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

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰紫金丰安 27 个月定开债券发起
基金主代码	009844
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 24 日
报告期末基金份额总额	7,987,214,209.28 份
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。 封闭期内，本基金主要有以下投资策略：资产配置策略、类属配置策略、信用债投资策略、资产支持证券的投资策略、放大策略。 （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。	
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	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金丰安 27 个月定开债券发起 A	华泰紫金丰安 27 个月定开债券发起 C
下属分级基金的交易代码	009844	009845
报告期末下属分级基金的份额总额	7,986,040,232.92 份	1,173,976.36 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)	
	华泰紫金丰安 27 个月定开债券发起 A	华泰紫金丰安 27 个月定开债券发起 C
1.本期已实现收益	35,800,041.69	4,952.81
2.本期利润	35,800,041.69	4,952.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.0045	0.0042
4.期末基金资产净值	8,194,089,191.72	1,202,688.45
5.期末基金份额净值	1.0261	1.0245

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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

1、华泰紫金丰安 27 个月定开债券发起 A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.44%	0.01%	0.91%	0.01%	-0.47%	0.00%
过去六个月	1.00%	0.01%	1.80%	0.01%	-0.80%	0.00%
过去一年	1.75%	0.01%	3.60%	0.01%	-1.85%	0.00%
过去三年	6.43%	0.01%	10.81%	0.01%	-4.38%	0.00%

过去五年	12.49%	0.01%	18.01%	0.01%	-5.52%	0.00%
自基金合同生效起至今	15.99%	0.01%	21.68%	0.01%	-5.69%	0.00%

2、华泰紫金丰安 27 个月定开债券发起 C：

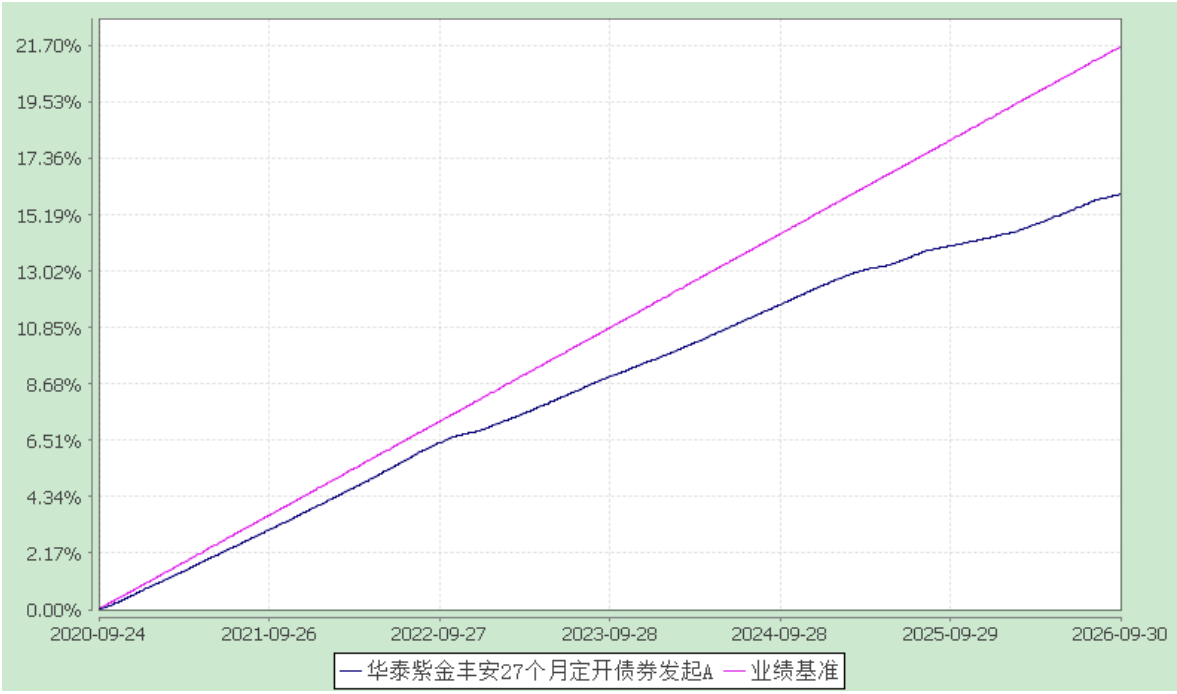
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.42%	0.01%	0.91%	0.01%	-0.49%	0.00%
过去六个月	0.95%	0.01%	1.80%	0.01%	-0.85%	0.00%
过去一年	1.64%	0.01%	3.60%	0.01%	-1.96%	0.00%
过去三年	6.11%	0.01%	10.81%	0.01%	-4.70%	0.00%
过去五年	11.92%	0.01%	18.01%	0.01%	-6.09%	0.00%
自基金合同生效起至今	15.28%	0.01%	21.68%	0.01%	-6.40%	0.00%

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

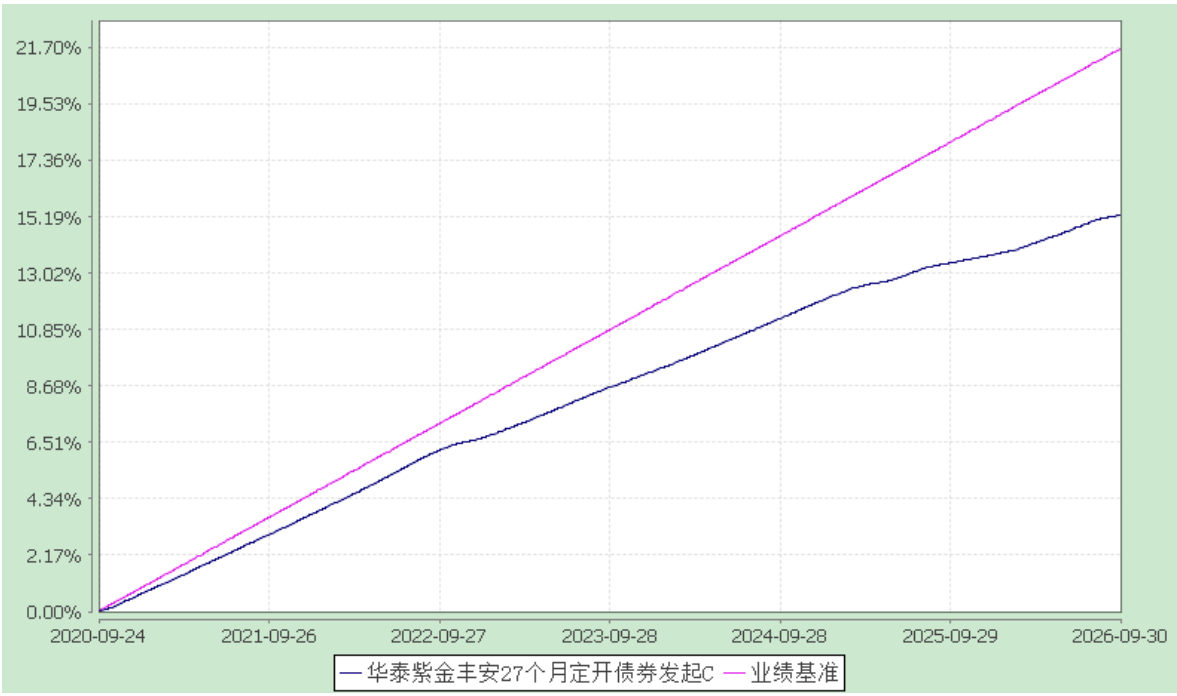
华泰紫金丰安 27 个月定期开放债券型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 9 月 24 日至 2026 年 9 月 30 日)

1．华泰紫金丰安 27 个月定开债券发起 A：



2．华泰紫金丰安 27 个月定开债券发起 C：



注：本基金业绩比较基准=两年期定期存款利率(税后)+1.5%。

§ 4　管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘鹏飞	本基金的基金经理	2021-08-16	-	10	清华大学工学学士、硕士，先后就职于东莞证券股份有限公司资产管理部、广发基金管理有限公司，从事债券交易、研究工作。2020 年 4 月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，现担任基金经理。

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

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

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《华泰紫金丰安 27 个月定期开放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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司建立了公募基金投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司股票池和债券库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合

既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，经济基本面延续“动能向新、结构向优”的 K 型分化格局，出口在关税博弈下仍保持韧性，但内需修复仍偏缓，信贷增速延续回落，消费与地产投资仍存压力，制造业 PMI 则于 9 月重回扩张区间。物价方面，PPI 于 7 月见顶后高位回落，CPI 则温和回升。政策层面，货币政策维持宽松基调，7 月政治局会议提出“综合运用并适时调整货币政策工具”“加大逆周期调节力度”，同时央行 7 月起启动隔夜 OMO 呵护关键时点流动性，资金利率稳定偏松。

债券市场方面，三季度债市以“基本面弱现实与资产荒”为核心主线，在政治局会议宽松定调、央行流动性呵护下整体震荡走强，收益率曲线显著平坦化。分月份看，7 月中上旬 10 年期国债在 1.72%-1.74%区间震荡；7 月下旬“存款降息”预期发酵，月末政治局会议宽松信号推动收益率突破向下至 1.70%。8 月中上旬央行“保持流动性充裕”基调叠加偏弱基本面数据，长端进一步走强，8 月下旬止盈情绪升温，长端小幅回调。9 月中下旬公积金降息预期与央行跨季呵护推动超长债领衔突破，月末在政策扰动与节前止盈下略有回调。信用债方面，在资金偏松和 5 年摊余债基获批推动下，信用利差普遍收窄。

组合操作上，在严控信用风险前提下，组合持续进行再配置，将组合杠杆维持在较高位置。

4.5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0.44%，C类份额基金净值收益率为0.42%，同期业绩比较基准收益率为 0.91%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	9,486,197,956.02	98.38
	其中：债券	9,486,197,956.02	98.38
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	45,785,498.77	0.47
7	其他各项资产	109,932,094.63	1.14
8	合计	9,641,915,549.42	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,066,941.50	0.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,132,539,571.15	50.43
5	企业短期融资券	10,062,115.89	0.12
6	中期票据	5,338,529,327.48	65.14
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,486,197,956.02	115.75

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	137570	22 舟交 02	1,200,000.00	122,301,629.87	1.49
2	524259	25 国海 01	1,200,000.00	120,759,491.60	1.47
3	102483317	24 武进经发 MTN005	1,200,000.00	120,566,229.68	1.47

4	240715	24 知投 02	1,100,000.00	111,854,726.41	1.36
5	152504	20 梅溪湖	1,100,000.00	110,543,615.14	1.35

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11投资组合报告附注

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

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

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,108.72
2	应收证券清算款	109,928,985.91
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	109,932,094.63

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰紫金丰安27个月定开债券发起A	华泰紫金丰安27个月定开债券发起C
本报告期期初基金份额总额	7,986,040,232.92	1,173,976.36
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,986,040,232.92	1,173,976.36

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	华泰紫金丰安27个月定开债券发起A	华泰紫金丰安27个月定开债券发起C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,900.09	-
本报告期买入/申购总份额	-	-
本报告期卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,900.09	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.13	-

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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内管理人运用固有资金投资本基金份额未发生变动。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,900.09	0.13%	10,000,000.00	0.13%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,900.09	0.13%	10,000,000.00	0.13%	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 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 10 备查文件目录

10.1备查文件目录

1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；

2、《华泰紫金丰安 27 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《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托管协议》；

4、《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丰安 27 个月定期开放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。

10.2存放地点

文件存放在基金管理人、基金托管人的住所。

10.3查阅方式

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

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二六年十月二十七日