

华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金

2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 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：二〇二二年七月二十一日

§ 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 2022 年 7 月 20 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 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华泰紫金季季享定开债券发起
基金主代码	006654
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 1 月 17 日
报告期末基金份额总额	220,603,677.41 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	本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略，封闭期投资策略包括资产配置策略、久期策略、类属配置策略、信用债投资策略等，开放期内，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险。

业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%	
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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金季季享定开债券发起 A	华泰紫金季季享定开债券发起 C
下属分级基金的交易代码	006654	006655
报告期末下属分级基金的份额总额	137,636,826.44 份	82,966,850.97 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 (2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)	
	华泰紫金季季享定开债券发起 A	华泰紫金季季享定开债券发起 C
1.本期已实现收益	672,634.87	571,248.73
2.本期利润	4,397,340.85	2,574,299.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0301	0.0306
4.期末基金资产净值	146,864,477.10	88,056,908.90
5.期末基金份额净值	1.0670	1.0614

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、华泰紫金季季享定开债券发起 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	3.07%	0.23%	1.61%	0.14%	1.46%	0.09%
过去六个月	2.06%	0.22%	0.78%	0.15%	1.28%	0.07%
过去一年	3.82%	0.20%	2.88%	0.13%	0.94%	0.07%
过去三年	12.78%	0.13%	14.22%	0.13%	-1.44%	0.00%
自基金合同生效起至今	16.67%	0.13%	17.80%	0.13%	-1.13%	0.00%

2、华泰紫金季季享定开债券发起 C:

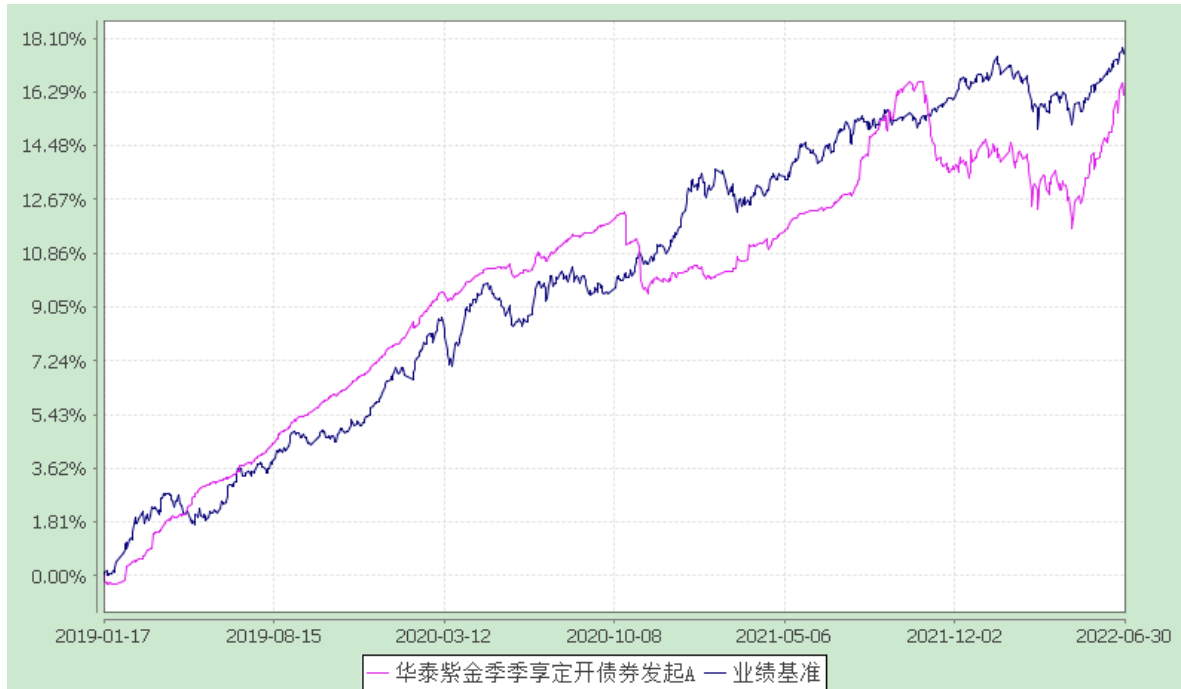
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.00%	0.22%	1.61%	0.14%	1.39%	0.08%
过去六个月	1.91%	0.22%	0.78%	0.15%	1.13%	0.07%
过去一年	3.51%	0.20%	2.88%	0.13%	0.63%	0.07%
过去三年	11.78%	0.13%	14.22%	0.13%	-2.44%	0.00%
自基金合同生效起至今	15.48%	0.13%	17.80%	0.13%	-2.32%	0.00%

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

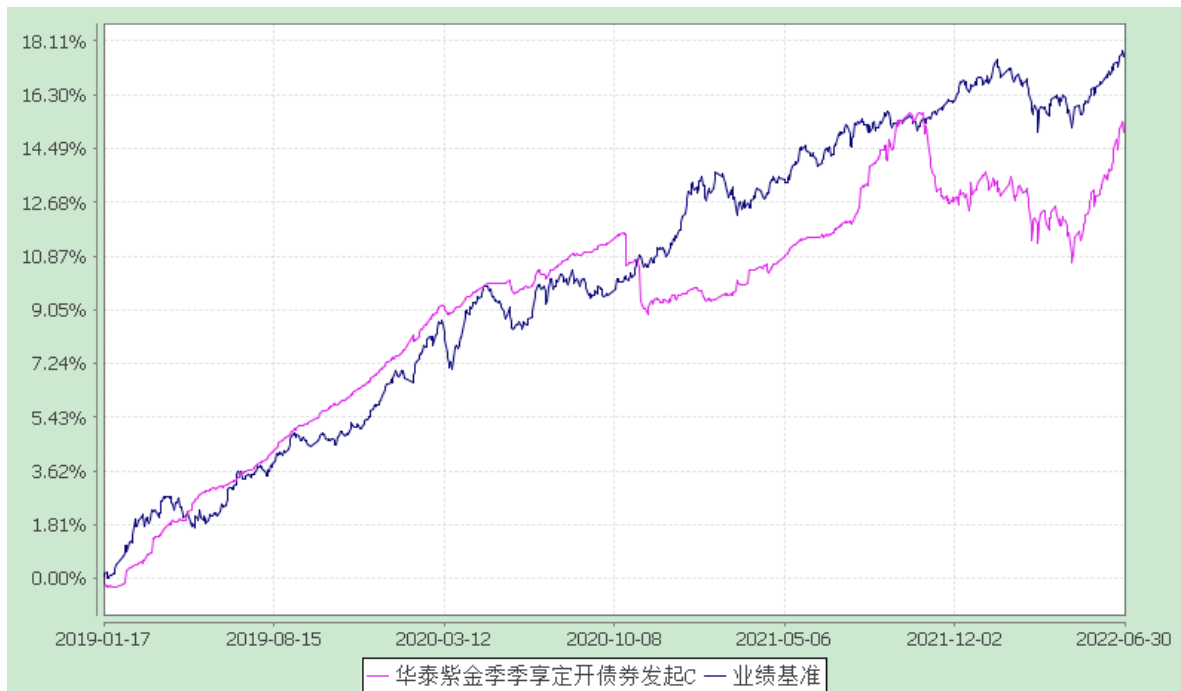
华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 1 月 17 日至 2022 年 6 月 30 日)

1. 华泰紫金季季享定开债券发起 A:



2. 华泰紫金季季享定开债券发起 C:



注：本基金业绩比较基准=中债综合财富（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。

§ 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		
李博良	本基金的基金经理	2019-01-17	-	9	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。
刘振超	本基金的基金经理	2020-03-24	-	7	曾任职于平安证券股份有限公司固定收益事业部,2016 年至 2019 年任职于万家基金管理有限公司,从事债券研究工作。2019 年 11 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,2020 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 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。

4.1.1 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。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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《华泰紫金季季享定期开放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

4 月以来全国新冠疫情多点爆发,打乱了上半年的经济复苏节奏。本轮疫情持续时间及波及范围均超出先前预期,对工业生产、运输以及居民消费带来非常大影响,4 月经济、金融数据均“砸出深坑”。5 月以来,国务院部署稳经济一揽子措施,稳增长、稳地产政策不断加码,全国逐步有序进行复产复工。5 月经济数据较 4 月出现边际恢复的迹象,预计 6 月环比改善效果更佳明显,经济最差的时候大概率已经过去。

面对“需求收缩、供给冲击与预期转弱”三重压力,财政政策前置发力明显。具体

的财政重心为“减收”、“增支”及“控制节奏”，地方政府专项债于 6 月底基本完成发行，稳增长政策应出尽出。货币政策则积极应对，央行先后全面降准 25BP、引导 LPR 非对称降息及上缴利润超万亿。虽然货币政策整体力度有限，但银行间流动性宽裕，资金价格持续低于政策利率。

二季度债市在弱现实和强预期的拉锯下，长端利率呈震荡市。4 月至 5 月下旬，国内疫情对经济冲击较大，资金面保持宽松，10 年期国债一度下探 2.7%。5 月底以来，国内疫情得到有效控制，美联储鹰派加息带动美债快速上行，长端利率情绪受到压制，10 年期国债逐步回归 2.8%。不过短端利率受益于资金面宽松，下行幅度较多，利率曲线明显陡峭化。在资产荒的格局下，信用债整体呈现牛陡态势，短久期、中低等级品种信用利差压缩明显。稳增长预期下，短券一度交易拥挤，短久期城投下沉策略受到市场追捧。

股票市场在二季度出现反弹，上证指数突破 3200 点，全 A 股日成交量破万亿，市场情绪有明显恢复。板块方面，随着大城市疫情拐点清晰化和复工复产持续推进，市场风险偏好得到提振，“稳增长”板块偃旗息鼓，电气设备、汽车及零部件等板块有明显反弹。转债市场表现弱于股市，转股溢价率水平仍然处于历史高位。

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，同时精选有一定安全边际的可转债及股票，分享权益市场上涨带来的超额回报。

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 3.07%，C 级基金净值收益率为 3.00%，同期业绩比较基准收益率为 1.61%。

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	19,200,880.22	8.04
	其中：股票	19,200,880.22	8.04
2	固定收益投资	156,413,245.94	65.46
	其中：债券	156,413,245.94	65.46
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	52,715,323.14	22.06
	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	6,452,135.90	2.70
7	其他各项资产	4,170,609.74	1.75
8	合计	238,952,194.94	100.00

注：1、本基金报告期末未持有港股通股票。

2、本基金报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	537,684.00	0.23
C	制造业	11,797,714.22	5.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	204,480.00	0.09
E	建筑业	830,492.00	0.35
F	批发和零售业	785,016.00	0.33

G	交通运输、仓储和邮政业	383,100.00	0.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	267,316.00	0.11
J	金融业	1,668,404.00	0.71
K	房地产业	1,988,920.00	0.85
L	租赁和商务服务业	232,930.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	220,724.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	284,100.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	19,200,880.22	8.17

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600383	金地集团	128,000.00	1,720,320.00	0.73
2	603876	鼎胜新材	30,000.00	1,356,000.00	0.58
3	600031	三一重工	60,000.00	1,143,600.00	0.49
4	000910	大亚圣象	118,800.00	1,089,396.00	0.46
5	300750	宁德时代	1,400.00	747,600.00	0.32
6	300896	爱美客	1,000.00	600,010.00	0.26
7	603890	春秋电子	60,000.00	591,600.00	0.25
8	601898	中煤能源	51,800.00	537,684.00	0.23
9	603916	苏博特	20,000.00	509,800.00	0.22
10	600195	中牧股份	40,000.00	490,400.00	0.21

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	23,079,076.40	9.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	81,788,298.08	34.82
	其中：政策性金融债	30,870,802.74	13.14
4	企业债券	16,603,758.23	7.07
5	企业短期融资券	10,033,002.74	4.27
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	24,909,110.49	10.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	156,413,245.94	66.58

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	200212	20 国开 12	100,000.00	10,518,104.11	4.48
2	180204	18 国开 04	100,000.00	10,319,493.15	4.39
3	2128024	21 中国银行 02	100,000.00	10,314,356.71	4.39
4	2128035	21 华夏银行 02	100,000.00	10,261,737.53	4.37
5	2128046	21 浦发银行 02	100,000.00	10,221,748.49	4.35

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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中，鼎胜新材在报告编制日前一年内曾受到中国证券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，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。

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

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	74,247.96
2	应收证券清算款	4,096,361.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,170,609.74

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产 净值比例(%)
1	113050	南银转债	2,366,574.89	1.01
2	113534	鼎胜转债	2,344,472.14	1.00
3	113622	杭叉转债	1,767,337.31	0.75
4	127032	苏行转债	1,381,377.67	0.59
5	128129	青农转债	1,312,522.26	0.56
6	128114	正邦转债	1,300,688.22	0.55
7	110043	无锡转债	1,241,624.90	0.53
8	123086	海兰转债	848,533.31	0.36
9	113599	嘉友转债	730,147.87	0.31
10	123071	天能转债	707,810.85	0.30
11	127035	濮耐转债	702,970.05	0.30
12	113037	紫银转债	519,405.34	0.22
13	110079	杭银转债	501,129.64	0.21
14	123085	万顺转 2	415,973.76	0.18
15	127019	国城转债	384,701.30	0.16
16	123078	飞凯转债	306,817.30	0.13
17	123063	大禹转债	296,683.84	0.13
18	127045	牧原转债	257,999.67	0.11
19	127012	招路转债	228,454.19	0.10
20	123082	北陆转债	197,426.97	0.08
21	123083	朗新转债	185,803.56	0.08
22	127043	川恒转债	173,943.18	0.07
23	127027	靖远转债	147,796.96	0.06
24	113634	珀莱转债	139,794.79	0.06
25	123120	隆华转债	137,884.58	0.06
26	123097	美力转债	136,567.81	0.06
27	123045	雷迪转债	131,385.71	0.06
28	128075	远东转债	122,935.89	0.05
29	123023	迪森转债	121,688.63	0.05
30	110080	东湖转债	118,297.67	0.05
31	127033	中装转 2	115,703.29	0.05
32	113535	大业转债	88,073.11	0.04

33	123012	万顺转债	80,011.01	0.03
34	110059	浦发转债	1,059.99	0.00
35	113042	上银转债	1,050.75	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

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	华泰紫金季季享定 开债券发起A	华泰紫金季季享定 开债券发起C
本报告期期初基金份额总额	259,140,977.49	99,739,590.83
本报告期基金总申购份额	9,738.65	85,146.98
减：本报告期基金总赎回份额	121,513,889.70	16,857,886.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	137,636,826.44	82,966,850.97

§ 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	华泰紫金季季享定开债 券发起A	华泰紫金季季享定开债 券发起C
报告期期初管理人持有的 本基金份额	89,278,474.17	-
本报告期买入/申购总份额	-	-
本报告期卖出/赎回总份额	59,080,000.00	-
报告期期末管理人持有的 本基金份额	30,198,474.17	-

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	21.94	-
---------------------------	-------	---

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

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	赎回	2022-04-12	59,080,000.00	61,059,180.00	-
合计			59,080,000.00	61,059,180.00	

注：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 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	30,198,474.17	13.69%	10,000,000.00	4.53%	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	30,198,474.17	13.69%	10,000,000.00	4.53%	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

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过20%的时间 区间					
机构	1	2022-4-1 至 2022-4-5、 2022-4-12 至 2022-6-30	103,3 33,95 9.61	0.00	58,060,0 00.00	45,273,959. 61	20.52%
	2	2022-4-1 至 2022-4-11	89,27 8,474. 17	0.00	59,080,0 00.00	30,198,474. 17	13.69%
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、发起式基金在成立三年后继续存续的，若本基金连续60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，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；</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>							

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 2022 年 4 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 2022 年 4 月 28 日起，潘熙先生新任本基金管理人副总经理。

2、本基金管理人根据监管规定要求于 2022 年 5 月 10 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 2022 年 5 月 9 日起，刘玉生先生因职务调整，不再担任本基金管理人合规总监、督察长。刘博文先生新任本基金管理人合规总监、督察长。

§ 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季季享定期开放债券型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2、《华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、《关于申请募集注册华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金之法律意见书》
- 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、产品资料概要；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

文件存放在本基金管理人、基金托管人的办公场所。

10.3 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

二〇二二年七月二十一日