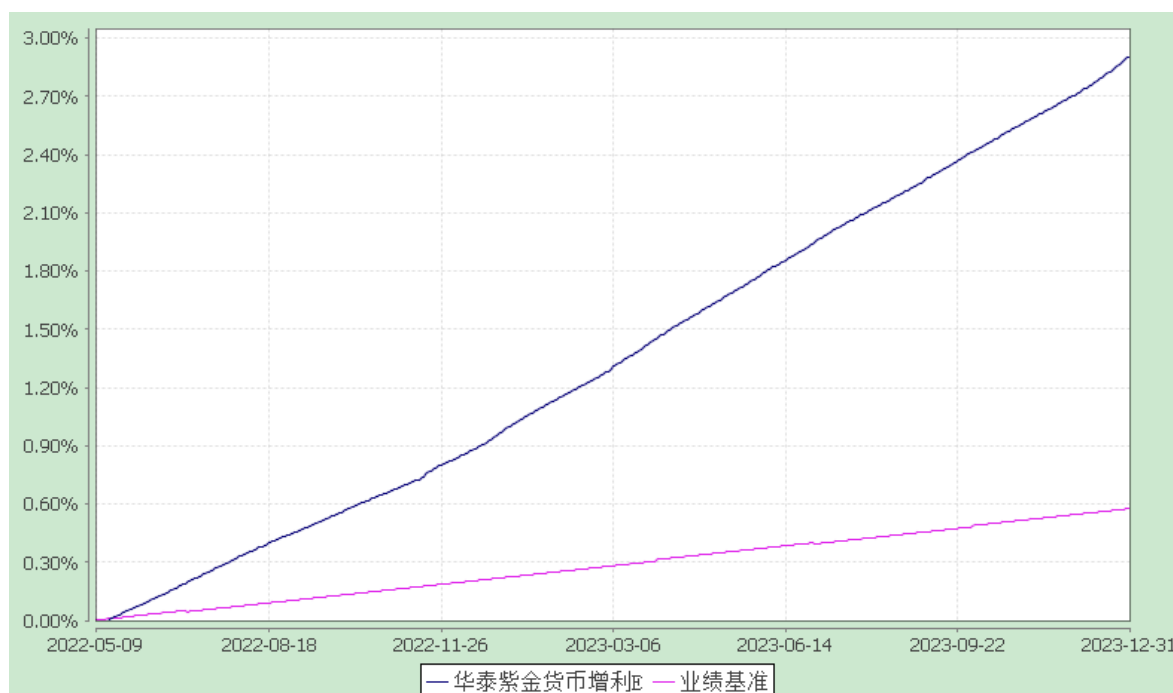
### 2、华泰紫金货币增利 B



### 3、华泰紫金货币增利 C



#### 4、华泰紫金货币增利 E



注：1、本基金业绩比较基准收益率=活期存款收益率（税后）；

2、本基金基金合同生效日期为2022年05月09日。本基金为券商资管大集合转型公募后的基金产品，截至本报告期末，本基金建仓已完成，建仓期结束时各项资产配置比例

均符合合同约定。

## § 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		
赵骥	本基金的基金 经理, 固收公募 投资部总经理	2022- 05-09	-	7	固收公募投资部总经理、基金投资决策委员会委员 英国雷丁大学国际证券市场协会 ICMA 商学院硕士； 2007 至 2010 年任职于广发银行金融市场部，2010 年至 2015 年任职于招商银行资产负债管理部负责司库投融资管理，2015 年至 2020 年任职于第一创业证券资产管理部，先后任投资二部负责人、交易部负责人。2020 年 5 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司，从事固定收益产品投资管理工作。
张迪	本基金的基金 经理	2023- 08-31	-	6	香港科技大学经济学硕士， 2017 年加入华泰证券（上海）资产管理有限公司从事固定收益产品投资管理工作，现担任基金经理。

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生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 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《华泰紫金货币增利货币市场基金基金合同》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

基本面方面，10-12 月 PMI 分别录得 49.5、49.4 和 49.0，有所走弱，生产端强于需求端。工业增加值有所提升，11 月累计同比 4.3%，较 9 月的 4.0%提升 0.2%。制造业投资基本平稳，基建投资略有下滑，地产政策不断放松但效果仍有限，地产投资仍是经济修复最大拖累项，11 月累计同比-9.4%。货币政策方面，三季度央行密集出台了降准降息等政策，四季度并未动用价格工具，在数量工具方面，11 月和 12 月央行各开展

MLF14500 亿元，分别净投放 6000 亿和 8000 亿，缓解了银行负债端压力。流动性方面，由于四季度大量政府债券集中发行，本季流动性先明显收紧，后随着央行加大投放，资金利率又逐渐回归到政策利率附近，四季度 DR007 平均 1.93%，较上个季度上行 5BP，高于央行 7 天回购利率。市场方面，存单收益率先上后下，10 月至 12 月上旬，政府债券发行导致资金收紧，银行负债端压力增大，1 年期存单收益率从 2.42% 上升至 2.67%，12 月中旬到月底，随着央行 MLF 超额投放和 OMO 大量投放跨年资金叠加年底财政资金回流，资金转松，机构积极买入各期限存单，1 年期存单收益率下行至 2.40% 附近。组合整体配置的品种为 3M-1Y 的存单存款以及短久期信用债，10-11 月降低了组合久期，12 月拉长了久期，并且适度调整了组合杠杆率。

展望一季度，预计经济趋稳，消费有望延续弱修复，基建投资在发行万亿特别国债以及政策发力三大工程背景下预计将企稳，地产投资可能仍是拖累项但预计拖累幅度将收窄，外部环境不确定性仍然较大，国际需求可能仍然偏弱。货币政策方面，预计资金利率在政策利率附近波动，降准降息等总量政策仍值得期待。组合策略方面，在配置时点到来前将耐心等待，适度进行波段交易，重点挖掘收益率曲线上最具有投资价值的品种进行投资，在资产配置价值较高的时候开始逐步配置，平衡产品流动性和收益率，关注今年资本新规实施可能导致季末时点产品负债端波动加大。

#### 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 0.5442%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%；B 级基金净值收益率为 0.5442%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%；C 级基金净值收益率为 0.5442%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%；E 级基金净值收益率为 0.4831%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%。

#### 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 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形；

2、本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 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	固定收益投资	7,836,398,609.22	50.20
	其中：债券	7,836,398,609.22	50.20
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,986,786,464.26	25.54
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	3,713,798,461.77	23.79
4	其他资产	74,541,420.57	0.48
5	合计	15,611,524,955.82	100.00

### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	12.16	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	85
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

#### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	30.54	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	2.75	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	30.11	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	2.54	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	33.38	-

其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计	99.33	0.00

#### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内未发生投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	101,855,844.91	0.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	751,964,688.87	4.82
	其中：政策性金融债	751,964,688.87	4.82
4	企业债券	83,544,881.09	0.54
5	企业短期融资券	634,716,397.82	4.07
6	中期票据	51,590,721.52	0.33
7	同业存单	6,212,726,075.01	39.81
8	其他	-	-
9	合计	7,836,398,609.22	50.22
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112320244	23 广发银行 CD244	5,000,000.00	493,639,006.25	3.16

2	112374297	23 宁波银行 CD245	5,000,000.00	493,569,573.14	3.16
3	112374378	23 成都农商银 行 CD130	4,000,000.00	394,825,659.89	2.53
4	112318292	23 华夏银行 CD292	3,500,000.00	348,025,309.46	2.23
5	112303259	23 农业银行 CD259	3,000,000.00	298,298,007.48	1.91
6	112372854	23 南京银行 CD183	2,500,000.00	248,655,259.80	1.59
7	112316160	23 上海银行 CD160	2,500,000.00	248,612,450.30	1.59
8	112388493	23 上海农商银 行 CD077	2,500,000.00	248,190,671.45	1.59
9	112374059	23 成都银行 CD241	2,500,000.00	246,737,860.34	1.58
9	112374089	23 广州银行 CD120	2,500,000.00	246,737,860.34	1.58
10	112374375	23 萧山农商银 行 CD101	2,400,000.00	236,850,459.28	1.52

### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0505%
报告期内偏离度的最低值	-0.0216%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0109%

注：以上数据按工作日统计。

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

### 5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

### 5.9.2 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。

### 5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,446.23
2	应收证券清算款	196,969.50
3	应收利息	-
4	应收申购款	74,338,004.84
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	74,541,420.57

### 5.9.4 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	华泰紫金货币 增利A	华泰紫金货币 增利B	华泰紫金货币 增利C	华泰紫金货币 增利E
本报告期期初	982,826,043.4	4,982,884,884	2,758,942,594	2,394,656,250

基金份额总额	8	.02	.46	.32
本报告期基金总申购份额	1,689,890,268	15,979,862,73	238,320,547.7	368,180,624.9
	.05	1.39	8	8
本报告期基金总赎回份额	1,323,765,359	10,885,142,68	335,186,144.2	1,246,709,498
	.90	6.20	9	.26
报告期期末基金份额总额	1,348,950,951	10,077,604,92	2,662,076,997	1,516,127,377
	.63	9.21	.95	.04

注：红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，基金转换转出作为本期赎回资金的来源，统一计入本期总赎回份额。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	红利再投资	-	828,090.45	828,090.45	-
2	赎回	2023-11-21	195,380,322.82	195,380,322.82	-
3	赎回	2023-11-21	102,661,835.95	102,661,835.95	-
合计			298,870,249.22	297,214,068.32	

注：1、红利再投资区间为2023年10月1日至11月20日；

2、基金管理人投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

### § 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

本基金管理人根据监管规定要求在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰



证券（上海）资产管理有限公司关于以通讯方式召开华泰紫金货币增利货币市场基金基金份额持有人大会的公告》，审议《关于调整华泰紫金货币增利货币市场基金管理费率的议案》。

## § 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变更注册的文件；
- 2、《华泰紫金货币增利货币市场基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金货币增利货币市场基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金货币增利货币市场基金招募说明书》；
- 5、《关于华泰紫金货币增强集合资产管理计划改造并申请注册华泰紫金货币增利货币市场基金的法律意见》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、基金产品资料概要；
- 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、基金托管人的住所。

### 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

二〇二四年一月九日