

**华泰紫金泰盈混合型证券投资基金**  
**2023 年年度报告**  
**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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年三月二十八日

## §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独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 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 2023 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
1.2 目录	3
<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合规守信情况的说明	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>	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	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	19
6.3 其他信息	19
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	19
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	19
<b>§7 年度财务报表</b>	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	26
<b>§8 投资组合报告</b>	63
8.1 期末基金资产组合情况	63
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	63

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 .....	65
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	68
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	70
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	70
8.12	本报告期投资基金情况 .....	71
8.13	投资组合报告附注 .....	71
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>72</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	72
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	72
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 .....	73
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 .....	73
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>73</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>73</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	73
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 .....	74
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	74
11.4	基金投资策略的改变 .....	74
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	74
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	74
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 .....	74
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	74
11.9	其他重大事件 .....	75
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>77</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>77</b>
13.1	备查文件目录 .....	77
13.2	存放地点 .....	78
13.3	查阅方式 .....	78

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰紫金泰盈混合型证券投资基金	
基金简称	华泰紫金泰盈混合	
基金主代码	008404	
交易代码	008404	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 1 月 21 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	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	311,507,012.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金泰盈混合 A	华泰紫金泰盈混合 C
下属分级基金的交易代码	008404	008405
报告期末下属分级基金的份额总额	34,240,022.10 份	277,266,990.39 份

### 2.2 基金产品说明

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	本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略，并对投资组合进行动态调整。由于本基金为混合型基金，核心投资策略为股票精选策略，同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益，提升投资组合回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+恒生指数收益率×15%+中债综合指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金与货币市场型基金，低于股票型基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	白海燕	许俊
	联系电话	4008895597	010-66596688
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008895597	95566
传真		021-28972120	010-66594942
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区基 隆路6号1222室	北京市复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区东方路18号21 楼	北京市复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		崔春	葛海蛟

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	上海市浦东新区东方路 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	2023 年		2022 年		2021 年	
	华泰紫金泰 盈混合 A	华泰紫金泰 盈混合 C	华泰紫金泰 盈混合 A	华泰紫金泰 盈混合 C	华泰紫金泰 盈混合 A	华泰紫金泰盈 混合 C
本期已 实现收 益	-3,001,599. 55	-20,717,755 .84	-11,025,461.6 7	-81,659,752.4 8	27,337,934.7 0	236,796,886.7 5
本期利 润	-2,729,923. 61	-17,635,250 .50	-12,703,900.6 1	-101,471,931. 48	1,593,472.48	13,299,234.30
加权平 均基金 份额本 期利润	-0.0760	-0.0740	-0.3002	-0.3601	0.0287	0.0280
本期加 权平均 净值利 润率	-5.94%	-5.84%	-22.77%	-27.37%	1.77%	1.73%
本期基 金份额 净值增 长率	-6.77%	-6.97%	-20.78%	-20.93%	-0.93%	-1.13%
3.1.2 期末 数据和指 标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	华泰紫金泰盈 混合 A	华泰紫金泰盈 混合 C	华泰紫金泰盈 混合 A	华泰紫金泰盈 混合 C	华泰紫金泰盈 混合 A	华泰紫金泰盈混 合 C
期末可 供分配 利润	5,902,156.1 1	45,233,215. 86	9,807,138.25	64,169,635.2 8	21,725,413.1 8	185,025,803.4 1

期末可供分配基金份额利润	0.1724	0.1631	0.2576	0.2502	0.5874	0.5812
期末基金资产净值	40,142,178.21	322,500,206.25	47,878,311.90	320,656,999.17	58,711,281.02	503,364,433.40
期末基金份额净值	1.1724	1.1631	1.2576	1.2502	1.5874	1.5812
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	华泰紫金泰盈混合 A	华泰紫金泰盈混合 C	华泰紫金泰盈混合 A	华泰紫金泰盈混合 C	华泰紫金泰盈混合 A	华泰紫金泰盈混合 C
基金份额累计净值增长率	17.24%	16.31%	25.76%	25.02%	58.74%	58.12%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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. 华泰紫金泰盈混合 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	-6.20%	0.79%	-4.22%	0.58%	-1.98%	0.21%



过去六个月	-8.44%	0.80%	-7.09%	0.62%	-1.35%	0.18%
过去一年	-6.77%	0.84%	-7.60%	0.62%	0.83%	0.22%
过去三年	-26.83%	1.27%	-23.71%	0.79%	-3.12%	0.48%
自基金合同生效起至今	17.24%	1.29%	-14.14%	0.84%	31.38%	0.45%

## 2. 华泰紫金泰盈混合 C:

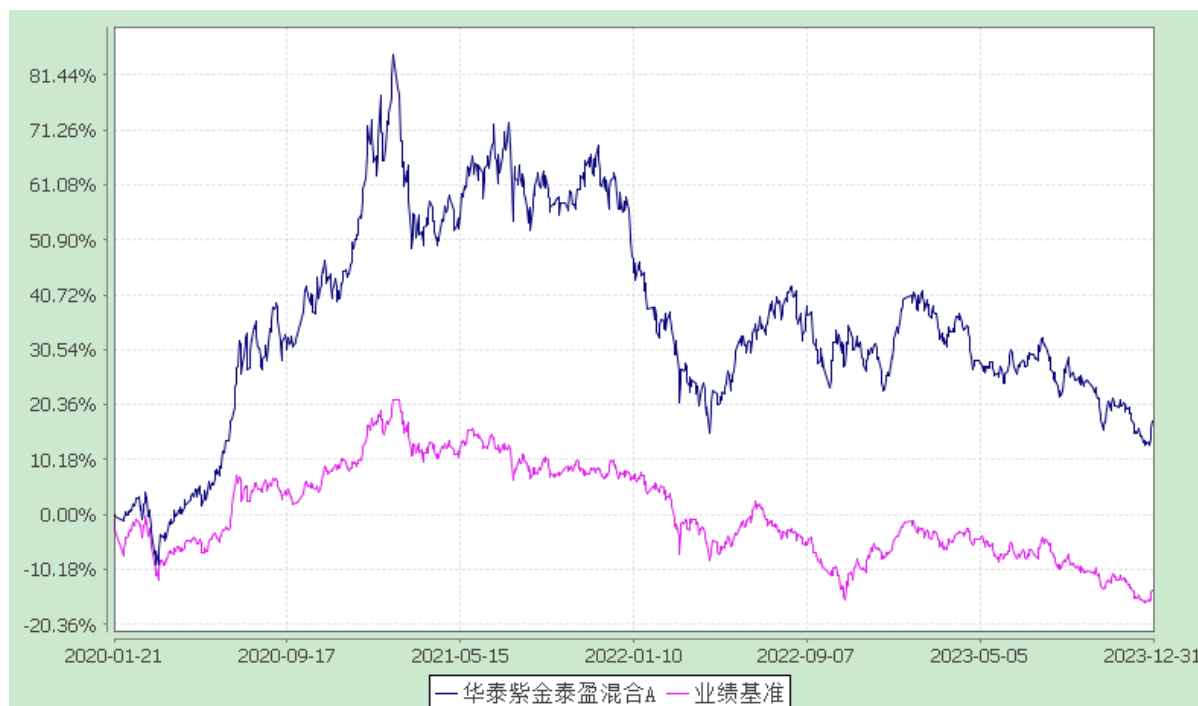
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.25%	0.79%	-4.22%	0.58%	-2.03%	0.21%
过去六个月	-8.54%	0.80%	-7.09%	0.62%	-1.45%	0.18%
过去一年	-6.97%	0.84%	-7.60%	0.62%	0.63%	0.22%
过去三年	-27.27%	1.27%	-23.71%	0.79%	-3.56%	0.48%
自基金合同生效起至今	16.31%	1.29%	-14.14%	0.84%	30.45%	0.45%

### 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

#### 华泰紫金泰盈混合型证券投资基金

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 1 月 21 日至 2023 年 12 月 31 日)

#### 1、华泰紫金泰盈混合 A



#### 2、华泰紫金泰盈混合 C



注：1、本基金业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率\*55%+恒生指数收益率\*15%+中债综合指数收益率\*30%；

2、本基金合同于 2020 年 1 月 21 日生效，自基金成立起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 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

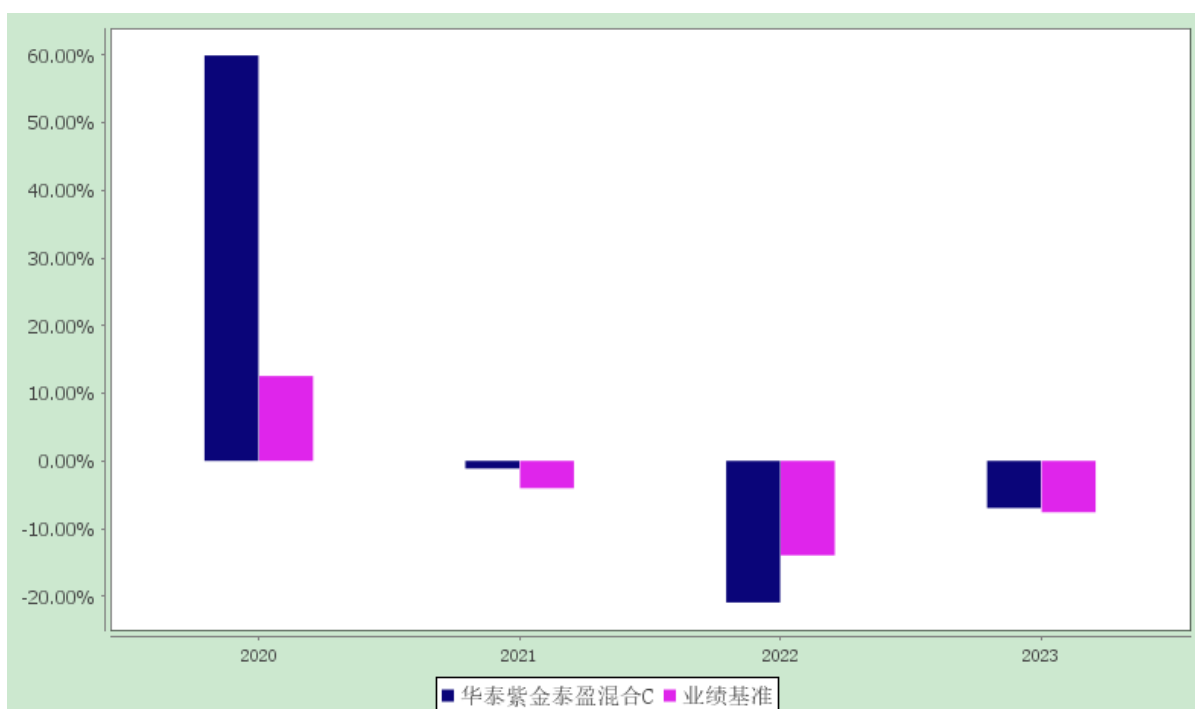
华泰紫金泰盈混合型证券投资基金

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、华泰紫金泰盈混合 A



## 2、华泰紫金泰盈混合 C



注：1、本基金业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率\*55%+中债综合指数收益率\*30%+恒生指数收益率\*15%；

2、本基金合同生效日为 2020 年 1 月 21 日。合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 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		
魏昊	本基金的基金经理,权益公募投资部总经理	2021-07-29	2023-06-19	22	魏昊先生于2001年加入海通证券从事行业和公司研究工作，2003年加入凯基证券从事A股和港股行业和公司研究，2005年在中国国际金融有限公司担任投资经理。2016年加入华泰证券（上海）资产管理有限公司担任投资经理，2021年4月起陆续担任华泰紫金信息科技主题6个月定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰紫金泰盈混合型证券投资基金等基金的基金经理。
查晓磊	本基金的基金经理,公司权益投资总监、权益公募投资部总经理、权	2023-06-19	-	12	深圳市后备级领军人才，香港中文大学金融学博士，博时基金-南开大学应用经济博士后。曾先后就职于博时基金、浙商基金，曾主管权益与AI量化投研团

	益专户投资部 总经理				队，建立并持续完善 AI+HI 的投研体系，形成 AI 驱动及+HI、+Beta 和+绝对收益四条成品线，多次荣获《中国基金报》、《证券时报》评比奖项。2022 年加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，现担任公司权益投资总监、权益公募投资部总经理、权益专户投资部总经理、基金经理兼投资经理。
冯潇	本基金的基金 经理助理	2023-11-21	-	11	四川大学经济学学士，美国亚利桑那大学理学硕士。 曾先后在国泰君安证券研究所担任非银金融、传媒行业研究员，在国泰君安权益投资部担任投资主办助理，曾获非银团队 2012 年新财富第四名、金牛奖第一名、水晶球第二名，2013 年新财富第五名，传媒团队 2014 年新财富入围。2016 年加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，历任研究员、投资经理。

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。

#### 4.1.3 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
查晓磊	公募基金	2.00	624,380,666.81	2023 年 6 月 19 日
	私募资产管理计划	3.00	113,468,497.70	2022 年 8 月 2 日
	其他组合	-	-	-
	合计	5.00	737,849,164.51	-

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

#### 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《华泰紫金泰盈混合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 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，公平交易控制制度，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

本报告期内，本产品基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理工作。

公司依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》针对同一基金经理管理的多个投资组合，加强了对投资指令、交易行为、交易监测和分析的管理，加强了事后报告机制。

本报告期内，未发现本产品基金经理所管理的各个投资组合间存在不公平交易的情况。

### 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

本产品以股票配置为主，其他资产配置为辅，通过自上而下与自下而上相结合，在投资逻辑驱动下基本面量化赋能，选择性价比占优的行业构建组合，力争获取权益类资产的长期超额收益。

我们内部的资产配置模型显示权益类资产性价比持续占优，从中长期配置的角度，产品权益类资产的占比处于较高水平。在结构上，组合构建围绕三大方面的主线持续寻找定价占优的具体标的。一是资本开支新周期下的资源品与制造业，尤其是面向全球市场的中游制造行业。二是偏向内需的行业以及经济从衰退后期过渡到复苏前期的行业。三是逐步接近下行周期尾声且估值位置低的行业，其中主要以泛科技行业为主。

虽然过去的一年市场跌宕起伏，但我们组合的操作整体变化并不大，拉长视野，降低换手，应对市场的流动性及交易性波动。组合的较大一部分结构偏向在估值偏低，且当前基本面可能偏弱但有企稳迹象和前景的行业和公司上。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-6.77%，同期业绩比较基准收益率为-7.60%；本基金 C 类份额净值增长率为-6.97%，同期业绩比较基准收益率为-7.60%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年是在不长的中国资本市场历史中，将“定价”两字的重要性极其凸显的一年。股价的回报，不等同于当期盈利的高速增长，不等同于远期的宏大叙事，不等同于当下的市场热点。当然，盈利的增长、远期的空间、市场的热点都是影响股价的重要因素，但当他们要实质性影响甚至决定我们投资回报率的时候，“定价”毫无疑问是其中最为重要的中间变量因素。人们讨论基本面的投资策略时，往往仅仅指的是狭义的“基本面”，关注未来一个季度的是否增长，关注行业当下是否景气，却往往忽视基本面投资策略中最为重要的“估值”因素，以及对于“估值”不确定性是否留有足够的冗余空间。二级市场投资中最重要的事情，是我们如何给各种不确定性定价，并且是一个可以带来合理回报的定价。

2023 年也是宏观因素影响程度十分显著的一年。自 2022 年底延续到 2023 年一季度中的经济修复预期，在 3 月下旬逐渐减弱。自 5 月份开始的一轮工业生产补库存的小周期，在商品市场明显演绎，在股票市场则是表现出弱势 beta 下的超额收益。最后一个季度，经济的弱预期再度发酵，风险资产再度成为市场规避的方向。

站在 2023 年的年末展望 2024 年的经济与市场。以股票为代表的风险类资产同时面临着不利与有利的方面，但总体上，我们倾向于认为新的一年仍可能要优于过去一年。相对不利因素在于在经济换挡并转型至高质量发展阶段的过程中，传统领域的出清时间可能拉得比较长，且也鲜有历史可比经验参考。对于资本市场本身，过去几年的市场配置结构与投资者的持有体验，也可能需要更多的时间修复。但相对有利的因素也十分显著。股票资产定价的重要变量在于对未来预期现金流的折现。无论是股票资产整体的估值水平，还是股票相对于其他主要资产的风险定价性价比，抑或是资产本身的调整时间，都处于历史上非常极端的水平。可以说，极端的预期留在了 2023，艰难的表现留在了 2023，留给 2024 年的现实可能仍有诸多困难，但同时留给 2024 年进一步向下的空间也已十分有限。此外，海外流动性环境相比今年有所宽松也将是大概率的事件。也许 2024 年还将发生很多不确定性的事情，但资产的表现大概率将迎来一个回归，哪怕是很正常的回归，可能就已经可以给众多投资者带来不一样的体验。

对于风险，最终可能在大家认为最没有风险的地方（应该也是最为拥挤的交易）爆发一些风险波动，形成最终出清，但彼时，权益资产的波动可能是由此的“次生灾害”，而非风险的主战场。

#### 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公募证券投资基金业务估值管理办法、股票池管理办法、信息技术管理制度、员工管理办法、销售机构合作准入指引、员工证券投资行为管理办法、固定收益研究工作管理办法、风险管理基本制度等，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；公司通过开展新规宣导及员工培训工作，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、债券投资管理、信息披露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历。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 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 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰紫金泰盈混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

毕马威华振审字第 2400497 号

华泰紫金泰盈混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了后附的华泰紫金泰盈混合型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产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、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及在财务报表附注 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，公允反映了该基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 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，我们独立于该基金，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

该基金管理人华泰证券(上海)资产管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2023 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 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照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，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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) 评价该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) 对该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，就可能导致对该基金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该基金不能持续经营。

(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。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师  
张楠 倪益

中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2024 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰紫金泰盈混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：		-	-
货币资金	7.4.7.1	32,860,549.79	32,204,041.44
结算备付金		888,310.67	488,899.94
存出保证金		108,017.77	106,407.69
交易性金融资产	7.4.7.2	330,414,024.40	336,982,436.26
其中：股票投资		330,414,024.40	336,982,436.26
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		3,572,226.57	-
应收股利		171,334.28	9,458.91
应收申购款		60,426.45	72,665.63

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	99,165.80	219,842.46
<b>资产总计</b>		<b>368,174,055.73</b>	<b>370,083,752.33</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 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		-	-
应付清算款		4,339,149.67	7.99
应付赎回款		316,137.89	681,150.57
应付管理人报酬		295,169.37	320,150.54
应付托管费		59,033.90	64,030.08
应付销售服务费		52,331.06	55,730.76
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	469,849.38	427,371.32
<b>负债合计</b>		<b>5,531,671.27</b>	<b>1,548,441.26</b>
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.8	311,507,012.49	294,558,537.54
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	51,135,371.97	73,976,773.53
<b>净资产合计</b>		<b>362,642,384.46</b>	<b>368,535,311.07</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>368,174,055.73</b>	<b>370,083,752.33</b>

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 311,507,012.49 份，其中 A 类基金份额净值 1.1724 元，基金份额总额 34,240,022.10 份；C 类基金份额净值 1.1631 元，基金份额总额 277,266,990.39

份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰紫金泰盈混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-15,403,837.86	-108,091,016.07
1.利息收入		146,418.86	214,586.78
其中：存款利息收入	7.4.7.10	145,835.01	214,586.78
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		583.85	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-18,943,992.99	-86,910,272.86
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-22,233,660.65	-94,837,721.77
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
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	3,289,667.66	7,927,448.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	3,354,181.28	-21,490,617.94
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	39,554.99	95,287.95
<b>减：二、营业总支出</b>		4,961,336.25	6,084,816.02
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,487,745.11	4,278,742.99

其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	697,549.04	855,748.54
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	605,369.91	744,149.90
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.21	-	-
7. 税金及附加		1.76	-
8. 其他费用	7.4.7.22	170,670.43	206,174.59
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-20,365,174.11</b>	<b>-114,175,832.09</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-20,365,174.11</b>	<b>-114,175,832.09</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-20,365,174.11</b>	<b>-114,175,832.09</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华泰紫金泰盈混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	294,558,537.54	73,976,773.53	368,535,311.07
二、本期期初净资产	294,558,537.54	73,976,773.53	368,535,311.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	16,948,474.95	-22,841,401.56	-5,892,926.61



(一)、综合收益总额	-	-20,365,174.11	-20,365,174.11
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	16,948,474.95	-2,476,227.45	14,472,247.50
其中: 1.基金申购款	77,335,686.19	14,867,126.56	92,202,812.75
2.基金赎回款	-60,387,211.24	-17,343,354.01	-77,730,565.25
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	311,507,012.49	51,135,371.97	362,642,384.46
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	355,324,497.83	206,751,216.59	562,075,714.42
二、本期期初净资产	355,324,497.83	206,751,216.59	562,075,714.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-60,765,960.29	-132,774,443.06	-193,540,403.35
(一)、综合收益总额	-	-114,175,832.09	-114,175,832.09
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-60,765,960.29	-18,598,610.97	-79,364,571.26

其中：1.基金申购款	56,305,721.76	18,147,197.50	74,452,919.26
2.基金赎回款	-117,071,682.05	-36,745,808.47	-153,817,490.52
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	294,558,537.54	73,976,773.53	368,535,311.07

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: 江晓阳, 主管会计工作负责人: 白海燕, 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

华泰紫金泰盈混合型证券投资基金(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”)《关于准予华泰紫金泰盈混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2019]2137 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《华泰紫金泰盈混合型证券投资基金基金合同》发售, 基金合同于 2020 年 1 月 21 日生效。本基金为契约型开放式证券投资基金, 存续期限不定, 首次设立募集规模为 1,077,156,763.91 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰资管, 基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金泰盈混合型证券投资基金基金合同》和《华泰紫金泰盈混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或准予注册上市的股票)、港股通股票、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券)、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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沪深 300 指数收益率×55%+恒生指数收益率×15%+中债综合指数收益率×30%。

#### 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和《资产管理产品相关会计处理规定》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的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况、自 2023 年 1 月 1 日至 2023 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

###### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券、买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征,在初始确认时将金融资产分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式,在此情形下,所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类,否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,

分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b)金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无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

##### (a)金融工具的初始确认

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。

(b)后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c)金融工具的终止确认

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：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（（或该部分金融负债））。

(d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量：

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报：

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销：

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 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，参考类似金融工具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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

#### 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

利息收入：

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益：

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证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初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益：

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。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 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（如有）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。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### 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，投资者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；若投资者不选择，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基金份额收益分配金额后不能低于面值。同一类别内每一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。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所、北京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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、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》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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。

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生

的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，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。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。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，其股息红利所得暂减按 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。

(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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
活期存款	32,860,549.79	32,204,041.44
等于：本金	32,857,868.23	32,200,461.68
加：应计利息	2,681.56	3,579.76
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	32,860,549.79	32,204,041.44

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	336,705,175.54	-	330,414,024.40	-6,291,151.14
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		336,705,175.54	-	330,414,024.40	-6,291,151.14
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		346,627,768.68	-	336,982,436.26	-9,645,332.42
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		346,627,768.68	-	336,982,436.26	-9,645,332.42

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 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 债权投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	99,165.80	219,842.46
待摊费用	-	-
合计	99,165.80	219,842.46

#### 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.05	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	217,349.33	147,371.32
其中：交易所市场	217,349.33	147,371.32
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	252,500.00	280,000.00
合计	469,849.38	427,371.32

#### 7.4.7.8 实收基金

华泰紫金泰盈混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日

	基金份额	账面金额
上年度末	38,071,173.65	38,071,173.65
本期申购	3,076,613.33	3,076,613.33
本期赎回（以“-”号填列）	-6,907,764.88	-6,907,764.88
本期末	34,240,022.10	34,240,022.10

华泰紫金泰盈混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	256,487,363.89	256,487,363.89
本期申购	74,259,072.86	74,259,072.86
本期赎回（以“-”号填列）	-53,479,446.36	-53,479,446.36
本期末	277,266,990.39	277,266,990.39

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.9 未分配利润

华泰紫金泰盈混合 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	15,591,396.39	-5,784,258.14	9,807,138.25
本期利润	-3,001,599.55	271,675.94	-2,729,923.61
本期基金份额交易产生的变动数	-1,528,624.48	353,565.95	-1,175,058.53
其中：基金申购款	1,212,153.49	-350,873.67	861,279.82
基金赎回款	-2,740,777.97	704,439.62	-2,036,338.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,061,172.36	-5,159,016.25	5,902,156.11

华泰紫金泰盈混合 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	102,917,512.93	-38,747,877.65	64,169,635.28
本期利润	-20,717,755.84	3,082,505.34	-17,635,250.50
本期基金份额交易产生的变动数	4,556,252.70	-5,857,421.62	-1,301,168.92
其中：基金申购款	25,787,149.82	-11,781,303.08	14,005,846.74
基金赎回款	-21,230,897.12	5,923,881.46	-15,307,015.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	86,756,009.79	-41,522,793.93	45,233,215.86

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	126,789.88	181,435.53
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	17,005.23	28,006.26
其他	2,039.90	5,144.99
合计	145,835.01	214,586.78

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-22,233,660.65	-94,837,721.77
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-



合计	-22,233,660.65	-94,837,721.77
----	----------------	----------------

#### 7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	716,201,628.18	1,027,013,901.96
减：卖出股票成本总额	736,760,991.01	1,119,385,999.03
减：交易费用	1,674,297.82	2,465,624.70
买卖股票差价收入	-22,233,660.65	-94,837,721.77

#### 7.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告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

本基金本报告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

本基金本报告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

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,289,667.66	7,927,448.91
证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,289,667.66	7,927,448.91

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	3,354,181.28	-21,490,617.94
——股票投资	3,354,181.28	-21,490,617.94
——债券投资	-	-
——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	3,354,181.28	-21,490,617.94

**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
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	39,554.99	95,287.95
合计	39,554.99	95,287.95

**7.4.7.20 持有基金产生的费用**

本基金本报告期及上年度可比期间均无持有基金产生的费用。

**7.4.7.21 信用减值损失**

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

**7.4.7.22 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	32,500.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
银行手续费	15,810.03	21,163.49
证券组合费	2,360.40	5,011.10
交易费用	-	-
合计	170,670.43	206,174.59

#### 7.4.7.23 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
中国银行股份有限公司	基金托管人
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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	223,046,813.45	15.51%	397,818,198.31	19.74%

#### 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的交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方的交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	120,676.66	15.43%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	97,018.69	10.37%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用华泰证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从华泰证券获得证券研究综合服务。

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
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,487,745.11	4,278,742.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,647,535.62	2,052,569.88
应支付基金管理人的净管理费	1,840,209.49	2,226,173.11

注：本基金的基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 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×1.00%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	697,549.04	855,748.54

注：本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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×0.2%/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		
	2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰紫金泰盈混合 A	华泰紫金泰盈混合 C	合计
华泰证券股份有限公司	-	545,577.50	545,577.50
合计	-	545,577.50	545,577.50
获得销售服务费的各	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年12月31日		

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰紫金泰盈混合A	华泰紫金泰盈混合C	合计
华泰证券股份有限公司	-	688,592.96	688,592.96
合计	-	688,592.96	688,592.96

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 0.2% 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×0.2%/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

本期及上年度可比期间，本基金未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

本期及上年度可比期间，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

本期及上年度可比期间，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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	华泰紫金泰盈混合A	华泰紫金泰盈混合C	华泰紫金泰盈混合A	华泰紫金泰盈混合C
期初持有的基金份额	10,488,909.65	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	11,988,909.65	-
期间因拆分变	-	-	-	-

动份额				
减：期间赎回/ 卖出总份额	1,500,000.00	-	1,500,000.00	-
期末持有的基 金份额	8,988,909.65	-	10,488,909.65	-
期末持有的基 金份额占基金 总份额比例	26.25%	-	27.55%	-

注：1、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；  
2、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。

#### 7.4.10.5.2 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

本基金本报告期末及上年度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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022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
中国银行股份有限公司	32,860,549.79	126,789.88	32,204,041.44	181,435.53

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 2023 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 545,688.11 元。(2022 年 12 月 31 日：人民币 488,610.54 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

本期及上年度可比期间，本基金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

本基金本报告期末进行利润分配。

### 7.4.12 期末（2023 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688610	埃科光电	2023-07-10	6 个月	新股锁定	73.33	51.00	252.00	18,479.16	12,852.00	-
688627	精智达	2023-07-11	6 个月	新股锁定	46.77	87.72	209.00	9,774.93	18,333.48	-
688563	航材股份	2023-07-12	6 个月	新股锁定	78.99	60.49	261.00	20,616.39	15,787.89	-
301505	苏州规划	2023-07-12	6 个月	新股锁定	26.35	35.81	194.00	5,111.90	6,947.14	-
301499	维科精密	2023-07-13	6 个月	新股锁定	19.50	28.93	371.00	7,234.50	10,733.03	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6 个月	新股锁定	31.16	28.27	230.00	7,166.80	6,502.10	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6 个月	新股锁定	8.66	11.06	805.00	6,971.30	8,903.30	-
688450	光格科技	2023-07-17	6 个月	新股锁定	53.09	36.42	164.00	8,706.76	5,972.88	-
301172	君逸数码	2023-07-19	6 个月	新股锁定	31.33	38.16	438.00	13,722.54	16,714.08	-
688651	盛邦安全	2023-07-19	6 个月	新股锁定	39.90	46.05	178.00	7,102.20	8,196.90	-
688612	威迈斯	2023-07-19	6 个月	新股锁定	47.29	37.97	194.00	9,174.26	7,366.18	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6 个月	新股锁定	15.32	23.87	193.00	2,956.76	4,606.91	-
688646	逸飞激光	2023-07-21	6 个月	新股锁定	46.80	36.07	219.00	10,249.20	7,899.33	-
301509	金凯生科	2023-07-26	6 个月	新股锁定	56.56	62.23	183.00	10,350.48	11,388.09	-
30136	民爆	2023-0	6 个月	新股	51.05	38.52	315.00	16,080	12,133	-



2	光电	7-27		锁定				.75	.80	
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6 个月	新股锁定	18.08	44.57	613.00	11,083.04	27,321.41	-
300904	威力传动	2023-08-02	6 个月	新股锁定	35.41	61.53	304.00	10,764.64	18,705.12	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6 个月	新股锁定	36.12	34.30	226.00	8,163.12	7,751.80	-
301510	固高科技	2023-08-04	6 个月	新股锁定	12.00	35.01	396.00	4,752.00	13,863.96	-
301533	威马农机	2023-08-07	6 个月	新股锁定	29.50	33.16	225.00	6,637.50	7,461.00	-
688592	司南导航	2023-08-07	6 个月	新股锁定	50.50	50.53	216.00	10,908.00	10,914.48	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6 个月	新股锁定	9.87	12.75	1,341.00	13,235.67	17,097.75	-
301511	德福科技	2023-08-08	6 个月	新股锁定	28.00	22.67	402.00	11,256.00	9,113.34	-
688573	信宇人	2023-08-09	6 个月	新股锁定	23.68	28.80	285.00	6,748.80	8,208.00	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6 个月	新股锁定	39.99	38.81	306.00	12,236.94	11,875.86	-
301469	恒达新材	2023-08-10	6 个月	新股锁定	36.58	33.09	275.00	10,059.50	9,099.75	-
603275	众辰科技	2023-08-16	6 个月	新股锁定	49.97	39.70	92.00	4,597.24	3,652.40	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6 个月	新股锁定	71.80	68.91	138.00	9,908.40	9,509.58	-
688591	泰凌微	2023-08-18	6 个月	新股锁定	24.98	28.02	481.00	12,015.38	13,477.62	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6 个月	新股锁定	99.57	81.46	96.00	9,558.72	7,820.16	-
603270	金帝股份	2023-08-25	6 个月	新股锁定	21.77	29.58	174.00	3,787.98	5,146.92	-
688549	中巨芯	2023-08-30	6 个月	新股锁定	5.18	8.09	1,962.00	10,163.16	15,872.58	-
301251	威尔高	2023-08-30	6 个月	新股锁定	28.88	34.59	318.00	9,183.84	10,999.62	-
301529	福赛科技	2023-08-31	6 个月	新股锁定	36.60	37.88	182.00	6,661.20	6,894.16	-
603075	热威股份	2023-09-01	6 个月	新股锁定	23.10	23.31	138.00	3,187.80	3,216.78	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6 个月	新股锁定	37.56	43.57	208.00	7,812.48	9,062.56	-
68870	盛科	2023-0	6 个月	新股	42.66	48.18	223.00	9,513.	10,744	-

2	通信	9-06		锁定				18	.14	
301548	崇德科技	2023-09-11	6 个月	新股锁定	66.80	58.99	113.00	7,548.40	6,665.87	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6 个月	新股锁定	23.97	20.89	370.00	8,868.90	7,729.30	-
688716	中研股份	2023-09-13	6 个月	新股锁定	29.66	36.39	249.00	7,385.34	9,061.11	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6 个月	新股锁定	67.88	52.74	134.00	9,095.92	7,067.16	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6 个月	新股锁定	25.73	24.88	134.00	3,447.82	3,333.92	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6 个月	新股锁定	69.98	60.10	143.00	10,007.14	8,594.30	-
301558	三态股份	2023-09-21	6 个月	新股锁定	7.33	13.40	1,235.00	9,052.55	16,549.00	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6 个月	新股锁定	103.40	78.23	86.00	8,892.40	6,727.78	-
301559	中集环科	2023-09-26	6 个月	新股锁定	24.22	18.24	398.00	9,639.56	7,259.52	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6 个月	新股锁定	26.87	43.69	185.00	4,970.95	8,082.65	-
603193	润本股份	2023-10-09	6 个月	新股锁定	17.38	16.66	231.00	4,014.78	3,848.46	-
301489	思泉新材	2023-10-16	6 个月	新股锁定	41.66	64.11	128.00	5,332.48	8,206.08	-
001378	德冠新材	2023-10-23	6 个月	新股锁定	31.68	31.27	205.00	6,494.40	6,410.35	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6 个月	新股锁定	22.88	32.44	224.00	5,125.12	7,266.56	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6 个月	新股锁定	14.23	18.19	217.00	3,087.91	3,947.23	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6 个月	新股锁定	58.08	57.81	66.00	3,833.28	3,815.46	-
001326	联域股份	2023-11-01	6 个月	新股锁定	41.18	48.64	99.00	4,076.82	4,815.36	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6 个月	新股锁定	15.18	21.43	303.00	4,599.54	6,493.29	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6 个月	新股锁定	53.63	75.36	64.00	3,432.32	4,823.04	-
688653	康希通信	2023-11-10	6 个月	新股锁定	10.50	15.99	648.00	6,804.00	10,361.52	-
301568	思泰克	2023-11-21	6 个月	新股锁定	23.23	35.58	246.00	5,714.58	8,752.68	-
68865	京仪	2023-1	6 个月	新股	31.95	52.25	262.00	8,370.	13,689	-

2	装备	1-22		锁定				90	.50	
301508	中机认检	2023-1-23	6 个月	新股锁定	16.82	26.68	419.00	7,047.58	11,178.92	-
601083	锦江航运	2023-1-28	6 个月	新股锁定	11.25	11.07	518.00	5,827.50	5,734.26	-
301516	中远通	2023-1-2-01	6 个月	新股锁定	6.87	15.51	604.00	4,149.48	9,368.04	-
001239	永达股份	2023-1-2-04	6 个月	新股锁定	12.05	19.92	189.00	2,277.45	3,764.88	-
301459	丰茂股份	2023-1-2-06	6 个月	新股锁定	31.90	39.84	208.00	6,635.20	8,286.72	-
603373	安邦护卫	2023-1-2-13	6 个月	新股锁定	19.10	34.75	88.00	1,680.80	3,058.00	-
001358	兴欣新材	2023-1-2-14	6 个月	新股锁定	41.00	44.16	87.00	3,567.00	3,841.92	-
301526	国际复材	2023-1-2-19	6 个月	新股锁定	2.66	4.45	6,003.00	15,967.98	26,713.35	-
603004	鼎龙科技	2023-1-2-20	6 个月	新股锁定	16.80	31.19	195.00	3,276.00	6,082.05	-
301578	辰奕智能	2023-1-2-21	6 个月	新股锁定	48.94	68.32	118.00	5,774.92	8,061.76	-

#### 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 2023 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 2023 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

#### 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，公司管理层及合规和风险管理委员会，风险管理部、合规稽核部及各类专业风险管理部门、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，下设合规与风险控制委员会。董事会承担公司全面风险管理的最终责任，主要负责审议批准公司全面风险管理的总体目标、基本政策和基本制度、公司年度风险管理报告、公司风险管理机构设置及其职责，监督和评估公司风险控制制度的执行情况，对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估审议等。

公司监事承担全面风险管理的监督责任，负责对董事和高级管理人员在风险管理方面的履职尽责情况进行监督。

公司管理层对全面风险管理承担主要责任，负责制定并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，明确全面风险管理职能部门、业务部门以及其他部门在风险管理中的职责分工，建立部门之间有效制衡、相互协调的运行机制，制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等基本政策的具体执行方案，确保其有效落实，定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系，建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制等。

公司管理层下设合规和风险管理委员会，负责批准适合各项业务发展的风险及合规管理政策，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及合规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及合规稽核报告，指导风险管理及合规稽核部门工作，初步审议公司全面风险管理的基本制度，初步审议公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等。

公司设首席风险官，负责分管领导全面风险管理工作，包括推动公司全面风险管理体系建设，牵头领导公司风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，推进公司创新业务风险管理审

查和评估，培育公司良好的风险管理文化，负责风险管理政策和理念的宣导，推进实施先进的风险管理方法和工具，提高风险管理的有效性等。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，分解落实全面风险管理的各项要求，牵头管理公司的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和投资合规性风险，构建专业风险管理体系，并制定相应的风险管理政策，分解管理和执行责任，监测、计量、评估、报告公司整体风险水平和风险资本运用，对重点风险领域和重点业务环节进行风险监控、评估和审查，对所识别的重要风险进行预警、提示，牵头应对和处置公司层面重大风险事件，负责对新业务和重大风险业务或项目组织进行独立风险审核及评估，统筹管理公司风险管理培训，促进公司形成良好的风险文化等。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### **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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本期末及上年度末，本基金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**

本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金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

本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持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，其余均能及时变现。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资产的公允价值。

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，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，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。

#### 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%。

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。基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	32,860,549.79	-	-	-	32,860,549.79
结算备付金	888,310.67	-	-	-	888,310.67
存出保证金	108,017.77	-	-	-	108,017.77
交易性金融资产	-	-	-	330,414,024.40	330,414,024.40
应收股利	-	-	-	171,334.28	171,334.28
应收申购款	-	-	-	60,426.45	60,426.45
应收证券清算款	-	-	-	3,572,226.57	3,572,226.57
其他资产	-	-	-	99,165.80	99,165.80
资产总计	33,856,878.23	-	-	334,317,177.50	368,174,055.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	316,137.89	316,137.89
应付管理人报酬	-	-	-	295,169.37	295,169.37
应付托管费	-	-	-	59,033.90	59,033.90
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	52,331.06	52,331.06

应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	4,339,149.67	4,339,149.67
其他负债	-	-	-	469,849.38	469,849.38
负债总计	-	-	-	5,531,671.27	5,531,671.27
利率敏感度缺口	33,856,878.23	-	-	328,785,506.23	362,642,384.46
<b>上年度末</b>					
<b>2022 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					
货币资金	32,204,041.44	-	-	-	32,204,041.44
结算备付金	488,899.94	-	-	-	488,899.94
存出保证金	106,407.69	-	-	-	106,407.69
交易性金融资产	-	-	-	336,982,436.26	336,982,436.26
应收股利	-	-	-	9,458.91	9,458.91
应收申购款	-	-	-	72,665.63	72,665.63
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	219,842.46	219,842.46
资产总计	32,799,349.07	-	-	337,284,403.26	370,083,752.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	681,150.57	681,150.57
应付管理人报酬	-	-	-	320,150.54	320,150.54
应付托管费	-	-	-	64,030.08	64,030.08
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	55,730.76	55,730.76
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	7.99	7.99
其他负债	-	-	-	427,371.32	427,371.32
负债总计	-	-	-	1,548,441.26	1,548,441.26
利率敏感度缺口	32,799,349.07	-	-	335,735,962.00	368,535,311.07



注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；3.该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；4.银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产的利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响。		
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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1 市场利率下降 25BP	-	-
	2 市场利率上升 25BP	-	-

注：本基金本报告期末计息资产仅包含银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

#### 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。本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖证券，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也加大基金净值波动的幅度。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			

交易性金融资产	-	52,656,556.51	52,656,556.51
应收股利	-	171,334.28	171,334.28
<b>资产合计</b>	<b>-</b>	<b>52,827,890.79</b>	<b>52,827,890.79</b>
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	52,827,890.79	52,827,890.79
项目	上年度末 2022年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	36,570,393.40	36,570,393.40
应收股利	-	9,458.91	9,458.91
<b>资产合计</b>	<b>-</b>	<b>36,579,852.31</b>	<b>36,579,852.31</b>
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	36,579,852.31	36,579,852.31

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日

	港币相对人民币升值 5%	2,641,394.54	1,828,992.62
	港币相对人民币贬值 5%	-2,641,394.54	-1,828,992.62

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

基金承受的其他市场价格风险，主要是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。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

##### 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 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	330,414,024.40	91.11	336,982,436.26	91.44
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	330,414,024.40	91.11	336,982,436.26	91.44

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

	业绩比较基准上升 5%	31,816,918.14	13,624,620.94
	业绩比较基准下降 5%	-31,816,918.14	-13,624,620.94

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	329,772,288.26	336,982,436.26
第二层次	-	-
第三层次	641,736.14	-
合计	330,414,024.40	336,982,436.26

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、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；并根据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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

本基金持有的金融工具无公允价值所属层次间的重大变动。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	541,931.54	541,931.54
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	99,804.60	99,804.60
其中：计入损益的利得或损失	-	99,804.60	99,804.60
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	641,736.14	641,736.14
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	99,804.60	99,804.60
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-

转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	641,736.14	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1962-2.1752	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §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	330,414,024.40	89.74
	其中：股票	330,414,024.40	89.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	33,748,860.46	9.17
8	其他各项资产	4,011,170.87	1.09
9	合计	368,174,055.73	100.00

注：1、本基金报告期末通过港股通交易机制持有的港股期末公允价值为 52,656,556.51 元人民币，占期末基金资产净值比例 14.52%。

2、本基金报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,014,006.00	1.11
B	采矿业	-	-
C	制造业	228,684,175.38	63.06

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,145,136.00	1.97
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,549.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	9,314,514.26	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,845,905.03	5.47
J	金融业	8,708,931.00	2.40
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	25,193.22	0.01
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	277,757,467.89	76.59

## 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	3,589,682.42	0.99
B 消费者非必需品	24,312,332.96	6.70
C 消费者常用品	-	-
D 能源	7,347,341.77	2.03
E 金融	-	-
F 医疗保健	3,746,530.97	1.03
G 工业	10,367,120.55	2.86
H 信息科技	3,293,547.84	0.91
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	52,656,556.51	14.52

注：以上分类采用财汇资讯提供的国际通用行业分类标准。



## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	603816	顾家家居	411,000.00	14,385,000.00	3.97
2	000683	远兴能源	2,384,200.00	13,995,254.00	3.86
3	688377	迪威尔	517,165.00	13,870,365.30	3.82
4	002028	思源电气	221,400.00	11,521,656.00	3.18
5	002749	国光股份	949,100.00	11,370,218.00	3.14
6	01999	敏华控股	2,271,600.00	11,013,346.03	3.04
7	600406	国电南瑞	491,534.00	10,971,038.88	3.03
8	002884	凌霄泵业	596,300.00	10,351,768.00	2.85
9	688019	安集科技	59,800.00	9,553,648.00	2.63
10	601799	星宇股份	72,600.00	9,518,586.00	2.62
11	00576	浙江沪杭甬	1,962,000.00	9,263,398.96	2.55
12	600989	宝丰能源	621,800.00	9,183,986.00	2.53
13	000596	古井贡酒	39,200.00	9,125,760.00	2.52
14	601021	春秋航空	176,900.00	8,880,380.00	2.45
15	601128	常熟银行	1,362,900.00	8,708,931.00	2.40
16	600761	安徽合力	424,340.00	7,727,231.40	2.13
17	600519	贵州茅台	4,400.00	7,594,400.00	2.09
18	02883	中海油田服务	1,016,000.00	7,347,341.77	2.03
19	688357	建龙微纳	140,893.00	7,282,759.17	2.01
20	600887	伊利股份	271,200.00	7,254,600.00	2.00
21	600276	恒瑞医药	159,600.00	7,218,708.00	1.99
22	600803	新奥股份	424,800.00	7,145,136.00	1.97
23	688099	晶晨股份	99,275.00	6,217,593.25	1.71
24	603833	欧派家居	87,600.00	6,097,836.00	1.68
25	002475	立讯精密	169,000.00	5,822,050.00	1.61
26	603986	兆易创新	62,800.00	5,802,092.00	1.60
27	301061	匠心家居	111,400.00	5,542,150.00	1.53
28	002595	豪迈科技	182,700.00	5,438,979.00	1.50
29	00175	吉利汽车	670,000.00	5,215,567.97	1.44
30	600183	生益科技	283,200.00	5,185,392.00	1.43
31	601231	环旭电子	340,700.00	5,147,977.00	1.42
32	688036	传音控股	35,961.00	4,977,002.40	1.37
33	603556	海兴电力	166,370.00	4,829,721.10	1.33
34	001332	锡装股份	140,105.00	4,602,449.25	1.27
35	300498	温氏股份	200,100.00	4,014,006.00	1.11
36	02015	理想汽车-W	29,100.00	3,879,174.39	1.07
37	06600	赛生药业	297,000.00	3,746,530.97	1.03
38	01907	中国旭阳集团	1,204,000.00	3,589,682.42	0.99

39	000400	许继电气	157,400.00	3,456,504.00	0.95
40	09868	小鹏汽车-W	66,800.00	3,432,362.62	0.95
41	002508	老板电器	156,100.00	3,399,858.00	0.94
42	00981	中芯国际	183,000.00	3,293,547.84	0.91
43	300832	新产业	40,100.00	3,135,820.00	0.86
44	600312	平高电气	219,400.00	2,784,186.00	0.77
45	601966	玲珑轮胎	138,100.00	2,655,663.00	0.73
46	600131	国网信通	172,600.00	2,614,890.00	0.72
47	601179	中国西电	515,600.00	2,541,908.00	0.70
48	002705	新宝股份	169,900.00	2,475,443.00	0.68
49	000680	山推股份	280,100.00	1,383,694.00	0.38
50	03808	中国重汽	79,500.00	1,103,721.59	0.30
51	002959	小熊电器	19,700.00	1,023,021.00	0.28
52	688301	奕瑞科技	3,100.00	1,008,306.00	0.28
53	001215	千味央厨	16,500.00	871,365.00	0.24
54	03690	美团-W	10,400.00	771,881.95	0.21
55	603885	吉祥航空	35,700.00	428,400.00	0.12
56	301348	蓝箭电子	613.00	27,321.41	0.01
57	301526	国际复材	6,003.00	26,713.35	0.01
58	300904	威力传动	304.00	18,705.12	0.01
59	688627	精智达	209.00	18,333.48	0.01
60	688548	广钢气体	1,341.00	17,097.75	0.00
61	301172	君逸数码	438.00	16,714.08	0.00
62	301558	三态股份	1,235.00	16,549.00	0.00
63	688549	中巨芯	1,962.00	15,872.58	0.00
64	688563	航材股份	261.00	15,787.89	0.00
65	301510	固高科技	396.00	13,863.96	0.00
66	688652	京仪装备	262.00	13,689.50	0.00
67	688591	泰凌微	481.00	13,477.62	0.00
68	688610	埃科光电	252.00	12,852.00	0.00
69	301362	民爆光电	315.00	12,133.80	0.00
70	301498	乖宝宠物	306.00	11,875.86	0.00
71	301509	金凯生科	183.00	11,388.09	0.00
72	301508	中机认检	419.00	11,178.92	0.00
73	301251	威尔高	318.00	10,999.62	0.00
74	688592	司南导航	216.00	10,914.48	0.00
75	688702	盛科通信	223.00	10,744.14	0.00
76	301499	维科精密	371.00	10,733.03	0.00
77	688653	康希通信	648.00	10,361.52	0.00
78	301528	多浦乐	138.00	9,509.58	0.00
79	301516	中远通	604.00	9,368.04	0.00
80	301511	德福科技	402.00	9,113.34	0.00
81	301469	恒达新材	275.00	9,099.75	0.00
82	301550	斯菱股份	208.00	9,062.56	0.00

83	688716	中研股份	249.00	9,061.11	0.00
84	688602	康鹏科技	805.00	8,903.30	0.00
85	301568	思泰克	246.00	8,752.68	0.00
86	688719	爱科赛博	143.00	8,594.30	0.00
87	301459	丰茂股份	208.00	8,286.72	0.00
88	688573	信宇人	285.00	8,208.00	0.00
89	301489	思泉新材	128.00	8,206.08	0.00
90	688651	盛邦安全	178.00	8,196.90	0.00
91	301517	陕西华达	185.00	8,082.65	0.00
92	301578	辰奕智能	118.00	8,061.76	0.00
93	688646	逸飞激光	219.00	7,899.33	0.00
94	301525	儒竞科技	96.00	7,820.16	0.00
95	688671	碧兴物联	226.00	7,751.80	0.00
96	301500	飞南资源	370.00	7,729.30	0.00
97	301533	威马农机	225.00	7,461.00	0.00
98	688612	威迈斯	194.00	7,366.18	0.00
99	301555	惠柏新材	224.00	7,266.56	0.00
100	301559	中集环科	398.00	7,259.52	0.00
101	301520	万邦医药	134.00	7,067.16	0.00
102	301505	苏州规划	194.00	6,947.14	0.00
103	301529	福赛科技	182.00	6,894.16	0.00
104	688657	浩辰软件	86.00	6,727.78	0.00
105	301548	崇德科技	113.00	6,665.87	0.00
106	301515	港通医疗	230.00	6,502.10	0.00
107	688648	中邮科技	303.00	6,493.29	0.00
108	001378	德冠新材	205.00	6,410.35	0.00
109	603004	鼎龙科技	195.00	6,082.05	0.00
110	688450	光格科技	164.00	5,972.88	0.00
111	601083	锦江航运	518.00	5,734.26	0.00
112	603270	金帝股份	174.00	5,146.92	0.00
113	001306	夏厦精密	64.00	4,823.04	0.00
114	001326	联域股份	99.00	4,815.36	0.00
115	603119	浙江荣泰	193.00	4,606.91	0.00
116	603107	上海汽配	217.00	3,947.23	0.00
117	603193	润本股份	231.00	3,848.46	0.00
118	001358	兴欣新材	87.00	3,841.92	0.00
119	603062	麦加芯彩	66.00	3,815.46	0.00
120	001239	永达股份	189.00	3,764.88	0.00
121	603275	众辰科技	92.00	3,652.40	0.00
122	603276	恒兴新材	134.00	3,333.92	0.00
123	603075	热威股份	138.00	3,216.78	0.00
124	603373	安邦护卫	88.00	3,058.00	0.00

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000683	远兴能源	23,115,942.40	6.27
2	603816	顾家家居	19,434,041.00	5.27
3	688377	迪威尔	16,389,022.19	4.45
4	002841	视源股份	15,808,873.50	4.29
5	000596	古井贡酒	15,129,442.00	4.11
6	003022	联泓新科	15,006,100.52	4.07
7	002749	国光股份	13,802,214.42	3.75
8	603885	吉祥航空	13,789,660.00	3.74
9	300454	深信服	12,629,069.00	3.43
10	601128	常熟银行	12,269,746.00	3.33
11	601799	星宇股份	12,222,746.00	3.32
12	601021	春秋航空	11,978,185.00	3.25
13	603833	欧派家居	11,695,630.00	3.17
14	01999	敏华控股	11,415,399.99	3.10
15	002884	凌霄泵业	11,249,721.83	3.05
16	002821	凯莱英	11,166,334.00	3.03
17	688212	澳华内镜	10,899,194.08	2.96
18	688099	晶晨股份	10,562,113.17	2.87
19	688357	建龙微纳	10,181,864.59	2.76
20	688019	安集科技	10,058,343.84	2.73
21	600031	三一重工	9,708,224.00	2.63
22	300911	亿田智能	9,447,915.00	2.56
23	600989	宝丰能源	9,133,496.00	2.48
24	00576	浙江沪杭甬	8,912,013.15	2.42
25	002493	荣盛石化	8,856,090.00	2.40
26	601231	环旭电子	8,469,917.00	2.30
27	600803	新奥股份	8,438,703.00	2.29
28	02883	中海油田服务	8,358,786.08	2.27
29	600276	恒瑞医药	8,265,290.80	2.24
30	002508	老板电器	8,077,909.00	2.19
31	03808	中国重汽	8,038,013.96	2.18
32	300347	泰格医药	7,984,712.00	2.17
33	600131	国网信通	7,893,286.00	2.14
34	600761	安徽合力	7,823,382.20	2.12
35	600887	伊利股份	7,790,491.00	2.11

36	03888	金山软件	7,714,572.55	2.09
37	688338	赛科希德	7,700,248.63	2.09
38	300750	宁德时代	7,686,910.00	2.09
39	688111	金山办公	7,538,910.38	2.05
40	300443	金雷股份	7,440,548.00	2.02
41	001332	锡装股份	7,422,701.25	2.01
42	603986	兆易创新	7,393,115.00	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	003022	联泓新科	36,118,362.00	9.80
2	688111	金山办公	28,996,153.30	7.87
3	300454	深信服	27,846,016.50	7.56
4	300026	红日药业	26,191,020.93	7.11
5	300294	博雅生物	24,339,134.00	6.60
6	300415	伊之密	21,570,484.11	5.85
7	300760	迈瑞医疗	19,325,997.80	5.24
8	000537	中绿电	17,698,912.20	4.80
9	002271	东方雨虹	15,940,766.00	4.33
10	300750	宁德时代	15,046,024.22	4.08
11	688212	澳华内镜	14,049,943.25	3.81
12	002841	视源股份	13,565,721.70	3.68
13	600406	国电南瑞	13,427,170.36	3.64
14	03888	金山软件	12,680,037.38	3.44
15	00570	中国中药	11,777,328.77	3.20
16	688065	凯赛生物	11,246,906.53	3.05
17	605186	健麾信息	10,867,925.10	2.95
18	000858	五粮液	10,843,180.00	2.94
19	603885	吉祥航空	10,760,655.00	2.92
20	002028	思源电气	10,728,039.00	2.91
21	002180	纳思达	10,354,169.96	2.81
22	603876	鼎胜新材	9,935,101.00	2.70
23	002821	凯莱英	9,682,388.76	2.63
24	002493	荣盛石化	9,515,646.00	2.58
25	03808	中国重汽	9,503,930.81	2.58
26	688029	南微医学	9,237,109.18	2.51
27	600031	三一重工	9,075,736.00	2.46

28	600519	贵州茅台	8,898,762.00	2.41
29	06606	诺辉健康	8,807,668.28	2.39
30	688048	长光华芯	8,495,867.72	2.31
31	300911	亿田智能	8,245,671.77	2.24
32	02238	广汽集团	8,028,585.01	2.18
33	688338	赛科希德	7,742,834.95	2.10

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	726,838,397.87
卖出股票的收入（成交）总额	716,201,628.18

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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 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 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

本基金本报告期末投资基金。

### 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。

### 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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	108,017.77
2	应收清算款	3,572,226.57
3	应收股利	171,334.28
4	应收利息	-
5	应收申购款	60,426.45
6	其他应收款	99,165.80
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,011,170.87

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 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
华泰紫金泰盈混合 A	1,709	20,035.12	8,989,110.68	26.25%	25,250,911.42	73.75%
华泰紫金泰盈混合 C	14,931	18,569.89	61,286,633.50	22.10%	215,980,356.89	77.90%
合计	16,640	18,720.37	70,275,744.18	22.56%	241,231,268.31	77.44%

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	华泰紫金泰盈混合 A	640,860.06	1.87%
	华泰紫金泰盈混合 C	525,709.08	0.19%



	合计	1,166,569.14	0.37%
--	----	--------------	-------

**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	华泰紫金泰盈混合 A	10~50
	华泰紫金泰盈混合 C	10~50
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰紫金泰盈混合 A	0
	华泰紫金泰盈混合 C	0~10
	合计	0~10

**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**

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
查晓磊	公募基金	>100
	私募资产管理计划	50~100
	合计	>100

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	华泰紫金泰盈混合 A	华泰紫金泰盈混合 C
基金合同生效日（2020 年 1 月 21 日）基金份额总额	109,533,608.79	967,623,155.12
本报告期期初基金份额总额	38,071,173.65	256,487,363.89
本报告期基金总申购份额	3,076,613.33	74,259,072.86
减：本报告期基金总赎回份额	6,907,764.88	53,479,446.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	34,240,022.10	277,266,990.39

**§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

本报告期内，无涉及本基金基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

## 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，无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，无涉及本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 32,500.00 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

### 11.7.1 管理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。

### 11.7.2 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	
广发证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	1,000,551,969.64	69.60%	542,815.14	69.43%	-
华泰证券	4	223,046,813.45	15.51%	120,676.66	15.43%	-
长江证券	2	141,740,953.54	9.86%	78,596.44	10.05%	-
东吴证券	2	72,287,162.34	5.03%	39,777.24	5.09%	-

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交易单元的变更情况：新增 2 个天风证券交易单元。

### 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
广发证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	10,000,000.00	100.00%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

### 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	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-01-13
2	华泰紫金泰盈混合型证券投资基金 2022 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、规定报刊等	2023-01-17
3	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2022 年 4 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-01-17
4	关于华泰证券（上海）资产管理有限公司直销中心启用新版电子交易协议书的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-02-03
5	华泰证券（上海）资产管理有限公司传真及电子邮件交易协议书 V2023	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-02-03
6	华泰紫金泰盈混合型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、规定报刊等	2023-02-17
7	华泰紫金泰盈混合型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	2023-02-17

		站、规定报刊等	
8	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于调整旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-03-20
9	华泰紫金泰盈混合型证券投资基金 2022 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、规定报刊等	2023-03-31
10	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2022 年年度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-03-31
11	关于防范和识别不法分子假冒华泰证券（上海）资产管理有限公司名义从事非法证券活动的严正声明	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-04-19
12	华泰紫金泰盈混合型证券投资基金 2023 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站、规定报刊等	2023-04-22
13	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2023 年 1 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-04-22
14	华泰紫金泰盈混合型证券投资基金基金经理变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-06-21
15	华泰紫金泰盈混合型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、规定报刊等	2023-06-21
16	华泰紫金泰盈混合型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、规定报刊等	2023-06-21
17	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-07-17
18	华泰紫金泰盈混合型证券投资基金 2023 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、规定报刊等	2023-07-20
19	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2023 年 2 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-07-20
20	华泰紫金泰盈混合型证券投资基金 2023 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、规定报刊等	2023-08-30
21	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2023 年中期报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-08-30
22	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下	基金管理人网站、中国	2023-09-01

	部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	证监会基金电子披露网站、规定报刊等	
23	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-09-08
24	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下产品持有的债券恢复第三方估值的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-09-28
25	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-10-19
26	华泰紫金泰盈混合型证券投资基金 2023 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、规定报刊等	2023-10-25
27	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2023 年 3 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-10-25

## §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

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。

### 12.2 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《华泰紫金泰盈混合型证券投资基金基金经理变更的公告》，自 2023 年 6 月 19 日起新增查晓磊先生为本基金的基金经理，魏昊先生不再担任本基金的基金经理。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予华泰紫金泰盈混合型证券投资基金注册的文件；
- 2、《华泰紫金泰盈混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金泰盈混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金泰盈混合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泰盈混合型证券投资基金之法律意见书；

8、产品资料概要；

9、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人的住所。

### 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

二〇二四年三月二十八日