

华泰保兴货币市场基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：二〇一九年八月二十九日

§ 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 2019 年 8 月 27 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§ 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 | 6,701,147,091.13 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 | 17,428,616.17 份 | 6,683,718,474.96 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。 |

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 | 刘连舸 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金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 |

§ 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(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日) | 报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 302,975.45 | 93,394,103.80 |

| | | |
|----------------------|-------------------------|------------------|
| 本期利润 | 302,975.45 | 93,394,103.80 |
| 本期净值收益率 | 1.1553% | 1.2766% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) | |
| 期末基金资产净值 | 17,428,616.17 | 6,683,718,474.96 |
| 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(2019年6月30日) | |
| 累计净值收益率 | 7.3064% | 7.8749% |

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、本基金收益分配自 2019 年 5 月 10 日起由按月结转份额改为按日结转份额。

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 | 0.1751% | 0.0003% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0641% | 0.0003% |
| 过去三个月 | 0.5393% | 0.0004% | 0.3366% | 0.0000% | 0.2027% | 0.0004% |
| 过去六个月 | 1.1553% | 0.0009% | 0.6695% | 0.0000% | 0.4858% | 0.0009% |
| 过去一年 | 2.5055% | 0.0015% | 1.3500% | 0.0000% | 1.1555% | 0.0015% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.3064% | 0.0024% | 2.9663% | 0.0000% | 4.3401% | 0.0024% |

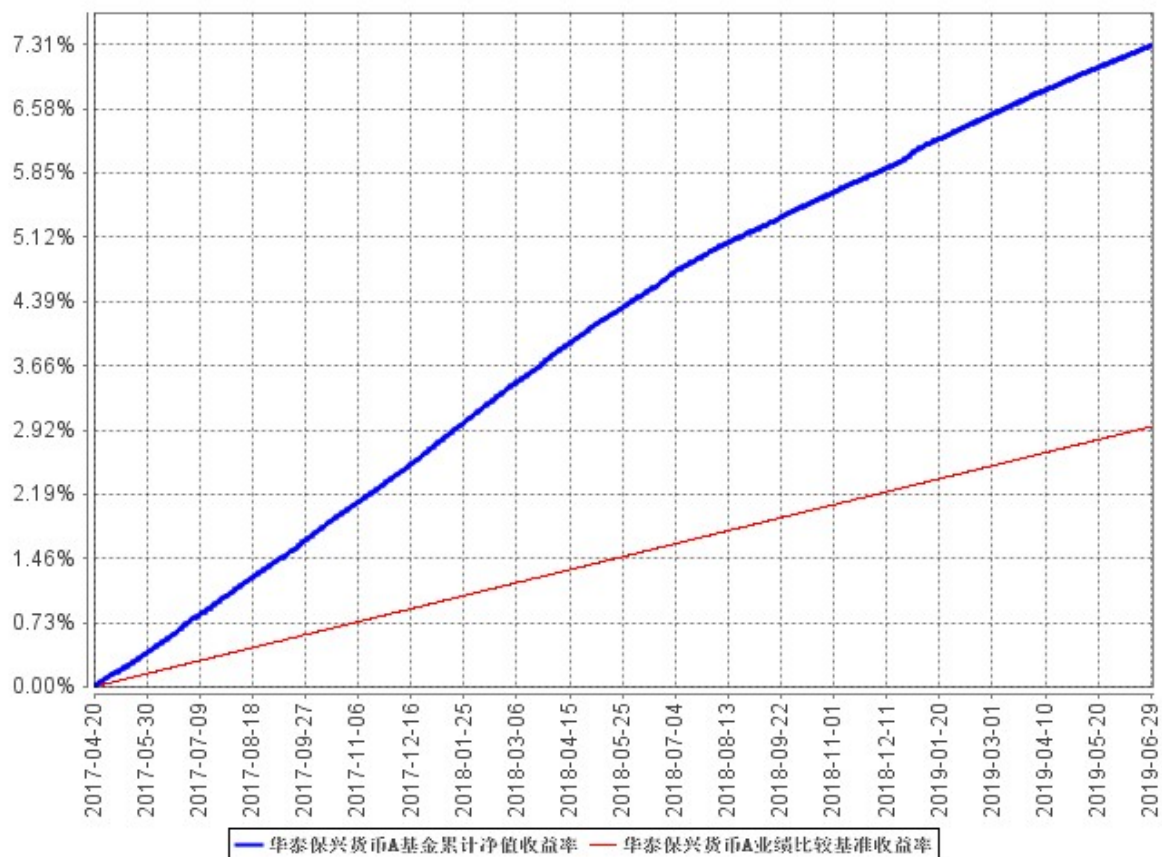
华泰保兴货币 B

| 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 | 0.1948% | 0.0003% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0838% | 0.0003% |
| 过去三个月 | 0.6001% | 0.0004% | 0.3366% | 0.0000% | 0.2635% | 0.0004% |
| 过去六个月 | 1.2766% | 0.0009% | 0.6695% | 0.0000% | 0.6071% | 0.0009% |
| 过去一年 | 2.7524% | 0.0015% | 1.3500% | 0.0000% | 1.4024% | 0.0015% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.8749% | 0.0024% | 2.9663% | 0.0000% | 4.9086% | 0.0024% |

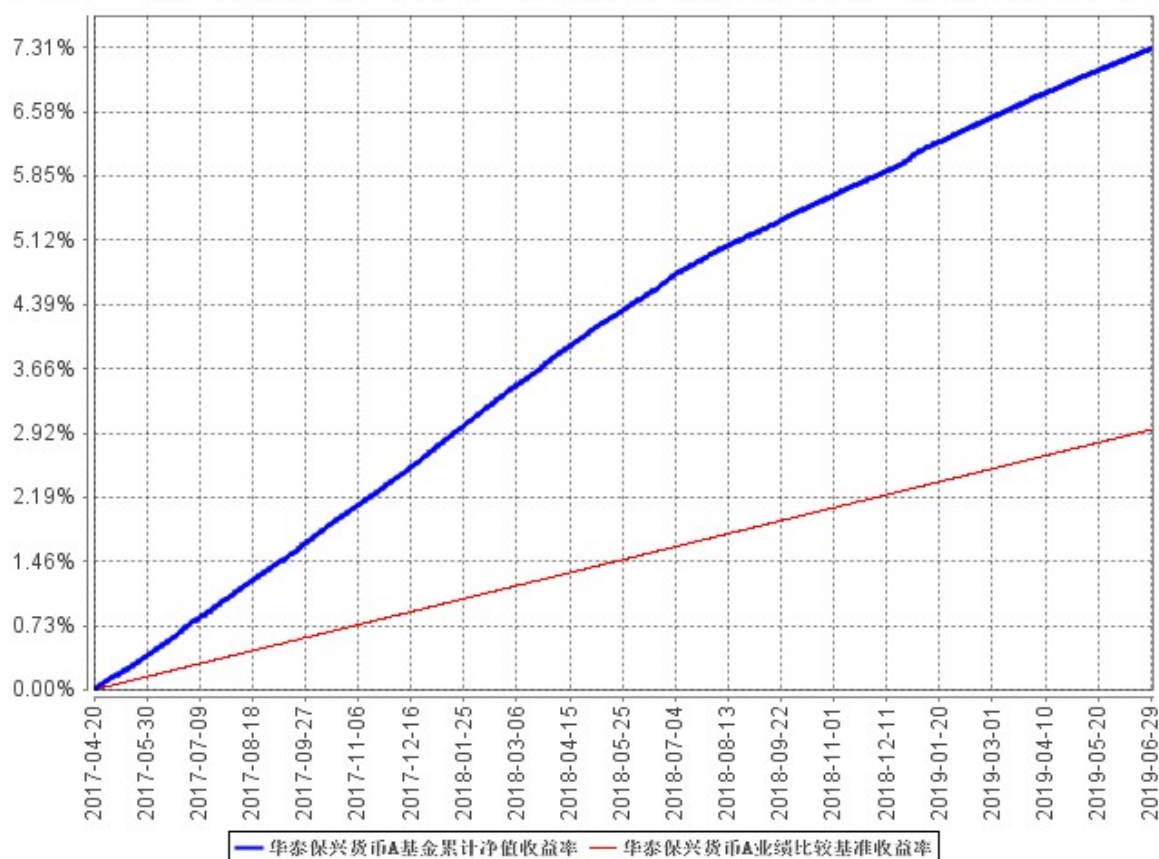
注：本基金业绩比较基准为：中国人民银行公布的 7 天通知存款利率（税后）。

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



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2019年6月30日，公司公募基金产品资产管理规模为142.20亿元。公司共管理十四只

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、华泰保兴尊颐定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰保兴研究智选灵活配置混合型证券投资基金、华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰保兴健康消费混合型证券投资基金。

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 | - | 8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。 |
| 王海明 | 基金经理助理 | 2019年6月20日 | - | 3年 | 硕士研究生，曾任华泰资产管理有限公司固定收益投资部研究员。 |

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，结合投资交易系统中的公平交易模块，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不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

2019 年上半年，国内经济运行总体保持稳定，二季度下行压力有所显现。社融、M2 增速略有回升，央行货币政策仍保持银行间市场流动性合理充裕。物价呈现食品较强、非食品较弱的特征，总体 CPI 温和回升。美债利率大幅下行，中美利差有所扩大，人民币汇率保持稳定。

报告期内，银行间市场流动性保持合理充裕，回购利率、存单利率保持低位稳定。包商银行托管后银行存单等级利差有所扩大。

基金投资上，主要投资信用资质较好的银行存单和存款，保持资产较高流动性和安全性，合理安排资产的到期期限。

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 1.1553%，本报告期华泰保兴货币 B 的基

金份额净值收益率为 1.2766%，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 2019 年下半年，经济下行压力依然存在，经济增速可能会继续小幅回落。房地产投资增速同比可能会逐步回落，工业品价格仍面临下行风险，制造业投资仍将保持较低增速。政策方面，央行仍将保持稳健货币政策，通过定向降准等方式支持实体经济，全面降息降准的可能性不大。

总体而言，预期下半年央行货币政策会延续稳健中性，保持流动性合理充裕，引导资金支持实体经济，货币市场利率水平总体仍将保持低位稳定。投资上仍将注意保持资产的流动性和安全性，合理安排资产到期结构，在严控风险的前提下，通过精细化的操作获取收益。

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。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司/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，本基金收益分配自 2019 年 5 月 10 日起由按月结转份额改为按日结转份额。本报告期内本基金应分配收益 93,697,079.25 元，实际分配收益 93,697,079.25 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、准确和完整。

§ 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,611,119,434.88 | 1,609,127,893.13 |
| 结算备付金 | | - | 5,204,545.45 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,843,782,052.40 | 3,045,471,008.09 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 2,843,782,052.40 | 3,045,471,008.09 |
| 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 | 2,436,456,854.70 | 2,649,732,754.62 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 22,366,758.07 | 23,657,187.54 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 30,300,000.00 | 300.00 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 6,944,025,100.05 | 7,333,193,688.83 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 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 | | 238,799,640.60 | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,734,754.81 | 1,992,675.75 |
| 应付托管费 | | 525,683.25 | 603,841.16 |
| 应付销售服务费 | | 55,912.03 | 67,360.87 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 92,918.42 | 96,353.10 |
| 应交税费 | | 1,578.09 | 27,197.28 |
| 应付利息 | | 37,708.66 | - |
| 应付利润 | | 1,418,491.26 | 3,439,037.11 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 211,321.80 | 417,000.00 |
| 负债合计 | | 242,878,008.92 | 6,643,465.27 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 6,701,147,091.13 | 7,326,550,223.56 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 6,701,147,091.13 | 7,326,550,223.56 |
| 负债和所有者权益总计 | | 6,944,025,100.05 | 7,333,193,688.83 |

注：报告截止日 2019 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 17,428,616.17 份；华泰保兴货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 6,683,718,474.96 份。华泰保兴货币份额总额合计为 6,701,147,091.13 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰保兴货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|---|--|
| 一、收入 | | 110,691,689.77 | 146,500,226.41 |
| 1.利息收入 | | 110,568,620.80 | 146,015,108.18 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 26,600,463.78 | 46,257,994.02 |
| 债券利息收入 | | 50,356,393.30 | 72,051,045.88 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | 686,533.92 |
| 买入返售金融资产收入 | | 33,611,763.72 | 27,019,534.36 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 123,068.97 | 485,118.23 |
| 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 | 123,068.97 | 485,118.23 |
| 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 | | 16,994,610.52 | 17,268,085.05 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 12,084,892.12 | 10,496,243.31 |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|----------------|
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 3,662,088.40 | 3,180,679.86 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 397,070.14 | 341,234.05 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | - | - |
| 5. 利息支出 | | 604,249.21 | 2,988,501.39 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 604,249.21 | 2,988,501.39 |
| 6. 税金及附加 | | 1,363.27 | 5,287.56 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 244,947.38 | 256,138.88 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 93,697,079.25 | 129,232,141.36 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 93,697,079.25 | 129,232,141.36 |

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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） | 7,326,550,223.56 | - | 7,326,550,223.56 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 93,697,079.25 | 93,697,079.25 |
| 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） | -625,403,132.43 | - | -625,403,132.43 |
| 其中：1.基金申购款 | 17,046,034,359.38 | - | 17,046,034,359.38 |
| 2.基金赎回款 | -17,671,437,491.81 | - | -17,671,437,491.81 |
| 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） | - | -93,697,079.25 | -93,697,079.25 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 6,701,147,091.13 | - | 6,701,147,091.13 |
| 项目 | 上年度可比期间 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金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | -129,232,141.36 | -129,232,141.36 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 6,316,591,449.57 | - | 6,316,591,449.57 |

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 | _____ 王冠龙 | _____ 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人民币 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 2019 年 8 月 28 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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 |
| 华泰保险集团股份有限公司 | 基金管理人的主要股东 |
| 上海飞恒资产管理中心（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 上海旷正资产管理中心（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 上海泰颐资产管理中心（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 上海哲昌资产管理中心（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 上海志庄资产管理中心（有限合伙） | 基金管理人的股东 |

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日 至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日 至2018年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 12,084,892.12 | 10,496,243.31 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 546,380.32 | 27,031.84 |

注：支付基金管理人华泰保兴基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| | 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日 | 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,662,088.40 | 3,180,679.86 |

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 | | |
|----------------|---------------------------------|------------|------------|
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 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 | 23,830.45 | 321,800.68 | 345,631.13 |
| 中国银行股份有限公司 | 2,356.17 | - | 2,356.17 |
| 合计 | 26,186.62 | 321,800.68 | 347,987.30 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 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 | - | 2,951.81 |
| 合计 | 23,451.86 | 315,621.08 | 339,072.94 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金份额和 B 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华泰保兴基金管理有限公司，再由华泰保兴基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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 | - | 18,902,987.51 |
| 期间申购/买入总份额 | - | 200,887.66 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | 11,000,000.00 |
| 期末持有的基金份额 | - | 8,103,875.17 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | - | 0.12% |

| 项目 | 上年度可比期间 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% |

注：1. 期间申购/买入总份额含转换入、红利再投、强制调增份额，期间赎回/卖出总份额含转换出、强制调减份额。

2. 基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

6.4.8.4.2 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 B | | |
|----------|------------------------|--------------------------|
| 关联方名称 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 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 |
|------------------|---------------|--------------------------|-------------|--------------------------|
| 华泰保险集团 股份有限公司 | 50,100,176.45 | 0.7476% | - | - |

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

6.4.8.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 | 11,119,434.88 | 57,110.42 | 6,614,621.56 | 60,768.36 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 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 |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 318,643.78 | - | -15,668.33 | 302,975.45 | - |

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 |
|---------------|-------------------|---------------|---------------|----|
| 95,398,981.32 | - | -2,004,877.52 | 93,394,103.80 | - |

6.4.10 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：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。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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 238,799,640.60 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 |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 111808251 | 18 中信银行 CD251 | 2019 年 7 月 1 日 | 99.88 | 1,500,000 | 149,815,729.84 |
| 190201 | 19 国开 01 | 2019 年 7 月 1 日 | 99.89 | 1,050,000 | 104,884,041.68 |
| 合计 | | | | 2,550,000 | 254,699,771.52 |

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.11 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 2019 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 2,843,782,052.40 元，无属于第一或第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第二层次 3,045,471,008.09 元，无第一或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间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 2019 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(2018 年 12 月 31 日：同)。

(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) 其他

除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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 | 固定收益投资 | 2,843,782,052.40 | 40.95 |
| | 其中：债券 | 2,843,782,052.40 | 40.95 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 2,436,456,854.70 | 35.09 |
| | 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 | 1,611,119,434.88 | 23.20 |
| 4 | 其他各项资产 | 52,666,758.07 | 0.76 |
| 5 | 合计 | 6,944,025,100.05 | 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 | 0.80 |

| | 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 | 238,799,640.60 | 3.56 |
| | 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 | 41 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 56 |
| 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

注：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 | 59.20 | 3.56 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 21.60 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 14.72 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天(含)—120 天 | - | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天(含)—397 天(含) | 7.32 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 102.84 | 3.56 |

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：本基金本报告期内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 | 582,028,456.31 | 8.69 |
| | 其中：政策性金融债 | 582,028,456.31 | 8.69 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 19,999,867.24 | 0.30 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 2,241,753,728.85 | 33.45 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 2,843,782,052.40 | 42.44 |
| 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 | 111907092 | 19 招商银行 CD092 | 3,000,000 | 298,277,170.71 | 4.45 |
| 2 | 111817200 | 18 光大银行 CD200 | 2,000,000 | 199,757,474.42 | 2.98 |
| 3 | 111997350 | 19 宁波银行 CD085 | 2,000,000 | 199,308,300.23 | 2.97 |
| 4 | 111817188 | 18 光大银行 CD188 | 2,000,000 | 199,198,997.48 | 2.97 |
| 5 | 111903074 | 19 农业银行 CD074 | 2,000,000 | 198,795,245.08 | 2.97 |
| 6 | 111808251 | 18 中信银行 CD251 | 1,500,000 | 149,815,729.84 | 2.24 |
| 7 | 190201 | 19 国开 01 | 1,200,000 | 119,867,476.20 | 1.79 |
| 8 | 180202 | 18 国开 02 | 1,000,000 | 101,077,002.66 | 1.51 |
| 9 | 150203 | 15 国开 03 | 1,000,000 | 100,611,240.18 | 1.50 |
| 10 | 120231 | 12 国开 31 | 1,000,000 | 100,019,161.74 | 1.49 |

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 | 0.0505% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0138% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0207% |

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

注：本基金本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

1、19 宁波银行 CD085（代码：111997350）为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 12 月 13 日，宁波银监局针对宁波银行个人贷款资金违规流入房市、购买理财的违法违规行为，对宁波银行处以 20 万元罚款的行政处罚（详见甬银监罚决字[2018]45 号行政处罚决定书）；2019 年 3 月 3 日，宁波银保监局针对宁波银行违规将同业存款变为一般性存款，对宁波银行处以罚款人民币 20 万元的行政处罚（详见甬银保监罚决字[2019]14 号行政处罚决定书）；2019 年 6 月 28 日，宁波银保监局针对宁波银行违反信贷政策、违反房地产行业政策、违规开展存贷业务、员工管理不到位、向监管部门报送的报表不准确等违法违规事实，对宁波银行处以罚款人民币 270 万元、并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分的行政处罚（详见甬银保监罚决字[2019]59 号行政处罚决定书）；2019 年 6 月 28 日，宁波银保监局针对宁波银行销售行为不合规、双录管理不到位等违法违规事实，对宁波银行处以罚款人民币 30 万元、并责令该行对相关直接责任人给予记录处分的行政处罚（详见甬银保监罚决字[2019]62 号行政处罚决定书）。

2、18 光大银行 CD200（代码：111817200）、18 光大银行 CD188（代码：111817188）为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 11 月 9 日，中国银保监会针对光大银行内控管理严重违反审慎经营规则等违法违规行为，对光大银行处以人民币 1120 万元的行政处罚（详见银

保监银罚决字[2018]10 号行政处罚决定书)。

3、18 中信银行 CD251 (代码: 111808251) 为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 11 月 19 日, 中国银保监会针对中信银行理财资金违规缴纳土地款等违法违规行为, 对中信银行给予罚款人民币 2280 万元的行政处罚 (详见银保监银罚决字[2018]14 号行政处罚决定书)。

本基金投资 19 宁波银行 CD085、18 光大银行 CD200、18 光大银行 CD188、18 中信银行 CD251 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 19 宁波银行 CD085、18 光大银行 CD200、18 光大银行 CD188、18 中信银行 CD251 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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 22,366,758.07 |
| 4 | 应收申购款 | 30,300,000.00 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 52,666,758.07 |

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 | 278 | 62,692.86 | 12,052,655.28 | 69.15% | 5,375,960.89 | 30.85% |

| | | | | | | |
|----------|-----|---------------|------------------|---------|--------------|-------|
| A | | | | | | |
| 华泰保兴货币 B | 84 | 79,568,077.08 | 6,683,718,474.96 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 362 | 18,511,456.05 | 6,695,771,130.24 | 99.92% | 5,375,960.89 | 0.08% |

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 | 530,112,147.96 | 7.91% |
| 2 | 券商类机构 | 504,099,725.55 | 7.52% |
| 3 | 银行类机构 | 500,067,156.37 | 7.46% |
| 4 | 保险类机构 | 402,227,884.67 | 6.00% |
| 5 | 其他机构 | 315,662,208.66 | 4.71% |
| 6 | 其他机构 | 315,662,208.66 | 4.71% |
| 7 | 信托类机构 | 306,754,006.16 | 4.58% |
| 8 | 券商类机构 | 250,951,848.13 | 3.74% |
| 9 | 信托类机构 | 250,016,922.11 | 3.73% |
| 10 | 银行类机构 | 205,056,501.30 | 3.06% |

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 | 131,313.45 | 0.75% |
| | 华泰保兴货币 B | 0.00 | 0.00% |
| | 合计 | 131,313.45 | 0.00% |

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、基金投资和相关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 |

注：期末本基金基金经理未持有本基金份额。

§ 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 | 66,453,659.42 | 5,767,493,819.10 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 42,977,780.30 | 7,283,572,443.26 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 26,532,004.12 | 17,019,502,355.26 |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额 | 52,081,168.25 | 17,619,356,323.56 |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 17,428,616.17 | 6,683,718,474.96 |

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) 本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。
 (2) 2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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。本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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 | - | - | - | - | -- |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | -- |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | -- |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | -- |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | -- |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | -- |
| 申万证券 | 2 | - | - | - | - | -- |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | -- |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | -- |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | -- |

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，基金管理人对多家证券经营机构进行了综合评估。

1、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。

2、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。

10.7.2 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 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | 63,500,000.00 | 0.86% | - | - |
| 东方证券 | - | - | 1,115,000,000.00 | 15.02% | - | - |
| 广发证券 | - | - | 1,010,000,000.00 | 13.61% | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万证券 | - | - | 20,000,000.00 | 0.27% | - | - |
| 天风证券 | - | - | 1,040,000,000.00 | 14.01% | - | - |
| 兴业证券 | - | - | 2,050,000,000.00 | 27.62% | - | - |
| 国泰君安 | - | - | 2,125,000,000.00 | 28.63% | - | - |

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。

§ 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。

华泰保兴基金管理有限公司

2019 年 8 月 29 日