

# 华泰保兴货币市场基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰保兴基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 年 4 月 20 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 债券回购融资情况.....	43
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	44
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	45
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	46
7.8 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.....	46
7.9 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	52
10.9 其他重大事件.....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>54</b>
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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>55</b>

12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰保兴货币市场基金	
基金简称	华泰保兴货币	
基金主代码	004493	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 4 月 20 日	
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,070,936,997.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰保兴货币 A	华泰保兴货币 B
下属分级基金的交易代码:	004493	004494
报告期末下属分级基金的份额总额	19,600,849.13 份	5,051,336,148.05 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上，力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下，结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，采取主动性的投资策略和精细化的操作手法，在控制的前提下，实现基金的投资目标。	
业绩比较基准	中国人民银行公布的 7 天通知存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
	华泰保兴货币 A	华泰保兴货币 B
下属分级基金的风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基

	预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	金的预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
--	--------------------------------	----------------------------------

### 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		华泰保兴基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	尤小刚	王永民
	联系电话	021-80299000	010-66594896
	电子邮箱	fund_xxpl@ehuatai.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-632-9090	95566
传真		021-60963566	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号 4306 室	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号金茂大厦 4306 室	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		杨平	田国立

### 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、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ehuataifund.com
基金半年度报告备置地点	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	华泰保兴基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号金茂大厦 4306 室

### § 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

基金级别	华泰保兴货币 A	华泰保兴货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2017 年 4 月 20 日 - 2017 年 6 月 30 日 )	报告期( 2017 年 4 月 20 日 - 2017 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	202, 155. 50	26, 178, 302. 17
本期利润	202, 155. 50	26, 178, 302. 17
本期净值收益率	0. 7348%	0. 7824%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	19, 600, 849. 13	5, 051, 336, 148. 05
期末基金份额净值	1. 0000	1. 0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	0. 7348%	0. 7824%

注：1、本基金合同生效日为 2017 年 4 月 20 日，截止报告期末基金合同生效未满半年。

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，由于货币市场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、本基金收益分配为按月结转份额。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰保兴货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0. 3377%	0. 0025%	0. 1110%	0. 0000%	0. 2267%	0. 0025%



自基金合同 生效起至今	0.7348%	0.0021%	0.2663%	0.0000%	0.4685%	0.0021%
----------------	---------	---------	---------	---------	---------	---------

华泰保兴货币 B

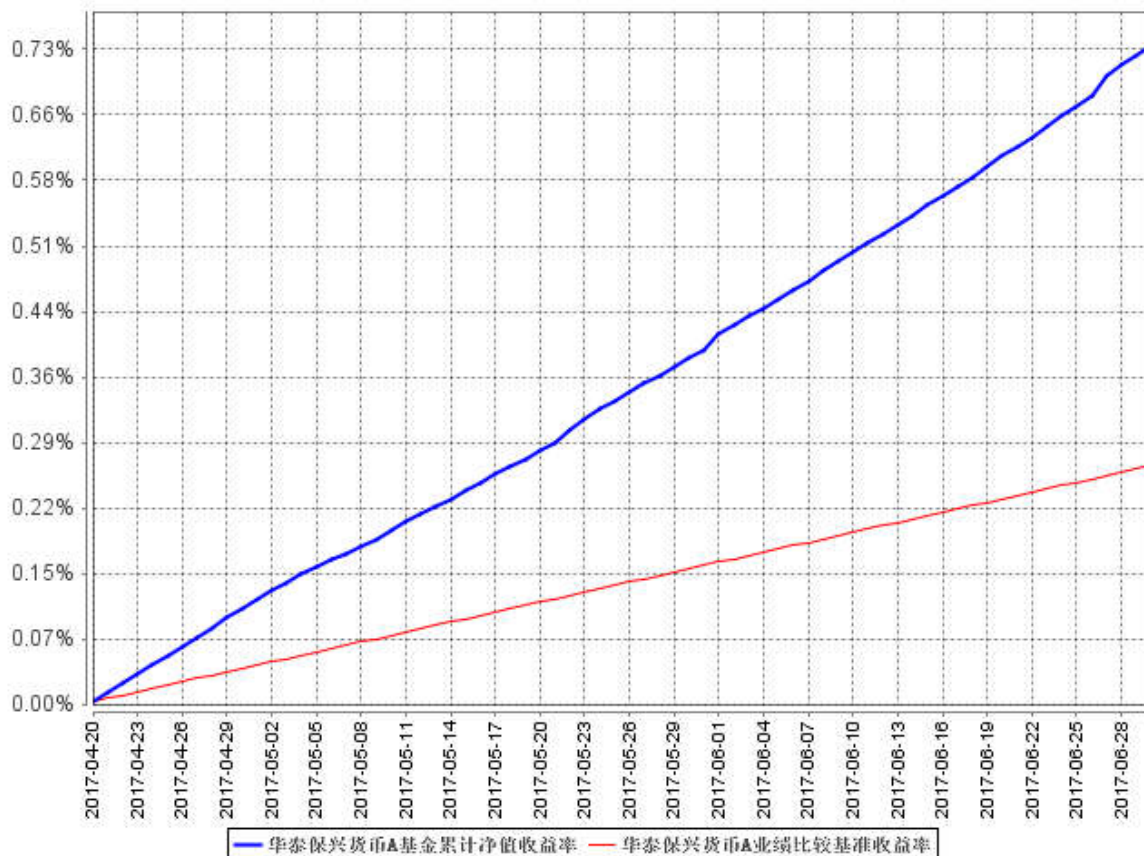
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3576%	0.0025%	0.1110%	0.0000%	0.2466%	0.0025%
自基金合同 生效起至今	0.7824%	0.0022%	0.2663%	0.0000%	0.5161%	0.0022%

注：1、本基金基金合同于 2017 年 4 月 20 日生效，截止报告期末基金合同生效未满半年。

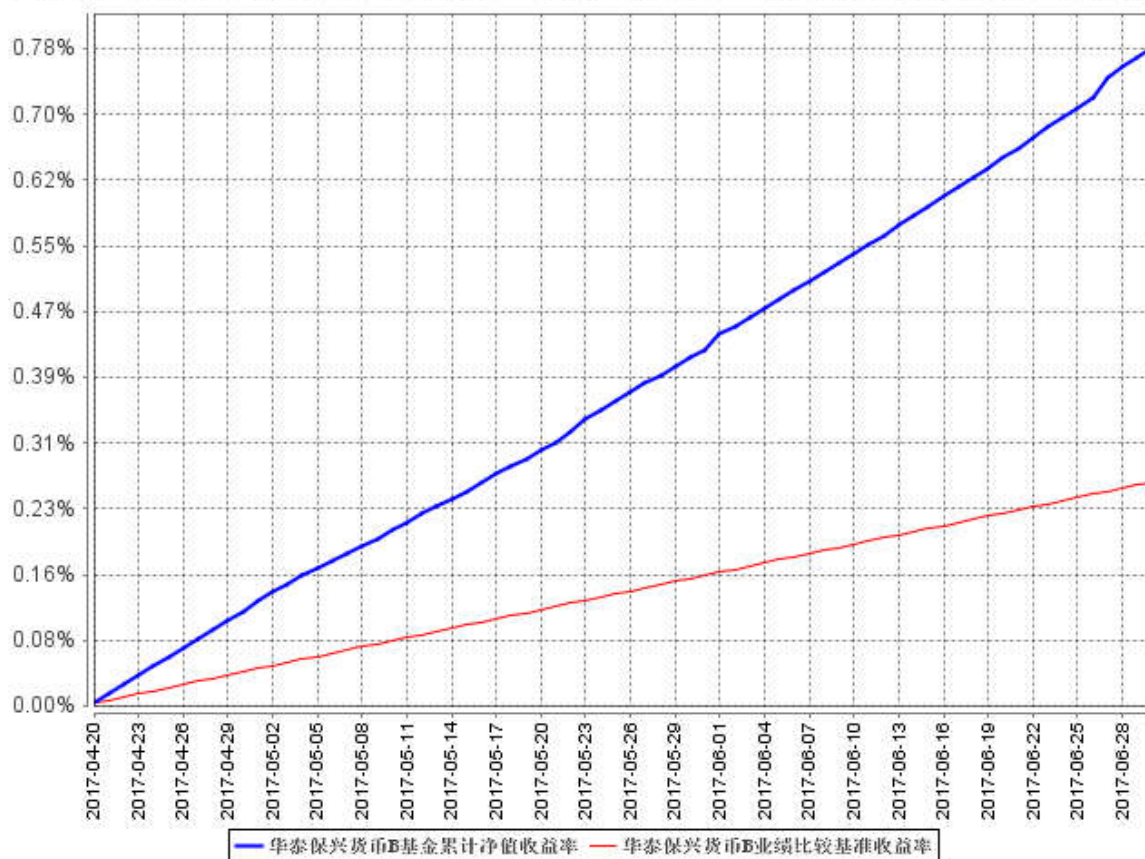
2、本基金业绩比较基准为：中国人民银行公布的 7 天通知存款利率（税后）。

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

华泰保兴货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰保兴货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2017 年 4 月 20 日生效，截止报告期末基金合同生效未满半年。  
 2、按照本基金基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截止报告期末本基金尚未完成建仓。

## § 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

华泰保兴基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2016]1309 号文核准，于 2016 年 7 月 26 日成立，注册资本 1.2 亿元人民币，公司股东分别为华泰保险集团股份有限公司（下称“华泰保险集团”）、上海飞恒资产管理中心（有限合伙）（下称“飞恒资产”）、上海旷正资产管理中心（有限合伙）（下称“旷正资产”）、上海泰颐资产管理中心（有限合伙）（下称“泰颐资产”）、上海哲昌资产管理中心（有限合伙）（下称“哲昌资产”）、上海志庄资产管理中心（有限合伙）（下称“志庄资产”），其中，华泰保险集团持股比例为 80%，飞恒资产、旷正资产、泰颐资产、哲昌资产、志庄资产均为公司高级管理人员及核心业务骨干股权激励持股平台，合计持股比例为 20%。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司资产管理总规模为 143.9 亿元，其中公募基金管理规模为 54.21 亿元，包括华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金、华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金、华泰保兴货币市场基金等 3 只产品。

#### 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		
张挺	本基金基金经理、华泰保兴尊诚定开基金基金经理	2017 年 4 月 20 日	-	6 年	上海财经大学经济学硕士。历任华泰资产管理有限公司固定收益组合管理部债券研究员、投资助理、投资经理。在华泰资产管理有限公司任职期间，曾管理组合类保险资产管理产品、集合型企业年金计划等。2016 年 8 月加入华泰保兴基金管理有限公司。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决

定确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》及其他相关法律法规、规范性文件要求和本基金基金合同约定，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，基金运作无违法违规、未履行基金合同或其他损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

公司公平交易制度的执行情况主要包括：公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究报告发布和信息共享平台，使各投资组合得到公平的投资研究服务；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行投资授权制度及授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度，以“时间优先、价格优先”为基本原则，结合投资交易系统内的公平交易模块，尽最大可能保证公平对待各投资组合；建立各投资组合投资信息严格管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对各投资组合投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

本报告期内，各投资组合不存在因非公平交易等导致的利益输送行为及其他违反公平交易制度的情况，公平交易制度的整体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待不同的投资组合，公司制定《异常交易监控与报告制度》对涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行了界定，并拟定相应的监控、识别、分析与防控措施；公司禁止同一交易日内同一投资组合内部、不同投资组合之间的反向交易以及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。

公司对各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5

日) 内的同向交易、反向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验, 未发现违反公平交易制度的异常交易行为。

本报告期内, 未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 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

上半年, 国内经济运行稳中有升, 全国房地产销售面积增速同比有所回落, 但仍处于正增长, 三四线城市房地产市场去库存效果良好, 带动房地产投资回升。物价方面, 工业品价格高位略有回落, 居民消费价格指数受猪肉价格下滑的影响总体处于低位, 整体通胀压力不大。债券市场的关注重点在于去杠杆政策, 随着监管政策的推进, 叠加资金面紧张因素, 债券市场一度大幅下跌, 资金面较为紧张, 收益率曲线平坦化, 之后监管更加注重协调和稳定, 6 月上旬资金预期较紧, 但随着央行投放 28 天逆回购和加强市场沟通, 下旬资金转为平稳。

报告期内, 基金操作上除了做好日常流动性管理以外, 注重在资金面分析的基础上合理安排资产的到期期限。将大部分资产的到期日安排在 6 月中旬, 在同业存单利率上行后加大了配置力度, 适度拉长剩余期限, 并在季末资金利率高企时通过质押式回购积极融出资金, 在保证基金流动性的前提下增强收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期华泰保兴货币 A 的基金份额净值收益率为 0.7348%, 本报告期华泰保兴货币 B 的基金份额净值收益率为 0.7824%, 同期业绩比较基准收益率为 0.2663%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年, 经济运行仍将保持良好态势, 主要原因在于房地产市场去库存情况理想, 未来半年房地产投资难以显著下行, 从而给下游工业品需求带来支撑。同时, 人民币有效汇率指数上半年出现一定修复, 海外经济形势较好, 可能使得贸易盈余有所回升, 也有利于经济增速保持高位。四季度工业品价格同比回落可能会对经济带来一些负面影响, 但程度预计较为轻微。

从债券市场来看, 严监管仍然会继续推进, 但也会注意监管协调, 货币政策可能会保持不紧不松, 货币市场利率仍然会保持在一个中性偏高的水平, 综合考虑, 同业存单仍然具备较高的投资价值, MPA 考核时点仍然需要注意防范流动性阶段性紧张风险。

基金操作上，主要配置方向仍然是全国性股份制银行同业存单和同业存款，加强对资金面的分析，做好流动性管理，防范 MPA 考核时点流动性紧张风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理、科学和一贯性，保护基金份额持有人的合法权益，成立了估值委员会。估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会委员由分管运营的副总经理、研究部、风险管理部、监察稽核部和运营保障部的指定人员担任。估值委员会委员均具备良好的专业胜任能力，在基金估值研究或运作方面具有丰富经验。

研究部负责对特殊投资品种估值进行分析研究，并就可能影响投资品种公允价值的重大事项进行监控和报告，对拟采用的估值方法进行初步判断，提出适用的估值模型和参数；风险管理部负责对特殊投资品种的估值方法和估值模型进行研究，通过实证分析等方法完善估值模型，验证研究部提供的估值模型参数并协助提供数据支持文件；监察稽核部检查、督促相关部门严格遵守法规和公司制度的规定，采用适当程序进行基金估值及调整；检查、督促相关部门及时进行信息披露；根据相关规定及估值委员会的决议对估值相关公告进行合规性审核；运营保障部根据相关法规和本办法对基金进行估值；根据指定方法监控并汇报基金持有停牌股票的情况，根据公司估值委员会的决议进行估值并与托管人核对，与会计师事务所沟通；根据相关法规规定及时进行信息披露。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场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）的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同中收益分配的有关规定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每月集中支付。本报告期内本基金应分配收益 26,380,457.67 元，实际分配收益 26,380,457.67 元。

#### 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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰保兴货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确、完整。

## § 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：华泰保兴货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	967,912,590.68
结算备付金		5,995,373.91
存出保证金		41,914.42
交易性金融资产	6.4.7.2	1,762,697,673.67
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,762,697,673.67
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,431,122,431.67
应收证券清算款		113,772.63
应收利息	6.4.7.5	13,228,225.73
应收股利		-
应收申购款		350,000.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		5,181,461,982.71
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>



<b>负 债：</b>		
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		108,899,716.65
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		647,196.33
应付托管费		196,120.10
应付销售服务费		23,895.83
应付交易费用	6.4.7.7	30,768.76
应交税费		-
应付利息		28,316.10
应付利润		606,533.36
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	92,438.40
负债合计		110,524,985.53
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	5,070,936,997.18
未分配利润	6.4.7.10	-
所有者权益合计		5,070,936,997.18
负债和所有者权益总计		5,181,461,982.71

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，华泰保兴货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 19,600,849.13 份；华泰保兴货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 5,051,336,148.05 份。华泰保兴货币份额总额合计为 5,070,936,997.18 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰保兴货币市场基金

本报告期：2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		29,973,777.57
1.利息收入		29,115,461.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	22,797,967.50
债券利息收入		4,814,810.60
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,502,683.11
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		858,316.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	858,316.36
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
<b>减：二、费用</b>		3,593,319.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,209,041.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	669,406.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	80,078.42

4. 交易费用	6.4.7.19	-
5. 利息支出		513,974.45
其中：卖出回购金融资产支出		513,974.45
6. 其他费用	6.4.7.20	120,819.08
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		26,380,457.67
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		26,380,457.67

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰保兴货币市场基金

本报告期：2017 年 4 月 20 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	5,833,947,478.52	-	5,833,947,478.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,380,457.67	26,380,457.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-763,010,481.34	-	-763,010,481.34
其中：1. 基金申购款	4,826,118,238.97	-	4,826,118,238.97
2. 基金赎回款	-5,589,128,720.31	-	-5,589,128,720.31



现收益和 7 日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括：现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰保兴基金管理有限公司于 2017 年 8 月 26 日批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰保兴货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2017 年 4 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 4 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **6.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 4 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 06 月 30 日。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资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。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资或资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资或资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）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；或者（3）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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资或资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资或资产支持证券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资或资产支持证券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 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。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因级别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 6.4.4.8 损益平准金

不适用。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式为红利再投资；“每日分配、按月支付”，本基金根据每日基金收益情况，以各类基金份额的每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每月集中支付，投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；当月收益结转时，如投资人的累计未结转收益为正，则为份额持有人增加相应的基金份额；如投资人的累计未结转收益为负，则为份额持有人缩减相应的基金份额；如投资人的累计未结转收益等于零时，份额持有人的基金份额保持不变；当日申购的基金份额自下一个交易日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个交易日起，不享有基金的收益分配权益；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 6.4.4.12 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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、



经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资或资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 在银行间同业市场交易的债券和资产支持证券品种，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券和资产支持证券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

### **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**

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期内未发生会计估计变更。

#### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正事项。

### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[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《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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[2016]36号《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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市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。

(4) 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	47,912,590.68
定期存款	920,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	200,000,000.00
存款期限 3 个月-1 年	720,000,000.00
其他存款	-
合计：	967,912,590.68

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	73,092,986.81	73,076,527.30	-16,459.51	-0.0003%
	银行间市场	1,689,604,686.86	1,691,161,000.00	1,556,313.14	0.0307%
	合计	1,762,697,673.67	1,764,237,527.30	1,539,853.63	0.0304%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

### 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 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	2,181,122,431.67	-
买入返售证券	250,000,000.00	-
合计	2,431,122,431.67	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	9,723.09
应收定期存款利息	5,171,499.99
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,697.90
应收债券利息	7,004,377.79
应收买入返售证券利息	1,039,908.06
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	18.90
合计	13,228,225.73

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	30,768.76
合计	30,768.76

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	92,438.40
合计	92,438.40

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰保兴货币 A		
项目	本期 2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	46,449,159.42	46,449,159.42
本期申购	23,164,053.40	23,164,053.40
本期赎回(以“-”号填列)	-50,012,363.69	-50,012,363.69
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	19,600,849.13	19,600,849.13

金额单位：人民币元

华泰保兴货币 B		
项目	本期 2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	5,787,498,319.10	5,787,498,319.10
本期申购	4,802,954,185.57	4,802,954,185.57
本期赎回(以“-”号填列)	-5,539,116,356.62	-5,539,116,356.62
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	5,051,336,148.05	5,051,336,148.05

注：1、申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金于 2017 年 4 月 10 日至 2017 年 4 月 17 日期间公开发售，共募集有效净认购资金

5,833,947,478.52 元，其中含认购资金利息 415,149.39 元。

3、根据《华泰保兴货币市场基金基金合同》和《华泰保兴货币市场基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2017 年 4 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 5 月 2 日期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回等业务自 2017 年 5 月 3 日起开始办理。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰保兴货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	202,155.50	-	202,155.50
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-202,155.50	-	-202,155.50
本期末	-	-	-

单位：人民币元

华泰保兴货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	26,178,302.17	-	26,178,302.17
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-26,178,302.17	-	-26,178,302.17
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	305,889.50
定期存款利息收入	22,483,833.32
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,189.94
其他	54.74
合计	22,797,967.50

#### 6.4.7.12 股票投资收益

注：无。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年4月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,042,814,557.01
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,031,337,637.10
减：应收利息总额	10,618,603.55
买卖债券差价收入	858,316.36

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

注：无。

#### 6.4.7.15 股利收益

注：无。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

注：无。

#### 6.4.7.17 其他收入

注：无。

#### 6.4.7.18 交易费用

注：无。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	30,375.36
信息披露费	59,063.04
债券账户维护费	3,000.00
银行汇划费用	16,832.99
其他费用	11,547.69
合计	120,819.08

#### 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，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 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

本报告期存在控制关系或其他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
华泰保兴基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、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。

## 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

本基金基金合同于 2017 年 4 月 20 日生效，本报告期末通过关联方交易单元进行交易。

### 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
	2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,209,041.46
其中：支付销售机构的客户维护费	91,845.57

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	669,406.49

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

### 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 2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴货币 A	华泰保兴货币 B	合计
华泰保兴基金管理有限公司	884.13	61,434.98	62,319.11
中国银行股份有限公司	12,008.01	480.26	12,488.27
合计	12,892.14	61,915.24	74,807.38

注：本基金对不同份额类别设定不同的基金销售服务费率，本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，本基金 B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额的年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

各类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

### 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

注：本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 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 2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	
	华泰保兴货币 A	华泰保兴货币 B
基金合同生效日(2017 年 4 月 20 日)持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	0.00	40,193,695.94

期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	0.00	40,193,695.94
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.00%	0.79%

注：1、报告期内，申购份额含红利再投资份额。

2、本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

#### 6.4.10.4.2 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

注：本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 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 2017年4月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	47,912,590.68	305,889.50

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金基金合同 2017 年 4 月 20 日生效，本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

华泰保兴货币A

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
199,956.25	-	2,199.25	202,155.50	-

华泰保兴货币B

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
25,573,968.06	-	604,334.11	26,178,302.17	-

**6.4.12 期末（2017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**

注：无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：无。

**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 2017 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 108,899,716.65 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
170204	17 国开 04	2017 年 7 月 5 日	99.57	1,100,000	109,527,000.00
合计				1,100,000	109,527,000.00

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

**6.4.13 金融工具风险及管理**

**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了分工明确、相互制约的风险管理组织架构体系。公司的风险管理组织架构体系由公司董事会、董事会风险控制委员会、经理层及其合规和风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部、各业务部门及全体员工共同组成。

董事会负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，对公司的

风险控制承担最终责任；董事会下设风险控制委员会，负责对公司经营管理和投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督。公司经理层负责根据董事会批准的风险控制制度和战略具体组织实施公司风险控制工作并对风险控制的有效性及其执行效果承担直接责任；总经理负责公司全面的风险控制工作，副总经理负责其分管业务范围的风险控制工作；公司经理层下设合规和风险管理委员会，负责协助经理层进行风险管理的咨询和议事，指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。在业务操作层面，督察长按照中国证监会有关监管规定开展风险管理工作，负责分管并领导监察稽核部、风险管理部独立履行监察稽核及风险管理职责；监察稽核部对公司的风险控制承担独立评估、检查和报告职责；风险管理部对公司的风险控制承担评估、分析、评价职责，具体而言，风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，力争各投资组合的投资范围及投资比例限制合规；参与各投资组合新股申购、债券申购以及银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证场外交易的事中合规控制，并完成各投资组合的投资风险及绩效分析。公司各业务部门负责执行公司的风险控制政策及决策，定期对本部门的风险进行全面评估，并对本部门风险控制的有效性负责；公司所有员工是本岗位风险控制的直接责任人，负责具体风险管理职责的实施。

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评估各种风险可能产生的损失。从定性的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的额度；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的特征通过特定的风险量化指标、模型、日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，以及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之内。

#### 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的发行人出现违约、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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行活期存款存放在本基金托管人中国银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险较低；本基金的银行定期存款均存放于具有证券投资基金托管资格的兴业银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、广东发展银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、恒丰银行股份有限公司、包商银行股份有限公司等，与该部分银行存款相关的信用风险较低；本基金在银行间同业市场进行交易前，基金管理人均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险；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，违约风险

可能性很小。

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。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 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 2017 年 6 月 30 日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	1,764,237,527.30
合计	1,764,237,527.30

注：1、债券评级均取自第三方评级机构的债项评级；未评级债券主要包括到期日在一年（含）以内的国债、政策性金融债、超短期融资券以及同业存单；债券投资均以净价列示。

2、本基金基金合同于 2017 年 4 月 20 日生效，上年度末未产生相关数据。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

#### 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源于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来源于投资品种所处的交易市场不活跃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，有效保障基金份额持有人利益。

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。本基金所投资证券的平均剩余期限在每个交易日均不超过 120 天，且能够通过提前支取定期存款和出售所持有的银行间市场交易债券应对流动性需求。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，除发生

巨额赎回的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

本基金所承担的全部金融负债无固定到期日或合同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 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 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。本基金主要投资于银行存款和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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 2017 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	767,912,590.68	200,000,000.00	-	-	-	967,912,590.68
结算备付金	5,995,373.91	-	-	-	-	5,995,373.91
存出保证金	41,914.42	-	-	-	-	41,914.42
交易性金融资产	1,583,566,227.00	179,131,446.67	-	-	-	1,762,697,673.67
买入返售金融资产	2,431,122,431.67	-	-	-	-	2,431,122,431.67

应收证券清算款	-	-	-	-	113,772.63	113,772.63
应收利息	-	-	-	-	-13,228,225.73	13,228,225.73
应收申购款	-	-	-	-	350,000.00	350,000.00
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,788,638,537.68	379,131,446.67	-	-	-13,691,998.36	5,181,461,982.71
负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	108,899,716.65	-	-	-	-	108,899,716.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	647,196.33	647,196.33
应付托管费	-	-	-	-	196,120.10	196,120.10
应付销售服务费	-	-	-	-	23,895.83	23,895.83
应付交易费用	-	-	-	-	30,768.76	30,768.76
应付利息	-	-	-	-	28,316.10	28,316.10
应付利润	-	-	-	-	606,533.36	606,533.36
其他负债	-	-	-	-	92,438.40	92,438.40
负债总计	108,899,716.65	-	-	-	-1,625,268.88	110,524,985.53
利率敏感度缺口	4,679,738,821.03	379,131,446.67	-	-	-12,066,729.48	5,070,936,997.18

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率发生变动之外，影响本基金资产净值的其他风险变量保持不变。	
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（2017年6月30日）
	市场利率上升 25 个基点	-877,862.54
	市场利率下降 25 个基点	879,318.04

#### 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。本基金主要投资于交易所或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

##### (1) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (2) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### A. 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 1,762,697,673.67 元，无属于第一层次或第三层次的余额。

##### B. 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

##### C. 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (3) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (4) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### 2、增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入

基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 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	固定收益投资	1,762,697,673.67	34.02
	其中: 债券	1,762,697,673.67	34.02
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,431,122,431.67	46.92
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	973,907,964.59	18.80
4	其他各项资产	13,733,912.78	0.27
5	合计	5,181,461,982.71	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额		3.89
	其中: 买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	108,899,716.65	2.15
	其中: 买断式回购融资	-	-

注: 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注: 本基金报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	48
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过 120 天的情况。

#### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	57.88	2.15
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	9.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	25.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	1.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	7.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		101.91	2.15

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

### 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	73,092,986.81	1.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	159,140,945.71	3.14
	其中：政策性金融债	159,140,945.71	3.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	250,516,083.28	4.94
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,279,947,657.87	25.24
8	其他	-	-
9	合计	1,762,697,673.67	34.76
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111709220	17 浦发银行 CD220	1,500,000	148,608,694.75	2.93
2	111707139	17 招商银行 CD139	1,500,000	148,491,387.35	2.93
3	111710281	17 兴业银行 CD281	1,300,000	128,722,408.82	2.54
4	170204	17 国开 04	1,100,000	109,356,109.80	2.16
5	111710218	17 兴业银行 CD218	1,000,000	99,705,302.28	1.97
6	111714160	17 江苏银行 CD160	1,000,000	99,283,631.17	1.96
7	111715184	17 民生银行 CD184	1,000,000	98,981,093.05	1.95
8	111708186	17 中信银行 CD186	1,000,000	98,946,772.73	1.95
9	019546	16 国债 18	731,570	73,092,986.81	1.44

10	011698709	16 现代投资 SCP002	500,000	50,159,733.72	0.99
----	-----------	----------------	---------	---------------	------

### 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0557%
报告期内偏离度的最低值	-0.0294%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0131%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金报告期内未发生负偏离的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金报告期内未发生正偏离的绝对值达到 0.5%的情况。

### 7.8 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

注：本基金报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

#### 7.9.2

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体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。

#### 7.9.3 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	41,914.42
2	应收证券清算款	113,772.63
3	应收利息	13,228,225.73
4	应收申购款	350,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	13,733,912.78

#### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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
华泰保 兴货币 A	338	57,990.68	6,778,352.46	34.58%	12,822,496.67	65.42%
华泰保 兴货币 B	51	99,045,806.82	5,001,266,198.38	99.01%	50,069,949.67	0.99%
合计	389	13,035,827.76	5,008,044,550.84	98.76%	62,892,446.34	1.24%

### 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	华泰保兴货币 A	402,729.05	2.0547%
	华泰保兴货币 B	0.00	0.0000%
	合计	402,729.05	0.0079%

### 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

注：本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	华泰保兴货币 A	华泰保兴货币 B
基金合同生效日（2017 年 4 月 20 日）基金份额总额	46,449,159.42	5,787,498,319.10
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	23,164,053.40	4,802,954,185.57
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	50,012,363.69	5,539,116,356.62
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	19,600,849.13	5,051,336,148.05

注：总申购份额含红利再投、转换入份额、份额强增。总赎回份额含转换出份额、份额强减。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会

### 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

- (1) 基金管理人 2017 年 3 月 30 日公告，增聘王现成先生为本公司副总经理。
- (2) 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。

### 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管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
长城证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
申万证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

### 10.7.2 基金租用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
长城证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	547,641,044.45	100.00%	1,462,800,000.00	100.00%	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）有关规定，基金管理人等多家证券经营机构进行了综合评估。

专用交易单元的选择标准：

- (1) 财务状况良好，经营行为规范；
- (2) 研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向和个股分析的研究报告等信息服务；
- (3) 内部管理规范、严谨，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

专用交易单元的选择程序：

- (1) 公司对交易单元所属券商进行综合评价，投资决策委员会根据综合评价的结果作出租用与否

的决策；

(2) 公司研究部定期组织对交易单元所属券商的综合服务进行评价，由投资决策委员会对交易单元的交易量进行分配和调整。

2、报告期内基金租用交易单元的变更情况：

本基金于本报告期内成立，本报告期内租用的交易单元全部为新增交易单元。

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金报告期内未发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### 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	华泰保兴基金管理有限公司关于开通网上直销通联支付业务并实施费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站	2017年1月6日
2	华泰保兴基金管理有限公司关于调整旗下基金最低赎回份额、最低份额保留余额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站	2017年3月10日
3	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加蚂蚁基金为销售机构及开通定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站	2017年3月17日
4	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下增加中信建投证券为销售机构及开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站	2017年3月17日
5	华泰保兴基金管理有限公司关于新任副总经理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站	2017年3月30日
6	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加上海攀赢金融信息服务有限公司为销售机构及开通定投、转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站	2017年4月12日

7	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加上海汇付金融服务有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站	2017 年 4 月 12 日
8	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加申万宏源证券有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站	2017 年 4 月 13 日
9	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加申万宏源西部证券有限公司为销售机构及开通申购、转换等业务并参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站	2017 年 4 月 15 日
10	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参加认申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站	2017 年 5 月 4 日
11	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构及开通申购、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站	2017 年 6 月 17 日
12	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加上海好买基金销售有限公司为销售机构及开通申购、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站	2017 年 6 月 17 日
13	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构及开通申购、转换等业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站	2017 年 6 月 24 日

## § 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	2017.05.23-2017.06.27	0.00	104,007,651.40	100,000,000.00	604,057,151.40	11.91%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：单一机构投资者 1 通过认购，在基金合同生效日持有本基金份额 600,049,500.00 份。

报告期内，申购份额含红利再投资份额。

### 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、中国证监会批准本基金募集的文件
- 2、《华泰保兴货币市场基金基金合同》
- 3、《华泰保兴货币市场基金托管协议》
- 4、《华泰保兴货币市场基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、报告期内本基金在指定媒介披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人办公场所，地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号金茂大厦 4306 室

### 12.3 查阅方式

- 1、营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅
- 2、登录基金管理人网站 [www.ehuataifund.com](http://www.ehuataifund.com) 查阅
- 3、拨打基金管理人客服热线电话 400-632-9090 查询

华泰保兴基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日