

**华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金**  
**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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 5 月 16 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	7
2.5 其他相关资料	7
<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	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
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	18
<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	20
<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	25
<b>§8 投资组合报告</b>	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	56

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.....	58
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
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.....	62
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.....	62
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.....	62
8.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	62
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
8.12	本报告期投资基金情况.....	62
8.13	投资组合报告附注.....	62
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>64</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
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.....	65
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.....	66
9.5	发起式基金发起资金持有份额情况.....	66
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>66</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>67</b>
11.1	基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
11.4	基金投资策略的改变.....	67
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	67
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
11.9	其他重大事件.....	68
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>69</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>69</b>
13.1	备查文件目录.....	69
13.2	存放地点.....	70
13.3	查阅方式.....	70

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金	
基金简称	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起	
基金主代码	017689	
交易代码	017689	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 5 月 16 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	
报告期末基金份额总额	137,238,836.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 A	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 C
下属分级基金的交易代码	017689	017692
报告期末下属分级基金的份额总额	36,497,393.44 份	100,741,442.61 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以追求绝对收益为目标，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以获取绝对收益为投资目的，采取稳健的投资策略，在控制投资风险的基础之上确定大类资产配置比例，力争使投资者获得较为合理的绝对收益。本基金的投资策略由大类资产配置策略、股票投资策略、债券和资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资业务的投资策略、存托凭证投资策略等部分组成。（一）大类资产配置策略（二）股票投资策略：1、A 股投资策略；2、港股投资策略（三）债券和资产支持证券投资策略：1、久期策

	略；2、期限结构策略；3、个券选择策略；4、相对价值判断策略；5、可转换、可交换公司债投资策略；6、信用债和资产支持证券投资策略（四）股指期货投资策略（五）国债期货投资策略（六）股票期权投资策略（七）参与融资业务的投资策略（八）存托凭证投资策略
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×10%+中证港股通综合指数（CNY）收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其风险收益水平理论上高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金可投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	白海燕	张姗
	联系电话	4008895597	400-61-95555
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008895597	400-61-95555
传真		021-28972120	0755-83195201
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区基隆路6号1222室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区东方路18号21楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		崔春	缪建民

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	华泰证券（上海）资产管理有限公司	中国(上海)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 5 月 16 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 A	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 C
本期已实现收益	26,069.55	-179,362.24
本期利润	-37,329.91	-355,140.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0010	-0.0035
本期加权平均净值利润率	-0.10%	-0.35%
本期基金份额净值增长率	-0.10%	-0.35%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	
	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 A	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 C
期末可供分配利润	-37,251.09	-355,066.59

期末可供分配基金份额利润	-0.0010	-0.0035
期末基金资产净值	36,460,142.35	100,386,376.02
期末基金份额净值	0.9990	0.9965
3.1.3 累计期末指标	<b>2023 年末</b>	
	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 A	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 C
基金份额累计净值增长率	-0.10%	-0.35%

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。

4、合同生效未满1年，无可比期间数据。

### 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. 华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 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	-0.17%	0.13%	-0.38%	0.13%	0.21%	0.00%
过去六个月	-0.10%	0.10%	-1.00%	0.13%	0.90%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-0.10%	0.09%	-1.28%	0.13%	1.18%	-0.04%

##### 2. 华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 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	-0.27%	0.13%	-0.38%	0.13%	0.11%	0.00%
过去六个月	-0.30%	0.10%	-1.00%	0.13%	0.70%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-0.35%	0.10%	-1.28%	0.13%	0.93%	-0.03%



效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

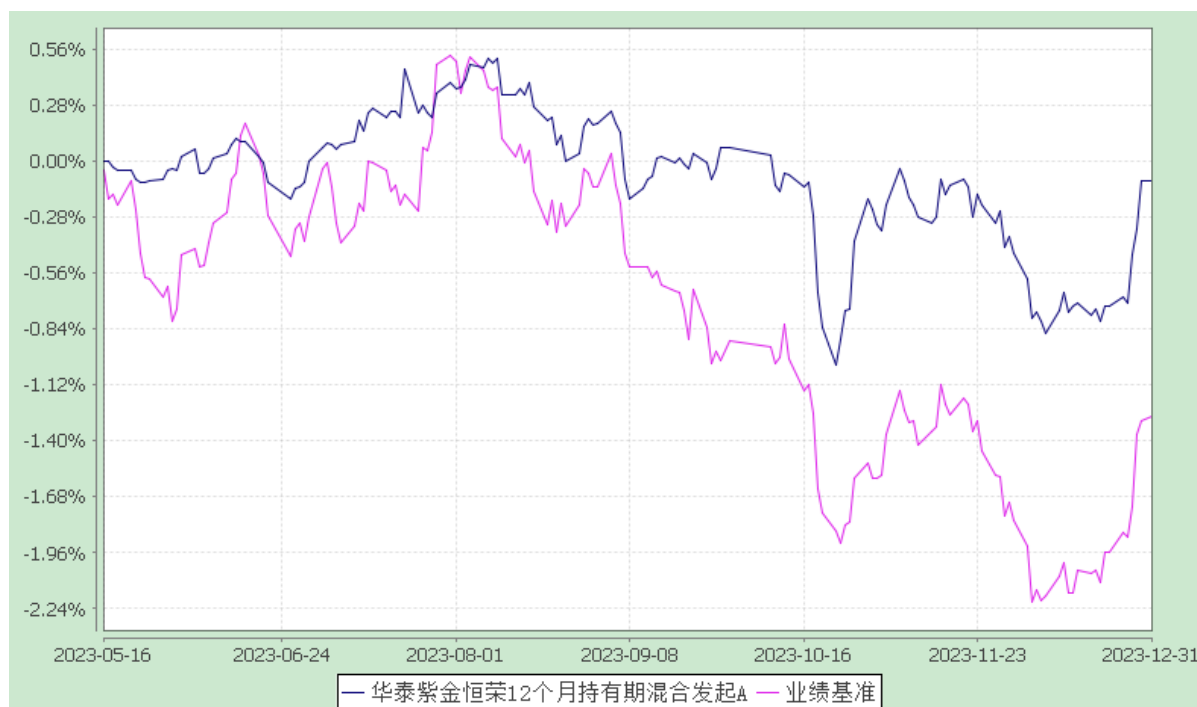
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金

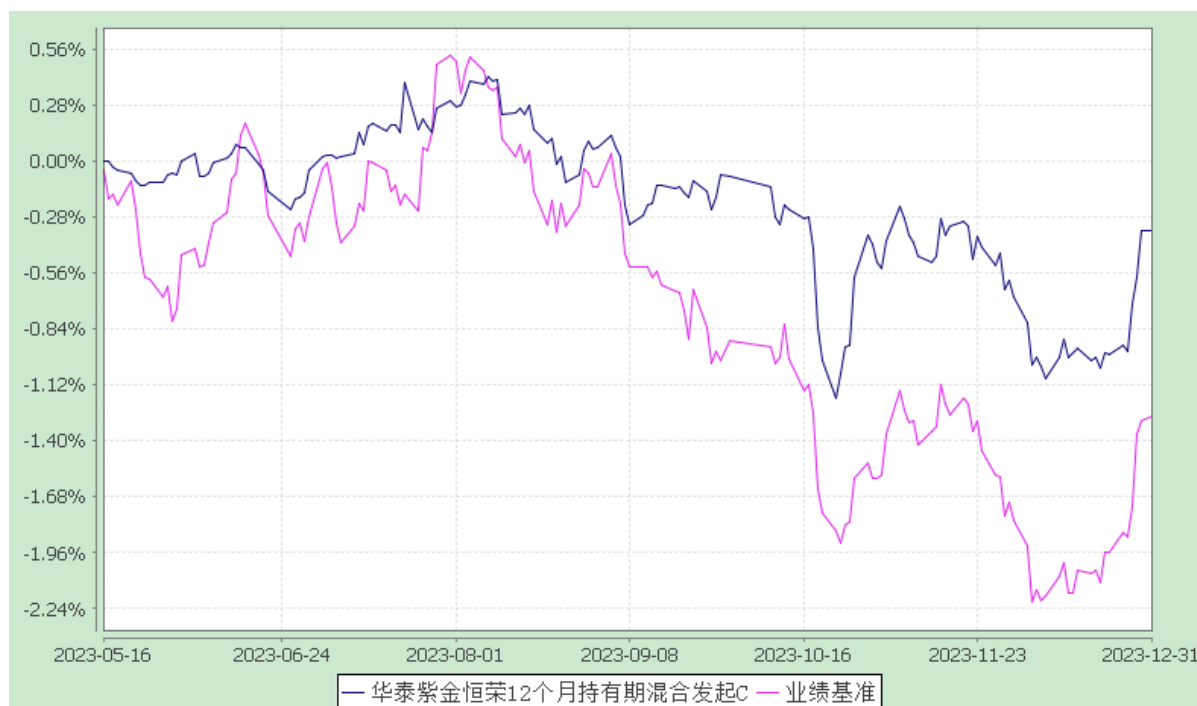
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2023 年 5 月 16 日至 2023 年 12 月 31 日)

#### 1、华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 A



#### 2、华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 C



注：1、本基金业绩比较基准收益率=中债综合（全价）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×10%+中证港股通综合指数（CNY）收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×5%；

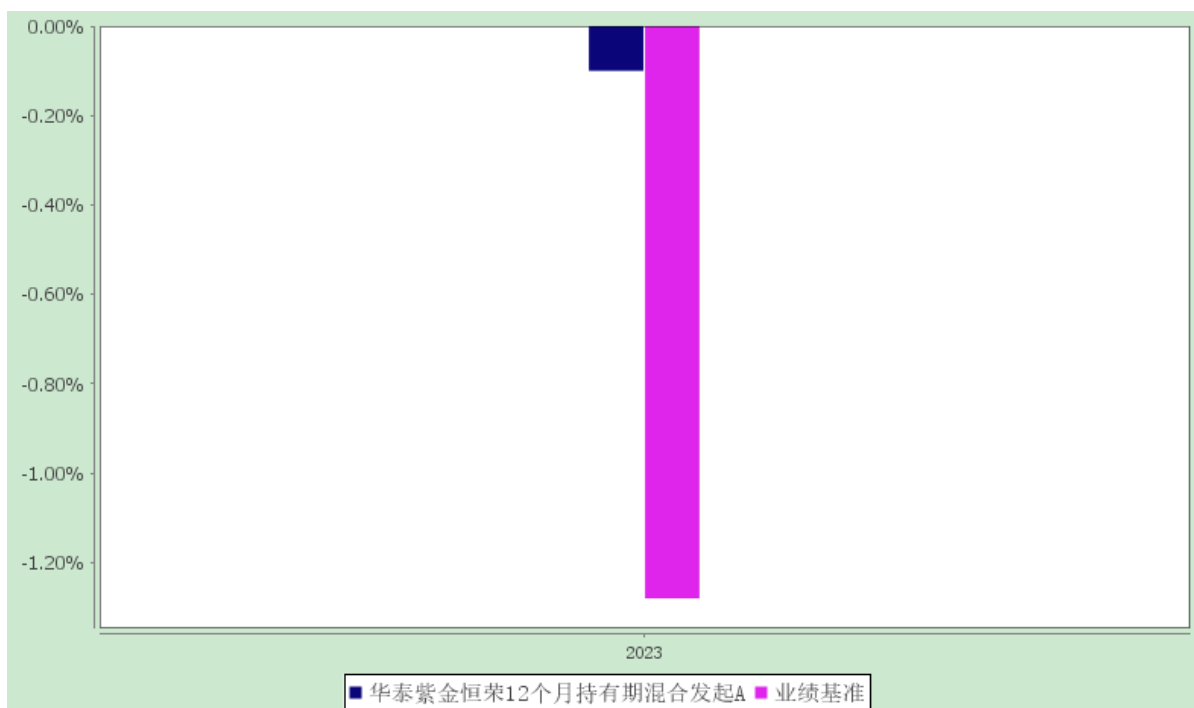
2、本基金合同于 2023 年 5 月 16 日生效，截止报告期末本基金运作未满一年；自基金成立起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 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

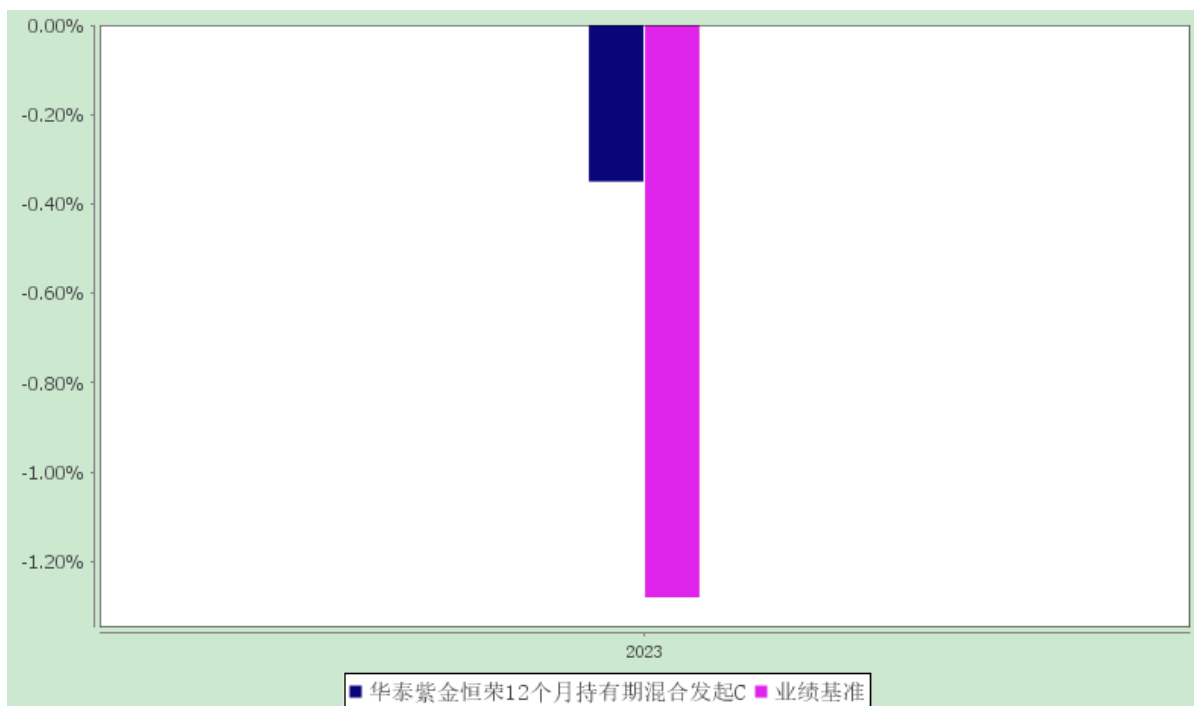
华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金

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、华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 A



2、华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 C



注：1、本基金业绩比较基准收益率=中债综合（全价）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×10%+中证港股通综合指数（CNY）收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×5%；

2、本基金合同于 2023 年 5 月 16 日生效，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		
王曦	本基金的基金经理,多资产公募投资部总经理	2023-06-14	-	15	2008 年至 2021 年曾任职于博时基金管理有限公司，历任研究助理、投资分析师、研究员、投资助理、基金经理。2021 年 12 月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司。
刘曼沁	本基金的基金经理	2023-05-16	-	9	2014 年至 2022 年曾任职于中银基金管理有限公司，历任固定收益研究员、大类资产配置研究员以及基金经理助理，2022 年 5 月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司。

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资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

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实守信、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

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国内经济方面，2023 年一季度国内经济重启，信贷、地产销售等数据快速回暖，经济修复斜率预期有所上调，但随着两会定调 GDP 增速 5% 左右，市场对政策支撑力度的博弈减弱，对于经济复苏的弹性和持续性出现分歧；二季度国内经济疫后复苏出现波折，前期积压需求释放后实体经济动能有所回落，修复斜率出现预期差，6 月后降息落地，政策博弈有所增强；三季度国内经济修复范围逐步扩大，7 月中央政治局会议后稳增长政策密集出台，房地产、地方政府化债、活跃资本市场等三大政策主线逐渐清晰，9 月制造业 PMI 升至 50.2% 重回扩张区间，制造业供需两端均有边际好转迹象，企业生产经营活动预期持续修复，但制造业企业出口订单及地产需求仍待企稳；四季度面临终端需求不足的问题，伴随海外经济的加速下行，经济复苏动能仍欠稳固。海外市场方面，主线仍然是高通胀与美联储政策，货币政策预期经历多轮反复，2023 年初紧缩预期抬升，一季度末硅谷银行、瑞信事件及美国债务上限问题压制风险偏好，二季度美国通胀与经济数据的韧性重新抬升紧缩预期，三季度美欧增长动能分化，美国经济基本面韧性超预期，四季度欧美央行均暗示加息终点，经济数据走弱，美国通胀下行幅度超预期，市场开始定价宽松预期。2023 年全年美联储加息 4 次合计 100bp，10 年期美债收益率一季度从 3.9% 大幅回落至 3.5% 附近，二三季度大幅上升至 4.6% 左右，四季度再度回落至 3.9% 左右。

股票市场方面，2023 年春节前国内外流动性预期共振向好，权益市场风险偏好明显回升，北向资金连续大幅净流入推动大盘股上涨；春节后至 3 月初，海外紧缩预期再度升温，非美地区需求好转的交易或也接近尾声，小盘股阶段性占优；3 月后硅谷银行暴雷及瑞信事件引发避险情绪蔓延，

后随着欧美央行出手，市场对于银行业的担忧短期内告一段落，全球风险偏好阶段性回升，A 股呈现了剧烈的分化，与 ChatGPT 相关的 TMT 板块迎来了较大幅度的上涨；4 月在宏观数据偏弱和政策目标温和稳健的背景下，市场主题行情演绎极致化，TMT 和“中特估”板块先后表现；随着一季报业绩表现普遍不佳以及 5 月后经济数据环比走弱，市场出现显著回调；7 月政治局会议给出积极的政策信号后市场一度较为乐观，金融地产等顺周期板块普遍走强，主题投资整体回调；8 月随着经济金融数据不及预期，叠加长端美债利率跳升导致北向资金从流入变为流出，市场出现显著下跌；9 月外资继续大规模流出，国内股票市场延续弱势，但基本面预期边际好转，上游能源与资源板块表现较好；10 月高频经济数据的边际走弱叠加流动性的边际收紧对权益市场形成共同打压，顺周期的金融地产链领跌，偏成长的电子、医药、汽车等板块则逆势上涨；11 月美元周期逆转与风险偏好提升驱动成长方向领涨，科技、医药、汽车板块表现居前；12 月美元周期逆转及海外映射交易阶段性兑现，而国内基本面依然偏弱叠加流动性偏紧，主要指数全月收跌。2023 年全年，上证指数下跌 3.70%，沪深 300 指数下跌 11.38%，恒生指数下跌 13.82%。

债券市场方面，2023 年一季度利率债长端品种出现小幅下跌，收益率曲线走势出现熊平，信用债总体上涨，信用利差显著压缩；二季度利率债与信用债均出现上涨，收益率曲线陡峭化下行，信用利差维持低位；三季度利率债与信用债均出现下跌，收益率曲线平坦化上行，信用利差低位震荡；四季度利率债与信用债均显著上涨，收益率曲线平坦化下行，信用利差维持低位。2023 年全年，10 年期国债收益率从 2.84% 下行 28bp 至 2.56%，10 年期国开债收益率从 2.99% 下行 31bp 至 2.68%。货币市场方面，一季度受信贷投放积极影响，超储率持续处于较低水位，银行间资金面多次出现时点性紧张；二季度在信贷投放放缓和降准降息的宽松货币政策背景下，资金面整体宽松；三季度政策取向整体偏松，降准降息落地，但汇率及政府债缴款等因素对资金面构成阶段性冲击；四季度资金面持续偏紧。2023 年全年，银行间 1 天回购加权平均利率均值在 1.83% 左右，较前一年均值上行 9bp，银行间 7 天回购利率均值在 2.14% 左右，较前一年均值下行 9bp。可转债方面，受到权益市场下跌的拖累，2023 年全年中证转债指数下跌 0.47%。

产品操作上，2023 年三季度本基金处于建仓期，股债性价比处于高位，在市场调整及组合安全垫持续累积过程中本基金逐步提高组合权益仓位，并维持行业均衡配置，配置仓以稳健分红类股票为主，并从金融、上游资源品板块向家电、纺织服装、机械等板块扩散；交易仓主要选择库存和产品价格处于低位的电子板块、出口受益的机械板块、以及景气度较高的汽车零部件板块；债券资产部分，债市波动加大，主要跟随资金面和地产政策两大脉络运行，组合久期先升后降，总体处于中低久期区间。四季度本基金调整行业配置，配置仓以稳健分红类股票为主，并从家电、纺织服装板块向公用事业、交通运输等板块扩散；交易仓主要选择处于库存低位且具有创新点的电子板块、产

能去化的农林牧渔板块、受益于海外流动性的港股等；债券资产部分，四季度债市先跌后涨，10 月中上旬虽然地产销售未见明显起色，但受债券供给放量以及资金面持续偏紧影响，收益率曲线平坦化上行；10 月下旬市场开始博弈货币端宽松，叠加高频数据显示经济动能再次走弱，债市情绪好转，组合纯债久期先降后升，10 月下旬市场情绪好转后积极提升债券仓位增配金融机构资本债。

#### 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-0.10%，同期业绩比较基准收益率为-1.28%；本基金 C 类份额净值增长率为-0.35%，同期业绩比较基准收益率为-1.28%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，全球经济预期下调但有望软着陆，国内以库存周期见底推动的经济修复仍具备中长期持续性，制造业投资韧性及出口回落速度有望好于预期均对经济有一定支撑，但工业部门产能过剩，内需不足的问题仍然存在，房地产链条有待企稳从而引导居民资产负债表摆脱负向循环。宏观政策有望进一步发力稳增长，流动性环境边际趋于宽松。权益方面，配置仓部分仍以高股息类股票为主，随着债券收益下降和市场对确定性收益的追逐，高股息个股波动放大，适当增加个股交易次数；交易仓部分，美联储降息延后，提高出口链投资比例，降低利率敏感强板块比例；中上游供需结构有改善可能，密切关注政策变化及各行业库存情况。债券方面，基本面存在物价增速放缓以及资产价格下行压力，货币政策依然处于宽松周期，实际利率有进一步下降空间，对债市有望形成利好，曲线预计总体保持平坦；转债估值水平处于历史较低分位，高到期收益率转债品种配置价值显著提升，转债供给端维持偏弱，需求端重点观察险资和养老基金入市情况；在做好组合流动性管理的基础上，本基金将保持适度杠杆和久期，合理分配各类资产，审慎精选高等级信用债和可转债品种，积极把握投资交易机会。

#### 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验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金合同生效未满三年，暂不适用。

### §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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §6 审计报告

毕马威华振审字第 2400821 号

华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式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恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金（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，自 2023 年 5 月 16 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表、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 日的财务状况以及自 2023 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间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

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：华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金

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
资产：		-
货币资金	7.4.7.1	881,827.51
结算备付金		4,086,723.81
存出保证金		11,981.27
交易性金融资产	7.4.7.2	152,250,710.64
其中：股票投资		21,026,842.29
基金投资		-
债券投资		131,223,868.35
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		-
应收股利		-
应收申购款		100.00
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>157,231,343.23</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>
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		19,397,732.20
应付清算款		693,164.73
应付赎回款		-
应付管理人报酬		92,489.10
应付托管费		23,122.24
应付销售服务费		33,925.16
应付投资顾问费		-
应交税费		3,844.71
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.7	140,546.72
<b>负债合计</b>		<b>20,384,824.86</b>
<b>净资产：</b>		<b>-</b>
实收基金	7.4.7.8	137,238,836.05
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.9	-392,317.68
<b>净资产合计</b>		<b>136,846,518.37</b>

负债和净资产总计		<b>157,231,343.23</b>
----------	--	-----------------------

注：1、报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 137,238,836.05 份，其中 A 类基金份额净值 0.9990 元，基金份额总额 36,497,393.44 份；C 类基金份额净值 0.9965 元，基金份额总额 100,741,442.61 份。

2、合同生效未满 1 年，无上年度末数据。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 5 月 16 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2023 年 5 月 16 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		892,208.48
1.利息收入		173,006.20
其中：存款利息收入	7.4.7.10	57,284.71
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		115,721.49
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		958,379.86
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-289,357.82
基金投资收益	7.4.7.12	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,915,481.61
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	-725,946.15
股利收益	7.4.7.17	58,202.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-239,177.58

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	-
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,284,678.75</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	687,374.01
其中：暂估管理人报酬（若有）		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	171,843.48
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	252,262.61
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		34,530.73
其中：卖出回购金融资产支出		34,530.73
6. 信用减值损失	7.4.7.21	-
7. 税金及附加		2,559.45
8. 其他费用	7.4.7.22	136,108.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-392,470.27</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-392,470.27</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-392,470.27</b>

注：合同生效未满 1 年，无上年度可比期间数据。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 5 月 16 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2023 年 5 月 16 日（基金合同生效日）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	-	-	-



二、本期期初净资产	137,154,100.16	-	137,154,100.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	84,735.89	-392,317.68	-307,581.79
（一）、综合收益总额	-	-392,470.27	-392,470.27
（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）	84,735.89	152.59	84,888.48
其中：1.基金申购款	84,735.89	152.59	84,888.48
2.基金赎回款	-	-	-
（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	137,238,836.05	-392,317.68	136,846,518.37

注：合同生效未满 1 年，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

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

华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金(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”）《关于准予华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2022]3061 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《华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2023 年 5 月 16 日生效。本基金为契约

型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 137,154,100.16 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰资管，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。该资金已由毕马威华振会计事务所审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》和《华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式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，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、股票期权、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）。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×10%+中证港股通综合指数（CNY）收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《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 5 月 16 日（基金合同生效日）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 2023 年 12 月 31 日
活期存款	881,827.51
等于：本金	881,757.81
加：应计利息	69.70
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	881,827.51

#### 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	21,556,380.55	-	21,026,842.29	-529,538.26	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	78,649,107.74	852,372.55	79,540,450.87	38,970.58
	银行间市场	50,936,609.90	495,417.48	51,683,417.48	251,390.10
	合计	129,585,717.64	1,347,790.03	131,223,868.35	290,360.68
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	151,142,098.19	1,347,790.03	152,250,710.64	-239,177.58	

#### 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

本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	21,246.72
其中：交易所市场	16,391.77
银行间市场	4,854.95
应付利息	-
预提费用	119,300.00
合计	140,546.72

#### 7.4.7.8 实收基金

华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	36,432,761.79	36,432,761.79
本期申购	64,631.65	64,631.65
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	36,497,393.44	36,497,393.44
-----	---------------	---------------

华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	100,721,338.37	100,721,338.37
本期申购	20,104.24	20,104.24
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	100,741,442.61	100,741,442.61

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

华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 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
本期利润	26,069.55	-63,399.46	-37,329.91
本期基金份额交易产生的变动数	255.17	-176.35	78.82
其中：基金申购款	255.17	-176.35	78.82
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,324.72	-63,575.81	-37,251.09

华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 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
本期利润	-179,362.24	-175,778.12	-355,140.36
本期基金份额交易产生的变动数	44.43	29.34	73.77
其中：基金申购款	44.43	29.34	73.77

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-179,317.81	-175,748.78	-355,066.59

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 5 月 16 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	11,538.56
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	45,667.32
其他	78.83
合计	57,284.71

#### 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
	2023 年 5 月 16 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-289,357.82
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	-289,357.82

##### 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
	2023 年 5 月 16 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	16,804,423.03
减：卖出股票成本总额	17,043,200.18
减：交易费用	50,580.67
买卖股票差价收入	-289,357.82

#### 7.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	2,159,185.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-243,703.66
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,915,481.61

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	147,770,631.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	146,424,416.92
减：应计利息总额	1,582,988.80
减：交易费用	6,929.77
买卖债券差价收入	-243,703.66

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。



7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股指期货投资收益	-725,946.15

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	58,202.22
证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	58,202.22

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1.交易性金融资产	-239,177.58
——股票投资	-529,538.26
——债券投资	290,360.68
——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	-239,177.58
----	-------------

#### 7.4.7.19 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 7.4.7.20 持有基金产生的费用

本基金本报告期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5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	30,000.00
信息披露费	80,000.00
银行手续费	5,568.17
开户费	400.00
账户维护费	20,100.00
证券组合费	40.30
合计	136,108.47

#### 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
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
招商银行股份有限公司	基金托管人、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5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	2,121,193.78	3.83%

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	98,763,007.59	55.54%

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	714,600,000.00	48.40%

###### 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5月16日（基金合同生效日）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	1,126.96	3.69%	-	-

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
	2023年5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	687,374.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	305,895.13
应支付基金管理人的净管理费	381,478.88

注：本基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023年5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	171,843.48

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

	本期

关联方名称	2023年5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 A	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 C	合计
招商银行股份有限公司	-	423.42	423.42
华泰证券股份有限公司	-	251,609.38	251,609.38
合计	-	252,032.80	252,032.80

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 0.4% 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×0.4%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

本期，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，本基金未参与转融通证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	
	2023年5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	华泰紫金恒荣12个月持有期混合发起A	华泰紫金恒荣12个月持有期混合发起C

基金合同生效日（2023 年 5 月 16 日）持有的基金份额	10,009,000.00	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,009,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	27.42%	-

注：1、基金管理人投资本基金适用的认申购/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 2023年5月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	881,827.51	11,538.56

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 634,344.56 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，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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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 19,397,732.20 元，于 2024 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	8,012,158.36
合计	8,012,158.36

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

2、未评级部分为利率债。

#### 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，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，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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日
AAA	120,705,053.94
AAA 以下	2,506,656.05
未评级	-
合计	123,211,709.99

#### 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，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，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，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时间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	881,827.51	-	-	-	881,827.51
结算备付金	4,086,723.81	-	-	-	4,086,723.81
存出保证金	11,981.27	-	-	-	11,981.27
交易性金融资产	18,250,190.85	86,826,686.15	26,146,991.35	21,026,842.29	152,250,710.64
应收申购款	-	-	-	100.00	100.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-

资产总计	23,230,723.44	86,826,686.15	26,146,991.35	21,026,942.29	157,231,343.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	92,489.10	92,489.10
应付托管费	-	-	-	23,122.24	23,122.24
卖出回购金融资产款	19,397,732.20	-	-	-	19,397,732.20
应付销售服务费	-	-	-	33,925.16	33,925.16
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,844.71	3,844.71
应付证券清算款	-	-	-	693,164.73	693,164.73
其他负债	-	-	-	140,546.72	140,546.72
负债总计	19,397,732.20	-	-	987,092.66	20,384,824.86
利率敏感度缺口	3,832,991.24	86,826,686.15	26,146,991.35	20,039,849.63	136,846,518.37

#### 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
	1 市场利率下降 25BP	620,705.07
	2 市场利率上升 25BP	-615,088.81

#### 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	-	3,449,798.29	3,449,798.29
资产合计	-	<b>3,449,798.29</b>	<b>3,449,798.29</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	-	<b>3,449,798.29</b>	<b>3,449,798.29</b>

## 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
	港币相对人民币升值 5%	172,489.91
	港币相对人民币贬值 5%	-172,489.91

## 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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	21,026,842.29	15.37
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	131,223,868.35	95.89
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	152,250,710.64	111.26

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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；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。	
	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
	业绩比较基准上升 5%	2,862,124.75
	业绩比较基准下降 5%	-2,862,124.75

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
第一层次	36,728,969.32
第二层次	115,521,741.32
第三层次	-
合计	152,250,710.64

##### 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

本基金无公允价值计量结果所属层次为第三层次的金融工具。

###### 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

本基金无使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的金融工具。

##### 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	21,026,842.29	13.37
	其中：股票	21,026,842.29	13.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	131,223,868.35	83.46
	其中：债券	131,223,868.35	83.46
	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	4,968,551.32	3.16
8	其他各项资产	12,081.27	0.01
9	合计	157,231,343.23	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 3,449,798.29 元人民币，占期末基金资产净值比例 2.52%。

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	995,524.00	0.73
B	采矿业	944,346.00	0.69
C	制造业	12,123,375.00	8.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,953,558.00	1.43
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	370,368.00	0.27
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	799,146.00	0.58
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	209,274.00	0.15
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	181,453.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,577,044.00	12.84

## 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	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	1,496,024.22	1.09
E 金融	-	-
F 医疗保健	359,950.58	0.26

G 工业	1,004,898.30	0.73
H 信息技术	-	-
I 电信服务	588,925.19	0.43
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	3,449,798.29	2.52

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	600900	长江电力	83,700.00	1,953,558.00	1.43
2	02883	中海油田服务	158,000.00	1,142,598.42	0.83
3	600690	海尔智家	52,000.00	1,092,000.00	0.80
4	600585	海螺水泥	44,200.00	997,152.00	0.73
5	600989	宝丰能源	64,100.00	946,757.00	0.69
6	00576	浙江沪杭甬	192,000.00	906,509.99	0.66
7	600566	济川药业	25,300.00	795,179.00	0.58
8	603993	洛阳钼业	147,300.00	765,960.00	0.56
9	300124	汇川技术	11,600.00	732,424.00	0.54
10	688036	传音控股	4,138.00	572,699.20	0.42
11	603833	欧派家居	7,800.00	542,958.00	0.40
12	002032	苏泊尔	10,100.00	535,401.00	0.39
13	603596	伯特利	6,400.00	443,520.00	0.32
14	00700	腾讯控股	1,600.00	425,705.91	0.31
15	601128	常熟银行	62,900.00	401,931.00	0.29
16	600030	中信证券	19,500.00	397,215.00	0.29
17	002737	葵花药业	15,200.00	394,896.00	0.29
18	600183	生益科技	20,700.00	379,017.00	0.28
19	600029	南方航空	64,300.00	370,368.00	0.27
20	600975	新五丰	35,200.00	367,840.00	0.27
21	01548	金斯瑞生物科技	20,000.00	359,950.58	0.26
22	002327	富安娜	40,100.00	358,895.00	0.26
23	00883	中国海洋石油	30,000.00	353,425.80	0.26
24	002241	歌尔股份	15,300.00	321,453.00	0.23
25	002475	立讯精密	9,300.00	320,385.00	0.23
26	603477	巨星农牧	8,400.00	314,748.00	0.23
27	300498	温氏股份	15,600.00	312,936.00	0.23
28	002884	凌霄泵业	17,700.00	307,272.00	0.22
29	000050	深天马 A	28,100.00	299,265.00	0.22

30	000333	美的集团	5,400.00	295,002.00	0.22
31	002007	华兰生物	11,300.00	250,069.00	0.18
32	300661	圣邦股份	2,600.00	231,426.00	0.17
33	002810	山东赫达	10,000.00	211,900.00	0.15
34	603997	继峰股份	15,000.00	202,050.00	0.15
35	002572	索菲亚	12,600.00	200,970.00	0.15
36	000902	新洋丰	17,500.00	199,325.00	0.15
37	600887	伊利股份	7,400.00	197,950.00	0.14
38	000725	京东方 A	50,200.00	195,780.00	0.14
39	600600	青岛啤酒	2,600.00	194,350.00	0.14
40	002415	海康威视	5,500.00	190,960.00	0.14
41	601058	赛轮轮胎	16,100.00	189,175.00	0.14
42	600894	广日股份	25,600.00	188,160.00	0.14
43	603882	金城医学	2,900.00	181,453.00	0.13
44	600547	山东黄金	7,800.00	178,386.00	0.13
45	00772	阅文集团	6,200.00	163,219.28	0.12
46	600835	上海机电	13,100.00	155,497.00	0.11
47	605168	三人行	2,300.00	145,728.00	0.11
48	00152	深圳国际	16,500.00	98,388.31	0.07
49	688580	伟思医疗	1,460.00	93,337.80	0.07
50	300415	伊之密	5,000.00	88,150.00	0.06
51	002818	富森美	5,100.00	63,546.00	0.05

#### 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600900	长江电力	2,374,562.00	1.74
2	600690	海尔智家	1,988,362.00	1.45
3	600566	济川药业	1,292,457.00	0.94
4	02883	中海油田服务	1,250,645.75	0.91
5	600585	海螺水泥	1,093,284.00	0.80
6	002327	富安娜	997,881.00	0.73
7	002138	顺络电子	991,796.00	0.72
8	603596	伯特利	983,787.00	0.72
9	00576	浙江沪杭甬	899,327.84	0.66
10	603993	洛阳钼业	898,724.00	0.66
11	600183	生益科技	895,667.00	0.65
12	600989	宝丰能源	895,547.00	0.65

13	603833	欧派家居	889,453.00	0.65
14	03690	美团-W	819,042.73	0.60
15	300124	汇川技术	791,143.00	0.58
16	601128	常熟银行	698,710.00	0.51
17	002078	太阳纸业	697,499.00	0.51
18	600030	中信证券	696,840.00	0.51
19	601088	中国神华	696,815.00	0.51
20	002508	老板电器	694,046.00	0.51

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002138	顺络电子	1,041,733.00	0.76
2	000680	山推股份	771,034.00	0.56
3	600690	海尔智家	742,102.00	0.54
4	601088	中国神华	736,379.00	0.54
5	002078	太阳纸业	694,672.00	0.51
6	600183	生益科技	668,979.00	0.49
7	600566	济川药业	660,480.00	0.48
8	300782	卓胜微	648,393.00	0.47
9	002327	富安娜	630,378.00	0.46
10	03690	美团-W	618,466.67	0.45
11	688008	澜起科技	600,735.24	0.44
12	002508	老板电器	540,937.00	0.40
13	603596	伯特利	498,587.00	0.36
14	600900	长江电力	480,705.00	0.35
15	601012	隆基绿能	474,606.00	0.35
16	603986	兆易创新	465,955.00	0.34
17	600567	山鹰国际	439,140.00	0.32
18	601100	恒立液压	421,949.96	0.31
19	02273	固生堂	372,416.25	0.27
20	688377	迪威尔	338,670.46	0.25

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	38,599,580.73
卖出股票的收入（成交）总额	16,804,423.03

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	8,012,158.36	5.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,636,214.70	45.04
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	40,656,883.01	29.71
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	5,216,485.25	3.81
7	可转债（可交换债）	15,702,127.03	11.47
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	131,223,868.35	95.89

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	2028040	20 交通银行永续债	100,000.00	10,423,321.31	7.62
2	152378	19 济建设	100,000.00	10,301,575.34	7.53
3	185731	22 铁建 Y1	100,000.00	10,224,393.43	7.47
4	232380082	23 浙商银行二级资本	100,000.00	10,167,775.96	7.43

		债 02			
5	137625	22 银河 C5	100,000.00	10,077,040.00	7.36

### 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未出现报告期内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、处罚的情况。

#### 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	11,981.27
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	100.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,081.27

### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	110059	浦发转债	7,516,155.81	5.49
2	113042	上银转债	3,711,845.04	2.71
3	113056	重银转债	698,702.08	0.51
4	110073	国投转债	364,642.66	0.27
5	113052	兴业转债	300,637.33	0.22
6	113044	大秦转债	186,129.62	0.14
7	123128	首华转债	174,766.29	0.13
8	113623	凤 21 转债	132,932.43	0.10
9	110045	海澜转债	121,618.58	0.09
10	123184	天阳转债	107,871.07	0.08
11	113656	嘉诚转债	101,632.18	0.07
12	113021	中信转债	101,029.64	0.07
13	113663	新化转债	99,901.81	0.07
14	113058	友发转债	93,514.85	0.07
15	127078	优彩转债	75,800.20	0.06
16	111004	明新转债	73,136.56	0.05

17	118028	会通转债	72,065.56	0.05
18	127054	双箭转债	62,352.53	0.05
19	118033	华特转债	60,039.03	0.04
20	123099	普利转债	52,965.81	0.04
21	123147	中辰转债	52,910.25	0.04
22	128090	汽模转 2	52,903.89	0.04
23	123141	宏丰转债	51,311.20	0.04
24	113651	松霖转债	51,172.33	0.04
25	113664	大元转债	51,166.20	0.04
26	123107	温氏转债	50,631.73	0.04
27	110088	淮 22 转债	50,603.78	0.04
28	127012	招路转债	50,362.79	0.04
29	123087	明电转债	49,378.36	0.04
30	123153	英力转债	49,154.27	0.04
31	111005	富春转债	48,896.16	0.04
32	127043	川恒转债	48,852.49	0.04
33	113637	华翔转债	48,548.77	0.04
34	127059	永东转 2	47,956.98	0.04
35	118015	芯海转债	47,956.65	0.04
36	113649	丰山转债	47,594.89	0.03
37	128109	楚江转债	47,081.48	0.03
38	127070	大中转债	46,864.05	0.03
39	123168	惠云转债	46,620.52	0.03
40	110093	神马转债	46,159.02	0.03
41	113505	杭电转债	45,003.78	0.03
42	113033	利群转债	42,929.64	0.03
43	113065	齐鲁转债	40,135.57	0.03
44	113619	世运转债	37,028.51	0.03
45	113066	平煤转债	31,108.21	0.02
46	118004	博瑞转债	25,787.21	0.02

### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资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
华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 A	415	87,945.53	20,469,371.32	56.08%	16,028,022.12	43.92%
华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 C	2,305	43,705.62	2,182,242.36	2.17%	98,559,200.25	97.83%
合计	2,720	50,455.45	22,651,613.68	16.51%	114,587,222.37	83.49%

### 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	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 A	262,052.98	0.72%
	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 C	23,011.88	0.02%
	合计	285,064.86	0.21%

### 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	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 A	10~50
	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 A	10~50
	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 C	0
	合计	10~50

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

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

**9.5 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	10,009,000.00	7.29%	10,000,000.00	7.29%	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	10,009,000.00	7.29%	10,000,000.00	7.29%	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。

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 A	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合发起 C
基金合同生效日（2023 年 5 月 16 日）基金份额总额	36,432,761.79	100,721,338.37
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	64,631.65	20,104.24
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	36,497,393.44	100,741,442.61

## §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

本报告期内未发生涉及基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

无。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 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 30,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效日起至本报告期末。

### 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	45,586,323.92	82.28%	25,081.84	82.19%	-
华创证券	2	7,696,486.06	13.89%	4,309.41	14.12%	-
华泰证券	2	2,121,193.78	3.83%	1,126.96	3.69%	-

注：1、我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 个广发证券交易单元、新增 2 个华创证券交易单元、新增 2 个华泰证券交易单元。

### 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	75,691,146.97	42.57%	662,950,000.00	44.90%	-	-
华创证券	3,368,266.27	1.89%	98,850,000.00	6.70%	-	-
华泰证券	98,763,007.59	55.54%	714,600,000.00	48.40%	-	-

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	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	2023-05-17
2	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式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	2023-06-16
3	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资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	2023-06-16
4	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式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	2023-06-16
5	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
6	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告	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	2023-07-24
7	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	
8	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
9	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
10	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
11	华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金 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
12	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《华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金经理变更的公告》，自 2023 年 6 月 14 日起新增王曦为本基金的基金经理。

## §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恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2、《华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合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、关于申请募集注册华泰紫金恒荣 12 个月持有期混合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、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人、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