

华泰紫金周周购 6 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金
2025 年第 2 季度报告

2025 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：中信银行股份有限公司
报告送出日期：二〇二五年七月二十一日

§ 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 7 月 18 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 2025 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 华泰紫金周周购 6 个月滚动债发起 |
| 基金主代码 | 015141 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 3 月 10 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 230,152,022.00 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 | 1、资产配置策略：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。2、久期策略：本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对引起利率变化的相关因素进行跟踪和分析，进而对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案，以降低利率变动对组合带来的影响。3、类属配置策略；4、信用债投资策略；5、杠杆投资策略；6、再投资策略；7、资产支持证券的投资策略；8、国债期货投资策略；9、可转换债券投资策略；10、可交换债券投资策略；11、股票投资策略。 | |
| 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 | 中信银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华泰紫金周周购 6 个月滚动债发起 A | 华泰紫金周周购 6 个月滚动债发起 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 015141 | 015142 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 111,463,078.62 份 | 118,688,943.38 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 (2025 年 4 月 1 日-2025 年 6 月 30 日) | |
|----------------|---|-------------------------|
| | 华泰紫金周周购 6 个 月滚动债发起 A | 华泰紫金周周购 6 个 月滚动债发起 C |
| 1.本期已实现收益 | 265,546.25 | 185,470.99 |
| 2.本期利润 | 1,100,821.58 | 1,038,500.79 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0099 | 0.0091 |
| 4.期末基金资产净值 | 118,848,677.83 | 125,305,348.50 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0663 | 1.0557 |

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 6 个月滚动债发起 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 | 0.94% | 0.10% | 1.67% | 0.08% | -0.73% | 0.02% |
| 过去六个月 | 1.43% | 0.11% | 1.01% | 0.10% | 0.42% | 0.01% |
| 过去一年 | 5.76% | 0.13% | 5.89% | 0.13% | -0.13% | 0.00% |
| 过去三年 | 5.60% | 0.14% | 12.92% | 0.11% | -7.32% | 0.03% |
| 自基金合 同生效起 至今 | 6.63% | 0.14% | 15.03% | 0.11% | -8.40% | 0.03% |

2、华泰紫金周周购 6 个月滚动债发起 C:

| 阶段 | 净值增长 率① | 净值增长 率标准差 | 业绩比较 基准收益 | 业绩比较 基准收益 | ①-③ | ②-④ |
|----|------------|--------------|--------------|--------------|-----|-----|
| | | | | | | |

| | | ② | 率③ | 率标准差 ④ | | |
|------------|-------|-------|--------|-----------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.86% | 0.10% | 1.67% | 0.08% | -0.81% | 0.02% |
| 过去六个月 | 1.27% | 0.11% | 1.01% | 0.10% | 0.26% | 0.01% |
| 过去一年 | 5.43% | 0.13% | 5.89% | 0.13% | -0.46% | 0.00% |
| 过去三年 | 4.64% | 0.14% | 12.92% | 0.11% | -8.28% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.57% | 0.14% | 15.03% | 0.11% | -9.46% | 0.03% |

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 6 个月滚动持有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
(2022 年 3 月 10 日至 2025 年 6 月 30 日)

1. 华泰紫金周周购 6 个月滚动债发起 A:



2. 华泰紫金周周购 6 个月滚动债发起 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 | | |
| 曹渝 | 本基金的基金经理 | 2023-07-17 | 2025-04-22 | 14 | 南开大学管理学学士、金融学硕士，曾先后任职嘉实基金权益研究部、中金公司固定收益部，2015、2016 年获新财富分析师固定收益第二名(团队参评)。2016 年加入华泰证券(上海)资产管理有限公司从事固定收益型和混合型产品的投资管理工作，曾任固收增强团队负责人。 |
| 刘鹏飞 | 本基金的基金经理 | 2025-04-21 | - | 9 | 清华大学工学学士、硕士，先后就职于东莞证券股份有限公司资产管理部、广发基金管 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 理有限公司，从事债券交易、研究工作。2020 年 4 月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，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的生效日期。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

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 6 个月滚动持有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

二季度国内外宏观层面发生不少超预期事件——关税 4 月剧烈升级后中美之间又于 5 月初快速达成初步联合声明、央行降准降息、海外局部冲突等等，对金融市场产生明显的影响。整体看风险资产表现较强，关税冲击短暂下跌之后即持续反弹，修复跌幅后创二季度新高，万得全 A 指数二季度上涨 3.86%；可转债更为强势，中证转债指数二季度上涨 3.77%，指数创近十年新高。债券则有所分化，利率债整体震荡，收益率小幅下行，曲线走陡；票息较高的信用债受益于宽松的资金面，表现持续偏强。央行于 5 月初降准降息后，资金利率中枢下移，短端利率快速下行。长端利率一方面绝对收益率低，另一方面受债券供给、风险偏好等扰动较多，整体窄幅震荡。中长期限的信用债和二永债等票息较高的资产则受到机构的持续青睐，收益率持续下行，二季度表现较好。

组合在二季度进一步提升了纯债的仓位，拉长组合久期，把握票息类资产的行情。含权资产方面，考虑估值情况，可转债仓位整体中性，对其持仓结构适度调整；结合机会判断与基本面和估值水平，小仓位增加了部分股票。

当前国内外环境依然较为复杂，不确定性因素较多，在经济仍有压力、资金流动性宽松的条件下，当前位置权益和转债市场预计整体偏震荡，纯债资产的胜率依然不低。组合继续维持偏稳健的运作，积极把握各类资产的收益机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 类份额基金净值收益率为 0.94%，C 类份额基金净值收益率为 0.86%，同期业绩比较基准收益率为 1.67%。

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 | 权益投资 | 4,968,123.00 | 1.66 |
| | 其中：股票 | 4,968,123.00 | 1.66 |
| 2 | 固定收益投资 | 285,401,395.05 | 95.31 |
| | 其中：债券 | 285,401,395.05 | 95.31 |
| | 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 | 500,000.00 | 0.17 |
| | 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 | 1,931,343.10 | 0.65 |
| 7 | 其他各项资产 | 6,631,326.50 | 2.21 |
| 8 | 合计 | 299,432,187.65 | 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 | 261,300.00 | 0.11 |
| C | 制造业 | 3,664,501.00 | 1.50 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 443,800.00 | 0.18 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 239,418.00 | 0.10 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 359,104.00 | 0.15 |
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 4,968,123.00 | 2.03 |

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 | 601717 | 郑煤机 | 46,400.00 | 771,168.00 | 0.32 |
| 2 | 002014 | 永新股份 | 45,700.00 | 553,884.00 | 0.23 |
| 3 | 600096 | 云天化 | 21,700.00 | 476,749.00 | 0.20 |
| 4 | 000543 | 皖能电力 | 63,400.00 | 443,800.00 | 0.18 |
| 5 | 002262 | 恩华药业 | 21,100.00 | 438,458.00 | 0.18 |
| 6 | 002594 | 比亚迪 | 1,300.00 | 431,483.00 | 0.18 |
| 7 | 600519 | 贵州茅台 | 200.00 | 281,904.00 | 0.12 |
| 8 | 601899 | 紫金矿业 | 13,400.00 | 261,300.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|------------|------|
| 9 | 002706 | 良信股份 | 27,700.00 | 246,807.00 | 0.10 |
| 10 | 600012 | 皖通高速 | 14,100.00 | 239,418.00 | 0.10 |

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 | 23,229,542.06 | 9.51 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 125,655,199.99 | 51.47 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,918,616.44 | 4.47 |
| 4 | 企业债券 | 13,292,591.13 | 5.44 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 77,118,823.57 | 31.59 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 33,801,171.98 | 13.84 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 12,304,066.32 | 5.04 |
| 10 | 合计 | 285,401,395.05 | 116.89 |

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 | 019766 | 25 国债 01 | 130,000.00 | 13,057,296.16 | 5.35 |
| 2 | 220205 | 22 国开 05 | 100,000.00 | 10,918,616.44 | 4.47 |
| 3 | 232380069 | 23 建行二级资本债 02A | 100,000.00 | 10,744,528.77 | 4.40 |
| 4 | 242380019 | 23 邮储永续债 01 | 100,000.00 | 10,725,644.38 | 4.39 |
| 5 | 232380076 | 23 建行二级资本债 03A | 100,000.00 | 10,673,186.30 | 4.37 |

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**

二季度将此前持有的国债期货进行平仓，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

| 代码 | 名称 | 持仓量 (买/卖) | 合约市值 (元) | 公允价值变 动(元) | 风险指标说 明 |
|-------------------|----|--------------|-------------|---------------|------------|
| - | - | - | - | - | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | - |
| 国债期货投资本期收益(元) | | | | | -19,826.45 |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | - |

注：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

结合市场判断，合理控制组合久期敞口，择机平掉了持仓的国债期货，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，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚，中国农业银行、中国建设银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚，邮储银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。

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 | 27,849.73 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,903,482.77 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,699,994.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,631,326.50 |

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 | 118031 | 天 23 转债 | 2,100,049.32 | 0.86 |
| 2 | 110081 | 闻泰转债 | 1,898,240.96 | 0.78 |
| 3 | 113641 | 华友转债 | 1,762,705.48 | 0.72 |
| 4 | 113056 | 重银转债 | 1,511,431.23 | 0.62 |
| 5 | 111010 | 立昂转债 | 1,385,903.01 | 0.57 |
| 6 | 113632 | 鹤 21 转债 | 1,374,153.15 | 0.56 |
| 7 | 113062 | 常银转债 | 1,285,833.97 | 0.53 |
| 8 | 127083 | 山路转债 | 1,251,472.11 | 0.51 |
| 9 | 123107 | 温氏转债 | 1,230,608.49 | 0.50 |
| 10 | 127045 | 牧原转债 | 1,213,854.18 | 0.50 |
| 11 | 118034 | 晶能转债 | 1,036,746.85 | 0.42 |
| 12 | 113605 | 大参转债 | 975,873.53 | 0.40 |
| 13 | 113652 | 伟 22 转债 | 936,905.42 | 0.38 |
| 14 | 128141 | 旺能转债 | 857,955.52 | 0.35 |
| 15 | 127066 | 科利转债 | 853,472.60 | 0.35 |

| | | | | |
|----|--------|-------|------------|------|
| 16 | 111000 | 起帆转债 | 717,579.45 | 0.29 |
| 17 | 123113 | 仙乐转债 | 704,520.00 | 0.29 |
| 18 | 113679 | 芯能转债 | 679,870.68 | 0.28 |
| 19 | 113033 | 利群转债 | 666,593.42 | 0.27 |
| 20 | 113691 | 和邦转债 | 649,510.52 | 0.27 |
| 21 | 113066 | 平煤转债 | 639,838.08 | 0.26 |
| 22 | 110093 | 神马转债 | 621,388.08 | 0.25 |
| 23 | 123150 | 九强转债 | 597,816.44 | 0.24 |
| 24 | 110073 | 国投转债 | 580,671.92 | 0.24 |
| 25 | 118024 | 冠宇转债 | 573,989.73 | 0.24 |
| 26 | 128134 | 鸿路转债 | 571,127.40 | 0.23 |
| 27 | 113616 | 韦尔转债 | 551,699.38 | 0.23 |
| 28 | 113627 | 太平转债 | 507,122.88 | 0.21 |
| 29 | 127040 | 国泰转债 | 495,601.15 | 0.20 |
| 30 | 123192 | 科思转债 | 486,012.60 | 0.20 |
| 31 | 113045 | 环旭转债 | 471,757.92 | 0.19 |
| 32 | 113058 | 友发转债 | 443,750.14 | 0.18 |
| 33 | 113631 | 皖天转债 | 388,717.81 | 0.16 |
| 34 | 127050 | 麒麟转债 | 371,408.22 | 0.15 |
| 35 | 123212 | 立中转债 | 370,264.52 | 0.15 |
| 36 | 111021 | 奥锐转债 | 357,370.68 | 0.15 |
| 37 | 127086 | 恒邦转债 | 329,969.26 | 0.14 |
| 38 | 127073 | 天赐转债 | 310,372.32 | 0.13 |
| 39 | 127026 | 超声转债 | 248,437.53 | 0.10 |
| 40 | 123199 | 山河转债 | 243,983.29 | 0.10 |
| 41 | 113639 | 华正转债 | 238,278.90 | 0.10 |
| 42 | 113659 | 莱克转债 | 234,659.73 | 0.10 |
| 43 | 127049 | 希望转 2 | 226,507.73 | 0.09 |
| 44 | 113692 | 保隆转债 | 191,629.89 | 0.08 |
| 45 | 110090 | 爱迪转债 | 124,755.89 | 0.05 |
| 46 | 128137 | 洁美转债 | 122,492.90 | 0.05 |
| 47 | 118025 | 奕瑞转债 | 36,797.51 | 0.02 |

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不存在流通受限的情况。

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6个月滚动债发起A | 华泰紫金周周购6个月滚动债发起C |
|---------------|------------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 111,957,619.95 | 114,097,867.66 |
| 本报告期基金总申购份额 | 525,339.50 | 4,601,429.36 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,019,880.83 | 10,353.64 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 111,463,078.62 | 118,688,943.38 |

§ 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6个月滚动债发起A | 华泰紫金周周购6个月滚动债发起C |
|--------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 35,004,500.05 | - |
| 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 | 35,004,500.05 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 31.40 | - |

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 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 | 35,004,500.05 | 15.21% | 35,004,500.05 | 15.21% | 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 | 35,004,500.05 | 15.21% | 35,004,500.05 | 15.21% | 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

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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 10 备查文件目录

10.1 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 6 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金周周购 6 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金周周购 6 个月滚动持有债券型发起式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、《关于申请募集注册周周购 6 个月滚动持有债券型发起式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。

10. 2 存放地点

文件存放在基金管理人、基金托管人的住所。

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://www.htscamc.com>。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二五年七月二十一日