# 华泰紫金港股通价值研选混合型发起式证券投资基金

# 2026 年中期报告

# 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：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

# 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 16 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

**1 重要提示及目录**.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
**2 基金简介**.....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.....5
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....6
**3 主要财务指标和基金净值表现**.....6
3.1 主要会计数据和财务指标.....6
3.2 基金净值表现.....7
**4 管理人报告**.....9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....10
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.....10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....12
4.8 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.....12
**5 托管人报告**.....12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....12
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.....13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....13
**6 半年度财务会计报告（未经审计）**.....13
6.1 资产负债表.....13
6.2 利润表.....14
6.3 净资产变动表.....16
6.4 报表附注.....17
**7 投资组合报告**.....44
7.1 期末基金资产组合情况.....44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....45
7.3 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.....46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....48
7.6 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.....48
7.7 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.....48
7.8 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.....48
7.9 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.....48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....49
7.12 本报告期投资基金情况.....49
7.13 投资组合报告附注.....49

**8 基金份额持有人信息** ..... 50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 50
8.2 盈利投资者数量占比 ..... 50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 51
8.4 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 ..... 51
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 ..... 51
**9 开放式基金份额变动** ..... 52
**10 重大事件揭示** ..... 52
10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 52
10.2 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 ..... 52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 52
10.4 基金投资策略的改变 ..... 52
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 ..... 52
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 52
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 52
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 ..... 53
10.9 其他重大事件 ..... 54
**11 影响投资者决策的其他重要信息** ..... 55
11.1 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 ..... 55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 55
**12 备查文件目录** ..... 55
12.1 备查文件目录 ..... 55
12.2 存放地点 ..... 56
12.3 查阅方式 ..... 56

# 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 华泰紫金港股通价值研选混合型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 | |
| 基金主代码 | 026937 | |
| 交易代码 | 026937 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2026 年 4 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 | 55,227,192.61 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 A | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 026937 | 026938 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 55,227,192.61 份 | -份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金通过精选基本面良好、具有盈利能力和市场竞争力的公司，在有效控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、港股通标的股票投资策略；4、存托凭证的投资策略；5、债券投资策略；6、股指期货投资策略；7、国债期货投资策略；8、股票期权投资策略；9、资产支持证券投资策略；10、可转换债券及可交换债券投资策略；11、融资业务投资策略 |
| 业绩比较基准 | 中证港股通综合指数（人民币）收益率×75%+中债总全价(总值)指数收益率×20%+活期存款基准利率×5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金，其预期的风险与收益理论上低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。<br>本基金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。 |

## 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 | 姓名 | 白海燕 | 张姗 |
| | 联系电话 | 4008895597 | 400-61-95555 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 负责人 | 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E座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 | | 江晓阳 | 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 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | https://www.htscamc.com |
| 基金中期报告备置地点 | 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 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 华泰证券（上海）资产管理有限公司 | 上海市浦东新区东方路 18 号 21 楼 |

# 3 主要财务指标和基金净值表现

## 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** | **报告期（2026 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日）** | |
|---|---|---|
| | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 A | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 C |
| 本期已实现收益 | 600,488.51 | - |
| 本期利润 | -5,150,405.24 | - |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0932 | - |
| 本期加权平均净值利润率 | -9.56% | - |
| 本期基金份额净值增长率 | -9.32% | - |
| **3.1.2 期末数据和指标** | **报告期末(2026 年 6 月 30 日)** | |
| | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 A | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 C |
| 期末可供分配利润 | -5,148,307.46 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0932 | - |
| 期末基金资产净值 | 50,078,885.15 | - |
| 期末基金份额净值 | 0.9068 | - |
| **3.1.3 累计期末指标** | **报告期末(2026 年 6 月 30 日)** | |
| | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 A | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 C |
| 基金份额累计净值增长率 | -9.32% | - |

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、本报告期本基金 C 份额未有客户资金认购及存余。

## 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

华泰紫金港股通价值研选混合发起 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效起至今 | -9.32% | 0.54% | -9.63% | 0.80% | 0.31% | -0.26% |

注：本报告期本基金 C 类份额未有客户资金认购及存余。

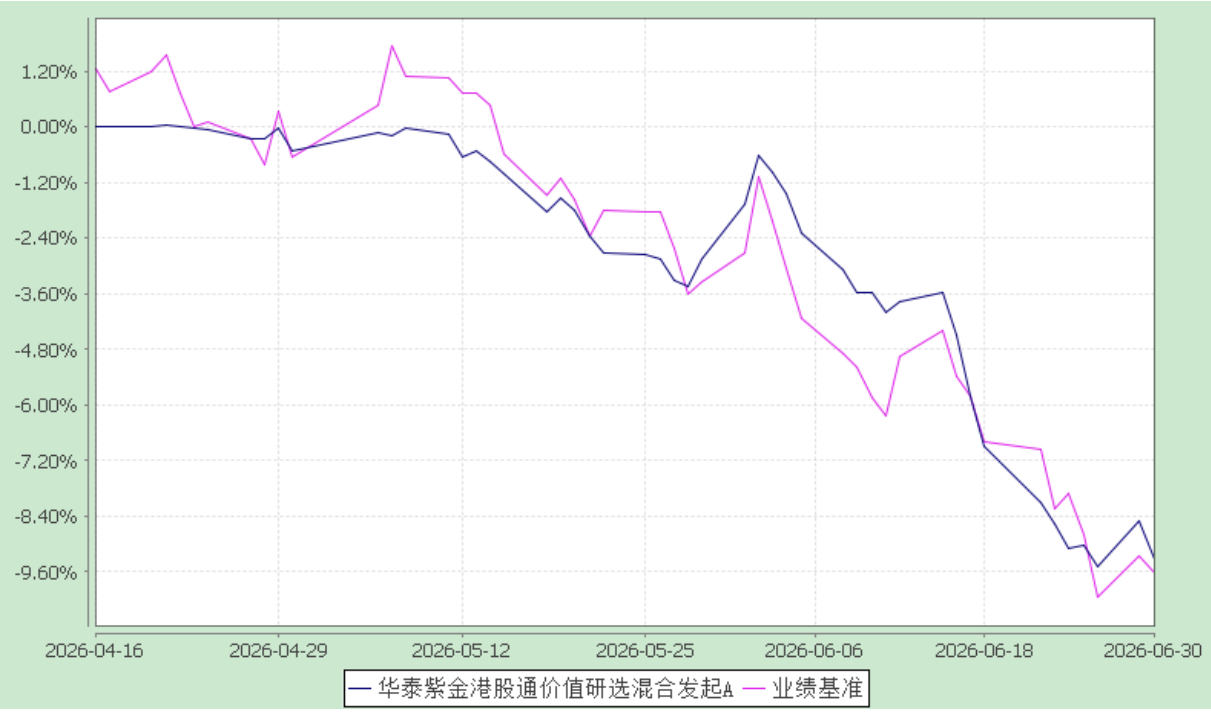
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰紫金港股通价值研选混合型发起式证券投资基金

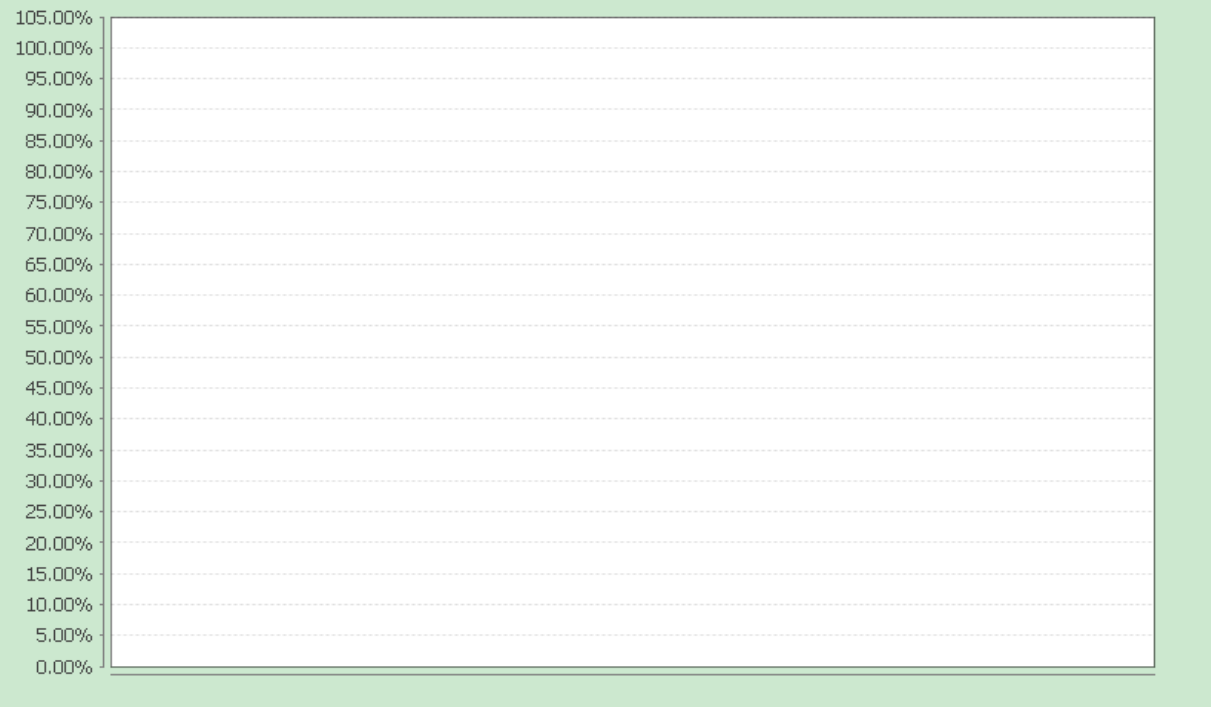
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2026 年 4 月 16 日至 2026 年 6 月 30 日）

华泰紫金港股通价值研选混合发起 A




华泰紫金港股通价值研选混合发起 C




注：1、本基金业绩比较基准收益率=中证港股通综合指数(人民币)收益率*75%+中债总全价(总值)指数收益率*20%+活期存款基准利率*5%；

2、本基金合同于 2026 年 4 月 16 日生效，截止报告期末本基金运作未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截止报告期末仍处于建仓期。

3、本报告期本基金 C 类份额未有客户资金认购及存余。

# 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 | | |
| 郑武 | 本基金的基金经理,研究中心总经理（权益） | 2026-04-16 | - | 22 | 郑武先生，超过 20 年证券从业经验，同济大学机械本科,复旦大学经济学硕士。2022 年 2 月起任华泰证券资产管理权益研究总监。2004 年-2005 年平安证券策略与债券研究,2006 年-2009 年平安证券交运首席,2009 年-2013 年国信证券交运首席,后兼任机械首席。2013 年-2021 年国泰君安交运首席。2006 年通过 CFA 三级考试,2007 年起连续十多年分析师新财富、金牛奖、水晶球奖等奖项,曾入选深圳地方级领军人才。 |

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。

### 4.1.3 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。

## 4.2 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《华泰紫金港股通价值研选混合型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 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 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

本基金经理撰写的“给未来持有人的信”，4 月发布于微信公众号“华泰证券资产管理”。希望持有

人充分了解基金经理的投资理念、方法论、产品定位与个人价值观，并通过定期报告，监督我们的投资实践。

本基金执行“股利贴现模型（DDM）+平台化”的投资体系，实践古典主义的价值投资。个股选择上，遵循内在价值、能力圈与竞争优势三条原则。组合构建的框架为戈登增长模型，组合长期观察指标为净资产收益率与预期股息收益率。期末股票仓位 53%，市值加权的历史平均净资产收益率 15.3%，历史平均税前股息率 6.1%。

本基金成立的首个季度，净值大幅下跌。考虑到股票仓位较低，实际持股的平均跌幅，显著高于中证港股通综指。二季度重点建仓泛消费领域，而本产品成立以来，港股通消费指数下跌近 17%。期末港股通消费指数以及恒生消费指数的市盈率，均处于多年以来的低位。

本基金持有的公司往往拥有良好的商业模式，长期保持竞争优势，并具有聚焦客户与回报股东的企业文化。净值的下跌，源自我未能预见更低的买点。过去十个年度，恒生指数、恒生科技与港股通指数滚动 12 个月的最大回撤中位数分别是-28%、-40%和-29%。企业的竞争力与现金流不会因股价涨跌而增减，但本基金的短期回报与买入成本高度相关。

我们尊重且信赖持有的每一家上市公司，除非日后发现我们错估了自己的能力圈，否则期待有机会长期陪伴。我们会持续学习股票池内公司的历史背景，动态评估自身认知能力。

### 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-9.32%，同期业绩比较基准收益率为-9.63%；本报告期本基金 C 类份额未有客户资金认购及存余。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金的长期回报，主要仅取决于两个因素，一是企业未来现金流，二是美元与人民币利率。我不确定国内持续多年的低通胀，长期能否持续。面对或有的全球通胀风险，我们评估的重点是企业提供差异化产品/服务的历史记录。二季度 10 年期美债利率冲高回落，未来仍可能意外上升并冲击估值；但若观察长期数据，美债利率处于过去二十年的较高分位。

根据我们的测算，部分公司处于隐含长期贴现率较高的估值分位。下半年我们将更审慎地评估

企业基本面与股票估值，更积极地寻找值得长期托付信任的企业。

重申“给未来持有人的信”的风险提示——尽管我所服务的华泰证券（上海）资产管理有限公司以及我的家庭均认购了本产品，但是本产品主要投资的港股通市场历史波动率较高，且家庭资产配置需求因人而异。长期的专业训练，把别人的钱当自己的钱的信托理念，并不必然带来符合预期的投资结果。

### 4.6 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委员会，公司领导担任估值委员会主任委员，投资部门、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历。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。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配。

### 4.8 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，本基金的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

托管人声明:

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。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰紫金港股通价值研选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| **资产：** | | - |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 2,887,658.67 |
| 结算备付金 | | 1,976,882.42 |
| 存出保证金 | | 930.09 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 29,787,433.16 |
| 其中：股票投资 | | 26,667,339.21 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 3,120,093.95 |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 其他投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 15,100,000.00 |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - |
| 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 | | 542,299.91 |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 50,295,204.25 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2026 年 6 月 30 日** |
| **负债：** | | **-** |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付清算款 | | 99,380.40 |
| 应付赎回款 | | 4,490.48 |
| 应付管理人报酬 | | 51,696.86 |
| 应付托管费 | | 8,616.16 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付投资顾问费 | | - |
| 应交税费 | | 677.22 |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.7 | 51,457.98 |
| 负债合计 | | 216,319.10 |
| **净资产：** | | |
| 实收基金 | 6.4.7.8 | 55,227,192.61 |
| 其他综合收益 | | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.9 | -5,148,307.46 |
| 净资产合计 | | 50,078,885.15 |
| 负债和净资产总计 | | 50,295,204.25 |

注：1、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 55,227,192.61 份，其中 A 类基金份额净值 0.9068 元，基金份额总额 55,227,192.61 份。

2、合同生效未满 1 年，无上年度末数据。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰紫金港股通价值研选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| **项目** | **附注号** | **本期<br>2026 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2026** |
|---|---|---|

| | | 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | **-4,957,982.66** |
| 1.利息收入 | | 58,515.85 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.10 | 11,497.57 |
| 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 | | 47,018.28 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 733,103.79 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.11 | -48,345.79 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.12 | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 7,379.29 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.14 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.15 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.16 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.17 | 774,070.29 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有） | | - |
| 其他投资收益 | | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | -5,750,893.75 |
| 4.汇兑收益（损失以“—”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.19 | 1,291.45 |
| **减：二、营业总支出** | | **192,422.58** |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 132,773.15 |
| 其中：暂估管理人报酬（若有） | | - |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 22,128.93 |
| 3．销售服务费 | | - |
| 4．投资顾问费 | | - |
| 5．利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.21 | - |
| 7. 税金及附加 | | 163.19 |
| 8．其他费用 | 6.4.7.22 | 37,357.31 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | **-5,150,405.24** |
| 减：所得税费用 | | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | **-5,150,405.24** |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | **-** |
| **六、综合收益总额** | | **-5,150,405.24** |

注：合同生效未满 1 年，无上年度可比期间数据。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华泰紫金港股通价值研选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 其他综合收益（若有） | 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 | 55,360,887.65 | - | - | 55,360,887.65 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -133,695.04 | - | -5,148,307.46 | -5,282,002.50 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -5,150,405.24 | -5,150,405.24 |
| （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） | -133,695.04 | - | 2,097.78 | -131,597.26 |
| 其中：1.基金申购款 | 85,674.78 | - | -629.82 | 85,044.96 |
| 2.基金赎回款 | -219,369.82 | - | 2,727.60 | -216,642.22 |
| （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 | 55,227,192.61 | - | -5,148,307.46 | 50,078,885.15 |

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。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱前，主管会计工作负责人：朱前，会计机构负责人：白海燕

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰紫金港股通价值研选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”)《关于准予华泰紫金港股通价值研选混合型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2026]264 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《华泰紫金港股通价值研选混合型发起式证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2026 年 04 月 16 日生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限为不定期，首次设立募集规模为 55360887.65 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”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金港股通价值研选混合型发起式证券投资基金合同》和《华泰紫金港股通价值研选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，包括国内依法发行或上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会注册或核准上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单）、债券回购、银行存款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。

本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，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。

本基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 60%-95%，其中，投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证港股通综合指数（人民币）收益率×75%+中债总全价(总值)指数收益率×20%+活期存款基准利率×5%

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金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》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

### 6.4.3 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的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2026 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止。

#### 6.4.4.2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。

#### 6.4.4.3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、资产支持证券投资、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。

**6.4.4.4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)金融工具的后续计量

-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。

**6.4.4.5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。

**6.4.4.6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。

**6.4.4.7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。

**6.4.4.8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资产比例计算的金额。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资产比例计算的金额。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。

**6.4.4.9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其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其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。

**6.4.4.10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。

**6.4.4.11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相应类别的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。基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金同一类别的每份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。

**6.4.4.12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。

**6.4.4.13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。

**6.4.4.14其他重要的会计政策和会计估计**

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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，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》（以下简称“估值处理标准”）在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所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），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值或减值。

**6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

**6.4.5.1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。

**6.4.5.2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。

**6.4.5.3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。

**6.4.6 税项**

根据财税[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《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《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》、财税 [2014] 81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税 [2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延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》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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)本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，

免征增值税；对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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

c)对本基金从上市公司、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，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。对本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%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d)本基金卖出股票按 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。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e)对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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附加。

### 6.4.7重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 2,887,658.67 |
| 等于：本金 | 2,887,369.45 |
| 加：应计利息 | 289.22 |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 合计 | 2,887,658.67 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 32,418,372.96 | - | 26,667,339.21 | -5,751,033.75 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 3,102,650.00 | 17,303.95 | 3,120,093.95 | 140.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 3,102,650.00 | 17,303.95 | 3,120,093.95 | 140.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 35,521,022.96 | 17,303.95 | 29,787,433.16 | -5,750,893.75 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 15,100,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 15,100,000.00 | - |

#### 6.4.7.4.2 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。

### 6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末未持有债权投资。

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 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 | 15,981.70 |
| 其中：交易所市场 | 15,981.70 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 35,476.28 |
| 合计 | 51,457.98 |

### 6.4.7.8 实收基金

华泰紫金港股通价值研选混合发起 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年4月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|

| | 基金份额（份） | 账面金额 |
|---|---|---|
| 基金合同生效日 | 55,360,887.65 | 55,360,887.65 |
| 本期申购 | 85,674.78 | 85,674.78 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -219,369.82 | -219,369.82 |
| 本期末 | 55,227,192.61 | 55,227,192.61 |

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.9 未分配利润**

华泰紫金港股通价值研选混合发起 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期利润 | 600,488.51 | -5,750,893.75 | -5,150,405.24 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -13.58 | 2,111.36 | 2,097.78 |
| 其中：基金申购款 | -72.35 | -557.47 | -629.82 |
| 基金赎回款 | 58.77 | 2,668.83 | 2,727.60 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 600,474.93 | -5,748,782.39 | -5,148,307.46 |

**6.4.7.10 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 8,070.01 |
| 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 | 1,163.03 |
| 其他 | 2,264.53 |
| 合计 | 11,497.57 |

**6.4.7.11 股票投资收益**

**6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -48,345.79 |
| 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 | -48,345.79 |

**6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | - |
| 减：卖出股票成本总额 | - |
| 减：交易费用 | 48,345.79 |
| 买卖股票差价收入 | -48,345.79 |

**6.4.7.12 基金投资收益**

本基金本报告期无基金投资收益。

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年4月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 债券投资收益——利息收入 | 7,379.29 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | - |
| 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 | 7,379.29 |

**6.4.7.14 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。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年4月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 774,070.29 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 774,070.29 |

### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2026年4月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -5,750,893.75 |
| ——股票投资 | -5,751,033.75 |
| ——债券投资 | 140.00 |
| ——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 | -5,750,893.75 |

### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年4月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 1,291.45 |
| 合计 | 1,291.45 |

### 6.4.7.20 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。

**6.4.7.21 信用减值损失**

本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.22 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年4月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 审计费用 | 8,768.88 |
| 信息披露费 | 26,307.40 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行手续费 | 1,581.82 |
| 开户费 | 400.00 |
| 证券组合费 | 299.21 |
| 合计 | 37,357.31 |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**6.4.8.1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。

**6.4.8.2 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。

**6.4.9 关联方、关联关系**

**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期内存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 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 |
| 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 |

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。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026年4月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 15,917,142.95 | 49.10% |

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026年4月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 3,102,650.00 | 100.00% |

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026年4月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 218,732,000.00 | 23.35% |

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026年4月16日（基金合同生效日）至2026年6月30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 | 7,929.13 | 49.61% | 7,929.13 | 49.61% |

注：1、上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2、该类佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》(中国证券监督管理委员会公告(2024)3 号)相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

**6.4.10.2 关联方报酬**

**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年4月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 132,773.15 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 349.55 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 132,423.60 |

注：本基金的基金管理费按前一日基金资产净值 1.20%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×1.20%/当年天数

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年4月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 22,128.93 |

注：本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/当年天数

**6.4.10.2.3 销售服务费**

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。费率若有打折以实际公告为准。本基金报告期未发生关联方的销售服务费。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 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**

**6.4.10.4.1 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**

本基金本报告期未参与转融通证券出借业务。

**6.4.10.4.2 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**

本基金本报告期未参与转融通证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.5.1 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<br>2026年4月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 华泰紫金港股通价值研选混合发起A | 华泰紫金港股通价值研选混合发起C |
| 基金合同生效日（2026 年 4 月 16 日）持有的基金份额 | 50,003,333.33 | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 50,003,333.33 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 90.54% | - |

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。

**6.4.10.5.2 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**

本期末本基金未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.10.6 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<br>2026年4月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行股份有限公司 | 2,887,658.67 | 8,070.01 |

注：本基金的上述银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期无其他关联交易事项。

##### 6.4.10.8.2 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。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 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。

#### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 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为 0，无抵押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金未参与转融通证券出借业务。

### 6.4.13 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。

#### 6.4.13.1 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。

报告期内，公司风险管理组织架构包括五个主要部分：公司董事会及其下设的合规与风险控制委员会，公司管理层及其下设的合规和风险管理委员会，风险管理部及各专业风险管理部门、各业务部门/职能部门。

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。

公司专业风险管理部门包括信息技术部、战略发展部、合规稽核部。其中，信息技术部负责牵头管理公司的信息技术风险；战略发展部负责牵头管理公司的声誉风险；合规稽核部负责牵头管理公司的合规风险（除投资合规性风险）、法律风险和洗钱风险。

公司其他各部门对各自条线的风险管理工作负责，负责落实公司及风险管理部制定的各项政策、流程和措施，接受风险管理部的指导以及对各类风险管理、执行责任的分解。

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。

#### 6.4.13.2 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发行的证券，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。

##### 6.4.13.2.1 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<br>2026年6月30日 |
|---|---|
| A-1 | - |
| A-1 以下 | - |
| 未评级 | 3,120,093.95 |
| 合计 | 3,120,093.95 |

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、未评级部分为国债。

#### 6.4.13.2.2 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。

#### 6.4.13.2.3 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。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末本基金未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 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。

#### 6.4.13.2.6 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。

### 6.4.13.3 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。

#### 6.4.13.3.1 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公司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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 2,887,658.67 | - | - | - | 2,887,658.67 |
| 结算备付金 | 1,976,882.42 | - | - | - | 1,976,882.42 |
| 存出保证金 | 930.09 | - | - | - | 930.09 |
| 交易性金融资产 | 3,120,093.95 | - | - | 26,667,339.21 | 29,787,433.16 |
| 买入返售金融资产 | 15,100,000.00 | - | - | - | 15,100,000.00 |
| 应收股利 | - | - | - | 542,299.91 | 542,299.91 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 23,085,565.13 | - | - | 27,209,639.12 | 50,295,204.25 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 4,490.48 | 4,490.48 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 51,696.86 | 51,696.86 |
| 应付托管费 | - | - | - | 8,616.16 | 8,616.16 |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | 677.22 | 677.22 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 99,380.40 | 99,380.40 |
| 其他负债 | - | - | - | 51,457.98 | 51,457.98 |
| 负债总计 | - | - | - | 216,319.10 | 216,319.10 |
| 利率敏感度缺口 | 23,085,565.13 | - | - | 26,993,320.02 | 50,078,885.15 |

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

**6.4.13.4.1.2 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
| | 市场利率下降 25BP | 4,217.88 |
| | 市场利率上升 25BP | -4,206.37 |

**6.4.13.4.2 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，将对基金收益产生不利影响；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。

**6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 美元<br>折合人民币 | 港币<br>折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | |
| 交易性金融资产 | - | 22,718,478.21 | 22,718,478.21 |
| 应收股利 | - | 542,299.91 | 542,299.91 |
| 资产合计 | - | 23,260,778.12 | 23,260,778.12 |
| 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 | - | 23,260,778.12 | 23,260,778.12 |

**6.4.13.4.2.2 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
| | 港币相对人民币升值 5% | 1,163,038.91 |
| | 港币相对人民币贬值 5% | -1,163,038.91 |

**6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 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 | 26,667,339.21 | 53.25 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产－债券投资 | 3,120,093.95 | 6.23 |
| 交易性金融资产－贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - |
| **合计** | 29,787,433.16 | 59.48 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | |
|---|---|---|
| 假设 | 1.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；2.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<br>2026 年 6 月 30 日 |
| | 业绩比较基准上升 5% | 625,859.40 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -625,859.40 |

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 第一层次 | 26,667,339.21 |
| 第二层次 | 3,120,093.95 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 29,787,433.16 |

#### 6.4.14.2.2 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。

### 6.4.14.3 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。

### 6.4.14.4 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。

### 6.4.15 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。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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 | 26,667,339.21 | 53.02 |
| | 其中：股票 | 26,667,339.21 | 53.02 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 3,120,093.95 | 6.20 |
| | 其中：债券 | 3,120,093.95 | 6.20 |
| | 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 | 15,100,000.00 | 30.02 |
| | 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 | 4,864,541.09 | 9.67 |
| 8 | 其他各项资产 | 543,230.00 | 1.08 |
| 9 | 合计 | 50,295,204.25 | 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 22,718,478.21 元人民币，占期末基金资产净值比例 45.37%。

2、本基金报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

**7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

**7.2.1 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 | 3,457,920.00 | 6.90 |
| 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 | 490,941.00 | 0.98 |
| 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 | 3,948,861.00 | 7.89 |

**7.2.2 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 | 6,445,429.64 | 12.87 |
| C 消费者常用品 | 7,006,879.47 | 13.99 |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | - | - |
| F 医疗保健 | - | - |
| G 工业 | 2,699,991.90 | 5.39 |
| H 信息科技 | - | - |
| I 电信服务 | 6,566,177.20 | 13.11 |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 22,718,478.21 | 45.37 |

注：以上分类采用财汇资讯提供的国际通用行业分类标准。

**7.3 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 | 01883 | 中信国际电讯 | 2,122,000.00 | 4,552,365.86 | 9.09 |
| 2 | 00322 | 康师傅控股 | 486,000.00 | 4,128,287.63 | 8.24 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 3 | 01405 | 达势股份 | 142,300.00 | 3,641,098.83 | 7.27 |
| 4 | 000651 | 格力电器 | 81,100.00 | 3,041,250.00 | 6.07 |
| 5 | 00220 | 统一企业中国 | 491,000.00 | 2,878,591.84 | 5.75 |
| 6 | 03306 | 江南布衣 | 187,500.00 | 2,804,330.81 | 5.60 |
| 7 | 03311 | 中国建筑国际 | 446,000.00 | 2,699,991.90 | 5.39 |
| 8 | 00700 | 腾讯控股 | 3,800.00 | 1,418,550.60 | 2.83 |
| 9 | 00941 | 中国移动 | 9,000.00 | 595,260.74 | 1.19 |
| 9 | 600941 | 中国移动 | 5,700.00 | 490,941.00 | 0.98 |
| 10 | 002508 | 老板电器 | 28,500.00 | 416,670.00 | 0.83 |

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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 | 01405 | 达势股份 | 5,533,061.97 | 11.05 |
| 2 | 01883 | 中信国际电讯 | 5,182,941.81 | 10.35 |
| 3 | 00322 | 康师傅控股 | 5,138,242.59 | 10.26 |
| 4 | 03306 | 江南布衣 | 3,458,314.56 | 6.91 |
| 5 | 03311 | 中国建筑国际 | 3,374,101.93 | 6.74 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 3,256,017.00 | 6.50 |
| 7 | 00220 | 统一企业中国 | 3,249,429.15 | 6.49 |
| 8 | 00700 | 腾讯控股 | 1,628,426.47 | 3.25 |
| 9 | 00941 | 中国移动 | 652,298.48 | 1.30 |
| 9 | 600941 | 中国移动 | 544,008.00 | 1.09 |
| 10 | 002508 | 老板电器 | 401,531.00 | 0.80 |

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。

#### 7.4.2 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

本基金本报告期未卖出股票。

#### 7.4.3 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

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 32,418,372.96 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | - |

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。

**7.5 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 | 3,120,093.95 | 6.23 |
| 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 | 3,120,093.95 | 6.23 |

**7.6 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 | 019827 | 26 国债 01 | 31,000.00 | 3,120,093.95 | 6.23 |

**7.7 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。

**7.8 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。

**7.9 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。

### 7.10 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 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。

### 7.12 本报告期投资基金情况

#### 7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策说明

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。

#### 7.13.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

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。

#### 7.13.3 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 | 930.09 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 542,299.91 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 9 | 合计 | 543,230.00 |

### 7.13.4 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。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.13.6 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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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 |
| 华泰紫金港股通价值研选混合发起 A | 26 | 2,124,122.79 | 50,003,333.33 | 90.54% | 5,223,859.28 | 9.46% |
| 华泰紫金港股通价值研选混合发起 C | - | - | - | - | - | - |
| 合计 | 26 | 2,124,122.79 | 50,003,333.33 | 90.54% | 5,223,859.28 | 9.46% |

### 8.2 盈利投资者数量占比

本基金合同于2026年4月16日生效，截至报告期末本基金运作未满一年，不适用。

**8.3 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 | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 A | 5,110,107.27 | 9.25% |
| | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 C | 0.00 | 0.00% |
| | 合计 | 5,110,107.27 | 9.25% |

**8.4 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 | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 A | >100 |
| | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 C | 0 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 A | >100 |
| | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 C | 0 |
| | 合计 | >100 |

**8.5 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 | 50,003,333.33 | 90.54% | 50,000,000.00 | 90.54% | 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 | 50,003,333.33 | 90.54% | 50,000,000.00 | 90.54% | - |

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。

# 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 A | 华泰紫金港股通价值研选混合发起 C |
| --- | --- | --- |
| 基金合同生效日（2026 年 4 月 16 日）基金份额总额 | 55,360,887.65 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 85,674.78 | - |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 219,369.82 | - |
| 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 | 55,227,192.61 | - |

# 10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

## 10.2 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，基金托管人无重大人事变动。

本报告期内，江晓阳先生担任本基金管理人董事长，不再担任本基金管理人总经理；朱前女士担任本基金管理人总经理，不再担任本基金管理人副总经理；刘博文先生担任本基金管理人首席风险官；覃洁女士不再担任本基金管理人首席风险官；司晓彬先生担任本基金管理人副总经理。

## 10.3 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，无涉及基金托管业务的诉讼。

本告期内，无涉及基金管理人基金管理业务、基金财产的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期的投资策略无改变。

## 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金未投资基金。

## 10.6 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未发生变更。

## 10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

**10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况**

本报告期内，本基金管理人的高级管理人员及从业人员无受调查或处罚等情况。

**10.7.3 托管人受调查或处罚等情况**

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

**10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况**

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到受调查或处罚。

**10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况**

**10.8.1 基金租用或者通过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 | |
| 华泰证券 | 2 | 15,917,142.95 | 49.10% | 7,929.13 | 49.61% | - |
| 华创证券 | 2 | 12,555,853.37 | 38.73% | 6,101.65 | 38.18% | - |
| 信达证券 | 2 | 3,543,845.64 | 10.93% | 1,771.94 | 11.09% | - |
| 国金证券 | 2 | 401,531.00 | 1.24% | 178.98 | 1.12% | - |

注：1、管理人选择证券公司的标准：

（1）财务状况良好，经营行为稳健规范，在业内有良好的声誉。

（2）内控管理规范、制度健全，包括但不限于：有健全的业务管理制度和风险管理制度；有规范的运营管理制度和业务操作流程；合规管理制度体系健全、合规管理组织架构完整清晰、合规管理人员配备充足。

（3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

（4）具有较强的全方位服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据管理人的特定要求，提供专门研究报告，积极协助安排上市公司调研；能积极为管理人投资及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、管理人选择证券公司的程序：

（1）公司研究、投资、交易、合规、风控、运营等部门根据上述评价标准确定合作券商名单，提请公募投决会、督察长审议通过后形成白名单库，提供证券交易服务的证券公司需从白名单中确定。

（2）公司和被选中的证券公司签订协议，并通知基金托管人。

3、本报告期内本基金租用交易单元的变更情况：新增 2 个国金证券交易单元、新增 2 个华创证券交易单元、新增 2 个华泰证券交易单元、新增 2 个信达证券交易单元。

### 10.8.2 基金租用或者通过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 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券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 |
| 华泰证券 | 3,102,650.00 | 100.00% | 218,732,000.00 | 23.35% | - | - |
| 华创证券 | - | - | 391,089,000.00 | 41.75% | - | - |
| 信达证券 | - | - | 236,600,000.00 | 25.26% | - | - |
| 国金证券 | - | - | 90,400,000.00 | 9.65% | - | - |

### 10.9 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 | 华泰紫金港股通价值研选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 | 2026-04-17 |
| 2 | 关于华泰紫金港股通价值研选混合型发起式证券投资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 | 2026-04-24 |
| 3 | 华泰紫金港股通价值研选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 | 2026-04-24 |
| 4 | 2025 年度华泰证券（上海）资产管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露 | 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 | 2026-04-29 |

# 11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 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 | 2026-04-16 至 2026-06-30 | 50,003,333.33 | 0.00 | 0.00 | 50,003,333.33 | 90.54% |
| 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50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，存在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。 | | | | | | | |

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

# 12 备查文件目录

## 12.1 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、《华泰紫金港股通价值研选混合型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《华泰紫金港股通价值研选混合型发起式证券投资基金托管协议》；

4、《华泰紫金港股通价值研选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港股通价值研选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、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。

### 12.2 存放地点

文件存放在基金管理人、基金托管人的住所。

### 12.3 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**

**二〇二六年八月三十一日**