华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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 1 月 1 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.....12
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.....15
6.4 报表附注.....17
7 投资组合报告.....39
7.1 期末基金资产组合情况.....39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....39
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.....40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....40
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.....40
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.....41
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.....41
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.....41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....41
7.12 本报告期投资基金情况.....42
7.13 投资组合报告附注.....42

8 基金份额持有人信息.....43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....43
8.3 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.....43
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....44
9 开放式基金份额变动.....44
10 重大事件揭示.....45
10.1 基金份额持有人大会决议.....45
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.....45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....45
10.4 基金投资策略的改变.....45
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....45
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....45
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....45
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.....45
10.9 其他重大事件.....47
11 影响投资者决策的其他重要信息.....48
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.....48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....48
12 备查文件目录.....48
12.1 备查文件目录.....48
12.2 存放地点.....48
12.3 查阅方式.....48

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金	
基金简称	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起	
基金主代码	016093	
交易代码	016093	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 7 月 11 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	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	54,693,013.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 A	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 C
下属分级基金的交易代码	016093	016094
报告期末下属分级基金的份额总额	51,646,252.52 份	3,046,760.60 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
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。 2、久期策略；3、类属配置策略；4、信用债投资策略；5、杠杆投资策略；6、再投资策略；7、资产支持证券的投资策略；8、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债综合财富(1 年以下)指数收益率×60%+中债综合财富(1-3 年)指数收益率×30%+一年期定期存款利率(税后)×10%
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。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露	姓名	白海燕	冯萌

负责人	联系电话	4008895597	021-52629999-213310
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		4008895597	95561
传真		021-28972120	021-62159217
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区基隆路6号1222室	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
办公地址		上海市浦东新区东方路18号E座21楼	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码		200120	200120
法定代表人		江晓阳	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 A	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 C
本期已实现收益	617,333.50	74,149.70
本期利润	595,737.09	74,944.96
加权平均基金份额本期利润	0.0117	0.0105
本期加权平均净值利润率	1.07%	0.97%
本期基金份额净值增长率	1.08%	0.98%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 A	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 C
期末可供分配利润	5,102,042.85	273,079.40

期末可供分配基金份额利润	0.0988	0.0896
期末基金资产净值	56,797,900.80	3,322,857.76
期末基金份额净值	1.0997	1.0906
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 A	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 C
基金份额累计净值增长率	9.97%	9.06%

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。

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

华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 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
过去三个月	0.55%	0.01%	0.45%	0.01%	0.10%	0.00%
过去六个月	1.08%	0.01%	0.98%	0.01%	0.10%	0.00%
过去一年	1.97%	0.01%	1.77%	0.01%	0.20%	0.00%
过去三年	7.60%	0.02%	6.74%	0.01%	0.86%	0.01%
自基金合同生效起至今	9.97%	0.02%	9.39%	0.01%	0.58%	0.01%

华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 C

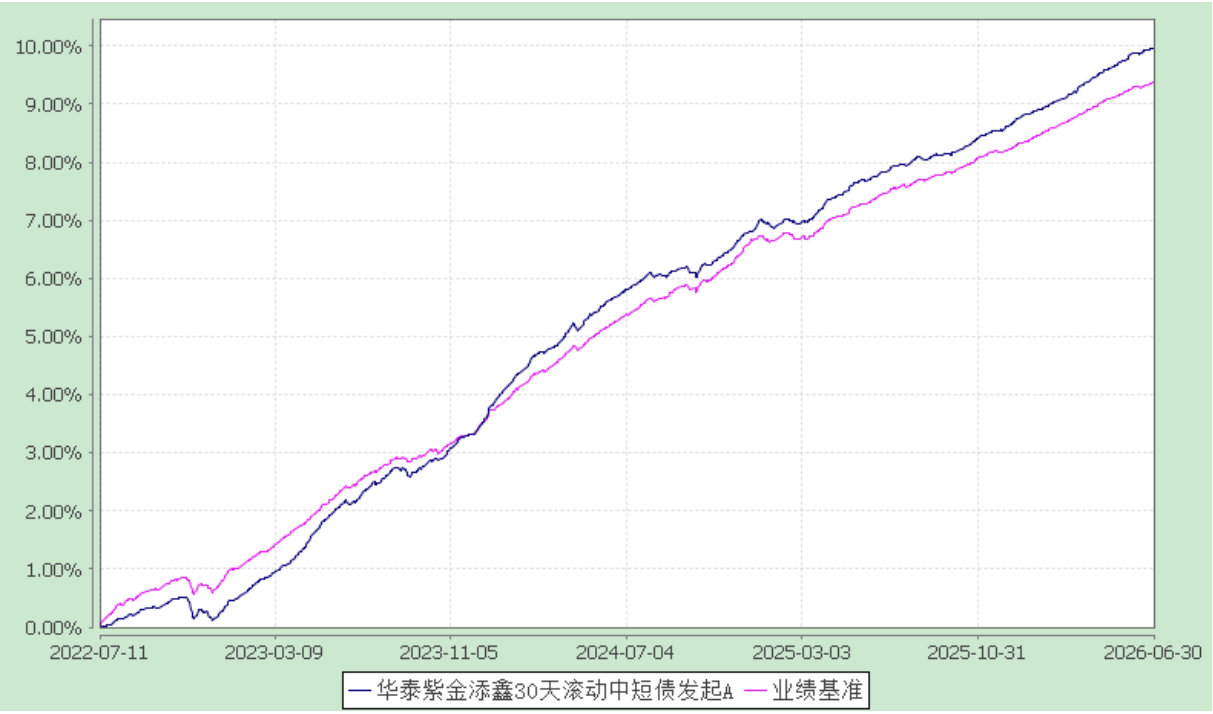
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.51%	0.01%	0.45%	0.01%	0.06%	0.00%
过去六个月	0.98%	0.01%	0.98%	0.01%	0.00%	0.00%
过去一年	1.75%	0.01%	1.77%	0.01%	-0.02%	0.00%
过去三年	6.95%	0.02%	6.74%	0.01%	0.21%	0.01%
自基金合同生效起至今	9.06%	0.02%	9.39%	0.01%	-0.33%	0.01%

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

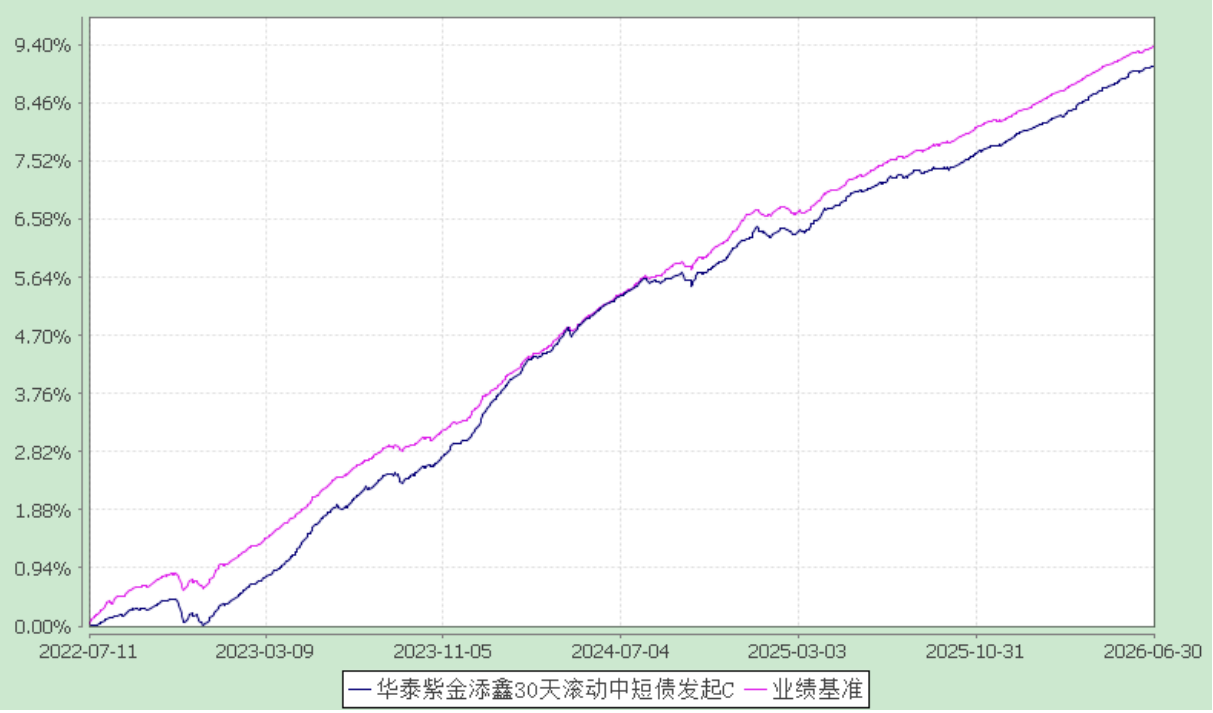
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2022 年 7 月 11 日至 2026 年 6 月 30 日）

华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 A



华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 C



注：本基金业绩比较基准=一年存款*10%+中债-综合指数(1-3 年)(财富)*30%+中债-综合指数(1 年以下)(财富)*60%。

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		
陈利	本基金的基金经理	2022-07-11	-	15	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。
钟英涛	本基金的基金经理助理	2024-05-06	-	10	中山大学学士，北京大学经济学硕士。9 年固定收益投研经验，曾供职于券商固收自营，2019 年加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，历任信用研究员。现任华泰紫金丰泰纯债债券型发起式证券投资基金、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等基金的基金经理助理。

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《华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券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

2026 年上半年，中国经济总体保持平稳运行态势。GDP 方面，上半年实际同比增长 4.7%，其

中一季度增长 5.0%，二季度回落至 4.3%。物价水平温和上涨，CPI 累计同比上涨 1.0%，通胀压力整体可控。PPI 同比由年初的-1.4%转正至 6 月的 4.1%，工业品价格明显回升。固定资产投资完成额累计同比下降 5.7%，投资信心仍需提振。消费方面，社会消费品零售总额上半年累计同比增长 1.3%，6 月当月同比增长 1.0%，但 5 月曾出现-0.6%的负增长，显示消费恢复动力不足，需求仍显疲软。出口方面表现亮眼，上半年，我国货物进出口总额同比增长 16.9%，外贸较快增长为上半年经济运行提供了重要支撑。货币环境方面，社会融资规模存量同比增长 7.4%，较年初的 8.2%有所回落，显示信用扩张节奏趋于审慎，货币政策保持稳健。总体来看，上半年经济在外部不确定性增加的背景下展现出韧性。

2026 年上半年债券市场走出"债牛"行情，10 年期国债收益率从年初 1.90%附近震荡下行至 6 月末的 1.73%左右，累计下行约 17BP。市场呈现三阶段特征：年初受权益市场走强和供给担忧影响，收益率一度冲高至 1.9%；1 月下旬后，在资金面宽松、基本面支撑共同作用下收益率转为下行；6 月初受央行公开市场操作影响，市场情绪短暂降温，但整体仍维持低位震荡。上半年债市走强的核心逻辑在于"资产荒"背景下配置需求旺盛、经济弱复苏格局延续以及货币政策维持宽松，利率债尤其是长端品种配置价值凸显。

投资运作方面，根据对基本面、政策面、市场行情等多方位的研判，本基金对组合久期进行了适度调节，2 月份适度降低了组合久期，3 月份开始适度拉长了组合久期，此后基本维持组合久期在今年以来的相对高位水平，与此同时，适度使用了杠杆策略，努力为投资人赚取与其风险偏好相匹配的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 类份额基金净值收益率为 1.08%，C 类份额基金净值收益率为 0.98%，同期业绩比较基准收益率为 0.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观经济预计延续“外强内弱”格局。出口虽具韧性但受高基数及海外需求不确定性影响，增速或边际放缓；内需方面，消费与投资修复仍需政策进一步发力，GDP 增速大概率维持在中速区间，基本面整体对债市偏多。同时，若三季度国内需求修复不及预期，不排除进一步加快国债、地方债发行，下半年支出追赶进度是大概率事件。总体而言，下半年债市扰动因素仍然较多，短端受益于资金宽松，确定性较高；长端虽受供给扰动及止盈压力影响，上半年“债牛”逻辑未变，但波动或加大。收益率下行斜率可能放缓，震荡磨底。

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

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 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本年度/中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：		-	-
货币资金	6.4.7.1	210,789.50	45,370.27
结算备付金		790,346.13	523,021.79
存出保证金		3,875.57	3,790.19
交易性金融资产	6.4.7.2	59,210,742.24	72,779,051.89
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		59,210,742.24	72,779,051.89
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	-	-
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		-	-
应收申购款		11,245.50	21,991.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		60,226,998.94	73,373,225.34
负债和净资产	**附注号**	**本期末**	**上年度末**

		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 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		-	399,911.89
应付清算款		-	110.14
应付赎回款		13,847.85	40,384.96
应付管理人报酬		9,972.63	13,248.40
应付托管费		2,493.18	3,312.10
应付销售服务费		685.77	2,761.78
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,375.98	2,179.74
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	75,864.97	102,413.75
负债合计		106,240.38	564,322.76
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	54,693,013.12	67,008,764.61
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	5,427,745.44	5,800,137.97
净资产合计		60,120,758.56	72,808,902.58
负债和净资产总计		60,226,998.94	73,373,225.34

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 54,693,013.12 份，其中 A 类基金份额净值 1.0997 元，基金份额总额 51,646,252.52 份；C 类基金份额净值 1.0906 元，基金份额总额 3,046,760.60 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		**885,954.05**	**2,530,881.79**
1.利息收入		6,501.73	16,239.87
其中：存款利息收入	6.4.7.10	6,501.73	9,110.50
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		-	7,129.37
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		900,253.47	2,945,177.13
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-	-
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	893,355.13	2,869,808.15
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	75,371.30
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	6,898.34	-2.32
股利收益	6.4.7.17	-	-
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	-20,801.15	-430,535.21
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	-	-
减：二、营业总支出		**215,272.00**	**540,293.05**
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	63,037.96	229,561.50
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	15,759.53	57,390.40
3．销售服务费		7,731.00	8,646.44
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		46,446.32	134,119.70
其中：卖出回购金融资产支出		46,446.32	134,119.70
6. 信用减值损失	6.4.7.21	-	-
7. 税金及附加		1,405.50	7,117.66
8．其他费用	6.4.7.22	80,891.69	103,457.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**670,682.05**	**1,990,588.74**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**670,682.05**	**1,990,588.74**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**670,682.05**	**1,990,588.74**

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 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	67,008,764.61	-	5,800,137.97	72,808,902.58
二、本期期初净资产	67,008,764.61	-	5,800,137.97	72,808,902.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,315,751.49	-	-372,392.53	-12,688,144.02
（一）、综合收益总额	-	-	670,682.05	670,682.05
（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）	-12,315,751.49	-	-1,043,074.58	-13,358,826.07
其中：1.基金申购款	9,415,368.48	-	860,834.20	10,276,202.68
2.基金赎回款	-21,731,119.97	-	-1,903,908.78	-23,635,028.75
（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	54,693,013.12	-	5,427,745.44	60,120,758.56
项目	**上年度可比期间** **2025 年 1 月 1 日至 2025 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	213,044,226.03	-	14,688,132.26	227,732,358.29
二、本期期初净资产	213,044,226.03	-	14,688,132.26	227,732,358.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	43,616,919.92	-	5,419,025.83	49,035,945.75
（一）、综合收益总额	-	-	1,990,588.74	1,990,588.74
（二）、本期基金份额交易产生的	43,616,919.92	-	3,428,437.09	47,045,357.01

净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	51,850,076.10	-	3,988,086.48	55,838,162.58
2.基金赎回款	-8,233,156.18	-	-559,649.39	-8,792,805.57
（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	256,661,145.95	-	20,107,158.09	276,768,304.04

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

华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券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”)《关于准予华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2022]1150 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《华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2022 年 7 月 11 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 200,140,183.26 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰资管，基金托管人为兴业银行股份有限公司 (以下简称“兴业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金基金合同》和《华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券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，包括债券（含国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、政府支持机构债、政府支持债、地方政府债、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货、货币市场工具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，但须符合中国证监会相关规定。

本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、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。

本基金的业绩比较基准为：中债综合财富(1 年以下)指数收益率×60%+中债综合财富(1-3 年)指数收益率×30%+一年期定期存款利率(税后)×10%

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 日的财务状况及 2026 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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 [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 号文《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》、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)对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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。

c)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。

d)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

	2026 年 6 月 30 日
活期存款	210,789.50
等于：本金	210,737.13
加：应计利息	52.37
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	210,789.50

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	13,070,129.91	143,713.98	13,183,413.98	-30,429.91
	银行间市场	45,666,829.84	375,038.26	46,027,328.26	-14,539.84
	合计	58,736,959.75	518,752.24	59,210,742.24	-44,969.75
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		58,736,959.75	518,752.24	59,210,742.24	-44,969.75

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 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	12,017.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	12,017.00
应付利息	-
预提费用	63,847.97
合计	75,864.97

6.4.7.8 实收基金

华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,144,827.04	55,144,827.04
本期申购	7,121,030.86	7,121,030.86
本期赎回（以“-”号填列）	-10,619,605.38	-10,619,605.38
本期末	51,646,252.52	51,646,252.52

华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期

	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,863,937.57	11,863,937.57
本期申购	2,294,337.62	2,294,337.62
本期赎回（以“-”号填列）	-11,111,514.59	-11,111,514.59
本期末	3,046,760.60	3,046,760.60

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

华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,776,756.58	74,310.08	4,851,066.66
本期期初	4,776,756.58	74,310.08	4,851,066.66
本期利润	617,333.50	-21,596.41	595,737.09
本期基金份额交易产生的变动数	-292,047.23	-3,108.24	-295,155.47
其中：基金申购款	651,142.22	11,871.42	663,013.64
基金赎回款	-943,189.45	-14,979.66	-958,169.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,102,042.85	49,605.43	5,151,648.28

华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	932,767.83	16,303.48	949,071.31
本期期初	932,767.83	16,303.48	949,071.31
本期利润	74,149.70	795.26	74,944.96
本期基金份额交易产生的变动数	-733,838.13	-14,080.98	-747,919.11
其中：基金申购款	193,806.00	4,014.56	197,820.56
基金赎回款	-927,644.13	-18,095.54	-945,739.67
本期已分配利润	-	-	-

本期末	273,079.40	3,017.76	276,097.16

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,384.29
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	3,108.63
其他	8.81
合计	6,501.73

6.4.7.11 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

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

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	680,862.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	212,492.97
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	893,355.13

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	348,494,007.41

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	344,919,550.18
减：应计利息总额	3,348,506.76
减：交易费用	13,457.50
买卖债券差价收入	212,492.97

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
国债期货投资收益	6,898.34

6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-20,801.15
——股票投资	-
——债券投资	-20,801.15
——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	-20,801.15

6.4.7.19 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

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 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行手续费	7,743.72
账户维护费	18,600.00
合计	80,891.69

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
兴业银行股份有限公司	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”）	基金管理人的控股股东、基金销售机构

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	12,737,310.00	100.00%	90,695,525.00	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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	251,200,000.00	100.00%	10,400,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	63,037.96	229,561.50
其中：应支付销售机构的客户维护费	22,250.74	70,867.09
应支付基金管理人的净管理费	40,787.22	158,694.41

注：本基金的基金管理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：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,759.53	57,390.40

注：本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05%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×0.05%/当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 A	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 C	合计
华泰证券股份有限公司	-	1,128.52	1,128.52
兴业银行股份有限公司	-	5,216.99	5,216.99
合计	-	6,345.51	6,345.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰紫金添鑫30天滚动中短债发起A	华泰紫金添鑫30天滚动中短债发起C	合计
华泰证券股份有限公司	-	3,359.77	3,359.77
兴业银行股份有限公司	-	3,260.12	3,260.12
合计	-	6,619.89	6,619.89

注：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 0.2%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×0.2%/当年天数。

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间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

本期及上年度可比期间，本基金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

本期及上年度可比期间，本基金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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	华泰紫金添鑫30天滚动中短债发起A	华泰紫金添鑫30天滚动中短债发起C	华泰紫金添鑫30天滚动中短债发起A	华泰紫金添鑫30天滚动中短债发起C
报告期初持有的基金份额	8,481,810.18	-	200,036,000.18	-
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	8,481,810.18	-	200,036,000.18	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.42%	-	79.74%	-

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

本基金本报告期末及上年度末无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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	210,789.50	3,384.29	863,969.23	7,283.22

注：本基金的上述银行存款由基金托管人兴业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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金是一只债券型基金，在证券投资基金中属于中等风险的品种，其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括债券(含国债,金融债,央行票据,企业债,公司债,中期票据,政府支持机构债,政府支持债,地方政府债,公开发行的次级债,可分离交易可转债的纯债部分,短期融资券,超短期融资券),资产支持证券,债券回购,银行存款(协议存款,通知存款,定期存款及其他银行存款),同业存单,国债期货,货币市场工具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,但须符合中国证监会相关规定.本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外),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。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于货币市场基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。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。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	3,036,427.40
A-1 以下	-	-
未评级	24,235,257.23	40,270,766.52
合计	24,235,257.23	43,307,193.92

注：1、持有发行期限在一年以内（含）的债券按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为长期信用评级进行列示；

2、未评级部分为国债、企业短期融资债券和企业超短期融资债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末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

本基金本报告期末及上年度末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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	18,889,145.29	21,333,135.84
AAA 以下	-	-
未评级	16,086,339.72	8,138,722.13
合计	34,975,485.01	29,471,857.97

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；

2、未评级部分为国债和中期票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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，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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。此外本基金还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，本基金债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过 40%。

本期末，本基金所持有的其他金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计

息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中的 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本基金所持有大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人根据质押品的资质确定质押率水平，持续检测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与本基金合同约定的投资范围保持一致。

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。

本基金主要投资于交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	210,789.50	-	-	-	210,789.50
结算备付金	790,346.13	-	-	-	790,346.13
存出保证金	3,875.57	-	-	-	3,875.57
交易性金融资产	40,483,015.54	10,998,908.21	7,728,818.49	-	59,210,742.24
应收申购款	-	-	-	11,245.50	11,245.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-
资产总计	41,488,026.74	10,998,908.21	7,728,818.49	11,245.50	60,226,998.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,847.85	13,847.85
应付管理人报酬	-	-	-	9,972.63	9,972.63
应付托管费	-	-	-	2,493.18	2,493.18
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	685.77	685.77
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,375.98	3,375.98
应付证券清算款	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	75,864.97	75,864.97
负债总计	-	-	-	106,240.38	106,240.38
利率敏感度缺口	41,488,026.74	10,998,908.21	7,728,818.49	-94,994.88	60,120,758.56
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	45,370.27	-	-	-	45,370.27
结算备付金	523,021.79	-	-	-	523,021.79
存出保证金	3,790.19	-	-	-	3,790.19
交易性金融资产	64,551,025.37	3,108,697.75	5,119,328.77	-	72,779,051.89
应收申购款	-	-	-	21,991.20	21,991.20
应收证券清算款	-	-	-	-	-
资产总计	65,123,207.62	3,108,697.75	5,119,328.77	21,991.20	73,373,225.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	40,384.96	40,384.96
应付管理人报酬	-	-	-	13,248.40	13,248.40
应付托管费	-	-	-	3,312.10	3,312.10
卖出回购金融资产款	399,911.89	-	-	-	399,911.89
应付销售服务费	-	-	-	2,761.78	2,761.78
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,179.74	2,179.74
应付证券清算款	-	-	-	110.14	110.14
其他负债	-	-	-	102,413.75	102,413.75
负债总计	399,911.89	-	-	164,410.87	564,322.76
利率敏感度缺口	64,723,295.73	3,108,697.75	5,119,328.77	-142,419.67	72,808,902.58

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	117,659.90	141,020.60
	市场利率上升 25 个基点	-116,945.76	-140,358.67

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	59,210,742.24	98.49	72,779,051.89	99.96
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	59,210,742.24	98.49	72,779,051.89	99.96

注：其他为资产支持证券。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资占基金资产净值的比例为 0.00%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	59,210,742.24	72,779,051.89
第三层次	-	-
合计	59,210,742.24	72,779,051.89

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	59,210,742.24	98.31
	其中：债券	59,210,742.24	98.31
	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	-	-
	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	1,001,135.63	1.66
8	其他各项资产	15,121.07	0.03
9	合计	60,226,998.94	100.00

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

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期未投资股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期未投资股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期未投资股票。

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	5,048,526.03	8.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,728,818.49	12.86
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	8,134,887.95	13.53
5	企业短期融资券	20,193,287.91	33.59
6	中期票据	18,105,221.86	30.11
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,210,742.24	98.49

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	2123016	21 阳光财险	50,000.00	5,183,089.04	8.62
2	240335	23 招证 11	50,000.00	5,097,120.00	8.48
3	102484973	24 冀能股份 MTN003A	50,000.00	5,087,431.51	8.46
4	042580394	25 南京港 CP001	50,000.00	5,077,278.90	8.45
5	019792	25 国债 19	40,000.00	4,041,969.32	6.72

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

为有效控制债券投资的系统性风险，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，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。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金充分结合国内外宏观经济和货币政策的分析，对于债券市场利率走势做出判断，以套期保值为主要目的进行了国债期货投资。该操作较好地对冲了利率风险、流动性风险，降低了基金的净值波动，将回撤保持在可控范围内。本基金国债期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金未投资基金。

7.12.2 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

本基金未投资基金。

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中，工商银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行和国家外汇管理局的处罚，阳光财险在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局山东监管局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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

本基金本报告期末未持有股票。

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	3,875.57
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,245.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,121.07

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

本基金本报告期末未持有股票。

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
华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 A	681	75,838.84	42,719,275.92	82.72%	8,926,976.60	17.28%
华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 C	150	20,311.74	0.00	0.00%	3,046,760.60	100.00%
合计	831	65,815.90	42,719,275.92	78.11%	11,973,737.20	21.89%

8.2 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	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 A	94,995.22	0.18%
	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 C	20,974.14	0.69%
	合计	115,969.36	0.21%

8.3 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	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 A	0
	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 A	0~10
	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 C	0
	合计	0~10

8.4 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	8,481,810.18	15.51%	8,481,810.18	15.51%	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	8,481,810.18	15.51%	8,481,810.18	15.51%	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。

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰紫金添鑫 30 天滚动中短债发起 A	华泰紫金添鑫30天滚动中短债发起 C
基金合同生效日（2022 年 7 月 11 日）基金份额总额	200,086,254.61	53,928.65
本报告期期初基金份额总额	55,144,827.04	11,863,937.57
本报告期基金总申购份额	7,121,030.86	2,294,337.62
减：本报告期基金总赎回份额	10,619,605.38	11,111,514.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	51,646,252.52	3,046,760.60

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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

本报告期内未发生涉及基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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

无。

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

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总额的比例		金总量的比例	
华泰证券	2	-	-	-	-	-

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证券公司交易单元无变更。

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	12,737,310.00	100.00%	251,200,000.00	100.00%	-	-

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	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 4 季度报告的提示性公告	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	2026-01-22
2	华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	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	2026-01-22
3	华泰证券（上海）资产管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2026-01-24
4	华泰证券（上海）资产管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2026-03-21
5	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	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	2026-03-23
6	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2025 年度报告的提示性公告	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	2026-03-31
7	华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	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	2026-03-31
8	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2026 年第 1 季度报告的提示性公告	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	2026-04-22
9	华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	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	2026-04-22
10	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	华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金招募说明书更新 202605	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	2026-05-16
12	华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新(202605)	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	2026-05-16

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

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。

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、《华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金托管协议》；

4、《华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券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添鑫 30 天滚动持有中短债债券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