

# 华泰保兴尊合债券型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 06 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

报告送出日期：2021 年 08 月 28 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。本中期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 2021 年 08 月 25 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 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	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	13
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遵规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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	37
7.1	期末基金资产组合情况	37
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	37
7.6	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	38
7.7	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	38
7.8	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贵金属投资明细	38
7.9	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	38
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38

7.12	投资组合报告附注 .....	38
§ 8	基金份额持有人信息 .....	42
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
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情况 .....	42
§ 9	开放式基金份额变动 .....	43
§ 10	重大事件揭示 .....	44
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4	基金投资策略的改变 .....	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8	其他重大事件 .....	46
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
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 .....	48
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
§ 12	备查文件目录 .....	49
12.1	备查文件目录 .....	49
12.2	存放地点 .....	49
12.3	查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰保兴尊合债券型证券投资基金	
基金简称	华泰保兴尊合债券	
基金主代码	005159	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 11 月 21 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	2,130,738,360.35 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰保兴尊合债券 A	华泰保兴尊合债券 C
下属分级基金的交易代码	005159	005160
报告期末下属分级基金的份额总额	1,901,123,291.64 份	229,615,068.71 份

### 2.2 基金产品说明

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	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。本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，灵活运用久期策略、期限结构配置策略、类属配置策略、信用债策略、个券挖掘策略及杠杆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。
业绩比较基准	中债综合指数（全价）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。

### 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	许俊
	联系电话	021-80299000	010-66594319
	电子邮箱	fund_xxpl@ehuatai.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-632-9090	95566
传真		021-60756968	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	纪大道 88 号 3810 室	
办公地址	上海市浦东新区博成路 1101 号 华泰金融大厦 9 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200126	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	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ehuataifund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所及基金托管人住所

## 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	上海市浦东新区博成路 1101 号华 泰金融大厦 9 层

### § 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）	
	华泰保兴尊合债券 A	华泰保兴尊合债券 C
本期已实现收益	3,470,302.87	297,553.01
本期利润	58,898,588.48	2,013,532.64
加权平均基金份额本期利润	0.0355	0.0260
本期加权平均净值利润率	2.89%	2.11%
本期基金份额净值增长率	3.24%	3.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2021 年 06 月 30 日）	
	华泰保兴尊合债券 A	华泰保兴尊合债券 C
期末可供分配利润	323,523,430.43	37,143,979.65
期末可供分配基金份额利润	0.1702	0.1618
期末基金资产净值	2,383,696,559.26	285,897,386.07
期末基金份额净值	1.2538	1.2451
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2021 年 06 月 30 日）	
	华泰保兴尊合债券 A	华泰保兴尊合债券 C
基金份额累计净值增长率	25.38%	24.51%

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。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上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 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

华泰保兴尊合债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.42%	0.08%	-0.04%	0.03%	0.46%	0.05%
过去三个月	2.62%	0.10%	0.45%	0.03%	2.17%	0.07%
过去六个月	3.24%	0.09%	0.65%	0.04%	2.59%	0.05%
过去一年	3.85%	0.09%	-0.20%	0.06%	4.05%	0.03%
过去三年	21.65%	0.09%	4.53%	0.07%	17.12%	0.02%
自基金合同生效起至今	25.38%	0.09%	6.57%	0.07%	18.81%	0.02%

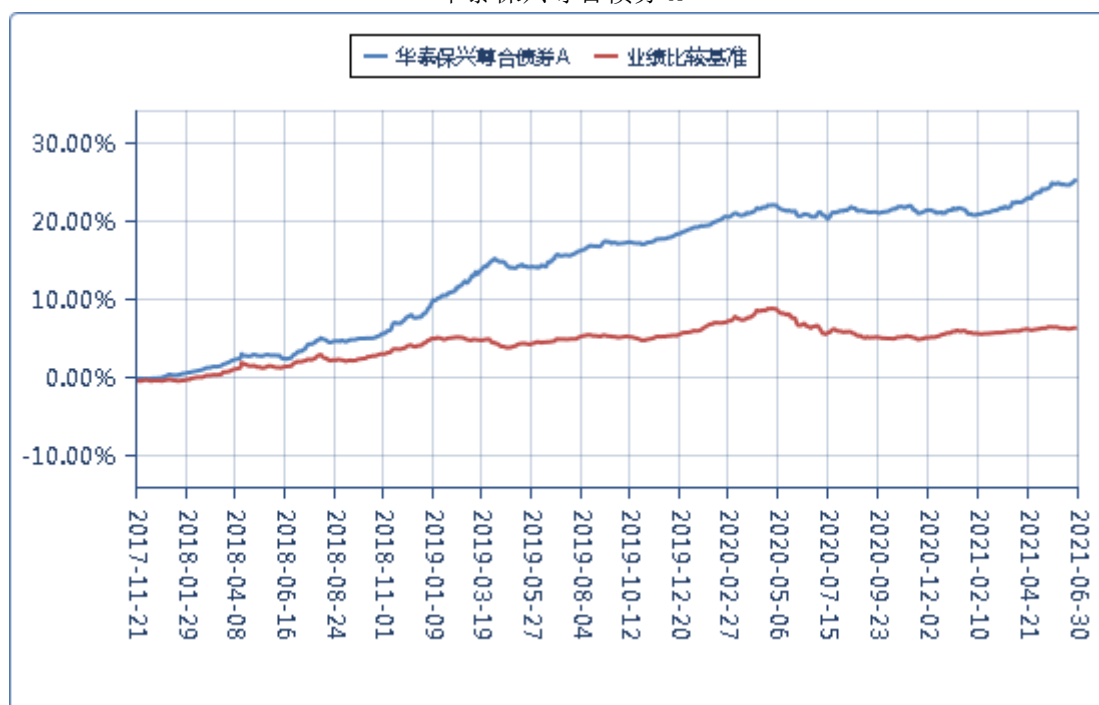
华泰保兴尊合债券 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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
过去一个月	0.41%	0.08%	-0.04%	0.03%	0.45%	0.05%
过去三个月	2.57%	0.10%	0.45%	0.03%	2.12%	0.07%
过去六个月	3.14%	0.09%	0.65%	0.04%	2.49%	0.05%
过去一年	3.65%	0.09%	-0.20%	0.06%	3.85%	0.03%
过去三年	20.97%	0.09%	4.53%	0.07%	16.44%	0.02%
自基金合同生 效起至今	24.51%	0.09%	6.57%	0.07%	17.94%	0.02%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率。

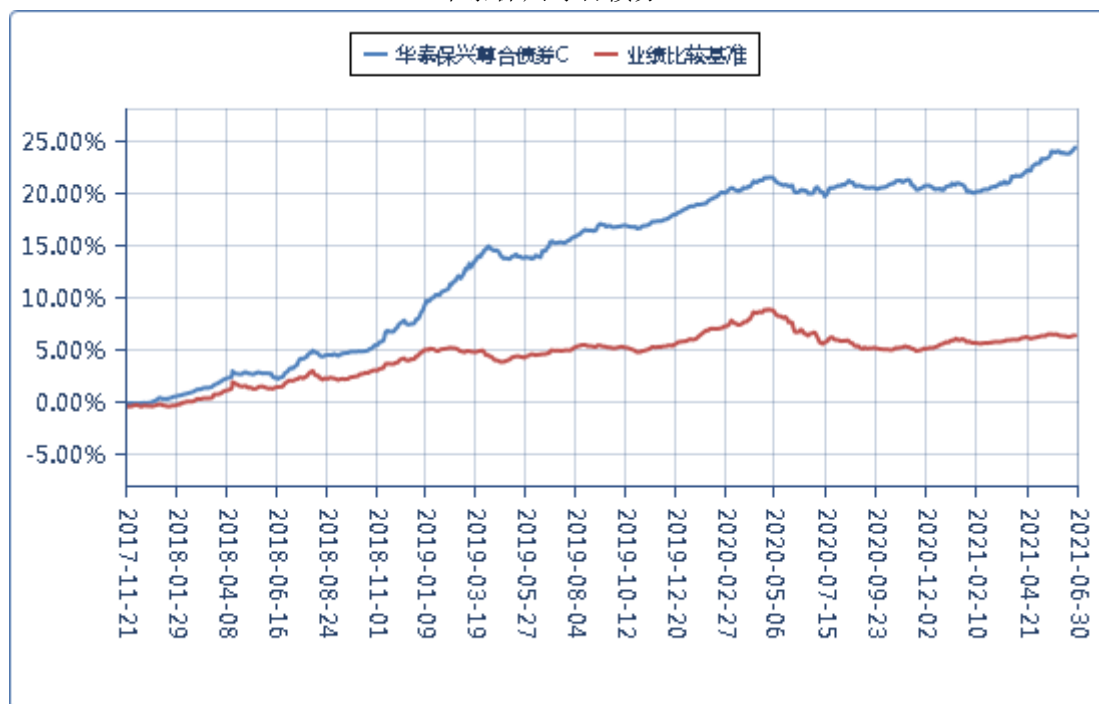
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰保兴尊合债券 A





华泰保兴尊合债券 C



注：截至本报告期末，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

华泰保兴基金管理有限公司(以下或简称“公司”或“本公司”)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,公司股东分别为华泰保险集团股份有限公司(以下简称“华泰保险集团”)、上海飞恒资产管理中心(有限合伙)(以下简称“飞恒资产”)、上海旷正资产管理中心(有限合伙)(以下简称“旷正资产”)、上海泰颐资产管理中心(有限合伙)(以下简称“泰颐资产”)、上海哲昌资产管理中心(有限合伙)(以下简称“哲昌资产”)、上海志庄资产管理中心(有限合伙)(以下简称“志庄资产”)。根据公司股东会决议,并经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]3003号文核准,本公司进行增资扩股。公司新增注册资本人民币6,000万元由公司主要股东华泰保险集团认购并已完成实缴。本次增资完成后,公司注册资本由人民币18,000万元增加至人民币24,000万元;其中,华泰保险集团持股比例为85%,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15%。公司本次增加注册资本及股权变更、章程修改涉及的工商变更登记手续已在上海市市场监督管理局办理完毕,并已按有关规定向中国证券监督管理委员会及中国证券监督管理委员会上海监管局备案。公司已于2020年6月4日就增加注册资本及股权变更事宜进行了公告。

截至2021年6月30日,公司公募证券投资基金管理规模为人民币261.37亿元,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、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、华泰保兴多策略三个月定期开放股票型发起式证券投资基金、华泰保兴安悦债券型证券投资基金、华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰保兴科荣混合型证券投资基金及华泰保兴久盈63个月定期开放债券型证券投资基金等19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	基金经理	2017 年 11 月 21 日	-	10 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，现任基金投资部联席总经理。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

2021 年上半年，国内经济运行呈现冲高回落走势。一季度受基数效应影响，GDP 增速冲高至 18.3%，二季度 GDP 增速回落至 7.9%，二季度经济略有走弱迹象，总体仍处于较高增速。融资方面，社融增速从去年底的 13.3%回落至 11%，M2 增速亦从去年底的 10.1%回落至 8.6%，货币政策保持流动性合理充裕，回购利率一季度总体较低，个别时点波动略大，二季度进一步下行且保持稳定。

物价方面，CPI 呈现底部略有回升，总体仍在低位，PPI 大幅冲高，5 月达到 9%的高位，6 月小幅回落至 8.8%。美债利率冲高回落，中美利差较为稳定。人民币汇率先贬后升，总体较为稳定。

报告期内，利率债先跌后涨，波动不大。信用利差有所压缩，高等级信用债整体表现优于利率债。可转债市场受权益市场和资金面宽松带动，总体表现较好。

报告期内，基金投资上，可转债坚持绝对收益的投资思路，增持了基本面较好、估值较低的银行转债。利率债总体控制久期，信用债仍以中短期高等级债为主，适度使用套息策略，规避信用风险。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰保兴尊合债券 A 份额净值为 1.2538 元，本报告期华泰保兴尊合债券 A 份额净值增长率为 3.24%，同期业绩比较基准收益率为 0.65%；截至本报告期末华泰保兴尊合债券 C 份额净值为 1.2451 元，本报告期华泰保兴尊合债券 C 份额净值增长率为 3.14%，同期业绩比较基准收益率为 0.65%。

## 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 2021 年下半年，基建和地产投资有回落压力，消费的回暖需要看疫情发展，存在不确定性，制造业投资仍将保持回升态势，总体经济可能存在小幅回落压力。同时，房地产市场调控持续推进，房价涨幅趋于稳定。在此背景下，预计货币政策仍将保持适度宽松，利率债有一定交易机会，但当前债券绝对收益率较低，配置价值有限，基金管理将更加注重保持流动性。信用利差压缩主要由于资金中枢趋于稳定，信用债套息价值仍存，但是总体仍处于紧信用环境，因此，信用下沉方面仍会保持谨慎，严控信用风险，择机配置中短期限高等级信用债。可转债估值有所提升，但权益市场整体点位不高，流动性充裕，总体仍看好，继续保持绝对收益增强思路，在控制整体回撤风险的前提下，逢低增持，分散投资低估值转债，涨幅较大品种逐步逢高减持。

#### 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

根据相关法律法规、本基金的基金合同等规定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未

实施利润分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的规定实施利润分配。

#### 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”）在华泰保兴尊合债券型证券投资基金（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、基金份额申购赎回价格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 托管人对本中期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（财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、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：华泰保兴尊合债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	39,224,810.93	11,376,796.90
结算备付金	-	13,120,932.05	4,315,014.20
存出保证金	-	20,196.85	30,675.84
交易性金融资产	6.4.7.2	2,497,194,636.80	2,909,662,006.42
其中：股票投资	-	-	-
基金投资	-	-	-
债券投资	-	2,497,194,636.80	2,909,662,006.42
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	100,000,000.00	111,992,388.00
应收证券清算款	-	-	-
应收利息	6.4.7.5	22,151,218.09	44,809,816.33
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	23,196.47	4,050.77
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计	-	2,671,734,991.19	3,082,190,748.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 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	-	-	599,299,301.05
应付证券清算款	-	-	62,986.08
应付赎回款	-	191,320.49	765,646.12
应付管理人报酬	-	1,245,977.78	1,288,968.29
应付托管费	-	415,325.93	429,656.09
应付销售服务费	-	46,806.67	12,799.03
应付交易费用	6.4.7.7	4,883.31	6,316.29
应交税费	-	123,288.01	233,428.79



应付利息	-	-	121,938.63
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	6.4.7.8	113,443.67	233,927.93
负债合计	-	2,141,045.86	602,454,968.30
<b>所有者权益：</b>	-	-	-
实收基金	6.4.7.9	2,130,738,360.35	2,042,291,980.32
未分配利润	6.4.7.10	538,855,584.98	437,443,799.84
所有者权益合计	-	2,669,593,945.33	2,479,735,780.16
负债和所有者权益总计	-	2,671,734,991.19	3,082,190,748.46

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，华泰保兴尊合债券 A 基金份额净值 1.2538 元，基金份额总额 1,901,123,291.64 份；华泰保兴尊合债券 C 基金份额净值 1.2451 元，基金份额总额 229,615,068.71 份。华泰保兴尊合债券份额总额合计为 2,130,738,360.35 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰保兴尊合债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
<b>一、收入</b>	-	74,434,385.32	88,690,337.82
1. 利息收入	-	39,671,491.11	73,143,013.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	137,272.46	309,661.83
债券利息收入	-	39,128,019.86	69,001,344.70
资产支持证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产收入	-	406,198.79	3,832,006.62
证券出借利息收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	-22,435,170.84	36,790,870.31
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	-22,435,170.84	36,790,870.31
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	-	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	57,144,265.24	-21,439,273.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	53,799.81	195,727.54
<b>减：二、费用</b>	-	13,522,264.20	21,304,705.88

1. 管理人报酬	-	6,330,891.22	15,039,585.44
2. 托管费	-	2,110,297.02	5,013,195.10
3. 销售服务费	-	92,617.83	563,113.58
4. 交易费用	6.4.7.18	11,832.72	33,051.64
5. 利息支出	-	4,724,621.84	366,222.39
其中：卖出回购金融资产支出	-	4,724,621.84	366,222.39
6. 税金及附加	-	123,560.02	151,248.26
7. 其他费用	6.4.7.19	128,443.55	138,289.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-	60,912,121.12	67,385,631.94
减：所得税费用	-	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-	60,912,121.12	67,385,631.94

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰保兴尊合债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 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）	2,042,291,980.32	437,443,799.84	2,479,735,780.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	60,912,121.12	60,912,121.12
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）	88,446,380.03	40,499,664.02	128,946,044.05
其中：1. 基金申购款	1,045,062,961.76	248,603,152.61	1,293,666,114.37
2. 基金赎回款	-956,616,581.73	-208,103,488.59	-1,164,720,070.32
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,130,738,360.35	538,855,584.98	2,669,593,945.33
项目	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 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）	3,287,941,860.74	618,656,555.42	3,906,598,416.16

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	67,385,631.94	67,385,631.94
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）	642,937,283.46	126,778,546.16	769,715,829.62
其中：1. 基金申购款	2,385,688,693.55	488,792,143.42	2,874,480,836.97
2. 基金赎回款	-1,742,751,410.09	-362,013,597.26	-2,104,765,007.35
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,930,879,144.20	812,820,733.52	4,743,699,877.72

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                      陈庆                      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

华泰保兴尊合债券型证券投资基金(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[2017]1183号《关于准予华泰保兴尊合债券型证券投资基金注册的批复》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《华泰保兴尊合债券型证券投资基金基金合同》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206,124,373.30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1002号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰保兴尊合债券型证券投资基金基金合同》于2017年11月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为206,139,079.35份基金份额,其中认购资金利息折合14,706.05份基金份额。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《华泰保兴尊合债券型证券投资基金基金合同》和《华泰保兴尊合债券型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的基金份额,称为A类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,赎回时收取赎回费用,且从本类

别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴尊合债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、资产支持证券、次级债、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具等以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资股票、权证等权益类资产，但可持有因可转换债券转股或可交换债券换股所形成的股票(包括因持有该股票所派发的权证)以及投资分离交易可转债而产生的权证。本基金的业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率。

#### 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<年度报告和中期报告>》、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》、《华泰保兴尊合债券型证券投资基金基金合同》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 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 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 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[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[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 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
----	-----

	2021 年 06 月 30 日
活期存款	39,224,810.93
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	39,224,810.93

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,088,305,745.42	1,120,765,636.80	32,459,891.38
	银行间市场	1,384,450,063.01	1,376,429,000.00	-8,021,063.01
	合计	2,472,755,808.43	2,497,194,636.80	24,438,828.37
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,472,755,808.43	2,497,194,636.80	24,438,828.37	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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 2021 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	100,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	100,000,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	1,799.90
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,904.40
应收债券利息	22,132,799.21
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	10,705.48
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	9.10
合计	22,151,218.09

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 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	4,883.31
合计	4,883.31

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5.32
应付证券出借违约金	-
应付审计费	44,630.98
应付信息披露费	59,507.37
应付银行间债券账户维护费	9,300.00
合计	113,443.67

#### 6.4.7.9 实收基金

## 华泰保兴尊合债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,981,782,307.20	1,981,782,307.20
本期申购	844,032,853.51	844,032,853.51
本期赎回（以“-”号填列）	-924,691,869.07	-924,691,869.07
本期末	1,901,123,291.64	1,901,123,291.64

## 华泰保兴尊合债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	60,509,673.12	60,509,673.12
本期申购	201,030,108.25	201,030,108.25
本期赎回（以“-”号填列）	-31,924,712.66	-31,924,712.66
本期末	229,615,068.71	229,615,068.71

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

## 华泰保兴尊合债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	329,332,413.96	95,574,160.38	424,906,574.34
本期利润	3,470,302.87	55,428,285.61	58,898,588.48
本期基金份额交易产生的变动数	-9,279,286.40	8,047,391.20	-1,231,895.20
其中：基金申购款	141,575,333.30	58,681,129.05	200,256,462.35
基金赎回款	-150,854,619.70	-50,633,737.85	-201,488,357.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	323,523,430.43	159,049,837.19	482,573,267.62

## 华泰保兴尊合债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,622,782.51	2,914,442.99	12,537,225.50
本期利润	297,553.01	1,715,979.63	2,013,532.64
本期基金份额交易产生的变动数	27,223,644.13	14,507,915.09	41,731,559.22
其中：基金申购款	32,230,538.59	16,116,151.67	48,346,690.26
基金赎回款	-5,006,894.46	-1,608,236.58	-6,615,131.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,143,979.65	19,138,337.71	56,282,317.36



#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	57,212.40
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	79,880.33
其他	179.73
合计	137,272.46

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,706,824,967.81
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,705,523,670.70
减：应收利息总额	23,736,467.95
买卖债券差价收入	-22,435,170.84

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	57,144,265.24
—股票投资	-
—债券投资	57,144,265.24

—资产支持证券投资	-
—基金投资	-
—贵金属投资	-
—其他	-
2. 衍生工具	-
—权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	57,144,265.24

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	42,064.35
基金转换费收入	11,735.46
合计	53,799.81

注：1、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

2、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	4,582.72
银行间市场交易费用	7,250.00
合计	11,832.72

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	5,405.20
银行间债券账户维护费	18,900.00
合计	128,443.55

#### 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，本基金并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，本基金并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、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
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
华泰保险集团股份有限公司	基金管理人的主要股东
华泰人寿保险股份有限公司	基金管理人主要股东控制的机构
华泰财产保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,330,891.22	15,039,585.44
其中：支付销售机构的客户维护费	277,372.01	562,825.41

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 0.60%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,110,297.02	5,013,195.10

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 0.20% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 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		
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴尊合债券 A	华泰保兴尊合债券 C	合计
华泰保兴基金管理有限公司	-	69,534.89	69,534.89
中国银行股份有限公司	-	941.70	941.70
合计	-	70,476.59	70,476.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴尊合债券 A	华泰保兴尊合债券 C	合计
华泰保兴基金管理有限公司	-	441,642.94	441,642.94
中国银行股份有限公司	-	5,279.28	5,279.28
合计	-	446,922.22	446,922.22

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 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。C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.20%。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

本基金本报告期内与上年度可比期间均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 报告期内转融通证券出借业务发生重大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转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未持有过本基金份额。

##### 6.4.10.5.2 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

华泰保兴尊合债券 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 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	116,147,869.27	5.45%	-	-
华泰财产保险有 限公司	77,950,000.53	3.66%	77,950,000.53	3.82%
华泰人寿保险股 份有限公司	400,775,701.83	18.81%	239,324,189.21	11.72%

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。

#### 6.4.10.6 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 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	39,224,810.93	57,212.40	21,460,592.78	107,653.27

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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

#### 6.4.10.8 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末 2021 年 06 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021 年 06 月 17 日	2021 年 07 月 01 日	新债未上市	100.00	100.00	6,980	698,000.00	698,000.00	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

本基金本报告期末无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。

###### 6.4.12.3.2 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。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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，使得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之发行人出现违约、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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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；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并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日

A-1	30,000,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	140,266,000.00	129,831,000.00
合计	170,266,000.00	129,831,000.00

注：未评级债券为国债和政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	1,444,702,983.80	1,739,946,030.30
AAA 以下	730,935,653.00	998,691,976.12
未评级	151,290,000.00	41,193,000.00
合计	2,326,928,636.80	2,779,831,006.42

注：未评级债券为政策性金融债和中期票据。

#### 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自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的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。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基



金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.0261%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 2,635,744,644.20 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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。

本基金的基金管理人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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 06 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	39,224,810.93	-	-	-	-	39,224,810.93
结算备付金	13,120,932.05	-	-	-	-	13,120,932.05
存出保证金	20,196.85	-	-	-	-	20,196.85
交易性金融资产	423,697,250.00	794,487,386.80	1,157,288,000.00	121,722,000.00	-	2,497,194,636.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	-	100,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	22,151,218.09	22,151,218.09
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	23,196.47	23,196.47
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	576,063,189.83	794,487,386.80	1,157,288,000.00	121,722,000.00	22,174,414.56	2,671,734,991.19
负债						
短期借款	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	191,320.49	191,320.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,245,977.78	1,245,977.78
应付托管费	-	-	-	-	415,325.93	415,325.93
应付销售服务费	-	-	-	-	46,806.67	46,806.67
应付交易费用	-	-	-	-	4,883.31	4,883.31
应交税费	-	-	-	-	123,288.01	123,288.01
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	113,443.67	113,443.67
负债总计	-	-	-	-	2,141,045.86	2,141,045.86
利率敏感度缺口	576,063,189.83	794,487,386.80	1,157,288,000.00	121,722,000.00	20,033,368.70	2,669,593,945.33
上年度末 2020 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	11,376,796.90	-	-	-	-	11,376,796.90
结算备付金	4,315,014.20	-	-	-	-	4,315,014.20
存出保证金	30,675.84	-	-	-	-	30,675.84
交易性金融资产	467,981,366.82	258,114,254.60	2,072,380,385.00	111,186,000.00	-	2,909,662,006.42
买入返售金融资产	111,992,388.00	-	-	-	-	111,992,388.00
应收利息	-	-	-	-	44,809,816.33	44,809,816.33

应收申购款	-	-	-	-	4,050.77	4,050.77
资产总计	595,696,241.76	258,114,254.60	2,072,380,385.00	111,186,000.00	44,813,867.10	3,082,190,748.46
负债						
卖出回购金融资产款	599,299,301.05	-	-	-	-	599,299,301.05
应付证券清算款	-	-	-	-	62,986.08	62,986.08
应付赎回款	-	-	-	-	765,646.12	765,646.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,288,968.29	1,288,968.29
应付托管费	-	-	-	-	429,656.09	429,656.09
应付销售服务费	-	-	-	-	12,799.03	12,799.03
应付交易费用	-	-	-	-	6,316.29	6,316.29
应付利息	-	-	-	-	121,938.63	121,938.63
应交税费	-	-	-	-	233,428.79	233,428.79
其他负债	-	-	-	-	233,927.93	233,927.93
负债总计	599,299,301.05	-	-	-	3,155,667.25	602,454,968.30
利率敏感度缺口	-3,603,059.29	258,114,254.60	2,072,380,385.00	111,186,000.00	41,658,199.85	2,479,735,780.16

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2021年06月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	10,835,489.35	19,013,246.39
市场利率上升 25 个基点	-10,704,066.89	-18,775,988.92	

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市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 2021 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一层次的余额为 448,163,233.80 元，属于第二层次的余额为 2,049,031,403.00 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 319,772,321.42 元，第二层次 2,589,889,685.00 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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 2021 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(2020 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)除公允价值外，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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,497,194,636.80	93.47
	其中：债券	2,497,194,636.80	93.47
	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	100,000,000.00	3.74
	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	52,345,742.98	1.96
8	其他各项资产	22,194,611.41	0.83
9	合计	2,671,734,991.19	100.00

### 7.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未进行股票买入交易。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未进行股票卖出交易。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未进行股票买卖交易。

### 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	80,140,000.00	3.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	181,600,000.00	6.80
	其中：政策性金融债	161,376,000.00	6.04
4	企业债券	337,618,000.00	12.65
5	企业短期融资券	30,000,000.00	1.12
6	中期票据	1,116,694,000.00	41.83
7	可转债（可交换债）	751,142,636.80	28.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,497,194,636.80	93.54

## 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110053	苏银转债	1,000,000	121,360,000.00	4.55
2	132008	17 山高 EB	1,000,000	104,620,000.00	3.92
3	113042	上银转债	999,270	102,205,335.60	3.83
4	210205	21 国开 05	1,000,000	101,250,000.00	3.79
5	132000015	20 金融城建 GN002	1,000,000	99,470,000.00	3.73

## 7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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。

## 7.10 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。

## 7.11 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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

1、苏银转债（代码：110053）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会江苏监管局官网 2020 年 12 月 31 日公布信息显示，2020 年 12 月 30 日，江苏银保监局针对江苏银行股份有限公司（以下简称“江苏银行”）个人贷款资金用途管控不严、发放流动资金贷款偿还银行承兑汇票垫款、理财投资和同业投资非标准化债权资产未严格比照自营贷款管理、个人理财资金对接项目资本金、理财业务未与自营业务相分离、理财资金投资非标准化债权资产的余额超监管比例要求等六项违法违规事实，对江苏银行处以罚款人民币 240 万元的行政处罚，详见《江苏银保监局行政处罚信息公开表》（苏银保监罚决字〔2020〕88 号）。

2、上银转债（代码：113042）为本基金的前十大持仓证券。

根据中国银保监会上海监管局官网 2020 年 8 月 14 日公布信息显示，2020 年 8 月 14 日上海银保监局针对上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）2014 年至 2019 年存在的违规向资本金不足、“四证”不全的房地产项目发放贷款，以其他贷款科目发放房地产开发贷款、并购贷款管理严重违反审慎经营规则、经营性物业贷款管理严重违反审慎经营规则、个人贷款业务严重违反审慎经营规则、流动资金贷款业务严重违反审慎经营规则、违规向关系人发放信用贷款、发放贷款用于偿还银行承兑汇票垫款、贷款分类不准确、违规审批转让不符合不良贷款认定标准的信贷资产、虚增存贷款、违规收费、票据业务严重违反审慎经营规则、同业资金投向管理严重违反审慎经营规则、理财业务严重违反审慎经营规则、委托贷款业务严重违反审慎经营规则、内保外贷业务严重违反审慎经营规则、衍生品交易人员管理严重违反审慎经营规则、监事会履职严重不到位、未经任职资格许可实际履行高级管理人员职责、关联交易管理严重不审慎、押品估值管理严重违反审慎经营规则、未按规定保存重要信贷档案，导致分类信息不准确、不完整、未按规定报送统计报表等二十三项违法违规行为，对上海银行处以责令改正，没收违法所得 27.155092 万元，罚款 1625 万元，罚没合计 1652.155092 万元的行政处罚，详见《上海银保监局行政处罚信息公开表》（沪银保监银罚决字〔2020〕14 号）。

经中国银保监会上海监管局官网 2020 年 11 月 25 日公布信息显示，2020 年 11 月 18 日上海银保监局针对上海银行 2014 年至 2018 年绩效考评管理严重违反审慎经营规则、2018 年未按规定延期支付 2017 年度绩效薪酬等两项违法违规行为，对上海银行处以责令改正，并处罚款共计 80 万元的行政处罚，详见《上海银保监局行政处罚信息公开表》（沪银保监银罚决字〔2020〕25 号）。

经中国银保监会上海监管局官网 2021 年 4 月 30 日公布信息显示，2021 年 4 月 25 日，上海银保监局针对上海银行未按照规定进行信息披露的主要违法违规行为，对上海银行处以责令改正，并处罚款共计 30 万元的行政处罚，详见《上海银保监局行政处罚信息公开表》（沪银保监银罚决字

(2021) 31 号)。

3、21 国开 05 (代码: 210205) 为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2021 年 1 月 8 日公布信息显示, 2020 年 12 月 25 日, 中国银保监会针对国家开发银行为违规的政府购买服务项目提供融资、项目资本金管理不到位, 棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况、违规变相发放土地储备贷款、设置不合理存款考核要求, 以贷转存, 虚增存款、贷款风险分类不准确、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产、违规进行信贷资产拆分转让, 隐匿信贷资产质量、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品、扶贫贷款存贷挂钩、易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职, 部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁、未落实同业业务交易对手名单制监管要求、以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资, 未纳入同业借款业务管理、以协定存款方式吸收同业存款, 未纳入同业存款业务管理、风险隔离不到位, 违规开展资金池理财业务、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况、逾期未整改, 屡查屡犯, 违规新增业务、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表、违规收取小微企业贷款承诺费、收取财务顾问费质价不符、利用银团贷款承诺费浮利分费、向检查组提供虚假整改说明材料、未如实提供信贷资产转让台账、案件信息迟报、瞒报、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位等二十四项违法违规行为, 对国家开发银行处以罚款 4880 万元的行政处罚, 详见《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表》(银保监罚决字(2020)67 号)。

本基金投资苏银转债(代码: 110053)、上银转债(代码: 113042)以及 21 国开 05(代码: 210205)的投资决策程序, 符合法律法规及公司投资制度有关规定。

除苏银转债(代码: 110053)、上银转债(代码: 113042)以及 21 国开 05(代码: 210205)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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	20,196.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,151,218.09
5	应收申购款	23,196.47



6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,194,611.41

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110053	苏银转债	121,360,000.00	4.55
2	132008	17 山高 EB	104,620,000.00	3.92
3	132014	18 中化 EB	98,088,000.00	3.67
4	110059	浦发转债	81,944,000.00	3.07
5	132017	19 新钢 EB	72,048,403.00	2.70
6	113021	中信转债	31,671,000.00	1.19
7	120002	18 中原 EB	22,450,000.00	0.84
8	110045	海澜转债	22,326,000.00	0.84
9	113532	海环转债	10,020,000.00	0.38
10	113528	长城转债	5,783,000.00	0.22
11	113530	大丰转债	5,636,400.00	0.21
12	110057	现代转债	5,420,548.80	0.20
13	113026	核能转债	5,286,500.00	0.20
14	132016	19 东创 EB	5,075,000.00	0.19
15	110043	无锡转债	3,380,400.00	0.13
16	128132	交建转债	3,361,050.00	0.13
17	113567	君禾转债	3,235,200.00	0.12
18	113036	宁建转债	3,040,800.00	0.11
19	110038	济川转债	2,099,400.00	0.08
20	113024	核建转债	1,539,099.40	0.06

#### 7.12.5 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。

#### 7.12.6 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。

## § 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
华泰保兴尊合债券 A	792	2,400,408.20	1,886,170,428.78	99.21%	14,952,862.86	0.79%
华泰保兴尊合债券 C	437	525,434.94	210,507,816.08	91.68%	19,107,252.63	8.32%
合计	1,194	1,784,537.99	2,096,678,244.86	98.40%	34,060,115.49	1.60%

### 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	华泰保兴尊合债券 A	1,247,329.27	0.07%
	华泰保兴尊合债券 C	35.36	0.00%
	合计	1,247,364.63	0.06%

### 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	华泰保兴尊合债券 A	>100
	华泰保兴尊合债券 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放 式基金	华泰保兴尊合债券 A	0
	华泰保兴尊合债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰保兴尊合债券 A	华泰保兴尊合债券 C
基金合同生效日(2017 年 11 月 21 日) 基金份额总额	110,397,559.39	95,741,519.96
本报告期期初基金份额总额	1,981,782,307.20	60,509,673.12
本报告期基金总申购份额	844,032,853.51	201,030,108.25
减：本报告期基金总赎回份额	924,691,869.07	31,924,712.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	1,901,123,291.64	229,615,068.71

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

本报告期内，本基金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

2021 年 4 月 1 日，基金管理人发布《华泰保兴基金管理有限公司关于高级管理人员离任的公告》，寻卫国先生不再担任公司副总经理。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及本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，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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

### 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	
安信证券	2	-	-	-	-	
长江证券	2	-	-	-	-	
东北证券	2	-	-	-	-	

东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中国国际金融	2	-	-	-	-	-
中国银河证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
中泰证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
中信建投证券	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		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,495,742,235.06	98.64%	10,410,157,000.00	100.00%	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	20,643,600.00	1.36%	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 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	华泰保兴尊合债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021年01月22日
2	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告的提示性公告	管理人网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021年01月22日
3	华泰保兴基金管理有限公司关于修订开放式证券投资基金业务规则的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021年03月01日
4	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加长江证券股份有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报、证券时报、证券日报	2021年03月24日
5	华泰保兴基金管理有限公司关于通过东方财富证券股份有限公司开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021年03月24日
6	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告的提示性公告	管理人网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021年03月31日
7	华泰保兴尊合债券型证券投资基金 2020 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021年03月31日
8	华泰保兴基金管理有限公司关于高级管理人员离任的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021年04月01日
9	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加安信证券股份有限公司为销售机构及开通认/申购、转换、定投业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021年04月07日

10	华泰保兴尊合债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021年04月22日
11	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告的提示性公告	管理人网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021年04月22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	20210423-20210614	239,324,189.21	161,451,512.62	-	400,775,701.83	18.81%
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。

### 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、《华泰保兴尊合债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《华泰保兴尊合债券型证券投资基金托管协议》
- 4、《华泰保兴尊合债券型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

### 12.2 存放地点

基金管理人办公场所及基金托管人住所

### 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  
2021 年 08 月 28 日