

华泰保兴尊睿 6 个月持有期债券型发起式证券投资基金  
2024 年第 3 季度报告

2024 年 09 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起
基金主代码	018846
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 09 月 07 日
报告期末基金份额总额	1,099,196,199.37 份
投资目标	在严格控制风险和保持资金流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>本基金通过对宏观经济运行状态、国家财政政策和货币政策、国家产业政策及资本市场资金环境的深入分析，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，结合定量分析方法，确定基金资产在各固定收益类证券之间的配置比例。</p> <p>本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，灵活运用久期管理策略、期限结构配置策略、类属配置策略、信用债投资策略、个券挖掘策略及杠杆投资策略等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，对债券组合进行动态调整。</p>
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险和预期收益低于股票型基金和混

	合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 A	华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 C
下属分级基金的交易代码	018846	018847
报告期末下属分级基金的份额总额	1,004,704,355.74 份	94,491,843.63 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 07 月 01 日-2024 年 09 月 30 日）	
	华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 A	华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 C
1. 本期已实现收益	11,435,099.28	463,091.96
2. 本期利润	509,143.33	-111,777.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0005	-0.0027
4. 期末基金资产净值	1,066,955,065.49	100,147,918.72
5. 期末基金份额净值	1.0620	1.0599

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 A

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.05%	0.06%	0.26%	0.10%	-0.21%	-0.04%
过去六个月	2.59%	0.06%	1.32%	0.09%	1.27%	-0.03%
过去一年	6.15%	0.05%	3.53%	0.07%	2.62%	-0.02%
自基金合同生效起至今	6.20%	0.05%	3.23%	0.07%	2.97%	-0.02%

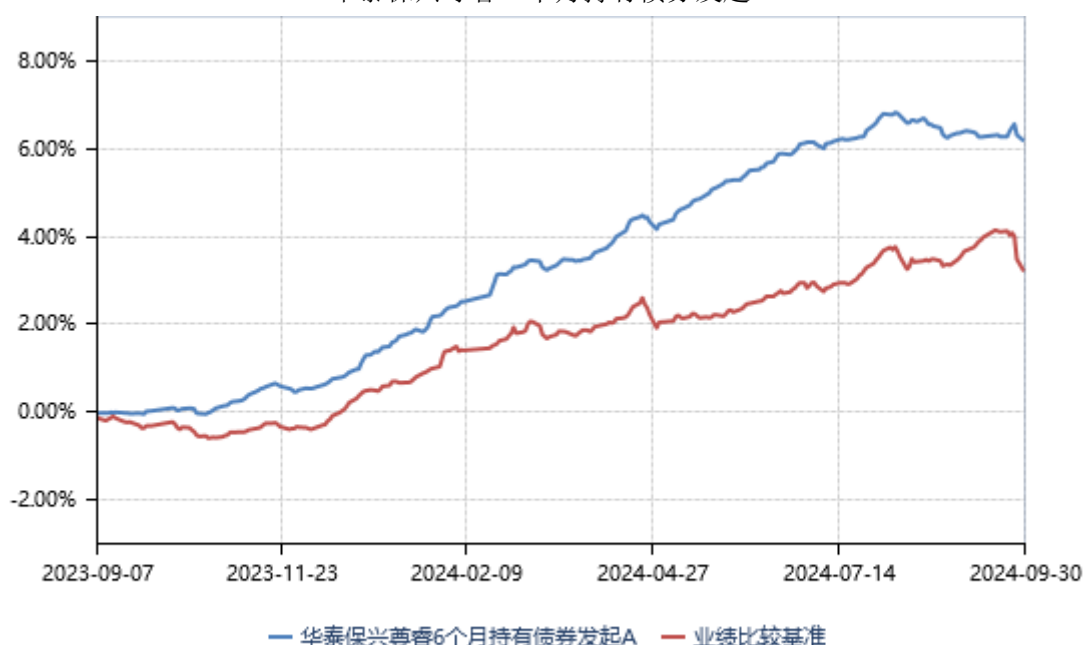
华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 C

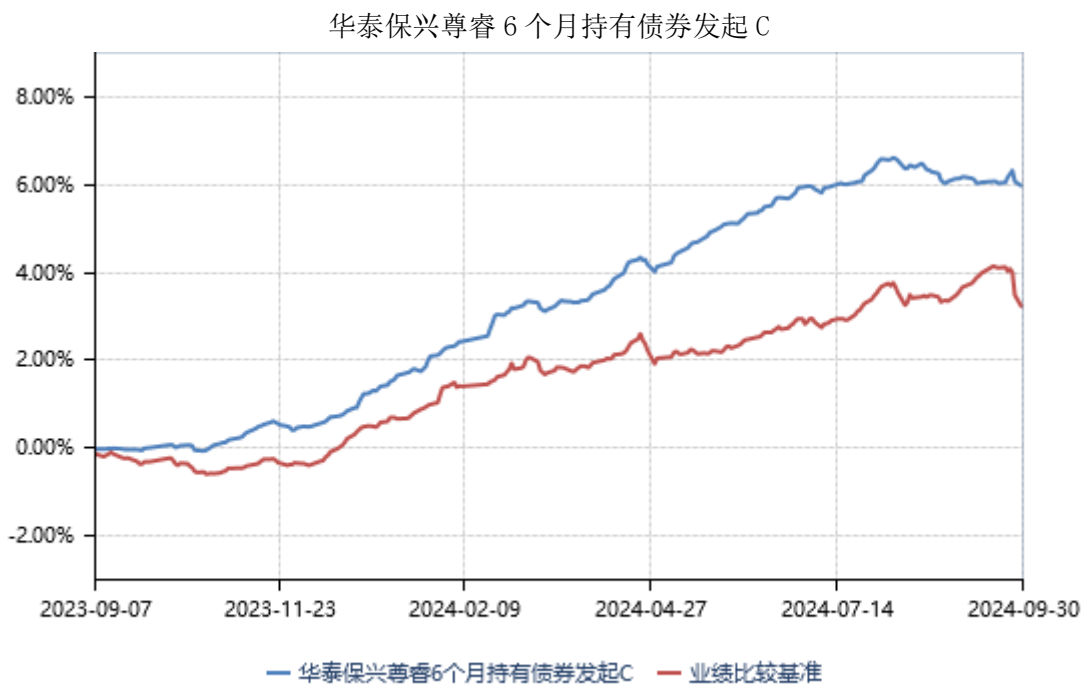
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.02%	0.06%	0.26%	0.10%	-0.24%	-0.04%
过去六个月	2.51%	0.06%	1.32%	0.09%	1.19%	-0.03%
过去一年	5.96%	0.05%	3.53%	0.07%	2.43%	-0.02%
自基金合同生效起至今	5.99%	0.05%	3.23%	0.07%	2.76%	-0.02%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率。

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

华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 A





## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄晓栋	基金经理、公司固定收益投资一部总经理助理	2023年09月07日	-	9年	毕业于复旦大学管理学院。2011年至2016年，先后就职于上海新世纪资信评估投资服务有限公司和华泰资产管理有限公司。2016年12月加入华泰保兴基金管理有限公司，历任信用研究员。
张挺	基金经理、公司固定收益投资总监、固定收益投资一部总经理	2023年09月07日	-	13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 公平交易专项说明

#### 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管理办法》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，严格监控同一交易日内不同投资组合之间的反向交易。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024年以来国内经济在修复过程中，供给保持增长态势，需求有待进一步恢复。9月PMI反映供需反弹，但新订单仍低于50，原材料价格和出厂价格回升，但处于低水平，8月经济数据低于预期，工业生产明显走弱，外需好于内需、消费疲弱。9月26日政治局会议体现了中央对于经济困难局面的重视，对经济

的看法从“回升向好”到“正视困难”，财政发力预期较强。9月27日财政部新闻发布会披露了一系列政策，包括化债、特别国债补充大行资本金等方面，均有助于经济进一步回升。

债券操作上，前三季度整体持仓以 AAA 品种为主。在年初基于信用债供需格局和政策环境有利于收益率下行及利差压缩的判断，适度增加相应品种的配置，获取了较好的票息及资本利得收益；三季度基于对收益率水平和机构行为的判断，对信用持仓进行一定调整，强化组合的流动性；此外基于宏观经济趋势的判断在适宜的仓位中增加了利率品种的交易，对组合收益做到了一定的增厚。

可转债方面，继续保持中性仓位，坚持绝对收益增强思路，低位参与以银行转债为代表的低估值品种，并适度分散参与平衡型转债。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 A 份额净值为 1.0620 元，本报告期华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 A 份额净值增长率为 0.05%，同期业绩比较基准收益率为 0.26%；截至本报告期末华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 C 份额净值为 1.0599 元，本报告期华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 C 份额净值增长率为 0.02%，同期业绩比较基准收益率为 0.26%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,452,165,290.67	97.16
	其中：债券	1,452,165,290.67	97.16
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	18,500,512.05	1.24
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	13,488,097.36	0.90
8	其他资产	10,390,720.59	0.70
9	合计	1,494,544,620.67	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	134,793,464.06	11.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	183,820,692.61	15.75
	其中：政策性金融债	50,289,191.78	4.31
4	企业债券	237,148,241.65	20.32
5	企业短期融资券	61,009,360.61	5.23
6	中期票据	715,930,987.36	61.34
7	可转债（可交换债）	119,462,544.38	10.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,452,165,290.67	124.42

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	2128002	21 工商银行二级 01	400,000	42,124,504.11	3.61
2	102480106	24 冀中能源 MTN001(科创票据)	400,000	41,711,278.69	3.57
3	2028040	20 交通银行永续债	400,000	40,936,144.66	3.51
4	012480857	24 闽投 SCP002	400,000	40,458,588.49	3.47
5	019733	24 国债 02	320,000	32,482,270.68	2.78

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。



## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

根据公开市场信息显示，本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到行政处罚，详见《国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字（2024）29 号）》。本基金投资上述证券的投资决策程序，符合法律法规及公司投资制度有关规定。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	10,781.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,379,938.85
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,390,720.59

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	12,382,037.72	1.06
2	113065	齐鲁转债	9,999,222.92	0.86
3	110079	杭银转债	8,113,766.19	0.70

4	113042	上银转债	7,683,602.80	0.66
5	128048	张行转债	7,306,681.96	0.63
6	113050	南银转债	6,849,613.95	0.59
7	113056	重银转债	6,463,804.40	0.55
8	132026	G 三峡 EB2	6,459,336.99	0.55
9	128129	青农转债	5,288,057.32	0.45
10	113037	紫银转债	5,253,010.69	0.45
11	110059	浦发转债	5,183,721.28	0.44
12	113021	中信转债	5,072,540.10	0.43
13	113669	景 23 转债	3,885,517.81	0.33
14	127032	苏行转债	3,215,564.86	0.28
15	123107	温氏转债	3,076,056.76	0.26
16	113062	常银转债	2,208,368.05	0.19
17	113044	大秦转债	2,137,644.99	0.18
18	113631	皖天转债	1,696,200.36	0.15
19	127039	北港转债	1,634,837.05	0.14
20	113055	成银转债	1,191,177.00	0.10
21	113060	浙 22 转债	906,223.12	0.08
22	123208	孩王转债	710,027.76	0.06
23	127045	牧原转债	646,600.81	0.06
24	113641	华友转债	631,015.68	0.05
25	127085	韵达转债	594,474.66	0.05
26	110084	贵燃转债	562,773.86	0.05
27	127027	能化转债	539,341.18	0.05
28	113069	博 23 转债	422,732.80	0.04
29	110068	龙净转债	420,870.86	0.04
30	110075	南航转债	420,639.60	0.04
31	113666	爱玛转债	411,864.78	0.04
32	123119	康泰转 2	409,565.39	0.04
33	128136	立讯转债	405,380.18	0.03
34	110094	众和转债	404,615.91	0.03
35	113619	世运转债	318,901.30	0.03
36	123158	宙邦转债	292,252.40	0.03
37	113671	武进转债	212,211.01	0.02
38	110067	华安转债	210,588.40	0.02
39	123091	长海转债	209,975.51	0.02
40	113043	财通转债	209,925.07	0.02
41	113623	凤 21 转债	209,334.28	0.02
42	110073	国投转债	207,390.33	0.02

43	113652	伟 22 转债	204,549.00	0.02
44	127031	洋丰转债	204,538.43	0.02
45	127073	天赐转债	204,004.69	0.02
46	128141	旺能转债	203,040.01	0.02
47	127020	中金转债	202,503.40	0.02
48	127086	恒邦转债	200,503.49	0.02
49	113045	环旭转债	196,352.05	0.02
50	127028	英特转债	168,433.81	0.01
51	118030	睿创转债	111,833.09	0.01
52	113058	友发转债	110,929.44	0.01
53	123090	三诺转债	110,896.64	0.01
54	127052	西子转债	110,793.94	0.01
55	123145	药石转债	109,484.51	0.01
56	127066	科利转债	109,391.34	0.01
57	110090	爱迪转债	109,285.66	0.01
58	118024	冠宇转债	108,108.50	0.01
59	110089	兴发转债	107,592.13	0.01
60	127091	科数转债	106,504.58	0.01
61	113061	拓普转债	106,169.48	0.01
62	118013	道通转债	106,034.67	0.01
63	128144	利民转债	105,135.59	0.01
64	128109	楚江转债	104,991.15	0.01
65	111002	特纸转债	104,914.44	0.01
66	113632	鹤 21 转债	104,717.35	0.01
67	110093	神马转债	104,253.66	0.01
68	113616	韦尔转债	103,077.43	0.01
69	127054	双箭转债	102,897.70	0.01
70	127072	博实转债	102,764.77	0.01
71	128132	交建转债	101,959.79	0.01
72	113049	长汽转债	101,527.32	0.01
73	113066	平煤转债	101,328.82	0.01
74	110082	宏发转债	100,928.85	0.01
75	127082	亚科转债	100,899.89	0.01
76	113047	旗滨转债	100,608.38	0.01
77	110087	天业转债	100,391.51	0.01
78	113627	太平转债	99,898.62	0.01
79	113064	东材转债	99,819.62	0.01
80	110076	华海转债	98,602.86	0.01
81	127050	麒麟转债	95,130.39	0.01

82	113674	华设转债	91,686.53	0.01
83	128133	奇正转债	88,592.76	0.01

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 A	华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 C
报告期期初基金份额总额	970,222,945.65	24,250,722.98
报告期期间基金总申购份额	88,912,519.22	71,310,426.45
减：报告期期间基金总赎回份额	54,431,109.13	1,069,305.80
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	1,004,704,355.74	94,491,843.63

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。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 A	华泰保兴尊睿 6 个月持有债券发起 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,900.09	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,900.09	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.91	-

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总 份额比例	发起份额承诺持有 期限
基金管理人固有 资金	10,000,900.09	0.91%	10,000,900.09	0.91%	自基金合同生效之 日起不少于 3 年
基金管理人高级 管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,900.09	0.91%	10,000,900.09	0.91%	-

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20240701-20240930	388,392,428.89	-	-	388,392,428.89	35.33%
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：申购份额含红利再投、转换入份额。赎回份额含转换出份额。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金募集的文件
- 2、《华泰保兴尊睿 6 个月持有期债券型发起式证券投资基金基金合同》

- 3、《华泰保兴尊睿 6 个月持有期债券型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《华泰保兴尊睿 6 个月持有期债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、报告期内本基金在规定媒介披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

## 10.2 存放地点

基金管理人办公场所及基金托管人住所

## 10.3 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（免长途话费）查询

华泰保兴基金管理有限公司  
2024 年 10 月 25 日