

华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金

2023 年第 3 季度报告

2023 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：二〇二三年十月二十五日

§ 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 2023 年 10 月 24 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 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 3 月滚动债
基金主代码	008941
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 2 月 26 日
报告期末基金份额总额	28,542,336.11 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 3 月滚动债 A	华泰紫金周周购 3 月滚动债 C
下属分级基金的交易代码	008941	008942
报告期末下属分级基金的份额总额	13,054,906.26 份	15,487,429.85 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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)	
	华泰紫金周周购 3 月滚动债 A	华泰紫金周周购 3 月滚动债 C
1.本期已实现收益	-128,866.90	-243,433.10
2.本期利润	-96,257.01	-135,119.17
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0072	-0.0051
4.期末基金资产净值	15,416,281.36	18,089,272.22

5.期末基金份额净值	1.1809	1.1680
------------	--------	--------

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 3 月滚动债 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	-0.61%	0.29%	0.45%	0.05%	-1.06%	0.24%
过去六个月	-0.68%	0.26%	1.79%	0.05%	-2.47%	0.21%
过去一年	0.38%	0.24%	3.04%	0.06%	-2.66%	0.18%
过去三年	15.83%	0.38%	11.90%	0.07%	3.93%	0.31%
自基金合同生效起至今	18.09%	0.35%	12.66%	0.08%	5.43%	0.27%

2、华泰紫金周周购 3 月滚动债 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	-0.70%	0.29%	0.45%	0.05%	-1.15%	0.24%
过去六个月	-0.83%	0.26%	1.79%	0.05%	-2.62%	0.21%
过去一年	0.08%	0.24%	3.04%	0.06%	-2.96%	0.18%
过去三年	14.78%	0.38%	11.90%	0.07%	2.88%	0.31%
自基金合同生效起至今	16.80%	0.35%	12.66%	0.08%	4.14%	0.27%

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 3 个月滚动持有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

(2020 年 2 月 26 日至 2023 年 9 月 30 日)

1. 华泰紫金周周购 3 月滚动债 A:



2. 华泰紫金周周购 3 月滚动债 C:



注：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		
曹渝	本基金的基金经理	2022-11-15	-	12	南开大学金融学硕士，具有基金从业资格，2011 年至 2012 年供职于嘉实基金研究部，2012 年至 2014 年供职于泰康之家（北京）投资有限公司，2014 年至 2016 年供职于中金公司固定收益部，2016 年 9 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和混合型产品的投资管理工作。

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。

4.1.1 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 3 个月滚动持有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

二季度经济修复动能下滑，7 月政治局会议指出经济运行面临新的困难挑战，稳经济和稳预期的政策陆续出台，经济修复仍然偏慢，政策预期变强经济修复预期仍有分歧，市场波动并且表现有所差异。三季度 10 年期国债收益率、上证指数、南华工业品指数分别表现为：震荡上行 4BP、下跌 2.86%、上涨 13.63%。

债券市场受加大力度的扩需求政策预期和偏弱的现实缺资产双重影响，8 月上旬尤其是超预期降息下，收益率先下而后房地产信贷政策加速落地，整体有所上行。1 年期 AAA 同业存单收益率由 2.30% 上行至 2.44%，10 年期国债收益率由 2.64% 微幅上行至 2.68%，收益率曲线呈现熊平。高等级信用债多数调整，部分低等级有所下行，3 年期 AAA 信用债收益率从 2.78% 上行至 2.87%，3 年 AA 从 3.42% 下行至 3.38%。组合 Q3 增加部分信用品种，获取相对确定的票息收益。展望四季度。债券市场，目前 10 年国债收益率 2.70% 附近，较 MLF 高出 20BP，一方面是短端资金面压制市场

做多情绪，另一方面隐含政策发力的预期和供给冲击担忧。当前市场，中短端票息资产、骑乘效应仍较提供较好的回报，长端资产的配置价值也在提升。理财出现前次赎回潮概率降低，不过四季度仍有机机构止盈需求、年底配置需求，在债市缺乏方向性交易的时候，短端票息的确定性和性价比较高，组合以中短端票息和杠杆套息策略为主，做好曲线凸点挖掘和杠杆增厚，通过精细化操作增厚组合收益。

三季度权益市场受盈利预期下滑和外资流出双重压力大幅回调，并且表现略强势的板块频繁切换，7 月份政策预期主导下地产顺周期和活跃资本市场提法的券商等板块强势，8 月市场快速全面下跌，9 月煤炭等上游板块在商品价格上涨刺激下有所表现。转债指数表现弱于二季度，并且 9 月份受到债市调整影响较正股下跌更明显。展望四季度，权益市场扩需求和活跃资本市场政策拐点已经出现，权益市场盈利和预期的修复只会迟到不会缺席，当前仍处于需求端线索不明确政策落地市场寻找主线的过程中；转债市场，经历了估值压缩和正股冲击后，配置价值明显提升。行业维度：1) 供给结构较好的顺周期行业；2) 关注底部的需求行业，地产链条弹性有限关注格局较好的家电、家居，关注消费链条中库存、政策受益的细分行业；3) 科技全年主线有共识，随着估值修复阶段进入波动期，库存和国产替代提升的细分行业。转债方面，当前转债价值好于前期，不过也不存在估值大幅抬升的基础，股性逻辑更为重要，低溢价率和行业选择都将有增厚作用。

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-0.61%，C 级基金净值收益率为-0.70%，同期业绩比较基准收益率为 0.45%。

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、本基金自 2023 年 9 月 1 日起出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，截止本报告期末，以上情况未消除。

§ 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	6,030,512.97	14.30
	其中：股票	6,030,512.97	14.30
2	固定收益投资	32,790,105.42	77.74
	其中：债券	32,790,105.42	77.74
	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	-329.04	0.00
	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	3,009,412.62	7.13
7	其他各项资产	351,634.87	0.83
8	合计	42,181,336.84	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	177,300.00	0.53
C	制造业	4,065,745.00	12.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	337,790.00	1.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	391,760.00	1.17
J	金融业	461,580.00	1.38
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	215,657.97	0.64
R	文化、体育和娱乐业	380,680.00	1.14
S	综合	-	-
	合计	6,030,512.97	18.00

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	601658	邮储银行	54,000.00	268,380.00	0.80
2	002555	三七互娱	11,800.00	256,060.00	0.76
3	000063	中兴通讯	7,000.00	228,760.00	0.68
4	600585	海螺水泥	8,500.00	221,255.00	0.66
5	300122	智飞生物	4,500.00	219,015.00	0.65
6	601298	青岛港	34,000.00	216,240.00	0.65
7	300015	爱尔眼科	12,001.00	215,657.97	0.64
8	603816	顾家家居	5,300.00	214,597.00	0.64
9	600690	海尔智家	9,000.00	212,400.00	0.63
10	601928	凤凰传媒	20,000.00	209,600.00	0.63

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	4,040,795.06	12.06

2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,062,711.26	6.16
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	16,429,142.17	49.03
5	企业短期融资券	1,029,963.93	3.07
6	中期票据	1,540,755.74	4.60
7	可转债（可交换债）	7,686,737.26	22.94
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	32,790,105.42	97.86

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	1928002	19 民生银行二级 01	20,000.00	2,062,711.26	6.16
2	175219	20 首钢 04	20,000.00	2,060,144.99	6.15
3	185051	21 格力 01	20,000.00	2,047,897.97	6.11
4	149747	21 润置 02	20,000.00	2,041,504.11	6.09
5	175907	21 首置 03	20,000.00	2,038,969.10	6.09

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

本基金本报告期末投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,367.95
2	应收证券清算款	332,432.06
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,834.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	351,634.87

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	110079	杭银转债	407,386.48	1.22
2	127045	牧原转债	352,561.97	1.05
3	127016	鲁泰转债	339,761.35	1.01
4	110088	淮 22 转债	333,878.30	1.00
5	110067	华安转债	289,864.86	0.87
6	118004	博瑞转债	273,964.66	0.82
7	113065	齐鲁转债	267,420.76	0.80
8	113062	常银转债	258,948.86	0.77
9	110073	国投转债	235,307.07	0.70
10	113058	友发转债	224,986.93	0.67
11	127078	优彩转债	221,553.22	0.66
12	128048	张行转债	210,607.74	0.63
13	111002	特纸转债	202,568.77	0.60
14	110045	海澜转债	178,927.86	0.53
15	127022	恒逸转债	172,400.44	0.51
16	113662	豪能转债	156,017.99	0.47
17	113647	禾丰转债	155,697.79	0.46
18	113024	核建转债	149,115.66	0.45
19	113632	鹤 21 转债	148,066.19	0.44
20	127044	蒙娜转债	139,701.04	0.42
21	123172	漱玉转债	133,980.75	0.40
22	123164	法本转债	130,152.34	0.39
23	110085	通 22 转债	118,502.00	0.35
24	118030	睿创转债	114,960.66	0.34
25	110090	爱迪转债	114,503.01	0.34
26	113563	柳药转债	112,705.40	0.34
27	128119	龙大转债	110,893.01	0.33
28	127056	中特转债	109,701.12	0.33
29	113637	华翔转债	109,108.95	0.33
30	113055	成银转债	105,931.98	0.32
31	128137	洁美转债	104,996.38	0.31
32	113056	重银转债	103,808.33	0.31
33	113061	拓普转债	92,623.48	0.28
34	113648	巨星转债	92,266.37	0.28
35	127018	本钢转债	91,715.61	0.27
36	113063	赛轮转债	90,317.38	0.27
37	123100	朗科转债	83,141.01	0.25
38	123152	润禾转债	80,967.05	0.24
39	123127	耐普转债	69,731.59	0.21
40	113623	凤 21 转债	35,335.73	0.11
41	118020	芳源转债	16,072.58	0.05

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	华泰紫金周周购3月 滚动债A	华泰紫金周周购3月 滚动债C
本报告期期初基金份额总额	13,556,745.12	31,146,579.13
本报告期基金总申购份额	180,133.06	240,019.80
减：本报告期基金总赎回份额	681,971.92	15,899,169.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,054,906.26	15,487,429.85

§ 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3月滚 动债A	华泰紫金周周购3月滚 动债C
报告期期初管理人持有的 本基金份额	-	7,005,839.08
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	-	7,005,839.08
报告期期末持有的本基金 份额占基金总份额比例 (%)	-	45.24

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 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

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	2023-07-01 至 2023-08-31	15,000,000.00	0.00	15,000,000.00	0.00	0.00%
	2	2023-09-01 至 2023-09-30	7,005,839.08	0.00	0.00	7,005,839.08	24.55%
	3	2023-09-01 至 2023-09-30	6,278,997.30	0.00	0.00	6,278,997.30	22.00%

产品特有风险

- 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；
- 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；
- 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；
- 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；
- 5、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，其他投资者可能面临终止基金合同的风险；
- 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；
- 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 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、《华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型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周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金之法律意见书》；
- 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

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

二〇二三年十月二十五日