

# 华泰紫金创新先锋混合型证券投资基金（LOF）

## 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十四日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 华泰紫金创新先锋混合（LOF）  |
| 场内简称       | 创新华泰   |
| 基金主代码      | 501202   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2020 年 7 月 17 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 477,855,865.57 份   |
| 投资目标       | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。                                   |
| 投资策略       | 本基金主要跟踪宏观经济指标、企业经营指标、政策走向、流动性分析、大类资产及行业估值比较等指标对宏观经济和市场环境进行综合研判，进而对仓位进行动态调整。基金资产配置策略主要依据基 |

|                 |   |                  |
|-----------------|---|------------------|
|                 | 本面和估值的变化动态调整。在经济处于复苏期和繁荣期且市场估值没有过分高估时，超配股票资产；在经济处于衰退期和政策刺激阶段且估值仍高于合理水平时，超配债券等固定收益资产，力争通过资产配置获得部分超额收益。 |                  |
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%  |                  |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。  |                  |
| 基金管理人           | 华泰证券（上海）资产管理有限公司  |                  |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司  |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 华泰紫金创新先锋混合（LOF）A  | 华泰紫金创新先锋混合（LOF）C |
| 下属分级基金的场内简称     | -   | 创新华泰             |
| 下属分级基金的交易代码     | 009663  | 501202           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 39,890,551.55 份   | 437,965,314.02 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

|        |                               |                  |
|--------|-------------------------------|------------------|
| 主要财务指标 | 报告期<br>(2024年7月1日-2024年9月30日) |                  |
|        | 华泰紫金创新先锋混合（LOF）A              | 华泰紫金创新先锋混合（LOF）C |

|                |               |                |
|----------------|---------------|----------------|
| 1.本期已实现收益      | -1,145,121.18 | -12,687,509.10 |
| 2.本期利润         | 2,998,049.92  | 32,595,068.85  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0734        | 0.0726         |
| 4.期末基金资产净值     | 39,163,954.12 | 426,376,825.64 |
| 5.期末基金份额净值     | 0.9818        | 0.9735         |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1、华泰紫金创新先锋混合（LOF）A：

| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 8.51%   | 1.30%     | 9.68%      | 0.93%         | -1.17% | 0.37% |
| 过去六个月      | 8.15%   | 1.00%     | 8.77%      | 0.74%         | -0.62% | 0.26% |
| 过去一年       | 3.10%   | 0.95%     | 7.11%      | 0.65%         | -4.01% | 0.30% |
| 过去三年       | -21.67% | 1.00%     | -21.15%    | 0.79%         | -0.52% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.82%  | 1.14%     | -9.77%     | 0.87%         | 7.95%  | 0.27% |

##### 2、华泰紫金创新先锋混合（LOF）C：

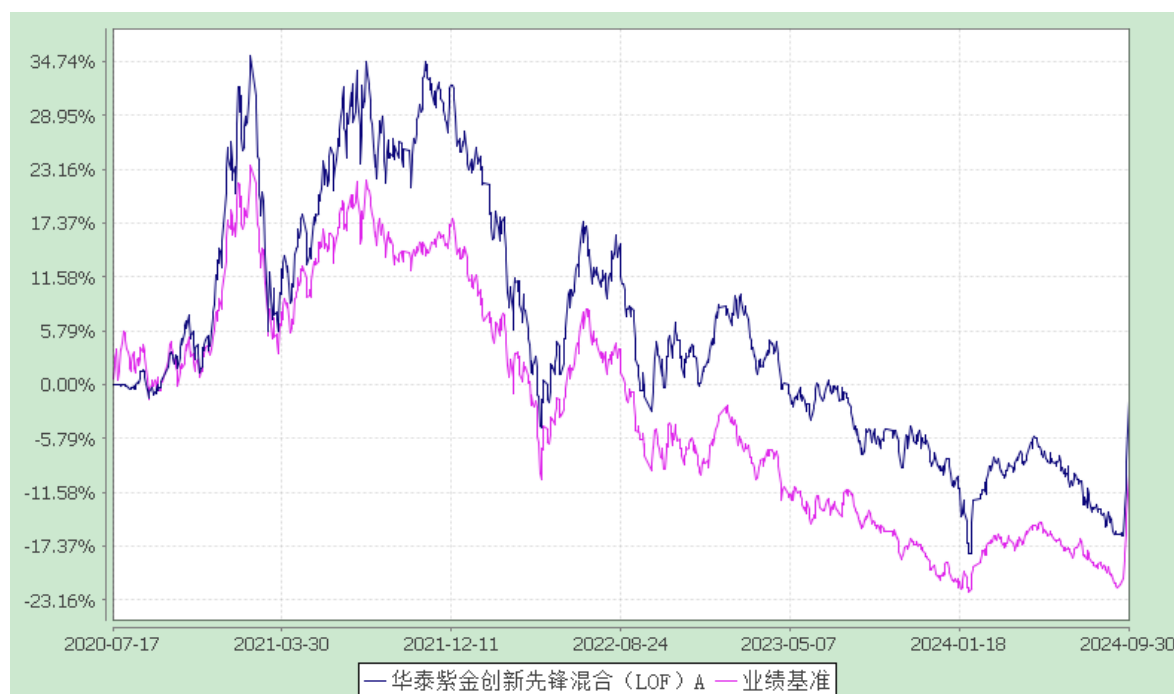
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 8.44%  | 1.30%     | 9.68%      | 0.93%         | -1.24% | 0.37% |
| 过去六个月 | 8.03%  | 1.01%     | 8.77%      | 0.74%         | -0.74% | 0.27% |

|            |         |       |         |       |        |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去一年       | 2.89%   | 0.95% | 7.11%   | 0.65% | -4.22% | 0.30% |
| 过去三年       | -22.14% | 1.00% | -21.15% | 0.79% | -0.99% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.65%  | 1.14% | -9.77%  | 0.87% | 7.12%  | 0.27% |

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

华泰紫金创新先锋混合型证券投资基金（LOF）  
 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7月17日至2024年9月30日)

#### 1. 华泰紫金创新先锋混合（LOF）A:



#### 2. 华泰紫金创新先锋混合（LOF）C:



注：1、自 2023 年 7 月 17 日起，本基金转为上市开放式基金（LOF），业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*60%+中债综合指数收益率\*40%。转型前业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率\*60%+中债综合指数收益率\*40%；

2、本基金合同于 2020 年 7 月 17 日生效，自基金成立日起 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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务       | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|----------|-------------|------|--------|--|
|    |          | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 刘瑞 | 本基金的基金经理 | 2020-08-05  | -    | 14     | 拉夫堡大学金融学硕士。2009 年加入泰信基金管理有限公司，从事研究员工作；2011 年加入海通证券，曾任宏观策略高级分析师、银行业分析师，2012-2013 年分别荣获新财富最佳分析师第四名、第三名，2014-2015 年分别荣获 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 新财富最佳分析师第三名和第二名。2015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，现担任基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1、上述基金经理的任职日期及离任日期均以基金公告为准；首任基金经理的任职日期为基金合同的生效日期。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金创新先锋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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

公司建立了公募基金投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司股票池和债券库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得

到公平对待,各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易,本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

由于目前宏观经济整体偏弱,因此在三季度操作上整体还是维持中等偏低的仓位。在三季末政府出台提振经济及资本市场政策后,仓位有所提升,现阶段整体权益仓位大约在7-8成之间。在持仓结构上,一方面我们坚持产品的定位和特色,在科技、医药等成长方向上持仓有所侧重;另一方面,我们也兼顾市场风格和产品波动的情况,配置了一定比例的低估值偏稳健的标的,如移动运营商、机械、资源品等。

展望市场,我们仍然持谨慎乐观的态度,一方面权益资产在大类资产的横向比较中,仍然是更具性价比的资产;另一方面,在宏观政策明显转向后,经济失速的风险大幅减弱。但对于市场能否马上展开一轮持续的牛市行情,我们认为还需要进一步观察,因为每轮牛市的展开都需要业绩和估值共同上行驱动,现阶段市场的反弹主要是还是预期的改善驱动估值修复,基本能否持续改善要依赖后续政策的持续发力以及经济信心的修复。因此,现阶段我们在操作上还是会相对谨慎,不会盲目追高,在标的选择上仍会以安全边际和业绩的确定性作为主要的选择标准。在经济预期和市场方向更加明确后,我们会相应的调整仓位和资产配置的重点。

#### 4.5 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8.51%,同期业绩比较基准收益率为9.68%;本基金C类份额净值增长率为8.44%,同期业绩比较基准收益率为9.68%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1、本基金本报告期内未出现连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人的情形;

2、本基金本报告期内未出现连续20个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。



## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 341,471,708.28 | 72.29        |
|    | 其中：股票             | 341,471,708.28 | 72.29        |
| 2  | 固定收益投资            | 29,368,832.80  | 6.22         |
|    | 其中：债券             | 29,368,832.80  | 6.22         |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 101,398,617.94 | 21.47        |
| 7  | 其他各项资产            | 104,185.34     | 0.02         |
| 8  | 合计                | 472,343,344.36 | 100.00       |

注：1、本基金报告期末未持有港股通股票。

2、本基金报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别            | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业        | -              | -            |
| B  | 采矿业             | 1,376,158.00   | 0.30         |
| C  | 制造业             | 301,437,727.28 | 64.75        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应 | -              | -            |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
|   | 业               |                |       |
| E | 建筑业             | -              | -     |
| F | 批发和零售业          | 3,176,820.00   | 0.68  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 3,293,840.00   | 0.71  |
| H | 住宿和餐饮业          | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 7,952,825.00   | 1.71  |
| J | 金融业             | 9,843,024.00   | 2.11  |
| K | 房地产业            | -              | -     |
| L | 租赁和商务服务业        | -              | -     |
| M | 科学研究和技术服务业      | 14,391,314.00  | 3.09  |
| 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              | 341,471,708.28 | 73.35 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)        | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|---------------|--------------|
| 1  | 300308 | 中际旭创 | 172,100.00   | 26,651,406.00 | 5.72         |
| 2  | 600566 | 济川药业 | 660,295.00   | 20,680,439.40 | 4.44         |
| 3  | 601058 | 赛轮轮胎 | 1,046,200.00 | 16,781,048.00 | 3.60         |
| 4  | 601138 | 工业富联 | 621,700.00   | 15,660,623.00 | 3.36         |
| 5  | 002332 | 仙琚制药 | 1,143,987.00 | 15,443,824.50 | 3.32         |
| 6  | 603225 | 新风鸣  | 1,208,511.00 | 15,299,749.26 | 3.29         |
| 7  | 000725 | 京东方A | 3,329,400.   | 14,882,418.00 | 3.20         |

|    |        |      |            |               |      |
|----|--------|------|------------|---------------|------|
|    |        |      | 00         |               |      |
| 8  | 300347 | 泰格医药 | 208,600.00 | 14,391,314.00 | 3.09 |
| 9  | 002475 | 立讯精密 | 306,100.00 | 13,303,106.00 | 2.86 |
| 10 | 002371 | 北方华创 | 33,000.00  | 12,077,340.00 | 2.59 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 27,187,532.05 | 5.84         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 2,181,300.75  | 0.47         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 29,368,832.80 | 6.31         |

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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|------------|---------------|--------------|
| 1  | 019727 | 23 国债 24 | 266,000.00 | 27,187,532.05 | 5.84         |
| 2  | 128137 | 洁美转债     | 18,950.00  | 2,181,300.75  | 0.47         |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 5.11.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 90,920.34 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 13,265.00 |
| 6  | 其他应收款   | -         |

|   |      |            |
|---|------|------------|
| 7 | 待摊费用 | -          |
| 8 | 其他   | -          |
| 9 | 合计   | 104,185.34 |

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 128137 | 洁美转债 | 2,181,300.75 | 0.47         |

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

**§ 6 开放式基金份额变动**

单位：份

| 项目            | 华泰紫金创新先锋混合（LOF）A | 华泰紫金创新先锋混合（LOF）C |
|---------------|------------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 42,628,703.93    | 462,043,391.13   |
| 本报告期基金总申购份额   | 5,654.35         | 817,604.88       |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,743,806.73     | 24,895,681.99    |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 39,890,551.55    | 437,965,314.02   |

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

本基金管理人未使用固有资金投资本基金。

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

本基金管理人未使用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予华泰紫金科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- 2、《华泰紫金创新先锋混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金创新先锋混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金创新先锋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科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书；
- 8、基金产品资料概要；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

文件存放在基金管理人、基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

部分备查文件可通过本基金管理人公司网站查询，也可咨询本基金管理人。客服电话：4008895597；公司网址：<https://htamc.htsc.com.cn/>。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二四年十月二十四日