# 华泰紫金多元均衡三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

# 2026 年第 2 季度报告

# 2026 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

## §1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 20 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 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 华泰紫金多元均衡三个月持有（FOF） |
| 基金主代码 | 024292 |
| 交易代码 | 024292 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2025 年 8 月 5 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 103,352,563.91 份 |
| 投资目标 | 在控制风险的前提下，通过主动的资产配置、基金优选，力求基金资产稳定增值。 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略；2、基金投资策略；3、股票投资策略；4、债券投资策略；5、可转换债券及可交换债券投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、风险管理策略。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价(总值)指数收益率×70%+中证 800 指数收益率×22%+中证港股通综合指数收益率×5%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率×3% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金中基金，其预期风险和预期收益理论上高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金、股票 |

| | | |
|---|---|---|
| | 型基金中基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担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。 | |
| 基金管理人 | 华泰证券（上海）资产管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 华泰紫金多元均衡三个月持有（FOF）A | 华泰紫金多元均衡三个月持有（FOF）C |
| 下属两级基金的交易代码 | 024292 | 024293 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 102,202,101.15 份 | 1,150,462.76 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>(2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) | |
|---|---|---|
| | 华泰紫金多元均衡三个月持有（FOF）A | 华泰紫金多元均衡三个月持有（FOF）C |
| 1.本期已实现收益 | 703,421.86 | 7,392.23 |
| 2.本期利润 | 2,136,502.06 | 24,721.19 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0208 | 0.0200 |
| 4.期末基金资产净值 | 104,242,572.87 | 1,169,163.38 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0200 | 1.0163 |

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 本报告期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、华泰紫金多元均衡三个月持有（FOF）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 | 2.08% | 0.38% | 2.50% | 0.36% | -0.42% | 0.02% |
| 过去六个月 | 1.12% | 0.38% | 2.14% | 0.37% | -1.02% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.00% | 0.33% | 5.47% | 0.32% | -3.47% | 0.01% |

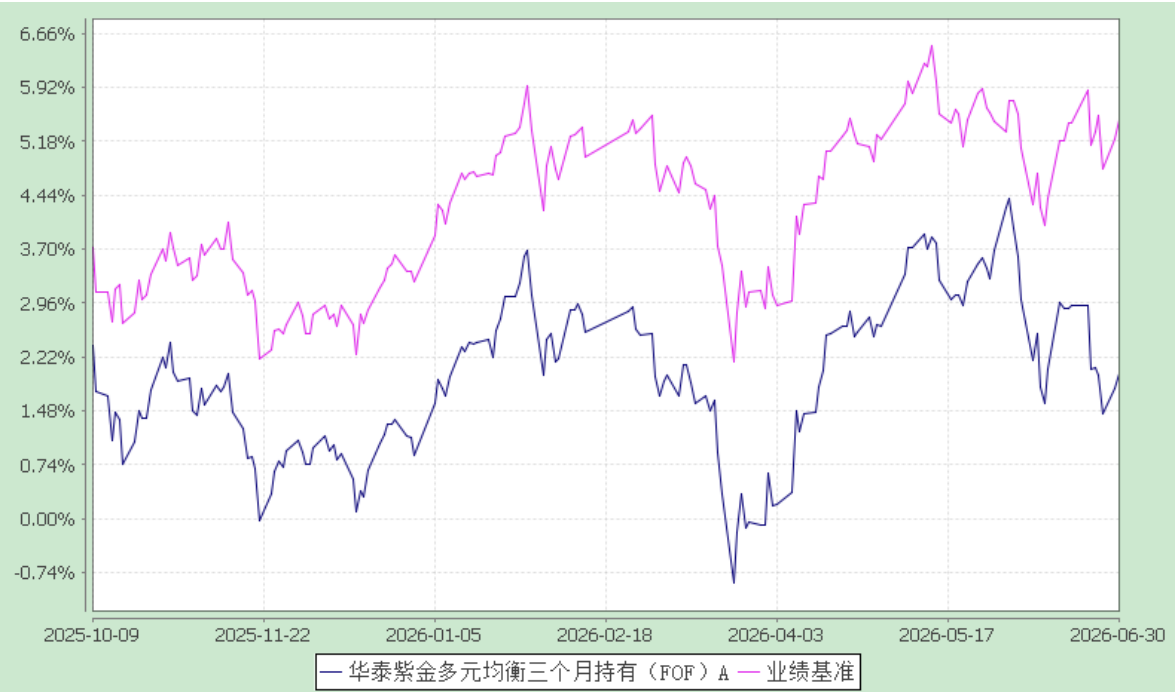
**2、华泰紫金多元均衡三个月持有（FOF）C：**

| 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 | 1.98% | 0.38% | 2.50% | 0.36% | -0.52% | 0.02% |
| 过去六个月 | 0.91% | 0.38% | 2.14% | 0.37% | -1.23% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.63% | 0.33% | 5.47% | 0.32% | -3.84% | 0.01% |

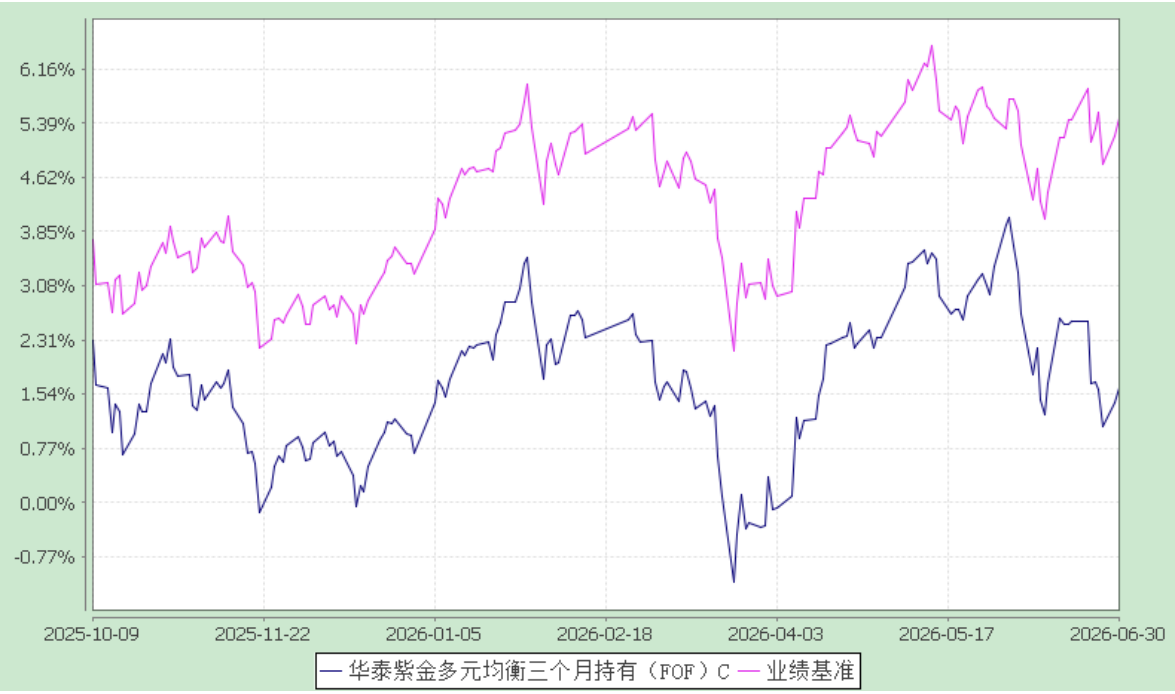
**3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较**

华泰紫金多元均衡三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2025 年 8 月 5 日至 2026 年 6 月 30 日）

1．华泰紫金多元均衡三个月持有（FOF）A：



2．华泰紫金多元均衡三个月持有（FOF）C：




注：1、本基金运作业绩比较基准收益率=中债综合全价（总值）指数收益率*70%+中证800指数收益率*22%+中证港股通综合指数收益率*5%+上海黄金交易所Au99.99现货实盘合约收益率*3%。

2、本基金合同于2025年8月5日生效；自基金成立日起6个月内为建仓期。

## §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 | | |
| 方宇翔 | 本基金的基金经理 | 2025-08-05 | - | 11 | 厦门大学应用数学与数理金融双学士，上海交通大学金融学硕士，拥有 7 年以上资产配置及管理人研究经验。曾就职于上投摩根基金管理有限公司担任量化研究员，拥有多年基金及数量化产品策略研发经验。2018 年加入华泰证券（上海）资产管理有限公司 FOF/MOM 团 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 队，负责大类资产配置模型体系搭建以及 FOF 产品组合构建，具有丰富的多元策略 FOF 管理经验。 |

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

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

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

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

**4.2 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《华泰紫金多元均衡三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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**

市场层面：2026 年二季度，全球资本市场在"中东地缘局势演变+AI 产业景气持续+全球货币政策分化"三条主线的交织下，呈现出显著的分化格局：权益资产中，美股与 A 股共振走强，港股逆势承压；商品方面，黄金经历深度回调，原油大幅下挫；债券市场则在中美两国走出了截然不同的路径。指数涨跌幅，股票方面：上证指数上涨 5.20%，创业板指大涨 36.35%，香港恒生指数下跌 7.69%，纳斯达克指数则上涨 21.41%。商品方面：黄金跌幅接近 15%，原油则同样出现了大幅下跌。债券方面：中国 10 年期国债收益率下行 8 个 bps，而美国的 10 年期国债收益率则上行约 15 个 bps。

产品运作层面：本基金于 2025 年 8 月成立，定位偏稳健的多元资产配置型 FOF 产品。2026 年二季度整体仓位层面持续优化调整，美股基金的仓位有所上升，而国内股票基金的仓位小幅下降。截止到二季度末，本基金的配置情况为：49.4%的偏固定收益类基金（包含 14.4%的“固收+”基金和 35.0%的纯债基金），22.4%的偏权益类基金（包含 10.2%的国内权益基金和 12.2%的美股基金），5.6%的海外债券基金，以及 5.8%的黄金基金，其余为现金管理参与打新策略。

总结二季度， 抱团的市场环境对本基金所坚持的"多元资产+多元策略"分散化投资框架构成了较大挑战。从资产配置效果来看：科技板块在综合企业基本面与估值性价比后，本基金超配了海外纳斯达克指数基金和少量港股互联网龙头，但弹性不足，显著跑输国内科技主题基金；黄金部分作为通胀对冲和防御型资产，在美元走强和利率回升的情形下出现大幅回撤拖累了组合。尽管本基金在分散化层面达到了设计目标，但在二季度这种极致结构性行情中，非热点资产的普遍下跌抵消了大部分配置价值。本基金二季度业绩表现未达到预期。

展望未来，当前市场已呈现出若干抱团行情后期的典型特征：成交集中度较高，热点板块成交额占比已处于历史高位区间；行业覆盖度收窄，上涨个股集中度持续提升，赚钱效应范围明显缩窄；板块分化程度加剧，成长/价值、大盘/小盘、内需/外需等多维度裂口均处于历史极值水平。历史经验表明，当上述指标同时达到或接近极值时，市场往往面临再平衡压力。下阶段操作上，我们会继续秉持多元资产多元配置分散投资的投资理念，动态评估各个大类资产之间的性价比，不断优化配置组合，期待市场出现再平衡的时候能够把握住机会修复净值。同时，市场波动特别是热点板块的波动近期显著放大，产品要守好风控底线，努力将产品的波动回撤控制在目标之内。

**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 2.08%，同期业绩比较基准收益率为 2.5%；本基金 C 类份额份额净值增长率为 1.98%，同期业绩比较基准收益率为 2.5%

**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 | 6,112.00 | 0.01 |
| | 其中：股票 | 6,112.00 | 0.01 |
| 2 | 基金投资 | 89,744,032.12 | 84.65 |
| 3 | 固定收益投资 | 6,062,953.97 | 5.72 |
| | 其中：债券 | 6,062,953.97 | 5.72 |
| | 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 | 1,300,000.00 | 1.23 |
| | 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 | 625,566.65 | 0.59 |
| 8 | 其他各项资产 | 8,284,865.65 | 7.81 |
| 9 | 合计 | 106,023,530.39 | 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 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| C | 制造业 | 6,112.00 | 0.01 |
| 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 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| 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 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 6,112.00 | 0.01 |

**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 | 920193 | 吉和昌 | 300.00 | 2,556.00 | 0.00 |
| 2 | 920136 | 永励精密 | 100.00 | 1,928.00 | 0.00 |
| 3 | 920189 | 康美特 | 200.00 | 1,628.00 | 0.00 |

**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 | 6,062,953.97 | 5.75 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 6,062,953.97 | 5.75 |

**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 | 019792 | 25 国债 19 | 60,000.00 | 6,062,953.97 | 5.75 |

**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**

不适用。

**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其他资产构成**

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 4,619.01 |
| 2 | 应收证券清算款 | 8,280,216.64 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 30.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 8,284,865.65 |

**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**

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 920193 | 吉和昌 | 2,556.00 | 0.00 | 新股未上市 |
| 2 | 920136 | 永励精密 | 1,928.00 | 0.00 | 新股未上市 |
| 3 | 920189 | 康美特 | 1,628.00 | 0.00 | 新股未上市 |

**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 基金中基金

**6.1 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基金投资明细**

| 序号 | 基金代 | 基金名 | 运作方 | 持有份 | 公允价值 | 占 基 金 | 是 否 属 于 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|

| | 码 | 称 | 式 | 额（份） | （元） | 资产净值比例 | 基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 003949 | 兴全稳泰债券 A | 契约型开放式 | 7,500,833.47 | 9,261,279.09 | 8.79% | 否 |
| 2 | 004388 | 鹏华丰享债券 | 契约型开放式 | 7,009,658.83 | 9,160,222.16 | 8.69% | 否 |
| 3 | 020089 | 广发纯债债券 E | 契约型开放式 | 6,840,091.34 | 8,548,062.15 | 8.11% | 否 |
| 4 | 513390 | 博时纳斯达克 100ETF | 交易型开放式 | 3,209,900.00 | 7,816,106.50 | 7.41% | 否 |
| 5 | 008409 | 景顺长城景泰裕利纯债债券 A | 契约型开放式 | 6,127,878.92 | 6,900,604.45 | 6.55% | 否 |
| 6 | 518880 | 华安黄金 ETF | 交易型开放式 | 720,000.00 | 6,032,160.00 | 5.72% | 否 |
| 7 | 010923 | 永赢鑫欣混合 A | 契约型开放式 | 4,263,458.43 | 5,312,695.55 | 5.04% | 否 |
| 8 | 000385 | 景顺长城景颐双利债券 A 类 | 契约型开放式 | 2,767,900.55 | 5,303,297.45 | 5.03% | 否 |
| 9 | 161128 | 易方达标普信息科技指数(QDII-LOF)A(人民币份额) | 契约型开放式 | 792,094.00 | 5,271,940.04 | 5.00% | 否 |
| 10 | 023512 | 景顺长城景颐丰利债券 F 类 | 契约型开放式 | 2,640,757.67 | 4,534,445.00 | 4.30% | 否 |

**6.1.1 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公开募集不动产投资信托基金投资明细**

本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

**6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况**

本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

### 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 | 其中：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 |
|---|---|---|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | - | - |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 11,649.58 | - |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 108,368.58 | 2,130.91 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 27,502.11 | 639.27 |
| 当期交易基金产生的交易费（元） | 805.97 | - |

### 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

## §7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华泰紫金多元均衡三个月持有（FOF）A | 华泰紫金多元均衡三个月持有（FOF）C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 102,763,658.46 | 1,215,547.53 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 12,624.43 | 293,220.58 |
| 减：本报告期期间基金总赎回份额 | 574,181.74 | 358,305.35 |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 102,202,101.15 | 1,150,462.76 |

## §8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 华泰紫金多元均衡三个月持有（FOF）A | 华泰紫金多元均衡三个月持有（FOF）C |
|---|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 100,012,333.33 | - |
| 本报告期买入/申购总份额 | - | - |
| 本报告期卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 100,012,333.33 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 97.86 | - |

注：期末持有的基金份额占基金总份额比例为期末持有份额占基金同类份额的比例。

### 8.2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。

## §9 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 | 100,012,333.33 | 96.77% | 99,999,000.00 | 96.76% | 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 | 100,012,333.33 | 96.77% | 99,999,000.00 | 96.76% | 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 影响投资者决策的其他重要信息

### 10.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2026-04-01 至 2026-06-30 | 100,012,333.33 | 0.00 | 0.00 | 100,012,333.33 | 96.77% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；<br>2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；<br>3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；<br>4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；<br>5、发起式基金在成立三年后继续存续的，若本基金连续60个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险，本基金合同生效未满三年；<br>6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；<br>7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。 | | | | | | | |

### 10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

# §11　备查文件目录

## 11.1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、《华泰紫金多元均衡三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》；

3、《华泰紫金多元均衡三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》；

4、《华泰紫金多元均衡三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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多元均衡三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）之法律意见书》；

8、基金产品资料概要；

9、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；

10、中国证监会规定的其他备查文件。

## 11.2存放地点

文件存放在基金管理人、基金托管人的住所。

## 11.3查阅方式

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

**华泰证券（上海）资产管理有限公司**

**二〇二六年七月二十一日**