华泰紫金丰泰纯债债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要

编制日期:2020年8月28日
送出日期:2020年9月1日

本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分。
作出投资决定前,请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	华泰紫金丰泰纯债债券发起	基金代码	007117
下属基金简称	华泰紫金丰泰纯债债券发起A	下属基金代码	007117
	华泰紫金丰泰纯债债券发起C		007118
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
基金合同生效日	2019-05-30		
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	李博良	开始担任本基金基金经理的日期	2019/5/30
		证券从业日期	2013/7/22

二、基金投资与净值表现

(一)投资目标与投资策略

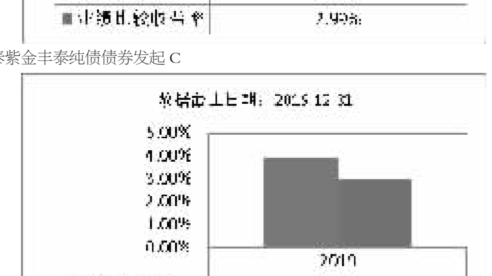
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值,为投资者实现超越业绩比较基准的收益。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。
主要投资策略	1、信用债投资策略 本基金将重点投资信用类债券,以提高组合收益能力。信用债券相对央票、国债等利率产品的信用利差是本基金获取较高投资收益的来源,本基金将在基金管理人内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下,积极投资信用债券,获取信用利差带来的高投资收益。 债券的信用利差主要受两个方面的影响,一是市场信用利差曲线的走势;二是债券本身的信用变化。本基金依靠对宏观经济走势、行业信用状况、信用债券市场流动性风险、信用债券供需情况等的分析,判断市场信用利差曲线整体及分行业走势,确定各期限、各类属信用债券的投资比例。依靠内部评级系统分析各信用债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差,选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资,减持信用利差被低估、未来信用利差可能上升的信用债券。 2、收益率曲线策略 收益率曲线形状变化代表长、中、短期债券收益率差异变化,相同久期债券组合在收益率曲线发生变化时差异较大。通过对同一类属下的收益率曲线形态和期限结构变动进行分析,首先可以确定债券组合的目标久期配置区域并确定采取子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略;其次,通过不同期限间债券当前利差与历史利差的比较,可以进行增陡、减斜和凸度变化的交易。 3、杠杆放大策略 杠杆放大操作即以组合现有债券为基础,利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金,并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券,以期获取超额收益的操作方式。 4、资产支持证券投资策略 5、中小企业私募债券投资策略 6、国债期货投资策略
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中债综合财富(总值)指数收益率×90%+银行活期存款利率(税后)×10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金。

(二)投资组合资产配置图表/区域配置图表(若有)

(三)自基金合同生效以来/最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

华泰紫金丰泰纯债债券发起A

华泰紫金丰泰纯债债券发起C



注:1、本基金成立于2019年5月30日;2、基金的过往业绩不代表未来表现;3、产品2019年数据非完整年度数据。

三、投资本基金涉及的费用

(一)基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取:

华泰紫金丰泰纯债A

费用类型	金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率
申购费(前收费)	M<100万	0.5%
	100万≤M<1000万	0.3%
	M≥1000万	500元/笔
赎回费	N<7日	1.5%
	7日≤N<30日	0.5%
	N≥30日	0

华泰紫金丰泰纯债C

费用类型	金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率
申购费(前收费)	-	不收取申购费
赎回费	N<7日	1.50%
	N≥7日	0

(二)基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.3%
托管费	0.1%
销售服务费(华泰紫金丰泰纯债A)	不收取销售服务费
销售服务费(华泰紫金丰泰纯债C)	0.3%

注:1、本基金的或有管理费按前一日基金资产净值0.3%的年费率计提,管理人每日对当日有效退出份额是否满足管理费收取条件进行判断,如满足,则该退出份额对应的已计提或有管理费将确认为基金管理人的管理费;如不满足,则该退出份额对应的已计提或有管理费将随同赎回款一并划付给申请退出的投资者。已确认的基金管理费按月支付;2、本基金交易证券、基金(如有)等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

(一)风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。投资于本基金的主要风险有:

1、市场风险,主要包括:(1)政策风险;(2)经济周期风险;(3)利率风险;(4)购买力风险;(5)再投资风险;(6)信用风险;(7)债券回购风险;2、管理风险;3、流动性风险;4、合规性风险;

5、本基金的特有风险:(1)各类固定收益证券投资风险;(2)资产支持证券投资风险;(3)中小企业私募债券投资风险;(4)国债期货投资风险;(5)《基金合同》终止的风险;(6)投资人误解的风险。

(二)重要提示

中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 https://htamc.htsc.com.cn/,客服电话:4008895597

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要

编制日期:2020年8月28日
送出日期:2020年9月1日

本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分。
作出投资决定前,请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

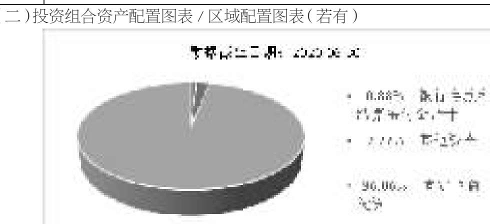
基金简称	华泰紫金季季享定开债券发起	基金代码	006654
下属基金简称	华泰紫金季季享定开债券发起A	下属基金代码	006654
	华泰紫金季季享定开债券发起C		006655
基金管理人	华泰证券(上海)资产管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2019-01-17		
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	定期开放式	开放频率	首个开放期为首个封闭期结束后的5到10个工作日,且应为某一月度的首个工作日;第二个开放期为首个开放期对属月份后的第3个月的前5到10个工作日。之后每三个月开放一次,依此类推。
基金经理	李博良	开始担任本基金基金经理的日期	2019/1/17
		证券从业日期	2013/7/22
基金经理	陈晨	开始担任本基金基金经理的日期	2019/3/6
		证券从业日期	2009/7/1
基金经理	刘振超	开始担任本基金基金经理的日期	2020/3/24
		证券从业日期	2015/7/1

二、基金投资与净值表现

(一)投资目标与投资策略

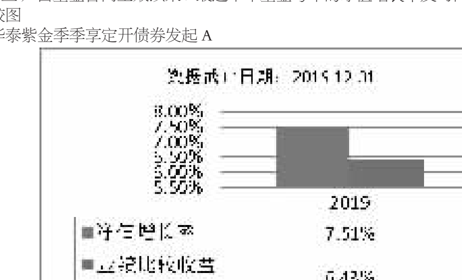
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值,为投资者实现超越业绩比较基准的收益。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、中小企业私募债、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。
主要投资策略	1、封闭期投资策略 本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配的基础上,基金管理人将视债券、银行存款、债券回购等大类资产的市场环境确定债券投资组合管理策略,确定部分债券采取持有到期策略,部分债券将采取积极的投资策略,以获取较高的债券组合投资收益,同时根据对股票市场的趋势研判,适度参与股票投资,力求提高基金总体收益率。 本基金的具体封闭期投资策略包括:资产配置策略、久期策略、类属配置策略、信用债投资策略、杠杆投资策略、再投资策略、资产支持证券的投资策略、国债期货投资策略、中小企业私募债券投资策略、可转换债券投资策略、股票投资策略 2、开放期投资策略 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中债综合财富(总值)指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金。

(二)投资组合资产配置图表/区域配置图表(若有)

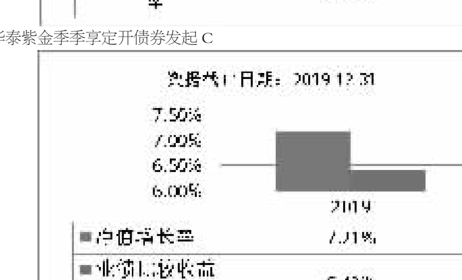


(三)自基金合同生效以来/最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

华泰紫金季季享定开债券发起A



华泰紫金季季享定开债券发起C



注:1、本基金成立于2019年1月17日;2、基金的过往业绩不代表未来表现;3、产品2019年数据非完整年度数据。

三、投资本基金涉及的费用

(一)基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取:

华泰紫金季季享定开A

费用类型	金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率
申购费(前收费)	M<100万	0.5%
	100万≤M<1000万	0.3%
	M≥1000万	1000元/笔
赎回费	N<7日	1.5%
	7日≤N<30日	0.2%
	N≥30日	0

华泰紫金季季享定开C

费用类型	金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率
申购费(前收费)	-	不收取申购费
赎回费	N<7日	1.5%
	7日≤N<30日	0.1%
	N≥30日	0

(二)基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.6%
托管费	0.1%
销售服务费(华泰紫金季季享定开A)	不收取销售服务费
销售服务费(华泰紫金季季享定开C)	0.3%

注:本基金交易证券、基金(如有)等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

(一)风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。投资于本基金的主要风险有:

1、市场风险,主要包括:(1)政策风险;(2)经济周期风险;(3)利率风险;(4)购买力风险;(5)再投资风险;(6)信用风险;(7)债券回购风险;2、管理风险;3、流动性风险;4、合规性风险;

5、本基金的特有风险:(1)各类固定收益证券的投资风险;(2)资产支持证券的投资风险;(3)中小企业私募债券的投资风险;(4)国债期货的投资风险;(5)股票价格波动的风险;(6)本基金采取封闭运作模式,基金份额持有人面临不能赎回基金份额的风险;(7)《基金合同》终止的风险。

(二)重要提示

中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 https://htamc.htsc.com.cn/,客服电话:4008895597

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

华泰紫金零钱宝货币市场基金基金产品资料概要

编制日期:2020年8月28日
送出日期:2020年9月1日

本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分。
作出投资决定前,请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

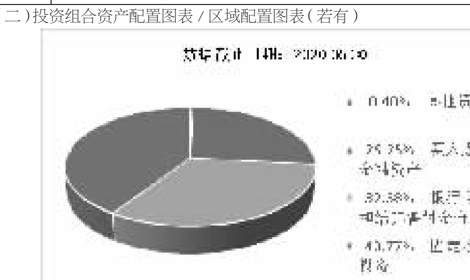
基金简称	华泰紫金零钱宝货币	基金代码	004860
基金管理人	华泰证券(上海)资产管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2017-08-24		
基金类型	货币市场基金	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	李博良	开始担任本基金基金经理的日期	2017/8/24
		证券从业日期	2013/7/22
基金经理	陈利	开始担任本基金基金经理的日期	2019/7/2
		证券从业日期	2011/7/1

二、基金投资与净值表现

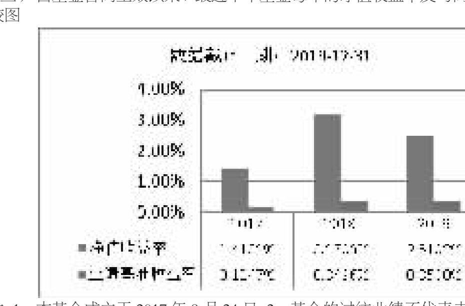
(一)投资目标与投资策略

投资目标	在控制投资组合风险,保持相对流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资范围	本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。
主要投资策略	本基金将资产配置和精选个券相结合,在动态调整现金类资产与固定收益类资产的投资比例的基础上,精选优质个券构建投资组合,在严格控制风险的基础上,实现基金资产的保值增值。 1、大类资产配置策略 本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,预测宏观经济的发展趋势,并据此评价未来一段时间债券市场相对收益率,在基金限定的投资比例范围内主动调整现金、债券及基金类资产的配置比例。本基金包括战略性资产配置和战术性资产配置;战略性资产配置首先分析较长时间段内所关注的各类资产的预期回报率和风险,然后确定最能满足基金风险-回报率目标的资产组合;战术性资产配置根据各类资产长短期平均回报率不同,预测短期性回报率,调整资产配置,获取市场时机选择的超额收益。 2、债券投资策略 本基金对固定收益类证券的投资,综合采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,对固定收益类证券进行科学合理的配置。自上而下部分主要是根据宏观经济发展状况、货币政策等的分析对市场利率进行动态预测,以此为基础对债券的类属和期限等进行配置;自下而上部分主要从到期收益率、流动性、信用风险、久期、凸性等因素对债券的价值进行分析,对优质债券进行重点配置。 3、资产支持证券投资策略 当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主(包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产),仍处于创新试点阶段。产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

(二)投资组合资产配置图表/区域配置图表(若有)



(三)自基金合同生效以来/最近十年基金每年的净值收益率及与同期业绩比较基准的比较图



注:1、本基金成立于2017年8月24日;2、基金的过往业绩不代表未来表现;3、产品2017年数据非完整年度数据。

三、投资本基金涉及的费用

(一)基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取:

华泰紫金零钱宝

费用类型	金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率
申购费(前收费)	-	不收取申购费
赎回费	-	本基金除根据合同约定收取1%强制赎回费的情形外,通常情况下,本基金不收取赎回费用

(二)基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.25%
托管费	0.05%
销售服务费	0.25%

注:1、2017年8月24日起,对本公司旗下华泰紫金零钱宝货币市场基金开展销售服务费优惠活动,优惠期间销售服务费率降至0.025%;2、本基金交易证券、基金(如有)等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

(一)风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。投资于本基金的主要风险有:

1、基金收益为负的风险;2、流动性风险;3、利率风险;4、信用风险;5、再投资风险;6、通货膨胀风险;7、操作风险;8、政策风险;9、估值风险;10、技术风险;11、不可抗力;12、资产支持证券的风险;13、杠杆风险;14、债券收益率曲线风险;15、证券交易资金前端控制的风险。

(二)重要提示

中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 https://htamc.htsc.com.cn/,客服电话:4008895597

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

华泰紫金丰安27个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要

编制日期:2020年8月28日
送出日期:2020年9月1日

本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分。
作出投资决定前,请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	华泰紫金丰安27个月定开债券发起	基金代码	009844
下属基金简称	华泰紫金丰安27个月定开债券发起A	下属基金代码	009844
	华泰紫金丰安27个月定开债券发起C		009845
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
基金合同生效日			
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	定期开放式	开放频率	本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日(含)起至27个月后的对应日的前一日止。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日(含)起至27个月后的对应日的前一日止,以此类推。
基金经理	陈晨	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2009/7/1

二、基金投资与净值表现

(一)投资目标与投资策略

投资目标	本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略,投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具,力求实现基金资产的稳定增值。
投资范围	本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括债券(国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、政府支持机构债等)、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资股票、可转换债券、可交换债券。 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。
主要投资策略	(一)封闭期投资策略 本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现,本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略,所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期,所投资产到期日(或回售日)不得晚于封闭运作期到期日。本基金投资含回售权的债券时,应在投资该债券前,确定行使回售权或持有至到期的时间;债券到期日晚于封闭运作期到期日的,基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。基金管理人可以基于持有人利益优先原则,在不违反《企业会计准则》的前提下,对尚未到期的固定收益类品种进行处置。 1、资产配置策略:在基金合同约定的投资范围内,本基金将通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究,积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平,结合定量分析方法,确定资产在利率债和信用债之间的配置比例。同时,根据市场利率的水平,确定采取持有到期投资策略的债券配置比例。 2、类属配置策略:本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。 3、信用债投资策略:信用品种收益率的主要影响因素为利率品种基准收益与信用利差。信用利差是信用产品相对国债、央行票据等利率产品获取较高收益的来源。信用利差主要受两方面的影响,一方面为债券所对应信用等级的市场平均信用利差水平,另一方面为发行人本身的信用状况。信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债个券的利差水平产生重要影响。因此,一方面,本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势;另一方面,本基金还将以内部信用评级为主、外部信用评级为辅,即采用内外结合的信用研究和评级制度,研究债券发行主体企业的基本面,以确定企业主体的实际信用状况。 4、资产支持证券的投资策略:资产支持类证券的定价受市场利率、流动性、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率及其它附加条款等多种因素的影响。本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上,辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较,审慎投资资产支持证券类资产。 5、放大策略:本基金将在考虑债券投资的风险收益情况,以及回购成本等因素的情况下,在风险可控以及法律法规允许的范围内,通过债券回购,放大杠杆进行投资操作。本基金将在封闭期内进行杠杆投资,杠杆放大部分仍投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具,并采取买入持有到期投资策略。同时采取滚动回购的方式来维持杠杆,因此负债的资金成本存在一定的波动性。 (二)开放期投资策略 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要进行流动性管理。
业绩比较基准	在每个封闭期,本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的两年期定期存款利率(税后)+1.5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,一般而言,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

(二)投资组合资产配置图表/区域配置图表(若有)

本基金尚处于募集期。

(三)自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图(若有)

本基金尚处于募集期。

三、投资本基金涉及的费用

(一)基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取:

华泰紫金丰安27个月定开债券发起A

费用类型	金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率
认购费	M<100万	0.5%
	100万≤M<1000万	0.3%
	M≥1000万	1000元/笔
申购费(前收费)	M<100万	0.5%
	100万≤M<1000万	0.3%
	M≥1000万	1000元/笔
赎回费	N<7日	1.5%
	7日≤N<30日	0.5%
	N≥30日	0

华泰紫金丰安27个月定开债券发起C

费用类型	金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率
认购费	-	不收取认购费
申购费(前收费)	-	不收取申购费
赎回费	N<7日	1.5%
	7日≤N<30日	0.5%
	N≥30日	0

(二)基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.6%
托管费	0.1%
销售服务费(华泰紫金丰安27个月定开债券发起A)	不收取销售服务费
销售服务费(华泰紫金丰安27个月定开债券发起C)	0.1%

注:本基金交易证券、基金(如有)等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

(一)风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。投资于本基金的主要风险有:

1、市场风险,主要包括:(1)政策风险;(2)经济周期风险;(3)利率风险;(4)通货膨胀风险;(5)再投资风险;(6)杠杆风险;(7)债券收益率曲线风险;2、信用风险;3、流动性风险;4、操作风险;5、管理风险;6、合规风险;

7、本基金的特有风险:(1)持有债券的信用风险;(2)最终赎回价格与封闭期到期日的净值可能存在差异的风险;(3)行情波动时可能损失一定交易收益的风险;(4)基金资产发生计提减值准备可能导致基金份额净值下跌的风险;(5)资产支持证券投资风险;(6)《基金合同》终止的风险;(7)封闭期将无法进行申购和赎回的风险。

(二)重要提示

中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 https://htamc.htsc.com.cn/,客服电话:4008895597

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

华泰紫金中债1-5年国开行债券指数证券投资基金基金产品资料概要

编制日期:2020年8月28日
送出日期:2020年9月1日

本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分。
作出投资决定前,请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	华泰紫金中债1-5年国开债指数	基金代码	008964
下属基金简称	华泰紫金中债1-5年国开债指数A	下属基金代码	008964
	华泰紫金中债1-5年国开债指数C		008965
基金管理人	华泰证券(上海)资产管理有限公司	基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
基金合同生效日	2020-05-15		
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	阮毅	开始担任本基金基金经理的日期	2020/5/15
		证券从业日期	2011/6/1
	陈晨	开始担任本基金基金经理的日期	2020/8/27
		证券从业日期	2009/7/1
	杨义山	开始担任本基金基金经理的日期	2020/8/27
		证券从业日期	2018/10/29

二、基金投资与净值表现

(一)投资目标与投资策略

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券,为更好实现投资目标,还可以投资于具有良好流动性的金融工具,包括政策性金融债、债券回购以及银行存款。 本基金不投资于除政策性金融债以外的债券资产。 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。
主要投资策略	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,或选择非成份券作为替代,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。 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0.25%,年化跟踪误差控制在3%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。 1、资产配置策略 本基金将主要采用分层和动态优化复制的方法,主要以标的指数的成份券为基础,综合考虑债券流动性、基金日常申购赎回以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况,进行替代优化,以保证对标的指数的有效跟踪。 2、债券投资策略 本基金通过采用分层和动态优化复制的方法进行被动式指数化投资,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当方法,如"久期盯住"等优化策略对基金资产进行调整,降低交易成本,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。
业绩比较基准	中债-1-5年国开行债券指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金。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。

(二)投资组合资产配置图表/区域配置图表(若有)

本基金成立于2020年05月15日,截至本报告编制日,本基金尚处于建仓期。

(三)自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图(若有)

本基金成立于2020年05月15日,截至本报告编制日,本基金尚处于建仓期。

三、投资本基金涉及的费用

(一)基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取:

华泰紫金中债1-5年国开债指数A

费用类型	金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率
申购费(前收费)	M<100万	0.4%
	100万≤M<200万	0.2%
	200万≤M<500万	0.1%
	M≥500万	1000元/笔
赎回费	N<7日	1.5%
	7日≤N<30日	0.1%
	N≥30日	0

华泰紫金中债1-5年国开债指数C

费用类型	金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率
申购费(前收费)	-	不收取申购费
赎回费	N<7日	1.5%
	7日≤N<30日	0.1%
	N≥30日	0

(二)基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.15%
托管费	0.05%
销售服务费(华泰紫金中债1-5年国开债指数A)	不收取销售服务费
销售服务费(华泰紫金中债1-5年国开债指数C)	0.1%

注:本基金交易证券、基金(如有)等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

(一)风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。投资于本基金的主要风险有:

1、市场风险,主要包括:(1)政策风险;(2)经济周期风险;(3)利率风险;(4)通货膨胀风险;(5)再投资风险;(6)杠杆风险;(7)债券收益率曲线风险;2、信用风险;3、流动性风险;4、操作风险;5、管理风险;6、合规风险;7、本基金的特有风险:指数化投资风险。

(二)重要提示

中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 https://htamc.htsc.com.cn/,客服电话:4008895597

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

华泰紫金周周购3个月滚动持有债券型证券投资基金基金产品资料概要

编制日期:2020年8月28日
送出日期:2020年9月1日

本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分。
作出投资决定前,请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	华泰紫金周周购3月滚动债	基金代码	008941
下属基金简称	华泰紫金周周购3月滚动债A	下属基金代码	008941
	华泰紫金周周购3月滚动债C		008942
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
基金合同生效日	2020-02-26		
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	其他开放式	开放频率	每周开放申购,认购/申购份额持有每满3个月可以根据合同约定在规定的时限内进行赎回
基金经理	陈晨	开始担任本基金基金经理的日期	2020/2/26
		证券从业日期	2009/7/1
基金经理	李博良	开始担任本基金基金经理的日期	2020/4/9
		证券从业日期	2013/7/22

二、基金投资与净值表现

(一)投资目标与投资策略

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。
投资范围	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、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 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。
主要投资策略	1、资产配置策略:在基金合同约定的投资范围内,本基金将通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究,积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平,结合定量分析方法,确定资产在利率债和信用债之间的配置比例。同时,根据市场利率的水平和本基金距下一运作期到期日的时间,确定采取持有到期投资策略的债券配置比例。 2、久期策略:本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化,对引起利率变化的相关因素进行跟踪和分析,进而对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案,以降低利率变动对组合带来的影响。 3、类属配置策略:本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。 4、信用债投资策略:本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势;还将以内部信用评级为主、外部信用评级为辅,即采用内外结合的信用研究和评级制度,研究债券发行主体企业的基本面,以确定企业主体的实际信用状况。 5、杠杆投资策略:本基金将在考虑债券投资的风险收益情况,以及回购成本等因素的情况下,在风险可控以及法律法规允许的范围内,通过债券回购,放大杠杆进行投资操作。 6、再投资策略:本基金因持有的债券获得的利息收入,将再投资于其他合适的投资标的。如果付息日距离下一运作期到期日较近,本基金将对该部分利息进行流动性管理。 7、资产支持证券的投资策略:本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上,辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较,审慎投资资产支持证券类资产。 8、国债期货投资策略:本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系,选择定价合理的国债期货合约,其次,考虑国债期货各合约的流动性情况,最终确定与现货组合的合适匹配,以达到风险管理的目标。 9、可转换债券投资策略:本基金的可转债的投资将基于三个方面的分析:数量为主的价值分析、债股性分析和公司基本面分析。通过以上分析,力求选择债券价值有一定支撑、安全性和流动性较好,并且发行人成长性良好的品种进行投资。 10、股票投资策略:基金管理人将把握股票市场出现的趋势性或结构性投资机会,在本基金合同约定范围内直接投资股票市场,努力获取超额收益。在股票投资方面,基金管理人将遵循稳健和灵活兼顾的投资思路。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中债综合财富(总值)指数收益率×95%+沪深300指数收益率×5%。
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

(二)投资组合资产配置图表/区域配置图表(若有)

(三)自基金合同生效以来/最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

注:本基金成立于2020年2月26日。

三、投资本基金涉及的费用

(一)基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取:

华泰紫金周周购3个月A

费用类型	金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率
申购费(前收费)	M<100万	0.5%
	100万≤M<1000万	0.3%
	M≥1000万	500元/笔
赎回费	N<180日	0.5%
	N≥180日	0

华泰紫金周周购3个月C

费用类型	金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率
申购费(前收费)	-	不收取申购费
赎回费	-	不收取赎回费

(二)基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.5%
托管费	0.1%
销售服务费(华泰紫金周周购3个月A)	不收取销售服务费
销售服务费(华泰紫金周周购3个月C)	0.3%

注:本基金交易证券、基金(如有)等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

(一)风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。投资于本基金的主要风险有:

1、市场风险,主要包括:(1)政策风险;(2)经济周期风险;(3)利率风险;(4)通货膨胀风险;(5)再投资风险;(6)杠杆风险;(7)债券收益率曲线风险;2、信用风险;3、流动性风险;4、操作风险;5、管理风险;6、合规风险;

7、本基金的特有风险:(1)债券市场的系统性风险;(2)国债期货投资风险;(3)资产支持证券投资风险;(4)运作期间到期日前无法赎回的风险;(5)运作期期限或有变化的风险。

(二)重要提示

中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 https://htamc.htsc.com.cn/,客服电话:4008895597

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料