

华泰保兴货币市场基金 2018 年半年度报告

2018 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：二〇一八年八月二十五日

§ 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 2018 年 8 月 23 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 2018 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 | 6 |
| 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..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 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..... | 13 |
| 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 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 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 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 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..... | 18 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| §7 投资组合报告..... | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 38 |
| 7.2 债券回购融资情况..... | 38 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 38 |
| 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..... | 39 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 39 |
| 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..... | 40 |
| 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离..... | 40 |
| 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..... | 41 |
| 7.9 投资组合报告附注..... | 41 |
| §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 期末货币市场基金前十名份额持有人情况..... | 43 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 45 |
| §10 重大事件揭示..... | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 46 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 46 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 46 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 47 |
| 10.9 其他重大事件..... | 48 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 49 |
| 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..... | 49 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 49 |

| | |
|-------------------------|-----------|
| §12 备查文件目录 | 50 |
| 12.1 备查文件目录..... | 50 |
| 12.2 存放地点..... | 50 |
| 12.3 查阅方式..... | 50 |

§ 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 | 6,316,591,449.57 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 | 20,356,781.53 份 | 6,296,234,668.04 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，其风险与预期收益低于债券型基金、混合型基金和股票型基金，是证券投资基金中的低风险品种。 | |
| | 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，其风险与预期收益低于债券型基金、混合型基金和股票型基金，是证券投资基金中的低风险品种。 | 本基金为货币市场基金，其风险与预期收益低于债券型基金、混合型基金和股票型基金，是证券投资基金中的低风险品种。 |

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@huatai.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 | 陈四清 |

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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日) | 报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 364, 377. 36 | 128, 867, 764. 00 |
| 本期利润 | 364, 377. 36 | 128, 867, 764. 00 |
| 本期净值收益率 | 1. 9173% | 2. 0389% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018 年 6 月 30 日) | |
| 期末基金资产净值 | 20, 356, 781. 53 | 6, 296, 234, 668. 04 |
| 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(2018 年 6 月 30 日) | |
| 累计净值收益率 | 4. 6835% | 4. 9853% |

注：1、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。

2、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. 2962% | 0. 0014% | 0. 1110% | 0. 0000% | 0. 1852% | 0. 0014% |
| 过去三个月 | 0. 8970% | 0. 0011% | 0. 3366% | 0. 0000% | 0. 5604% | 0. 0011% |
| 过去六个月 | 1. 9173% | 0. 0012% | 0. 6695% | 0. 0000% | 1. 2478% | 0. 0012% |
| 过去一年 | 3. 9200% | 0. 0013% | 1. 3500% | 0. 0000% | 2. 5700% | 0. 0013% |
| 自基金合同生效起至今 | 4. 6835% | 0. 0015% | 1. 6163% | 0. 0000% | 3. 0672% | 0. 0015% |

华泰保兴货币 B

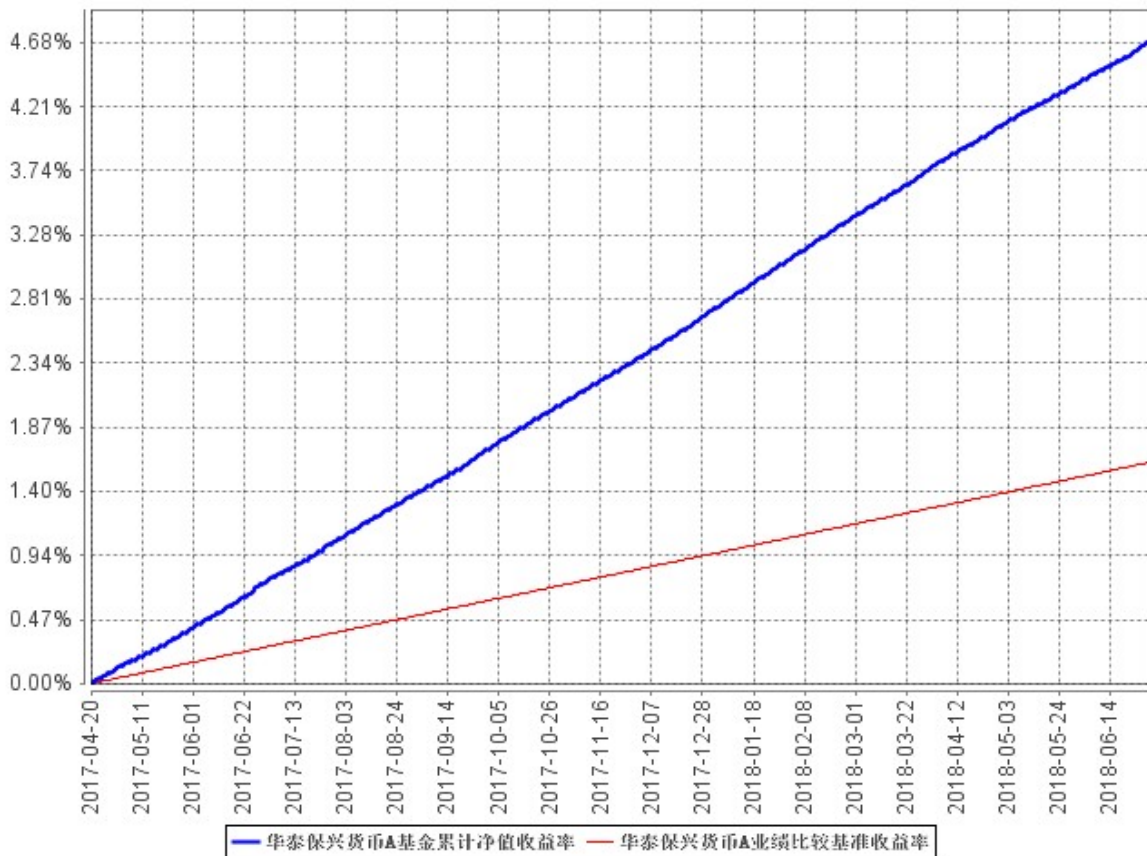
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

| | | | | | | |
|------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.3163% | 0.0014% | 0.1110% | 0.0000% | 0.2053% | 0.0014% |
| 过去三个月 | 0.9577% | 0.0011% | 0.3366% | 0.0000% | 0.6211% | 0.0011% |
| 过去六个月 | 2.0389% | 0.0012% | 0.6695% | 0.0000% | 1.3694% | 0.0012% |
| 过去一年 | 4.1702% | 0.0013% | 1.3500% | 0.0000% | 2.8202% | 0.0013% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.9853% | 0.0015% | 1.6163% | 0.0000% | 3.3690% | 0.0015% |

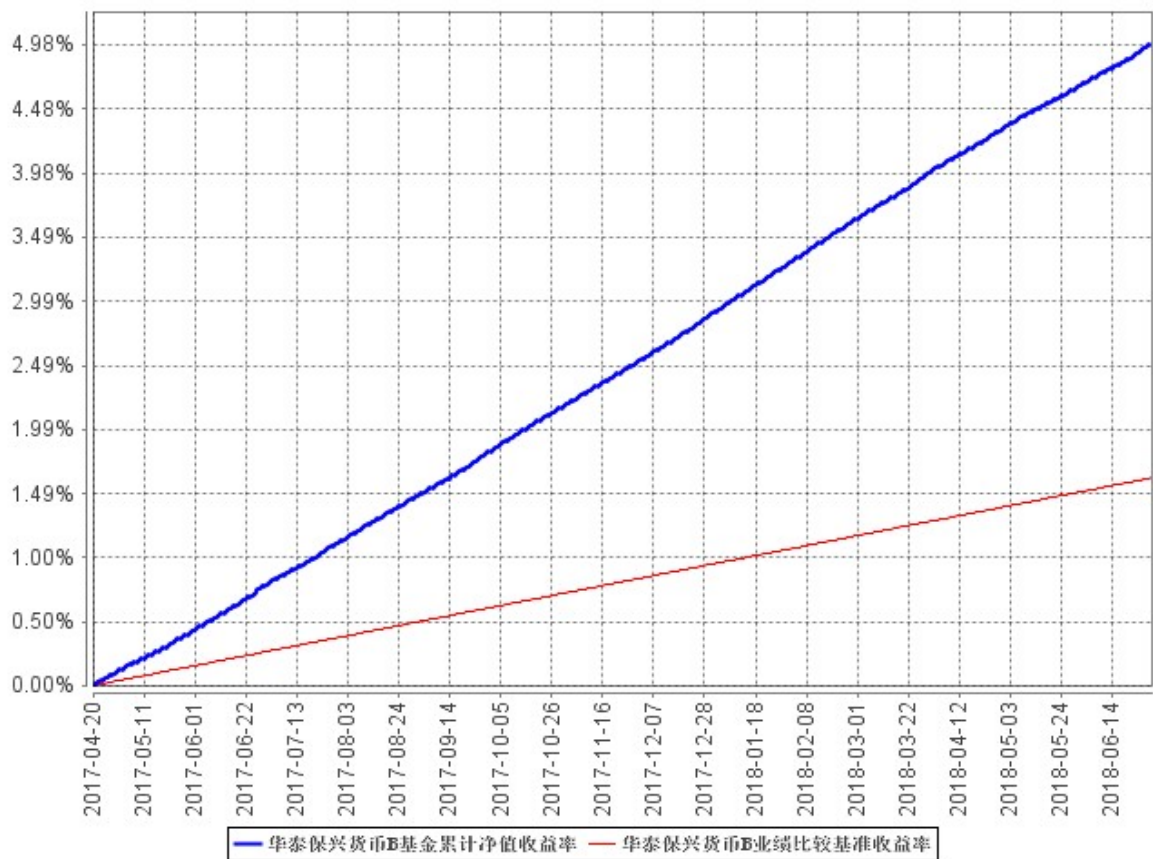
注：本基金业绩比较基准为：中国人民银行公布的 7 天通知存款利率（税后）。

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：截至报告期末，本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§ 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

本基金管理人为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，注册资本为人民币1.8亿元。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2018年6月30日，公司公募基金产品资产管理规模为83.75亿元。公司共管理九只公募基金产品，具体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、华泰保兴尊合债券型证券投资基金、华泰保兴策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、华泰保兴成长优选混合型证券投资基金、华泰保兴尊利债券型证券投资基金。

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 | 基金经理 | 2017年4月20日 | - | 7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。 |

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，未发现各投资组合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

2018 年上半年，中国经济运行整体仍保持稳定，虽然基建投资和消费增速有所回落，但房地产投资在低库存情况下依然保持强劲，成为支撑经济的主要动力。随着资管新规的落地，表外融资受到限制，社融增速出现明显回落，企业融资环境趋紧，同时，中美贸易摩擦也给经济带来不确定性，因此，货币政策进行了一定的调整，市场资金利率水平出现明显的下行。

报告期内，基金操作上继续做好日常流动性管理，同时注重在资金面分析的基础上合理安排资产的到期期限，规避季末流动性紧张的风险，也有利于提高资产的配置收益。投资方向上仍以全国性股份制银行同业存款和同业存单为主，注重保持资产的安全性和流动性。

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 1.9173%，本报告期华泰保兴货币 B 的基金份额净值收益率为 2.0389%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

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 2018 年下半年，中国经济增速可能会出现小幅回落，原因主要在于严控地方政府债务继续带来基建投资增速的下滑，而中美贸易摩擦也对出口有一定负面影响，同时也需要关注社融下行对经济的潜在影响，目前来看，由于房地产库存依然偏低，企业利润增速较高，海外经济较好，经济的回落幅度可能不大。

对于债券市场而言，最大的影响因素还是政策，资管新规的落地对表外融资收缩的效果是立竿见影的，但市场风险偏好下降之后企业融资困难度明显上升。虽然货币政策有一定的调整，但效果如何还需要观察。

总体而言，下半年资金面总体仍将保持相对宽松的局面，但季末时点非银机构的流动性风险仍需注意。

基金操作上，在信用违约风险上升的背景下，注重投资资产的安全性和流动性，增加短期回购融出比例，控制资产剩余期限，加强对资金面的分析和预判，合理安排资产的到期结构。

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、科学和一致性，保护基金份额持有人的合法权益，成立了估值委员会。估值委员会负责制订、评估和修订公司的估值管理办法，定期评估估值程序和估值技术，对估值技术进行

最终决策，指导和监督整个估值流程。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。估值委员会委员在基金估值研究或运作方面具有丰富经验，熟悉相关法规、估值原则和估值技术，在估值工作中保持判断的专业性和客观性。

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公司估值管理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固定收益品种/在证券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 129,232,141.36 元，实际分配收益 129,232,141.36 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,306,614,621.56 | 1,802,090,156.61 |
| 结算备付金 | | 11,090,909.09 | - |
| 存出保证金 | | 1,325.31 | 5,813.92 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 3,069,389,572.67 | 3,320,388,983.39 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 2,919,389,572.67 | 3,320,388,983.39 |
| 资产支持证券投资 | | 150,000,000.00 | - |
| 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 | 1,945,628,420.91 | 346,930,480.40 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 27,776,361.84 | 23,978,052.24 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 501,080.97 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 6,360,501,211.38 | 5,493,894,567.53 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 | 上年度末 2017 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 | | 39,999,860.00 | 150,919,653.62 |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | 2,000.00 |
| 应付管理人报酬 | | 1,449,930.43 | 1,515,814.21 |
| 应付托管费 | | 439,372.90 | 459,337.63 |
| 应付销售服务费 | | 49,181.80 | 48,924.65 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 84,318.70 | 71,413.69 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应交税费 | | 28,228.06 | - |
| 应付利息 | | 7,216.62 | 149,060.43 |
| 应付利润 | | 1,640,331.50 | 1,996,182.04 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 211,321.80 | 327,000.00 |
| 负债合计 | | 43,909,761.81 | 155,489,386.27 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 6,316,591,449.57 | 5,338,405,181.26 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 6,316,591,449.57 | 5,338,405,181.26 |
| 负债和所有者权益总计 | | 6,360,501,211.38 | 5,493,894,567.53 |

注：报告截止日 2018 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 20,356,781.53 份；华泰保兴货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 6,296,234,668.04 份。华泰保兴货币份额总额合计为 6,316,591,449.57 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰保兴货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2017 年 4 月 20 日(基金 合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 146,500,226.41 | 29,973,777.57 |
| 1.利息收入 | | 146,015,108.18 | 29,115,461.21 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 46,257,994.02 | 22,797,967.50 |
| 债券利息收入 | | 72,051,045.88 | 4,814,810.60 |
| 资产支持证券利息收入 | | 686,533.92 | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 27,019,534.36 | 1,502,683.11 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 485,118.23 | 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 | 485,118.23 | 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 | - | - |
| 减：二、费用 | | 17,268,085.05 | 3,593,319.90 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 10,496,243.31 | 2,209,041.46 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 3,180,679.86 | 669,406.49 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 341,234.05 | 80,078.42 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | - | - |
| 5. 利息支出 | | 2,988,501.39 | 513,974.45 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 2,988,501.39 | 513,974.45 |
| 6. 税金及附加 | | 5,287.56 | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 256,138.88 | 120,819.08 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 129,232,141.36 | 26,380,457.67 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 129,232,141.36 | 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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） | 5,338,405,181.26 | - | 5,338,405,181.26 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 129,232,141.36 | 129,232,141.36 |
| 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） | 978,186,268.31 | - | 978,186,268.31 |
| 其中：1. 基金申购款 | 18,908,580,084.11 | - | 18,908,580,084.11 |
| 2. 基金赎回款 | -17,930,393,815.80 | - | -17,930,393,815.80 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基 | - | -129,232,141.36 | -129,232,141.36 |

| | | | |
|--|---|----------------|-------------------|
| 金净值变动（净值减少以“-”号填列） | | | |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 6,316,591,449.57 | - | 6,316,591,449.57 |
| 项目 | 上年度可比期间 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 | 4,846,122,738.97 | - | 4,846,122,738.97 |
| 2. 基金赎回款 | -5,609,133,220.31 | - | -5,609,133,220.31 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -26,380,457.67 | -26,380,457.67 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 5,070,936,997.18 | - | 5,070,936,997.18 |

注：上年度可比期间数据已按年报口径进行调整，即认购期发生的份额升降级分别计入基金申购款和赎回款。

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：

| | | |
|--------------|--------------|--------------|
| _____ 王冠龙 | _____ 寻卫国 | _____ 王云凌 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰保兴货币市场基金(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”)证监许可[2016]2924号《关于准予华泰保兴货币市场基金注册的批复》核准，由华泰保兴基金管理有限公司依照《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》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 5,833,532,329.13 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 447 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰保兴货币市场基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,833,947,478.52 份，其中认购资金利息折合 415,149.39 份。本基金的基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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》的规定，本基金根据基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量不同，分设不同类别的基金份额，各类基金份额按照不同的费率计提销售服务费。其中，基金账户最低基金份额余额为 1 份，且按照 0.25% 的年费率计提销售服务费的称为 A 类份额；基金账户最低基金份额余额为 5,000,000 份，且按照 0.01% 的年费率计提销售服务费的称为 B 类份额；本基金 A 类份额及 B 类份额分设不同的基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类份额及 B 类份额将分别计算和公布每万份基金已实现收益和 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：中国人民银行公布的 7 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 2018 年 8 月 24 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“中国基金业协会”)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、中国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 2018 年上半年度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 2018

年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖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。

(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。

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 2018 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 6,614,621.56 |
| 定期存款 | 1,300,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | 200,000,000.00 |
| 存款期限 1-3 个月 | 1,100,000,000.00 |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 1,306,614,621.56 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2018 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 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 2,919,389,572.67 | 2,922,229,000.00 | 2,839,427.33 | 0.0450% |
| | 合计 | 2,919,389,572.67 | 2,922,229,000.00 | 2,839,427.33 | 0.0450% |
| 资产支持券 | | 150,000,000.00 | 150,000,000.00 | - | 0.0000% |
| 合计 | | 3,069,389,572.67 | 3,072,229,000.00 | 2,839,427.33 | 0.0450% |

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 2018 年 6 月 30 日 | |
|-------|------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 1,945,628,420.91 | - |
| 合计 | 1,945,628,420.91 | - |

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 2018 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,252.92 |
| 应收定期存款利息 | 10,793,333.30 |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 4,990.90 |
| 应收债券利息 | 14,588,953.41 |
| 应收资产支持证券利息 | 689,205.48 |
| 应收买入返售证券利息 | 1,698,625.23 |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 0.60 |
| 合计 | 27,776,361.84 |

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 2018 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 | 84,318.70 |
| 合计 | 84,318.70 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 |
|--------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付信息披露费 | 148,765.71 |
| 应付审计费 | 53,556.09 |
| 应付银行间债券账户维护费 | 9,000.00 |
| 合计 | 211,321.80 |

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 15,238,836.82 | 15,238,836.82 |
| 本期申购 | 40,134,681.36 | 40,134,681.36 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -35,016,736.65 | -35,016,736.65 |
| - 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 | 20,356,781.53 | 20,356,781.53 |

金额单位：人民币元

| 华泰保兴货币 B | | |
|---------------|---------------------------------------|--------------------|
| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 5,323,166,344.44 | 5,323,166,344.44 |
| 本期申购 | 18,868,445,402.75 | 18,868,445,402.75 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -17,895,377,079.15 | -17,895,377,079.15 |
| - 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 | 6,296,234,668.04 | 6,296,234,668.04 |

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

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 |
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期利润 | 364,377.36 | - | 364,377.36 |
| 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 | -364,377.36 | - | -364,377.36 |
| 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 |
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期利润 | 128,867,764.00 | - | 128,867,764.00 |
| 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 | -128,867,764.00 | - | -128,867,764.00 |
| 本期末 | - | - | - |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 60,768.30 |
| 定期存款利息收入 | 46,179,722.32 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 17,495.64 |
| 其他 | 7.76 |
| 合计 | 46,257,994.02 |

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 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 9,091,777,876.94 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 9,075,688,218.98 |
| 减：应收利息总额 | 15,604,539.73 |
| 买卖债券差价收入 | 485,118.23 |

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 53,556.09 |
| 信息披露费 | 148,765.71 |
| 银行汇划费用 | 34,823.18 |
| 债券账户维护费 | 18,600.00 |
| 其他费用 | 393.90 |
| 合计 | 256,138.88 |

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 |
| 华泰财产保险有限公司 | 基金管理人主要股东控制的机构 |
| 华泰保险集团股份有限公司 | 基金管理人主要股东 |

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

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

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 2018年1月1日至2018年6月 30日 | 上年度可比期间 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 | 10,496,243.31 | 2,209,041.46 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 27,031.84 | 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 2018年1月1日至2018年6月 30日 | 上年度可比期间 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 | 3,180,679.86 | 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 | 20,500.05 | 315,621.08 | 336,121.13 |
| 中国银行股份有限公司 | 2,951.81 | 0.00 | 2,951.81 |
| 合计 | 23,451.86 | 315,621.08 | 339,072.94 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 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率为 0.25%，本基金 B 类基金份额的年销售服务率为 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：本基金本报告期内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 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | - | 81,306,489.52 |
| 期间申购/买入总份额 | - | 1,177,934.05 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | 40,001,000.00 |
| 期末持有的基金份额 | - | 42,483,423.57 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | - | 0.67% |

| 项目 | 上年度可比期间 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 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | - | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | 40,193,695.94 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | - | 40,193,695.94 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | - | 0.79% |

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

份额单位：份

| 华泰保兴货币 A | | | | |
|----------------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 关联方名称 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 | |
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 |
| 华泰财产保 险有限公司 | - | - | 27.89 | 0.0000% |
| 华泰保险集 团股份有限 公司 | 5.54 | 0.0000% | 5.54 | 0.0000% |

注：除基金管理人之外的其他关联方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。

6.4.10.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 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 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行股份有限公司 | 6,614,621.56 | 60,768.36 | 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：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

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 配合计 | 备注 |
|--------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 364,768.22 | - | -390.86 | 364,377.36 | - |

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 配合计 | 备注 |
|----------------|-------------------|--------------|----------------|----|
| 129,223,223.68 | - | -355,459.68 | 128,867,764.00 | - |

6.4.12 期末（2018 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 2018 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 39,999,860.00 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 |
|--------|----------|----------------|--------|---------|---------------|
| 130238 | 13 国开 38 | 2018 年 7 月 2 日 | 100.22 | 400,000 | 40,088,000.00 |
| 合计 | | | | 400,000 | 40,088,000.00 |

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，定期存款主要存放于具有证券投资基金托管资格的银行，因而与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均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险；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，不投资于信用等级在 AA+级以下的债券和非金融企业债务融资工具，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。

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 2018年6月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 50,028,563.75 | 50,000,110.56 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 890,053,756.47 | 389,834,701.89 |
| 合计 | 940,082,320.22 | 439,834,812.45 |

注：未评级债券为政策性金融债及短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
|--------|-------------------|---------------------|

| | | |
|--------|------------------|------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 2,029,335,816.20 | 2,880,554,170.94 |
| 合计 | 2,029,335,816.20 | 2,880,554,170.94 |

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 150,000,000.00 | - |
| AAA 以下 | 0.00 | - |
| 未评级 | 0.00 | - |
| 合计 | 150,000,000.00 | - |

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。

6.4.13.4 市场风险

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 2018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 | 1,306,614,621.56 | - | - | - | - | 1,306,614,621.56 |
| 结算备付金 | 11,090,909.09 | - | - | - | - | 11,090,909.09 |
| 存出保证金 | 1,325.31 | - | - | - | - | 1,325.31 |
| 交易性金融资产 | 2,609,350,292.17 | 460,039,280.50 | - | - | - | 3,069,389,572.67 |
| 买入返售金融资产 | 1,945,628,420.91 | - | - | - | - | 1,945,628,420.91 |
| 应收利息 | - | - | - | - | -27,776,361.84 | 27,776,361.84 |
| 资产总计 | 5,872,685,569.04 | 460,039,280.50 | - | - | -27,776,361.84 | 6,360,501,211.38 |
| 负债 | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 39,999,860.00 | - | - | - | - | 39,999,860.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | -1,449,930.43 | 1,449,930.43 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | -439,372.90 | 439,372.90 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | -49,181.80 | 49,181.80 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | -84,318.70 | 84,318.70 |
| 应付利息 | - | - | - | - | -7,216.62 | 7,216.62 |
| 应交税费 | - | - | - | - | -28,228.06 | 28,228.06 |
| 应付利润 | - | - | - | - | -1,640,331.50 | 1,640,331.50 |
| 其他负债 | - | - | - | - | -211,321.80 | 211,321.80 |
| 负债总计 | 39,999,860.00 | - | - | - | -3,909,901.81 | 43,909,761.81 |
| 利率敏感度缺口 | 5,832,685,709.04 | 460,039,280.50 | - | - | -23,866,460.03 | 6,316,591,449.57 |
| 上年度末 2017年12月31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 | 1,802,090,156.61 | - | - | - | - | 1,802,090,156.61 |
| 存出保证金 | 5,813.92 | - | - | - | - | 5,813.92 |

| | | | | | | |
|-----------|------------------|---|---|----------------|---|------------------|
| 交易性金融资产 | 3,320,388,983.39 | - | - | - | - | 3,320,388,983.39 |
| 买入返售金融资产 | 346,930,480.40 | - | - | - | - | 346,930,480.40 |
| 应收利息 | - | - | - | -23,978,052.24 | - | 23,978,052.24 |
| 应收申购款 | - | - | - | 501,080.97 | - | 501,080.97 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 5,469,415,434.32 | - | - | -24,479,133.21 | - | 5,493,894,567.53 |
| 负债 | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 150,919,653.62 | - | - | - | - | 150,919,653.62 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 2,000.00 | - | 2,000.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,515,814.21 | - | 1,515,814.21 |
| 应付托管费 | - | - | - | 459,337.63 | - | 459,337.63 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 48,924.65 | - | 48,924.65 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 71,413.69 | - | 71,413.69 |
| 应付利息 | - | - | - | 149,060.43 | - | 149,060.43 |
| 应付利润 | - | - | - | 1,996,182.04 | - | 1,996,182.04 |
| 其他负债 | - | - | - | 327,000.00 | - | 327,000.00 |
| 负债总计 | 150,919,653.62 | - | - | 4,569,732.65 | - | 155,489,386.27 |
| 利率敏感度缺口 | 5,318,495,780.70 | - | - | -19,909,400.56 | - | 5,338,405,181.26 |

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（2018年6月30日） | 上年度末（2017年12月31日） |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -1,077,915.13 | -1,775,096.55 |
| 市场利率下降 25 个基点 | 1,080,983.91 | 1,777,719.66 | |

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

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 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 2,919,389,572.67 元，无属于第一层次或第三层次的余额。

(ii) 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次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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。

(d) 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，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。

根据财政部、国家税务总局于 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

§ 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 | 3,069,389,572.67 | 48.26 |
| | 其中: 债券 | 2,919,389,572.67 | 45.90 |
| | 资产支持证券 | 150,000,000.00 | 2.36 |
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,945,628,420.91 | 30.59 |
| | 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 | 1,317,705,530.65 | 20.72 |
| 4 | 其他各项资产 | 27,777,687.15 | 0.44 |
| 5 | 合计 | 6,360,501,211.38 | 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 | 3.66 | |
| | 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 | 39,999,860.00 | 0.63 |
| | 其中: 买断式回购融资 | - | - |

注: 本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: 本基金本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 | 52 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 68 |

| | |
|-------------------|----|
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 35 |
|-------------------|----|

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本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 | 40.57 | 0.63 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 37.89 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 9.46 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天(含)—120 天 | 2.85 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天(含)—397 天(含) | 9.49 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 100.26 | 0.63 |

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：本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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 709,968,699.95 | 11.24 |
| | 其中：政策性金融债 | 709,968,699.95 | 11.24 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 180,085,056.52 | 2.85 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 2,029,335,816.20 | 32.13 |

| | | | |
|----|----------------------|------------------|-------|
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 2,919,389,572.67 | 46.22 |
| 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 | 111812052 | 18 北京银行 CD052 | 4,000,000 | 398,032,204.82 | 6.30 |
| 2 | 111810238 | 18 兴业银行 CD238 | 2,500,000 | 248,547,436.68 | 3.93 |
| 3 | 111809105 | 18 浦发银行 CD105 | 2,000,000 | 199,763,220.53 | 3.16 |
| 4 | 111820127 | 18 广发银行 CD127 | 2,000,000 | 199,548,391.38 | 3.16 |
| 5 | 111815270 | 18 民生银行 CD270 | 1,500,000 | 148,810,224.04 | 2.36 |
| 6 | 160208 | 16 国开 08 | 1,200,000 | 119,072,577.56 | 1.89 |
| 7 | 140202 | 14 国开 02 | 1,000,000 | 100,966,264.60 | 1.60 |
| 8 | 011801128 | 18 华能集 SCP005 | 1,000,000 | 100,053,754.64 | 1.58 |
| 9 | 170211 | 17 国开 11 | 1,000,000 | 99,850,735.18 | 1.58 |
| 10 | 180207 | 18 国开 07 | 1,000,000 | 99,826,671.39 | 1.58 |

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 | 0.0832% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0121% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0356% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本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：本基金本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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|-----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 149417 | 宁远 03A1 | 1,000,000 | 100,000,000.00 | 1.58 |
| 2 | 1889112 | 18 上和 1A1 | 500,000 | 50,000,000.00 | 0.79 |

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

1、18 北京银行 CD052（代码：111812052）为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。2017 年 8 月 8 日，北京银监局针对北京银行未经核准提前授权部分人员实际履行高管人员职责的行为、同业业务严重违反审慎经营规则的违规事实，处以责令改正，并罚款人民币 50 万元的行政处罚。

2、18 兴业银行 CD238（代码：111810238）为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 3 月 26 日，中国人民银行福州中心支行针对兴业银行违反国库管理规定的违法违规事实，处以警告及罚款人民币 5 万元的行政处罚；经中国银保监会官网 2018 年 5 月 4 日发布信息显示，2018 年 4 月 19 日，中国银行保险监督管理委员会针对兴业银行十二项违法违规行为，处以罚款 5870 万元的行政处罚。

3、18 浦发银行 CD105（代码：111809105）为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。经中国银保监会官网 2018 年 5 月 4 日发布信息显示，2018 年 2 月 12 日，原中国银监会针对浦发银行十九项违法违规行为，处以罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元的行政处罚。

4、18 广发银行 CD127（代码：111820127）为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。2017 年 11 月 17 日，原中国银监会针对广发银行十二项违法违规行为，处以警告，没收违法所得 17553.79 万元，并处 3 倍罚款 52661.37 万元，对其他违规行为罚款 2000 万元，罚没合计 72215.16 万元的行政处罚。

本基金投资 18 北京银行 CD052、18 兴业银行 CD238、18 浦发银行 CD105、18 广发银行 CD127 的投资决策程序，符合法律法规及公司投资制度有关规定。

除 18 北京银行 CD052、18 兴业银行 CD238、18 浦发银行 CD105、18 广发银行 CD127 外，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。

7.9.3 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 | 1,325.31 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 27,776,361.84 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 27,777,687.15 |

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 | 337 | 60,405.88 | 13,161,871.70 | 64.66% | 7,194,909.83 | 35.34% |
| 华泰 保兴 货币 B | 80 | 78,702,933.35 | 6,296,234,668.04 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 417 | 15,147,701.32 | 6,309,396,539.74 | 99.89% | 7,194,909.83 | 0.11% |

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份） | 占总份额比例 |
|----|-------|----------------|--------|
| 1 | 券商类机构 | 515,206,724.79 | 8.16 |
| 2 | 其他机构 | 409,954,934.15 | 6.49 |
| 3 | 银行类机构 | 407,782,598.89 | 6.46 |
| 4 | 其他机构 | 307,192,448.84 | 4.86 |
| 5 | 其他机构 | 307,192,448.84 | 4.86 |
| 6 | 保险类机构 | 258,443,742.31 | 4.09 |
| 7 | 银行类机构 | 208,363,165.63 | 3.30 |
| 8 | 保险类机构 | 200,025,503.83 | 3.17 |
| 9 | 保险类机构 | 188,017,591.00 | 2.98 |
| 10 | 券商类机构 | 184,692,395.54 | 2.92 |

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 | 华泰保兴货币 A | 1,392,611.74 | 6.84% |
| | 华泰保兴货币 B | 0.00 | 0.00% |
| | 合计 | 1,392,611.74 | 0.02% |

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 | 华泰保兴货币 A | 10~50 |
| | 华泰保兴货币 B | 0 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 华泰保兴货币 A | 0 |
| | 华泰保兴货币 B | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 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 | 66,453,659.42 | 5,767,493,819.10 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 15,238,836.82 | 5,323,166,344.44 |
| 本报告期基金总申购份额 | 40,134,681.36 | 18,868,445,402.75 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 35,016,736.65 | 17,895,377,079.15 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 20,356,781.53 | 6,296,234,668.04 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§ 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 2018 年 3 月 10 日披露副总经理邓航先生离任公告，2018 年 5 月 30 日披露副总经理姜光明先生离任公告。

(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

本基金管理人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。本报告期内未改聘为本基金提供审计服务的会计师事务所。

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 | 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 | |
| 长城证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | 本报告期新增 |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|--------|
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | 本报告期新增 |
| 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 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 5,033,254.79 | 100.00% | 248,000,000.00 | 5.15% | - | - |
| 兴业证券 | - | - | 4,265,000,000.00 | 88.61% | - | - |
| 申万证券 | - | - | 140,000,000.00 | 2.91% | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | 160,000,000.00 | 3.32% | - | - |

注：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。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本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 | 关于旗下部分基金增加广州银行股份有限公司为销售机构及开通申（认）购、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 | 2018年1月13日 |
| 2 | 华泰保兴货币市场基金 2017 年第 4 季度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站 | 2018年1月22日 |
| 3 | 华泰保兴货币市场基金暂停及恢复申购（转换转入、定期定额投资）公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站 | 2018年2月9日 |
| 4 | 关于高级管理人员离任的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站 | 2018年3月10日 |
| 5 | 关于旗下基金增加中民财富基金销售（上海）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 | 2018年3月28日 |
| 6 | 华泰保兴货币市场基金 2017 年年度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站 | 2018年3月28日 |
| 7 | 关于修改华泰保兴货币市场基金基金合同、托管协议和招募说明书的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站 | 2018年3月30日 |
| 8 | 华泰保兴货币市场基金暂停及恢复申购（转换转入、定期定额投资）公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站 | 2018年3月31日 |
| 9 | 华泰保兴货币市场基金 2018 年第 1 季度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站 | 2018年4月20日 |
| 10 | 关于高级管理人员离任的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站 | 2018年5月30日 |
| 11 | 华泰保兴货币市场基金更新招募说明书及摘要（2018 年第 1 号） | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站 | 2018年6月4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

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有本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 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

2018 年 8 月 25 日