

**华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金**  
**2021 年年度报告**  
**2021 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年三月三十一日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料已经审计。毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
<b>§4 管理人报告</b>	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	17
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
<b>§5 托管人报告</b>	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
<b>§6 审计报告</b>	18
6.1 审计意见	18
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 其他信息	18
6.4 管理层对财务报表的责任	19
6.5 注册会计师的责任	19
<b>§7 年度财务报表</b>	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
<b>§8 投资组合报告</b>	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	53

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
8.6	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.....	54
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
8.8	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贵金属投资明细.....	54
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	55
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
8.12	本报告期投资基金情况.....	55
8.13	投资组合报告附注.....	55
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>56</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	57
9.4	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	58
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>58</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>58</b>
11.1	基金份额持有人大会决议.....	58
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	58
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
11.4	基金投资策略的改变.....	59
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	59
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
11.9	其他重大事件.....	60
<b>12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>61</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>63</b>
13.1	备查文件目录.....	63
13.2	存放地点.....	64
13.3	查阅方式.....	64

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金	
基金简称	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数	
基金主代码	008964	
交易代码	008964	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 15 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	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	837,402,714.56 份	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金中债 1-5 年国开债 指数 A	华泰紫金中债 1-5 年国开 债指数 C
下属分级基金的交易代码	008964	008965
报告期末下属分级基金的份额总额	837,393,916.50 份	8,798.06 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用分层和动态优化复制的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。
业绩比较基准	中债-1-5 年国开行债券指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。
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。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成

	份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	----------------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰证券（上海）资产管理有 限公司	上海浦东发展银行股份有限公 司
信息披露 负责人	姓名	白海燕	胡波
	联系电话	4008895597	021-61618888
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com	hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		4008895597	95528
传真		021-28972120	021-63602540
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区基 隆路6号1222室	中国上海市中山东一路12 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区东 方路18号21楼	中国上海市中山东一路12 号
邮政编码		200120	200001
法定代表人		崔春	郑杨

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://htamc.htsc.com.cn/">https://htamc.htsc.com.cn/</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	华泰证券（上海）资产管理有 限公司	中国(上海)自由贸易试验区东方路 18 号 21 楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指 标	2021 年		2020 年 5 月 15 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	华泰紫金中 债 1-5 年国 开债指数 A	华泰紫金中债 1-5 年国开 债指数 C	华泰紫金中债 1-5 年国开债 指数 A	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C
本期已 实现收 益	13,467,711.1 2	218.59	6,992,281.87	676.69
本期利 润	21,452,837.5 2	338.88	3,962,775.96	-348.05
加权平 均基金 份额本 期利润	0.0396	0.0367	0.0032	-0.0037
本期加 权平均 净值利 润率	3.86%	3.58%	0.32%	-0.37%
本期基 金份额 净值增 长率	3.89%	3.78%	0.92%	0.83%
3.1.2 期末 数据和指 标	2021 年末		2020 年末	
	华泰紫金中债 1-5 年国开债指 数 A	华泰紫金中债 1-5 年国开债 指数 C	华泰紫金中债 1-5 年国开债指 数 A	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C

期末可供分配利润	24,479,897.09	239.21	2,485,480.32	41.59
期末可供分配基金份额利润	0.0292	0.0272	0.0041	0.0033
期末基金资产净值	877,983,346.75	9,206.36	607,730,631.56	12,728.71
期末基金份额净值	1.0485	1.0464	1.0092	1.0083
	<b>2021 年末</b>		<b>2020 年末</b>	
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C
基金份额累计净值增长率	4.85%	4.64%	0.92%	0.83%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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. 华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.16%	0.05%	0.83%	0.04%	0.33%	0.01%
过去六个月	2.37%	0.05%	0.98%	0.05%	1.39%	0.00%
过去一年	3.89%	0.05%	0.73%	0.05%	3.16%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.85%	0.06%	-1.08%	0.07%	5.93%	-0.01%

2. 华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.13%	0.05%	0.83%	0.04%	0.30%	0.01%
过去六个月	2.31%	0.05%	0.98%	0.05%	1.33%	0.00%
过去一年	3.78%	0.05%	0.73%	0.05%	3.05%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.64%	0.06%	-1.08%	0.07%	5.72%	-0.01%

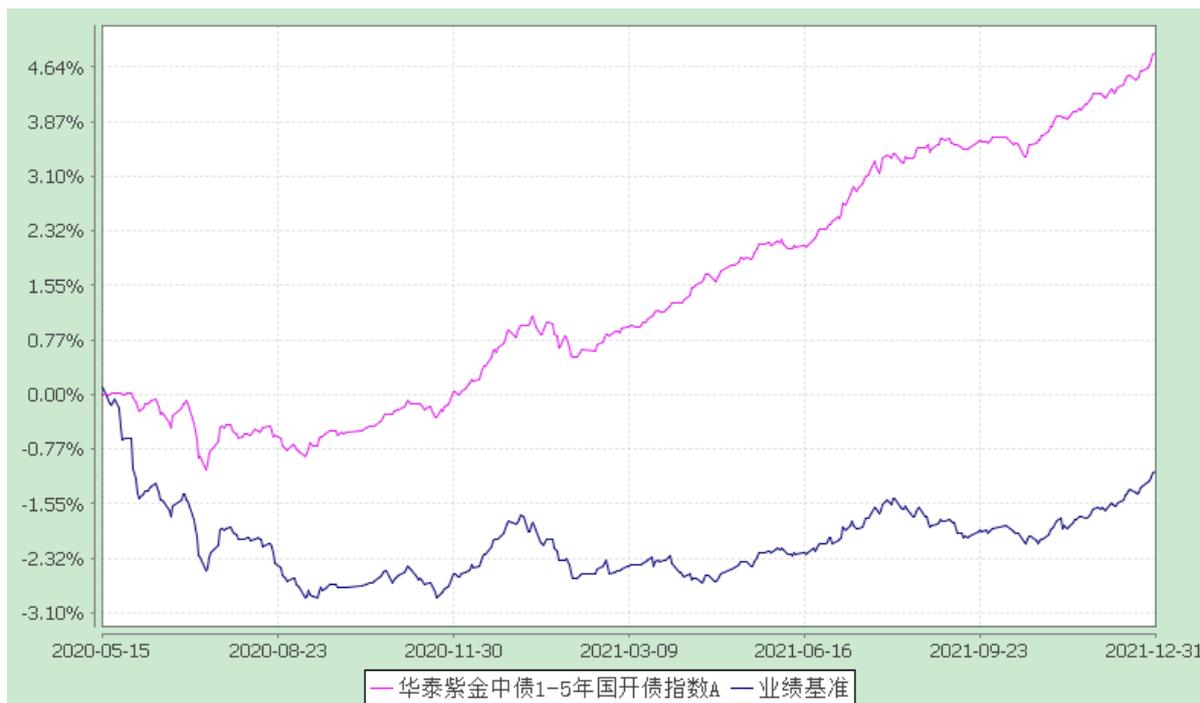
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金

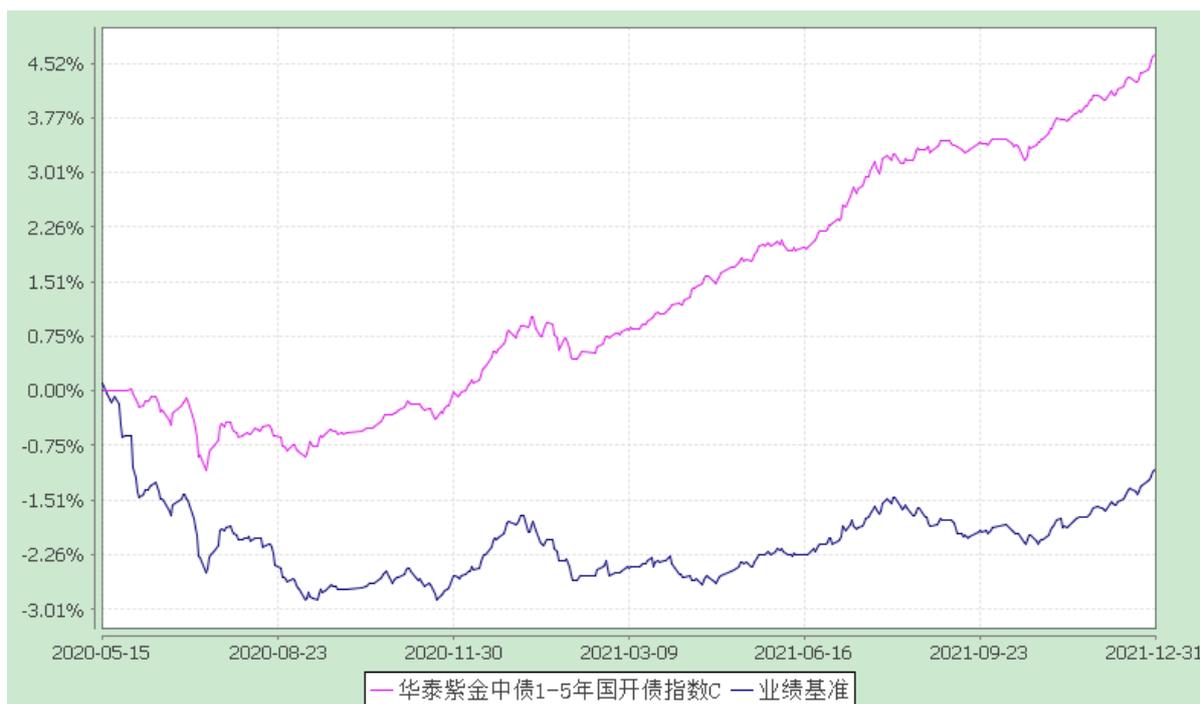
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 5 月 15 日至 2021 年 12 月 31 日)

1、华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A



## 2、华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C

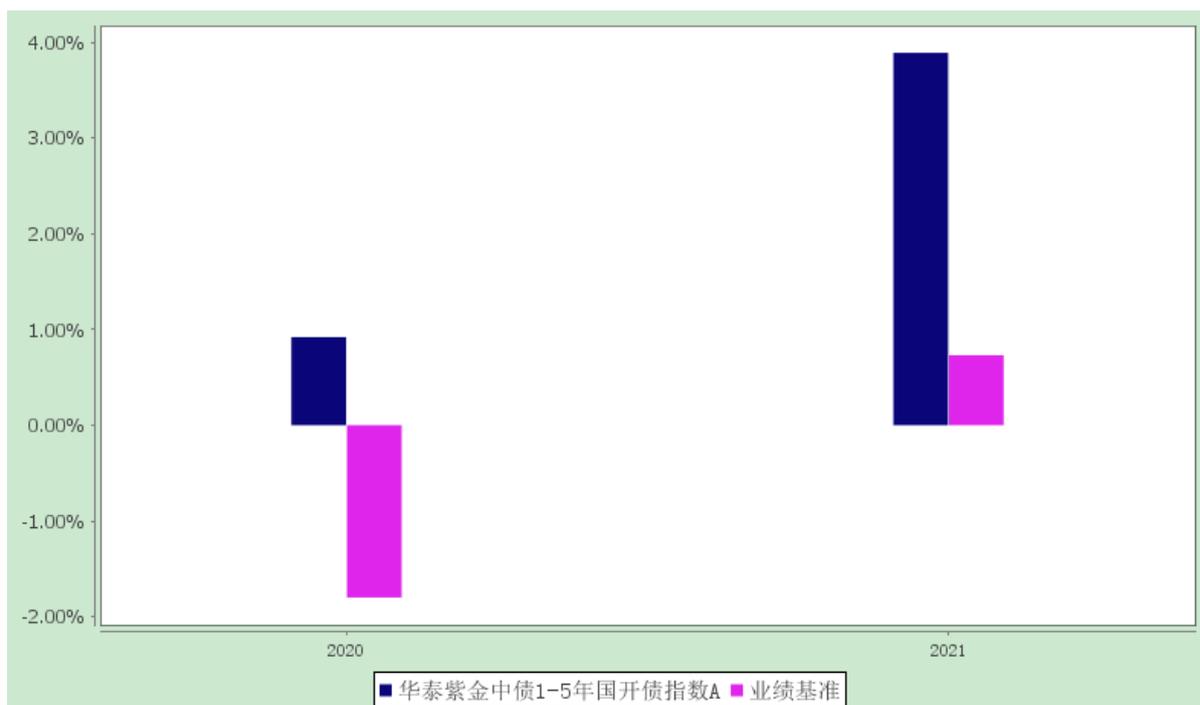


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

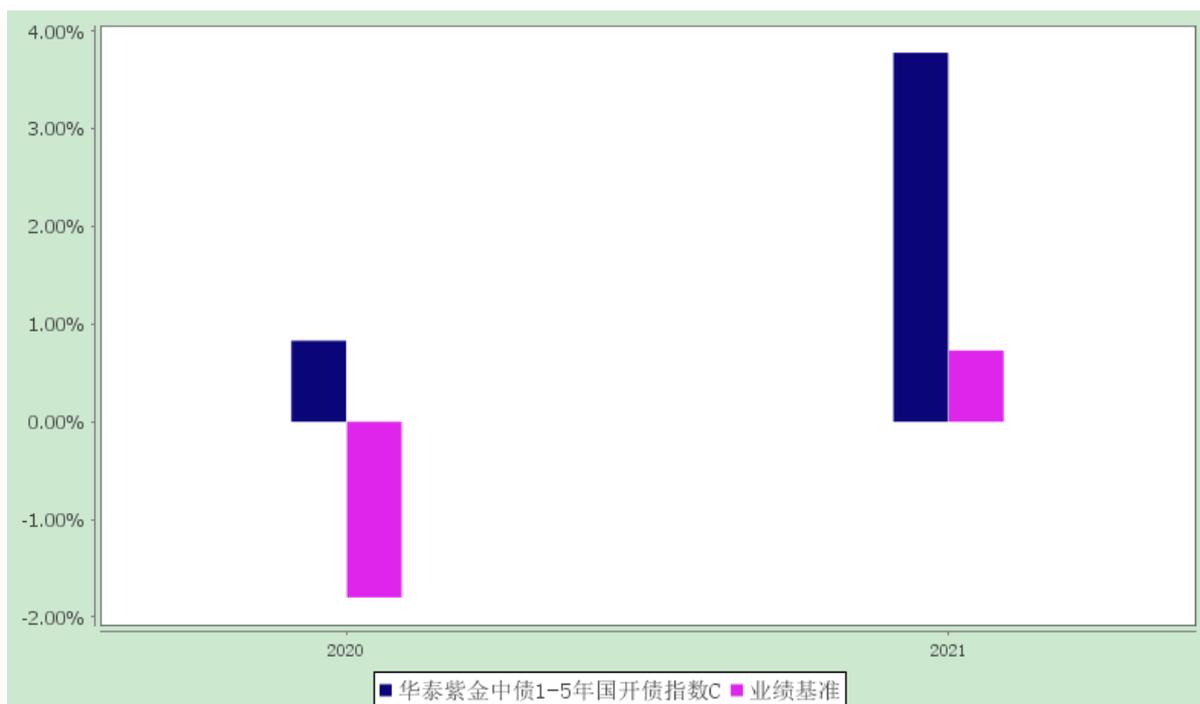
华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

#### 1、华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A



2、华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C



注：1、本基金的合同生效日为 2020 年 5 月 15 日，截至本报告期末，本基金已经完成建仓，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 1-5 年国开行指数收益率\*95%+同期银行活期存款利率（税后）\*5%。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华泰证券（上海）资产管理有限公司是经中国证监会证监许可〔2014〕679 号文批准，由华泰证券股份有限公司设立的全资资产管理子公司。2014 年 10 月成立时，注册资本 3 亿元人民币。2015 年 10 月增加注册资本至 10 亿元人民币。2016 年 7 月增加注册资本至 26 亿元人民币。2016 年 7 月，公司经中国证监会证监许可〔2016〕1682 号文批准，获得公开募集证券投资基金管理业务资格。公司主要业务为证券资产管理业务、公开募集证券投资基金业务及中国证监会批准的其它业务。公司注册地位于上海，在北京、南京、深圳等地设办公地点。公司前身为华泰证券资产管理总部，自 1999 年开展客户资产管理业务以来，持续打造从资产创设到资金募集对接全业务链协同下的差异化核心竞争力，致力于为客户提供多层次全方位高质量的产品投资、资产配置和整体金融服务解决方案。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	2020-08-27	-	12	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。
阮毅	本基金的基金经理	2020-05-15	2021-07-29	10	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。
杨义山	本基金的基金经理	2020-08-27	-	3	2009 年至 2013 年曾任韬睿惠悦咨询公司分析师；2013 年至 2018 年任职深圳证券信息有限公司，历任研究员、资深研究员，从事证券指数研发和相关金融研究工作；2018 年加入华泰证券(上海)资产管理有限公司，先后任职于固收投资部、基金固收部。2019 年 11 月起陆续担任华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数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。

3、陈晨女士于 2022 年 2 月 18 日离任该基金的基金经理。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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《华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年经济基本面前高后低，上半年经济稳定恢复，两年平均增长 5.3%，全球大宗商品涨价导致产业链通胀压力。进入三季度经济下行压力加大，出现阶段性限电限产、房地产行业收缩等新问题，9 月制造业 PMI 报 49.2，疫情之后首度低于荣枯线。下半年宏观调控两次降准，政府投资和地方债发行提速，全年经济增长 8.1%，两年平均增速回落至 5.1%。

政策方面，全年经济增长目标 6%，政策匹配以稳为主，下半年货币、财政政策转向稳增长。全年社融同比增长 10.3%，低于名义 GDP 增速，年末央行口径宏观杠杆率为 272.5%，比上年末降低 7.7 个百分点。分部门来看，企业、居民和政府杠杆率分别变化 -8、-0.4、+0.7 个百分点。

从债券市场来看，10 年国债收益率宽幅波动，利率中枢进入下降通道。春节前后，央行回收前期超额流动性，市场对货币政策“不急转弯”预期不一，10 年国债活跃券在 2 月中下旬再度接近 3.3% 的前期高点，3-6 月份震荡下行至 3.1% 附近。7 月初超预期降准，利率快速下行到 2.85% 附近。10 月份理财净值化转型造成抛压，货币政策预期转弱，10 月中旬短暂冲高至 3.05%，继而稳定在 2.85% 附近。12 月份二次降准叠加 LPR 调降，年末再度下行至 2.78%。

操作上，组合跟随基金申赎进行了债券投资，久期维持中性水平，整体通过抽样复制在指数样本券范围内进行配置。截至 2021 年 12 月 31 日，指数样本券加权平均久期 2.45，全年来看基金净值相对于指数的日收益年化跟踪误差约 0.29%，保持了对基准指数的紧密追踪。

##### 4.4.2 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 3.89%，C 级基金净值收益率为 3.78%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，2022 年稳增长难度加大，实现 5.5% 左右的经济增长目标需要一揽子政策支持。债券市场不确定因素交织，或维持在低位震荡，进一步获取资本利得收益比较困难，与之同时，阶段性调整风险将带来再配置的市场机会。

宏观方面，国内“需求收缩、供给冲击、预期转弱”三重压力仍待缓解，国外美欧陆续退出货币宽松、地缘政治局势更加复杂化，稳增长的重心将回到国内循环。从两会报告来看，今年财政支出强度明显扩大，在政府消费、基建投资和转移支付多层面发力，扩大全社会消费和投资需求。企业投融资环境和居民消费信心也在边际好转，有待进一步稳住市场预期。上半年作为重点发力的政策窗口，经济基本面可能出现两头低、中间高的局面，需要关注房地产调控的传导链条。

对于债券市场而言，短期内货币政策仍然是有利局面。继 1 月份降息之后，扩大信贷规模还需要保障总量流动性平稳、降低融资成本，提振实体融资需求。央行存在一定的逆周期调控需求，不会跟随美联储加息节奏，人民币汇率处于历史高位也积累了货币政策空间。全年来看，预计宏观杠杆率将提升，宽信用空间取决于经济恢复程度，但在隐债不增、房住不炒的制度约束下上行幅度有限。

投资运作方面，组合将紧密跟踪标的指数，参照指数样本调节组合久期和持仓结构，控制跟踪误差。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司规范运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金运作安全，保障份额持有人利益，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 公司持续加强现有内部控制制度体系的梳理建设，进一步修订和完善了信用风险管理指引、风险偏好管理规定、危机处理和恢复制度、公募基金的分类与风险评级指引、公募基金业务信息披露管理制度等，促进公司业务合法合规；进一步强化事前事中合规风险管理，对信息披露文件严格把关，认真审核基金宣传推介材料，加强销售行为管理，防范各类合规风险；公司开展面向全体员工的从业人员行为规范及洗钱风险管理合规培训以及投资者适当性管理、产品宣传推介材料、新股业务、新员工入职等专项培训，不断提升员工的合规守法意识。

(2) 公司坚持全面风险管理的理念，认真贯彻落实相关法规政策要求，围绕业务风险点建立和完善风险控制措施，通过系统与人工相结合的方式对各类业务进行全流程风险管理，在对日常投资运作进行持续监督管理的基础上，建立健全相关制度流程，持续加强投资准入管理、交易对手管理、风控指标和限额管理，综合运用压力测试、量化分析等方式进行风险评估，并对业务风险进行定期跟踪与排查，完善风险处置机制，加快风险资产处置。同时，公司高度重视风险管理信息系统建设，逐步提升风险管理数字化、智能化水平。

(3) 公司按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用常规检查与专项检查、定期检查和不定定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告。报告期内对投资者适当性管理、权限管理、债券投资交易管理、信息披露管理、防控内幕交易管理等方面进行了专项稽核，推动公司合规、内控体系的健全完善。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值小组，公司领导担任估值小组组长，投资研究部门、运营部、交易部、风险管理部指定人员担任委员。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 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 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由华泰证券（上海）资产管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 审计报告

毕马威华振审字第 2201626 号

华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了后附的华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金（以下简称“华泰紫金中债 1-5 年国开债指数”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰紫金中债 1-5 年国开债指数，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

华泰紫金中债 1-5 年国开债指数管理人华泰证券(上海)资产管理有限公司（以下简称“基金管理

人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 2021 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。

#### 6.4 管理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰紫金中债 1-5 年国开债指数的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非华泰紫金中债 1-5 年国开债指数计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华泰紫金中债 1-5 年国开债指数的财务报告过程。

#### 6.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表

意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰紫金中债 1-5 年国开债指数持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰紫金中债 1-5 年国开债指数不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师  
 王国蓓 倪益  
 中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层  
 2022 年 3 月 30 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	1,052,891.95	1,647,686.74
结算备付金	7.4.10.6	211,363.64	9,290,476.19
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	860,457,000.00	580,645,000.00

其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		860,457,000.00	580,645,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	6,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	16,640,161.31	10,478,283.23
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>878,361,416.90</b>	<b>608,061,446.16</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	12.08
应付管理人报酬		85,579.59	78,418.60
应付托管费		28,526.53	26,139.51
应付销售服务费		0.93	1.83
应付交易费用	7.4.7.7	11,097.25	4,770.00
应交税费		173.93	398.06
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	243,485.56	208,345.81
<b>负债合计</b>		<b>368,863.79</b>	<b>318,085.89</b>
<b>所有者权益：</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	7.4.7.9	837,402,714.56	602,229,625.65
未分配利润	7.4.7.10	40,589,838.55	5,513,734.62
<b>所有者权益合计</b>		<b>877,992,553.11</b>	<b>607,743,360.27</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>878,361,416.90</b>	<b>608,061,446.16</b>

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 837,402,714.56 份，其中 A 类份额的份额总额为 837,393,916.50 份，份额净值 1.0485 元，C 类份额的份额总额为 8,798.06 份，份额净值 1.0464 元。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 15 日（基 金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>23,125,560.86</b>	<b>5,954,453.41</b>
1.利息收入		16,676,254.26	22,093,053.07
其中：存款利息收入	7.4.7.11	13,574.44	401,929.94
债券利息收入		16,595,680.66	19,615,958.05
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		66,999.16	2,075,165.08
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,535,940.09	-13,108,069.35

其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-1,535,940.09	-13,108,069.35
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	7,985,246.69	-3,030,530.65
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	-	0.34
<b>减：二、费用</b>		<b>1,672,384.46</b>	<b>1,992,025.50</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	831,280.10	1,174,848.72
2. 托管费	7.4.10.2.2	277,093.34	391,616.24
3. 销售服务费		10.95	59.56
4. 交易费用	7.4.7.20	15,485.57	20,650.00
5. 利息支出		128,325.71	24,447.72
其中：卖出回购金融资产支出		128,325.71	24,447.72
6. 税金及附加		138.94	3,268.75
7. 其他费用	7.4.7.21	420,049.85	377,134.51
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>21,453,176.40</b>	<b>3,962,427.91</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>21,453,176.40</b>	<b>3,962,427.91</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	602,229,625.65	5,513,734.62	607,743,360.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,453,176.40	21,453,176.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	235,173,088.91	13,622,927.53	248,796,016.44
其中：1.基金申购款	335,183,928.69	14,813,071.31	349,997,000.00
2.基金赎回款	-100,010,839.78	-1,190,143.78	-101,200,983.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	837,402,714.56	40,589,838.55	877,992,553.11
项目	上年度可比期间		
	2020 年 5 月 15 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,350,272,223.84	-	1,350,272,223.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,962,427.91	3,962,427.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-748,042,598.19	1,551,306.71	-746,491,291.48

列)			
其中：1.基金申购款	502,219,789.86	-2,209,775.71	500,010,014.15
2.基金赎回款	-1,250,262,388.05	3,761,082.42	-1,246,501,305.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	602,229,625.65	5,513,734.62	607,743,360.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：聂挺进，主管会计工作负责人：刘博文，会计机构负责人：白海燕

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金注册的批复》(证监许可[2019]2589 号)批准,由华泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称“华泰资管”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2020 年 5 月 15 日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为 1,350,272,223.84 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰资管,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》和《华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成分券及备选成分券,为更好实现投资目标,还可以投资于具有良好流动性的金融工具,包括政策性金融债、债券回购以及银行存款。本基金不投资于除政策性金融债以外的债券资产。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:中债 1-5 年国开行债券指数收益率\*95%+同期银行活期存款利率(税后)\*5%。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况、自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

在初始确认时,金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债,相关交易费用直接计入当期损益;对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后,金融资产和金融负债的后续计量如下:

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值

- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持

的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴

的个人所得税(如适用)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后每一类基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位该类别基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。在符合法律法规及基金合同约定,并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整,无须召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确

定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于

全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增) 试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日(含) 以后，资管产品管理人(以下称管理人) 运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内(含 1 个月) 的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年) 的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含) 以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	1,052,891.95	1,647,686.74
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	1,052,891.95	1,647,686.74

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	855,502,283.96	860,457,000.00	4,954,716.04
	合计	855,502,283.96	860,457,000.00	4,954,716.04
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	855,502,283.96	860,457,000.00	4,954,716.04	
项目	上年度末			

		2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	583,675,530.65	580,645,000.00	-3,030,530.65
	合计	583,675,530.65	580,645,000.00	-3,030,530.65
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		583,675,530.65	580,645,000.00	-3,030,530.65

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,000,000.00	-
银行间市场	-	-

合计	6,000,000.00	-
----	--------------	---

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	552.60	214.95
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	104.61	4,598.77
应收债券利息	16,639,504.10	10,471,138.55
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	2,330.96
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	16,640,161.31	10,478,283.23

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	11,097.25	4,770.00

合计	11,097.25	4,770.00
----	-----------	----------

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	184,500.00	129,500.00
其他应付款	58,985.56	78,845.81
合计	243,485.56	208,345.81

#### 7.4.7.9 实收基金

华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	602,217,001.88	602,217,001.88
本期申购	335,183,928.69	335,183,928.69
本期赎回（以“-”号填列）	-100,007,014.07	-100,007,014.07
本期末	837,393,916.50	837,393,916.50

华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	12,623.77	12,623.77
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-3,825.71	-3,825.71
本期末	8,798.06	8,798.06

### 7.4.7.10 未分配利润

华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,485,480.32	3,028,149.36	5,513,629.68
本期利润	13,467,711.12	7,985,126.40	21,452,837.52
本期基金份额交易产生的变动数	8,526,705.65	5,096,257.40	13,622,963.05
其中：基金申购款	9,293,537.46	5,519,533.85	14,813,071.31
基金赎回款	-766,831.81	-423,276.45	-1,190,108.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,479,897.09	16,109,533.16	40,589,430.25

华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	41.59	63.35	104.94
本期利润	218.59	120.29	338.88
本期基金份额交易产生的变动数	-20.97	-14.55	-35.52
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-20.97	-14.55	-35.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	239.21	169.09	408.30

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 5 月 15 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

		日
活期存款利息收入	9,777.15	183,078.70
定期存款利息收入	-	120,750.00
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	3,790.03	98,101.24
其他	7.26	-
合计	13,574.44	401,929.94

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本期及上年度可比期间均无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年5月15日（基金合同 生效日）至2020年12月31 日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,535,940.09	-13,108,069.35
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-1,535,940.09	-13,108,069.35

##### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年5月15日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	745,193,170.18	1,219,225,649.46

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	735,372,785.49	1,214,384,429.35
减：应收利息总额	11,356,324.78	17,949,289.46
买卖债券差价收入	-1,535,940.09	-13,108,069.35

#### 7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

本基金本期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年5月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1.交易性金融资产	7,985,246.69	-3,030,530.65
——股票投资	-	-
——债券投资	7,985,246.69	-3,030,530.65
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-

2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	7,985,246.69	-3,030,530.65

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年5月15日（基金合同生效日）至 2020年12月31日
基金赎回费收入	-	0.34
合计	-	0.34

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年5月15日（基金合同生效日） 至2020年12月31日
交易所市场交易费用	410.57	-
银行间市场交易费用	15,075.00	20,650.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	15,485.57	20,650.00

##### 7.4.7.20.1 持有基金产生的费用

本基金本期及上年度可比期间均无持有基金产生的费用。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年5月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	60,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	70,000.00
银行手续费	375.12	6,264.82
账户管理费	18,000.00	10,500.00
指数使用费	221,674.73	234,969.69
开户费	-	400.00
合计	420,049.85	377,134.51

#### 7.4.7.22 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰证券(上海)资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，并以一般交易价格为定价基础。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年5月15日（基金合同生效日） 至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	20,127,604.20	100.00%	-	-

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年5月15日（基金合同生效日） 至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	263,000,000.00	100.00%	14,011,801,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年5月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	831,280.10	1,174,848.72
其中：支付销售机构的客户维护费	1,302.81	57.41

注：本基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年5月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	277,093.34	391,616.24

注：本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C	合计
华泰证券	-	7.71	7.71
合计	-	7.71	7.71
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年5月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰紫金中债1-5年国开债指数A	华泰紫金中债1-5年国开债指数C	合计
华泰证券	-	15.84	15.84
合计	-	15.84	15.84

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按 C 类基金份额前一

日基金资产净值的 0.1% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C 类基金份额每日基金销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金未参与转融通证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金未参与转融通证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本期及上年度可比期间管理人未使用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年5月15日（基金合同生效日） 至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	1,052,891.95	9,777.15	1,647,686.74	183,078.70

注：本基金通过托管人转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2021 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 211,363.64 元。（2020 年 12 月 31 日：人民币 9,290,476.19 元）

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

##### 7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金未投资基金。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只债券型基金，在证券投资基金中属于中等风险的品种，其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括政策性金融债、债券回购以及银行存款。

本基金不投资于除政策性金融债以外的债券资产。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于货币市场基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

公司建立健全与自身发展战略相适应的全面风险管理体系。公司全面风险管理体系包括可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效的风险应对机制以及良好的风险管理文化。

公司风险管理组织架构包括五个主要部分：董事会及合规与风险控制委员会，监事，公司管理层及风险管理委员会，风险管理部、合规稽核部及各类专业风险管理部门、各其他职能部门以及业务部门。

公司董事会是风险管理的最高决策机构，承担公司全面风险管理体系的最终责任。董事会下设合规与风险控制委员会，主要负责审议公司风险管理制度、风险偏好、风险容忍度和风险评估报告。公司监事承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。公司管理层对全面风险管理承担主要责任，负责制度及完善公司风险管理制度，建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，制定风险偏好、风险容忍度并定期评估公司整体风险。公司管理层下设风险管理委员会，负责批准适合各项业务发展的风险管理政策，提升公司风险管理的有效性，研究制定重大事件、重大决策和重要业务流程的风险评估报告以及重大风险的解决方案，审议公司定期和临时风险报告，指导风险管理相关部门工作等。公司设首席风险官，负责分管领导全面风险管理工作，公司保障首席风险官能够充分行使履行职责所必要的知情权，同时保障首席风险官的独立性。公司指定风险管理部与合规稽核部履行全面风险管理职责，包括牵头建立完善公司全面风险管理体系，牵头管理公司的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险和法律风险，监测、计量、评估、报告公司整体风险水平和风险资本运用及牵头应对和处置公司层面重大风险事件。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征

通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行上海浦东发展银行股份有限公司和其他商业信誉良好的股份制银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	860,457,000.00	580,645,000.00
合计	860,457,000.00	580,645,000.00

注：1、持有发行期限在一年以上的债券按其债项评级作为长期信用评级进行列示，持有的其他

债券以其债项评级作为短期信用评级进行列示；

2、未评级部分为政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，本基金债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过 40%。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所持有的所有金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中的 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本基金所持有大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人根据质押品的资质确定质押率水平，持续检测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与本基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果以及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内的流动性情况良好。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----------------------	-------	-------	-------	-----	----

日					
资产					
银行存款	1,052,891.95	-	-	-	1,052,891.95
结算备付金	211,363.64	-	-	-	211,363.64
交易性金融资产	60,336,000.00	758,228,000.00	41,893,000.00	-	860,457,000.00
应收利息	-	-	-	16,640,161.31	16,640,161.31
应收证券清算款	-	-	-	-	-
资产总计	61,600,255.59	758,228,000.00	41,893,000.00	16,640,161.31	878,361,416.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	85,579.59	85,579.59
应付托管费	-	-	-	28,526.53	28,526.53
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	0.93	0.93
应付交易费用	-	-	-	11,097.25	11,097.25
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	173.93	173.93
应付证券清算款	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	243,485.56	243,485.56
负债总计	-	-	-	368,863.79	368,863.79
利率敏感度缺口	61,600,255.59	758,228,000.00	41,893,000.00	16,271,297.52	877,992,553.11
<b>上年度末</b>					
<b>2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	1,647,686.74	-	-	-	1,647,686.74
结算备付金	9,290,476.19	-	-	-	9,290,476.19
交易性金融资产	70,602,000.00	510,043,000.00	-	-	580,645,000.00
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应收利息	-	-	-	10,478,283.23	10,478,283.23
应收证券清算款	-	-	-	-	-

资产总计	87,540,162.93	510,043,000.00	-	10,478,283.23	608,061,446.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	12.08	12.08
应付管理人报酬	-	-	-	78,418.60	78,418.60
应付托管费	-	-	-	26,139.51	26,139.51
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	1.83	1.83
应付交易费用	-	-	-	4,770.00	4,770.00
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	398.06	398.06
应付证券清算款	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	208,345.81	208,345.81
负债总计	-	-	-	318,085.89	318,085.89
利率敏感度缺口	87,540,162.93	510,043,000.00	-	10,160,197.34	607,743,360.27

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	5,431,698.69	3,460,623.77
	市场利率上升 25 个基点	-5,373,389.24	-3,426,700.49

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于定期存款和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	860,457,000.00	98.00	580,645,000.00	95.54
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	860,457,000.00	98.00	580,645,000.00	95.54

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资占基金资产净值的比例为 0.00%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 860,457,000.00 元,无属于第一层次或第三层次的余额。(2020 年 12 月 31 日:第二层次 580,645,000.00 元,无属于第一层次或第三层次的余额)。

(ii)对于本基金投资的证券交易所上市的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时,本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券公允价值的层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 12 月 31 日,本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2020 年 12 月 31 日:无)。

(d)不以公允价值计量的金融工具不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。本基金将按照新金融工具准则的衔接规定,对新金融工具准则施行日(即 2022 年 1 月 1 日)未终止确认的金融工具的分类和计量(含减值)进行追溯调整。本基金将不调整比较财务报表数据,将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益或其他综合收益。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	860,457,000.00	97.96
	其中：债券	860,457,000.00	97.96
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,264,255.59	0.14
8	其他各项资产	16,640,161.31	1.89
9	合计	878,361,416.90	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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。

### 8.2.2 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。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末投资股票。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末投资股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末投资股票。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	860,457,000.00	98.00
	其中：政策性金融债	860,457,000.00	98.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	860,457,000.00	98.00

### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	200202	20 国开 02	1,000,000.00	99,350,000.00	11.32
2	210202	21 国开 02	900,000.00	90,810,000.00	10.34
3	200207	20 国开 07	900,000.00	90,756,000.00	10.34
4	210208	21 国开 08	900,000.00	90,279,000.00	10.28
5	210203	21 国开 03	800,000.00	81,688,000.00	9.30

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 本报告期投资基金情况

### 8.12.1 投资政策及风险说明

本基金本报告期末持有基金。

### 8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 8.13 投资组合报告附注

### 8.13.1 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中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会（含原中国银行业监督管理委员会和中国保险监督管理委员会）或其派出机构的处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，报告期内，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

#### 8.13.2 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

本基金不得投资于股票。

#### 8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,640,161.31
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,640,161.31

#### 8.13.4 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。

#### 8.13.5 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。

#### 8.13.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A	124	6,753,176.75	837,392,647.05	100.00%	1,269.45	0.00%
华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C	225	39.10	0.00	0.00%	8,798.06	100.00%
合计	349	2,399,434.71	837,392,647.05	100.00%	10,067.51	0.00%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A	0.00	0.00%
	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C	4.01	0.05%
	合计	4.01	0.00%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A	0
	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A	0
	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C	0

	合计	0
--	----	---

#### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 A	华泰紫金中债 1-5 年国开债指数 C
基金合同生效日（2020 年 5 月 15 日）基金份额总额	1,350,145,288.69	126,935.15
本报告期期初基金份额总额	602,217,001.88	12,623.77
本报告期基金总申购份额	335,183,928.69	-
减：本报告期基金总赎回份额	100,007,014.07	3,825.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	837,393,916.50	8,798.06

#### §11 重大事件揭示

##### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

##### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：2021 年 6 月 30 日起，席晓峰先生不再担任公司副总经理职务；2021 年 8 月 31 日起，王锦海先生不再担任公司总经理职务；2021 年 9 月 17 日起，聂挺进先生新任公司总经理；2021 年 12 月 6 日起，刘玉生先生不再担任公司首席风险官职务，覃洁女士新任公司首席风险官。

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

##### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人基金管理业务、基金财产的诉讼。

本报告期内未发生涉及公募基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

#### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

#### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 60,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

#### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。行政监管措施方面，2021 年 7 月 22 日，上海证监局向基金管理人出具了《关于对华泰证券（上海）资产管理有限公司采取责令改正措施的决定》，指出基金管理人在开展固收业务过程中存在内控体系不足、信用风险管理机制不健全等问题。针对上述事项，基金管理人高度重视，组织相关部门进行了全面梳理和研究，针对监管此次提及的固定收益业务投研和风控体系中的相关问题，编制和实施了固定收益业务风控体系方案，涵盖了债券信用研究、产品流动性管理、风险控制、投研系统等多个方面，全面有效落实了整改计划，上述事项均已整改完毕。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

2、本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

##### 11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	回购交易	权证交易

	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
华泰证券	20,127,604.20	100.00%	263,000,000.00	100.00%	-	-

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-01-22
2	关于华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金跟踪标的指数的说明公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-01-30
3	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-02-09
4	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金托管协议	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-02-09
5	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金招募说明书	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-02-09
6	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金产品资料概要	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-03-30
7	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-03-30
8	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金招募说明书	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-03-30
9	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金修改基金合同部分条款的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-03-30
10	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-03-31
11	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网	2021-04-21

		站、证券时报等	
12	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金招募说明书更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-05-14
13	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-05-14
14	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-06-30
15	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-07-21
16	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理变更公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-07-31
17	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金招募说明书更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-08-03
18	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-08-03
19	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金 2021 年中期报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-08-31
20	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-08-31
21	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-09-17
22	华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-10-26
23	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-12-08
24	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报等	2021-12-08

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份 额	申购份 额	赎回份 额	持有份 额	份 额 占 比
机构	1	2021-01-01 至 2021-12-31	502,208,718.36	0.00	0.00	502,208,718.36	59.97%
产品特有风险							
<p>1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；</p> <p>4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>5、单一机构投资者赎回后，若本基金连续50个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的，基金管理人应当终止《基金合同》，不需要召开基金份额持有人大会；</p> <p>6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p>							

## 12.2 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 2021 年 1 月 30 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布《关于华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金跟踪标的指数的说明 公告》，本基金跟踪标的指数为中债 1-5 年国开行债券指数，由中债金融估值中心有限公司 负责编制与发布。中债 1-5 年国开行债券指数隶属于中债总指数族分类，该指数成分券包括国家开发银行在境内公开发行且上市流通的待偿期 0.5 至 5 年（包含 0.5 年和 5 年）的政策性银行债，可作为投资该类债券的业绩基准和标的指数。指数编制方案和相关信息可通过债金融估值中心有限公司官方网站进行查询。

2、本基金管理人于 2021 年 2 月 9 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下 12 只证券投资基金修改基金合同和托管协议并更新招募说明书的公告》，根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规，对本基金基金合同中的前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金份额持有人大会、基金的投资、基金资产估值、基金费用与税收、基金的收益与分配、基金的信息披露等章节增加侧袋机制相关内容并更新销售办法及信息披露相关术语。具体内容请阅读相关公告以及本基金更新后的基金合同、招募说明书等基金法律文件。

3、本基金管理人于 2021 年 3 月 30 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布《华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引〉修改基金合同部分条款的公告》，根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及《华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》的约定，经与华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金托管人协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，华泰证券（上海）资产管理有限公司决定对本基金的基金合同进行修改，具体内容请阅读相关公告以及本基金更新后的基金合同、招募说明书等基金法律文件。

4、本基金管理人根据监管规定要求于 2021 年 6 月 30 日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高级管理人员变更的公告》，自 2021 年 6 月 30 日起，席晓峰先生因个人原因辞职，不再担任公司副总经理职务。

5、本基金管理人根据监管规定要求于 2021 年 8 月 31 日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高级管理人员变更的公告》，自 2021 年 8 月 31 日起，王锦海先生因个人原因辞职，不再担任公司总经理职务。

6、本基金管理人根据监管规定要求于 2021 年 9 月 17 日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高级管理人员变更的公告》，自 2021 年 9 月 17 日起，聂挺进先生新任本基金管理人总经理。

7、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《华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理变更的公告》，自 2021 年 7 月 29 日起，阮毅先生不再担任本基金的基金经理。

8、本基金管理人根据监管规定要求于 2021 年 12 月 8 日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高级管理人员变更的公告》，自 2021 年 12 月 6 日起，刘玉生先生因职务调整，不再担任公司首席风险官职务。

9、本基金管理人根据监管规定要求于 2021 年 12 月 8 日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高级管理人员变更的公告》，自 2021 年 12 月 6 日起，覃洁女士新任本基金管理人首席风险官。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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、《华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》；

- 3、《华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、《关于申请募集注册华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金之法律意见书》；
- 8、产品资料概要；
- 9、中国证监会规定的其他备查文件。

### 13.2 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。

### 13.3 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  
二〇二二年三月三十一日