

# 华泰紫金中债-同业存单 AAA 指数 7 天持有期发起式证券投资 基金

## 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 31 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华泰紫金同存 AAA 指数 7 天持有发起
基金主代码	021709
交易代码	021709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 7 月 31 日
报告期末基金份额总额	140,054,997.64 份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金主要采用分层和动态优化复制的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。

	<p>在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、资产配置策略 2、同业存单投资策略 3、债券投资策略 4、资产支持证券投资策略</p>
业绩比较基准	中债-同业存单 AAA 指数收益率*95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。
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

### § 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
	(2024 年 7 月 31 日（基金合同生效日）-2024 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	445,159.59
2.本期利润	446,928.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0020

4.期末基金资产净值	140,344,381.56
5.期末基金份额净值	1.0021

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、本基金合同于 2024 年 7 月 31 日生效，未满一个季度。

### 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

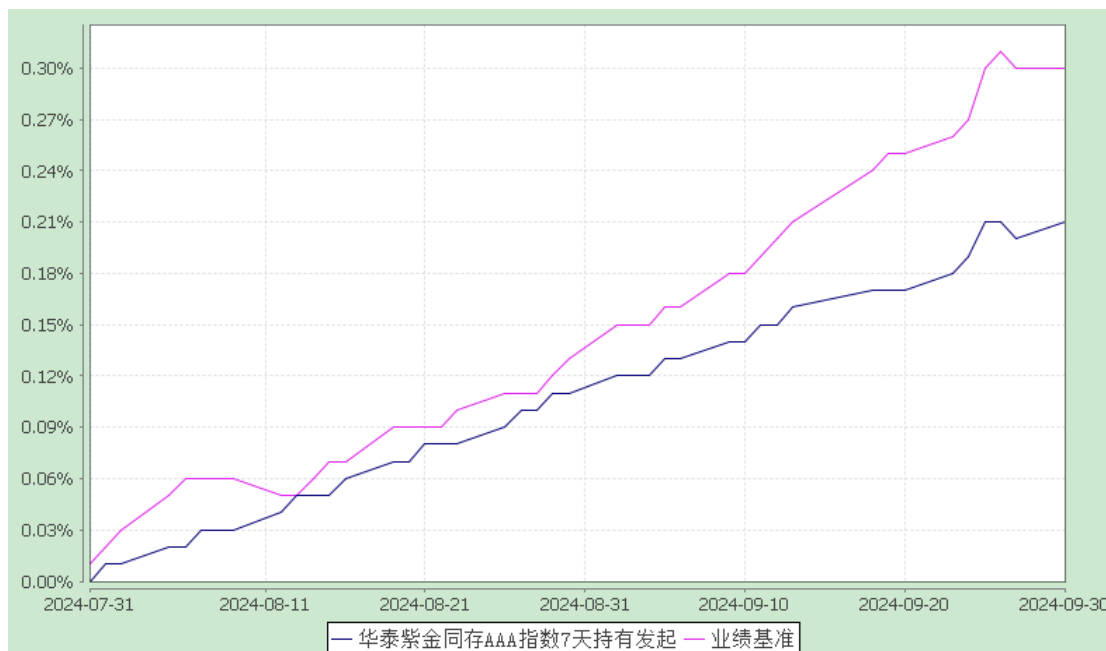
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.21%	0.01%	0.30%	0.01%	-0.09%	0.00%

#### 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

华泰紫金中债-同业存单 AAA 指数 7 天持有期发起式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2024 年 7 月 31 日至 2024 年 9 月 30 日)



注：1、本基金的合同生效日为 2024 年 7 月 31 日，自基金成立起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金尚处于建仓期。

2、本基金业绩比较基准=中债-同业存单 AAA 指数收益率\*95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)\*5%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经 理期限		证券从业 年限	说明
		任职日 期	离任日 期		
陈利	本基金的基金 经理	2024-07- 31	-	13	上海财经大学数量经济学硕士，曾任职于德邦证券、德邦基金从事固定收益相关工作。2017 年 1 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司，现担任基金经理。
杨义 山	本基金的基金 经理	2024-07- 31	-	6	武汉大学经济学学士、华中科技大学文学双学士，2009 年至 2013 年曾

					任韬睿惠悦咨询公司分析师；2013 年至 2018 年任职于深交所下属深圳证券信息有限公司，历任指数事业部研究员、资深研究员，从事证券指数研发和相关研究工作。2018 年加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，现担任基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《华泰紫金中债-同业存单 AAA 指数 7 天持有期发起式证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司建立了公募基金投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司股

票池和债券库,完善各类具体资产管理业务组织结构,规范各项业务之间的关系,在保证各投资组合既具有相对独立性的同时,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内,本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得到公平对待,各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易,本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度经济增长水平环比二季度进一步趋缓,生产端除汽车开工率外,多数中上游开工率环比仍在降低;需求端,新房二手房成交面积同比降幅继续扩大;传统基建项目仍受资金、项目等因素制约;出口虽仍有支撑,但高基数影响下同比增速或降低。三季度官方制造业 PMI 均在荣枯线以下,但 9 月制造业 PMI 录得 49.8%,较上月回升 0.7 个百分点,9 月制造业 PMI 转而上行,一是因为 8 月基数较低,二是季节性的驱动。完成全年经济增长的目标尚在,因此在三季度末,政策提速发力,不断释放积极信号,随着政策预期的改变,权益类资产在季末连续大涨,而固收类资产出现回调。

投资操作上,三季度,本基金严格遵守相关法律法规的要求,对组合资产进行了一定精选优化,并适当进行久期调节,努力为投资人赚取与其风险偏好相匹配的收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值收益率为 0.21%,同期业绩比较基准收益率为 0.30%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金,且截至本报告期末,本基金的基金合同生效未满三年,暂不适用。

## § 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	93,029,077.35	66.23
	其中：债券	93,029,077.35	66.23
	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	36,003,604.31	25.63
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,271,887.31	0.91
7	其他各项资产	10,151,363.71	7.23
8	合计	140,455,932.68	100.00

### 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

本基金本报告期末未持有境内股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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	14,240,299.73	10.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,163,591.78	21.49
	其中：政策性金融债	30,163,591.78	21.49
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	9,029,315.34	6.43
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	39,595,870.50	28.21
9	其他	-	-
10	合计	93,029,077.35	66.29

#### 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	240421	24 农发 21	200,000.00	20,022,027.40	14.27
2	019740	24 国债 09	120,000.00	12,093,915.62	8.62
3	220303	22 进出 03	100,000.00	10,141,564.38	7.23
4	112406080	24 交通银行 CD080	100,000.00	9,922,432.13	7.07
5	112402036	24 工商银行 CD036	100,000.00	9,886,656.00	7.04

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

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

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

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

本基金不得投资股票。

##### 5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	663.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,150,700.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,151,363.71

##### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	262,472,833.43
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	25,981,853.24
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	148,399,689.03
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	140,054,997.64

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

基金合同生效日管理人持有的本基金份额	10,000,694.44
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,694.44
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	7.14

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内管理人运用固有资金投资本基金份额未发生变动。

### § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份 额总数	持有份 额占基金总 份额比例	发起份 额总数	发起份 额占 基金总份 额比例	发起份 额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,6 94.44	7.14%	10,000,0 00.00	7.14%	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	10,000,6 94.44	7.14%	10,000,0 00.00	7.14%	-

注：持有份额总数部分包含利息结转的份额。

### § 9 影响投资者决策的其他重要信息

#### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

#### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

### § 10 备查文件目录

#### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《华泰紫金中债-同业存单 AAA 指数 7 天持有期发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金中债-同业存单 AAA 指数 7 天持有期发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金中债-同业存单 AAA 指数 7 天持有期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中债-同业存单 AAA 指数 7 天持有期发起式证券投资基金之法律意见书》;

8、基金产品资料概要;

9、中国证监会规定的其他备查文件。

## 10.2 存放地点

文件存放在基金管理人、基金托管人的住所。

## 10.3 查阅方式

部分备查文件可通过本基金管理人公司网站查询，也可咨询本基金管理人。

客服电话：4008895597；公司网址：<https://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