

华泰保兴货币市场基金
2022 年第 3 季度报告

2022 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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 2022 年 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

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 04 月 20 日	
报告期末基金份额总额	7,987,716,033.06 份	
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。本基金的预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
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	
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	27,087,951.29 份	7,960,628,081.77 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（2022 年 07 月 01 日-2022 年 09 月 30 日）	
	华泰保兴货币 A	华泰保兴货币 B
1. 本期已实现收益	103,239.13	38,180,211.95
2. 本期利润	103,239.13	38,180,211.95
3. 期末基金资产净值	27,087,951.29	7,960,628,081.77

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。由于本基金采用按实际利率计算账面价值，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、本基金的利润分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值收益率 ①	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
过去三个月	0.3757%	0.0021%	0.3403%	0.0000%	0.0354%	0.0021%
过去六个月	0.7680%	0.0020%	0.6768%	0.0000%	0.0912%	0.0020%
过去一年	1.7800%	0.0017%	1.3500%	0.0000%	0.4300%	0.0017%
过去三年	6.0016%	0.0014%	4.0537%	0.0000%	1.9479%	0.0014%
过去五年	12.4223%	0.0023%	6.7537%	0.0000%	5.6686%	0.0023%
自基金合同生效起 至今	14.3390%	0.0025%	7.3603%	0.0000%	6.9787%	0.0025%

华泰保兴货币 B

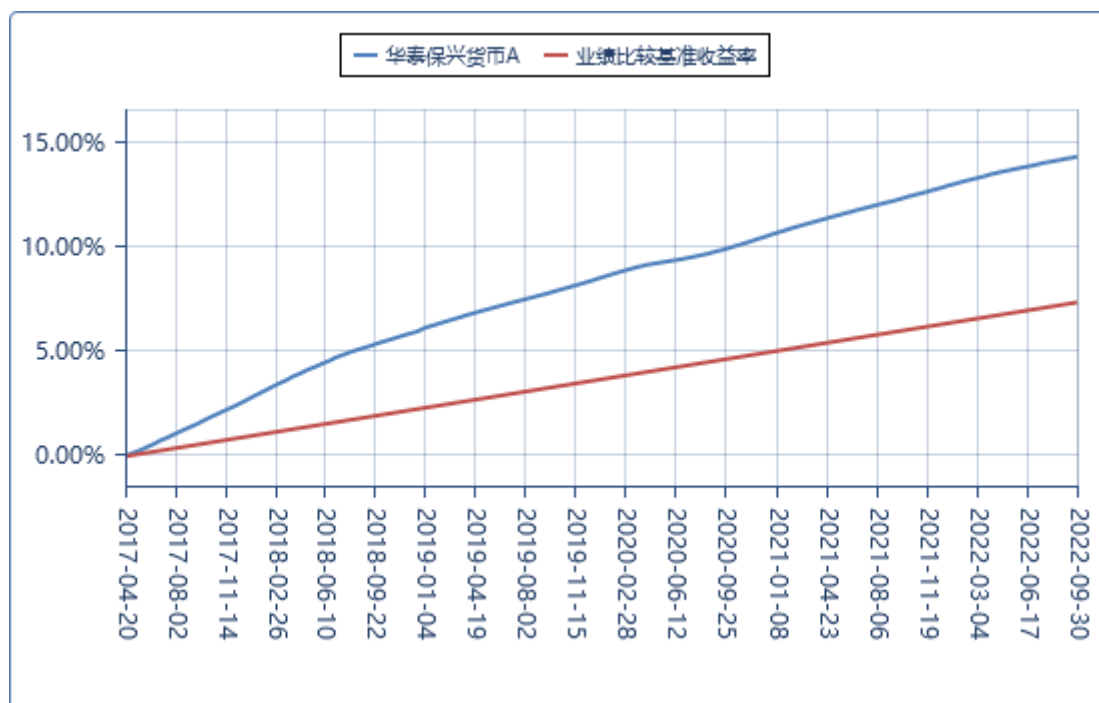
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4366%	0.0021%	0.3403%	0.0000%	0.0963%	0.0021%

过去六个月	0.8893%	0.0020%	0.6768%	0.0000%	0.2125%	0.0020%
过去一年	2.0251%	0.0017%	1.3500%	0.0000%	0.6751%	0.0017%
过去三年	6.7682%	0.0014%	4.0537%	0.0000%	2.7145%	0.0014%
过去五年	13.7812%	0.0023%	6.7537%	0.0000%	7.0275%	0.0023%
自基金合同生效起至今	15.8462%	0.0025%	7.3603%	0.0000%	8.4859%	0.0025%

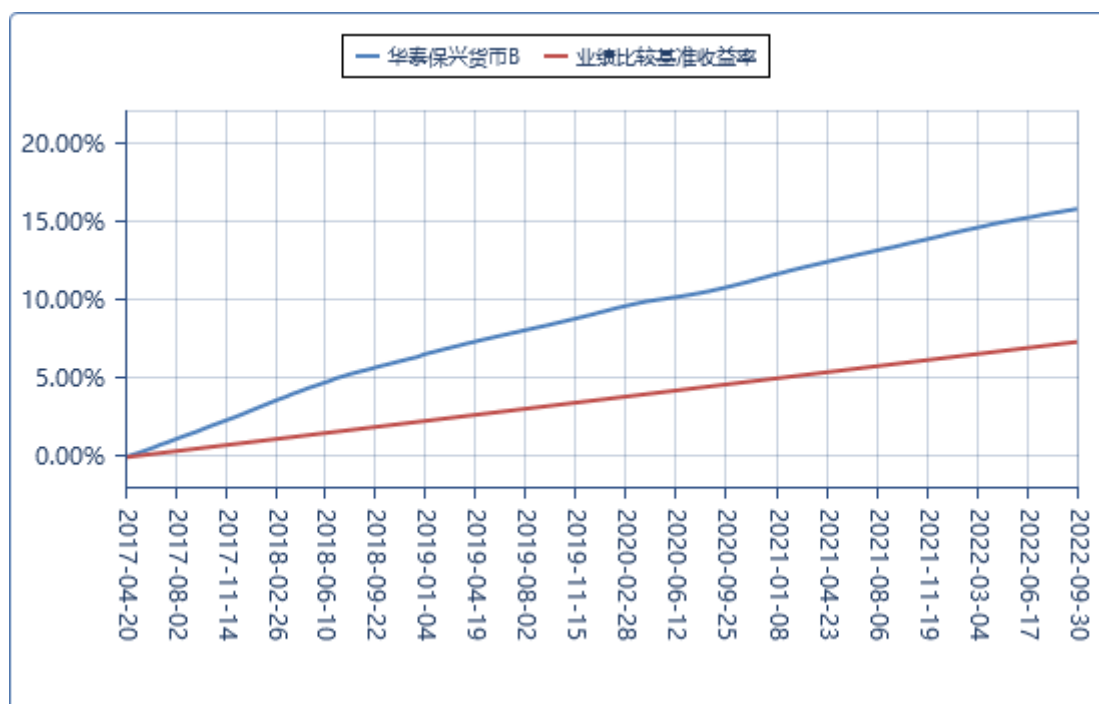
注：本基金业绩比较基准为：中国人民银行公布的 7 天通知存款利率（税后）。

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



华泰保兴货币 B



§ 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		
王海明	基金经理	2019年09月23日	-	6年	上海财经大学硕士研究生。曾任华泰资产管理有限公司固定收益投资部研究员。2016年8月加入华泰保兴基金管理有限公司,历任投资助理、华泰保兴货币市场基金基金经理助理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年三季度，在新冠疫情得到有效控制情况下，整体经济处于恢复之中，但存在一定的压力。固定资产投资方面，1-8 月同比 5.8%，好于上月。其中，基础设施建设增长较快。源于今年地方债发行前置，基建投资作为稳增长的着力点。制造业中的高技术产业投资引领投资增长。1-8 月，房地产投资同比-7.4%，同时房屋新开工面积和竣工面积同比增速大幅下滑。9 月下旬，人民银行、银保监会阶段性放宽部分城市首套住房贷款利率下限，下调首套个人住房公积金贷款利率，从总量层面对房地产行业有所支持。消费方面，呈现了弱复苏的状态，其中汽车消费增速较快。物价方面，居民消费价格保持相对低位，9 月同比 2.8%。3 季度，猪肉价格环比有所上行，带动了 CPI 食品项略有升高。非食方面受油价环比下跌影响，涨幅低于

季节性。海外方面，低失业率和高通胀下，美联储表态鹰派，分别在 7 月和 9 月两次加息，每次 75bp。从先行指标来看，未来海外经济有走弱的迹象。

国内货币政策方面，中国人民银行坚持稳健的货币政策灵活适度，保持连续性、稳定性、可持续性，科学管理市场预期，切实服务实体经济，有效防控金融风险。从市场利率来看，整个三季度资金面延续了较为充裕的局面。10 年国债收益率先下后上，信用利差基本维持。地方政府专项债在上半年基本发行完成，下半年利率债供给减少。后续来看，需要跟踪 PMI、社融增速和房地产政策等变量。

报告期内，本基金的运作以保证资产的流动性为重要任务，在关键时点增加了组合的剩余期限，增加了组合的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，华泰保兴货币 A 份额净值收益率为 0.3757%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%；华泰保兴货币 B 份额净值收益率为 0.4366%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

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 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	固定收益投资	4,766,227,076.94	57.82
	其中：债券	4,766,227,076.94	57.82
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,201,358,362.37	38.83
	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	256,217,476.39	3.11
4	其他资产	20,050,000.00	0.24
5	合计	8,243,852,915.70	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	7.32

	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	253,053,695.91	3.17
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	57
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	71
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	51

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超过 120 天。

5.3.2 报告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	60.29	3.17
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	10.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	2.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	10.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	18.87	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

合计	102.88	3.17
----	--------	------

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	370,272,236.27	4.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	182,646,348.05	2.29
	其中：政策性金融债	182,646,348.05	2.29
4	企业债券	10,219,879.45	0.13
5	企业短期融资券	511,884,439.71	6.41
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,691,204,173.46	46.21
8	其他	-	-
9	合计	4,766,227,076.94	59.67
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112219115	22 恒丰银行 CD115	2,000,000	199,880,157.12	2.50
2	112296990	22 广州农村商业银行 CD048	2,000,000	199,868,013.12	2.50
3	112112144	21 北京银行 CD144	2,000,000	199,776,179.65	2.50
4	112114141	21 江苏银行 CD141	2,000,000	199,580,706.11	2.50
5	112216158	22 上海银行 CD158	1,500,000	149,916,264.94	1.88
6	220201	22 国开 01	1,000,000	101,604,088.56	1.27
7	229933	22 贴现国债 33	1,000,000	99,961,162.92	1.25
8	112216160	22 上海银行 CD160	1,000,000	99,940,219.96	1.25
9	112216163	22 上海银行 CD163	1,000,000	99,916,276.63	1.25
10	112216164	22 上海银行 CD164	1,000,000	99,909,029.38	1.25

5.7 “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	0

报告期内偏离度的最高值	0.0884%
报告期内偏离度的最低值	0.0222%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0557%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到 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

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金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。

5.9.2 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、22 恒丰银行 CD115（代码：112219115）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2022 年 3 月 25 日公布信息显示，2022 年 3 月 21 日，中国银保监会针对恒丰银行股份有限公司（以下简称“恒丰银行”）监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据、漏报贸易融资业务 EAST 数据、漏报贷款核销业务 EAST 数据、错报债券投资业务 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据、未报送私募基金投资业务 EAST 数据、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据、漏报跟单信用证业务 EAST 数据、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差、EAST 系统分户账与总账比对不一致、漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据、未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息、EAST 系统《表外授信业务》表错报、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报等十八项违法违规事实，对恒丰银行处以罚款 480 万元的行政处罚决定，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〔2022〕26 号）。

2、22 广州农村商业银行 CD048（代码：112296990）为本基金的前十大持仓证券。

经中国人民银行广州分行官网 2022 年 1 月 7 日公布信息显示，2021 年 12 月 31 日，中国人民银行广州分行针对广州农村商业银行股份有限公司（以下简称“广州农村商业银行”）未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户发生交易的违法行为，对广州农村商业银行处以罚款人民币 590 万元、并对相关责任人员处以罚款的行政处罚，详见《人民银行广州分行行政处罚信息公示表（2022 年 1 月 7 日）》。

经中国银保监会广东监管局官网 2022 年 1 月 30 日公布信息显示，2022 年 1 月 28 日，中国银保监会广东监管局针对广州农村商业银行对非保本同业理财产品出具保本保收益承诺、虚假转让非标债权资产的违法事实，对广州农村商业银行处以罚款 100 万元、并对相关责任人员处以警告和/或罚款的行政处罚，详见《广东银保监局行政处罚信息公开表（2022 年 9 号）》。

经中国人民银行广州分行官网 2022 年 6 月 28 日公布信息显示，2022 年 6 月 24 日，中国人民银行广州分行针对广州农村商业银行违反金融统计管理规定、违反支付结算管理、违反人民币现金收付与货币防伪反假管理规、违反国库管理规定、违反征信管理规定、违反金融消费者权益保护管理规定的违法行为，对广州农村商业银行处以警告并罚款人民币 232.9 万元、并对相关责任人员处以罚款的行政处罚，详见《人民银行广州分行行政处罚信息公示表（2022 年 6 月 28 日）》。

经广州农村商业银行官网 2022 年 9 月 16 日发布公告：近日，广州农村商业银行收到中国银保监会广东监管局行政处罚决定书（粤银保监罚决字[2022]59 号）。广东监管局针对广州农村商业银行自有资金以同业业务为通道向房地产开发企业发放委托贷款、同业投资未按业务实质性计提风险资产和拨备、自有资金承接理财投资风险资产、自有资金借道资管计划承接存在兑付风险的代销业务产品、理财业务开展资金池运作、未充分披露同业理财产品投资信息、贷款资金被挪用于购买本行理财产品、配合检查不力、以同业投资为通道违规为企业提供融资、违规承接非标债权、理财投资非标违规接受第三方金融机构担保的行为等问题，共处以罚款合计 920 万元，详见《广州农村商业银行股份有限公司关于收到〈中国银保监会广东监管局行政处罚决定书〉的公告》。

3、21 北京银行 CD144（代码：112112144）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会北京监管局官网 2021 年 11 月 29 日公布信息显示，2021 年 11 月 24 日，中国银保监会北京监管局针对北京银行股份有限公司（以下简称“北京银行”）发生重要信息系统突发事件但未向监管部门报告、严重违反审慎经营规则的主要违法违规事实，对北京银行处以 40 万元罚款的行政处罚，详

见《北京银保监局行政处罚信息公开表》（京银保监罚决字〔2021〕30号）。

4、22 上海银行 CD158（代码：112216158）、22 上海银行 CD160（代码：112216160）、22 上海银行 CD163（代码：112216163）以及 22 上海银行 CD164（代码：112216164）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会上海监管局官网 2021 年 11 月 30 日公布信息显示，2021 年 11 月 19 日，中国银保监会上海监管局针对上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）未按规定报送统计报表的违法违规事实，对上海银行处以罚款 20 万元的行政处罚，详见《上海银保监局行政处罚信息公开表》（沪银保监罚决字〔2021〕174 号）。

经中国银保监会上海监管局官网 2022 年 2 月 23 日公布信息显示，2022 年 2 月 14 日，中国银保监会上海监管局针对上海银行 2015 年 3 月至 7 月该行同业投资业务违规接受第三方金融机构担保的违法违规事实，对上海银行处以责令改正、并处罚款 240 万元的行政处罚，详见《上海银保监局行政处罚信息公开表》（沪银保监罚决字〔2022〕13 号）。

本基金投资 22 恒丰银行 CD115（代码：112219115）、22 广州农村商业银行 CD048（代码：112296990）、21 北京银行 CD144（代码：112112144）、22 上海银行 CD158（代码：112216158）、22 上海银行 CD160（代码：112216160）、22 上海银行 CD163（代码：112216163）以及 22 上海银行 CD164（代码：112216164）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 22 恒丰银行 CD115（代码：112219115）、22 广州农村商业银行 CD048（代码：112296990）、21 北京银行 CD144（代码：112112144）、22 上海银行 CD158（代码：112216158）、22 上海银行 CD160（代码：112216160）、22 上海银行 CD163（代码：112216163）以及 22 上海银行 CD164（代码：112216164）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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	20,050,000.00
5	其他应收款	-
6	其他	-

7	合计	20,050,000.00
---	----	---------------

5.9.4 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	华泰保兴货币 A	华泰保兴货币 B
报告期期初基金份额总额	27,461,625.80	7,818,265,567.32
报告期期间基金总申购份额	181,954,065.87	10,780,929,251.18
减：报告期期间基金总赎回份额	182,327,740.38	10,638,566,736.73
报告期期末基金份额总额	27,087,951.29	7,960,628,081.77

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交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利再投	2022年07月01日	4,495.21	4,495.21	0.0000
2	红利再投	2022年07月04日	7,852.08	7,852.08	0.0000
3	红利再投	2022年07月05日	2,453.07	2,453.07	0.0000
4	红利再投	2022年07月06日	2,391.69	2,391.69	0.0000
5	红利再投	2022年07月07日	1,752.01	1,752.01	0.0000
6	红利再投	2022年07月08日	4,545.83	4,545.83	0.0000
7	红利再投	2022年07月11日	6,181.28	6,181.28	0.0000
8	红利再投	2022年07月12日	1,244.96	1,244.96	0.0000
9	红利再投	2022年07月13日	3,292.71	3,292.71	0.0000
10	红利再投	2022年07月14日	1,657.36	1,657.36	0.0000
11	红利再投	2022年07月15日	4,710.44	4,710.44	0.0000
12	红利再投	2022年07月18日	9,746.65	9,746.65	0.0000
13	红利再投	2022年07月19日	4,720.46	4,720.46	0.0000
14	红利再投	2022年07月20日	2,399.47	2,399.47	0.0000
15	红利再投	2022年07月21日	2,037.70	2,037.70	0.0000
16	红利再投	2022年07月22日	2,516.15	2,516.15	0.0000
17	红利再投	2022年07月25日	6,109.73	6,109.73	0.0000

18	红利再投	2022 年 07 月 26 日	2,002.58	2,002.58	0.0000
19	红利再投	2022 年 07 月 27 日	2,685.20	2,685.20	0.0000
20	红利再投	2022 年 07 月 28 日	1,999.17	1,999.17	0.0000
21	红利再投	2022 年 07 月 29 日	2,466.91	2,466.91	0.0000
22	红利再投	2022 年 08 月 01 日	6,257.90	6,257.90	0.0000
23	红利再投	2022 年 08 月 02 日	2,019.92	2,019.92	0.0000
24	红利再投	2022 年 08 月 03 日	4,041.63	4,041.63	0.0000
25	红利再投	2022 年 08 月 04 日	1,814.56	1,814.56	0.0000
26	红利再投	2022 年 08 月 05 日	2,161.11	2,161.11	0.0000
27	红利再投	2022 年 08 月 08 日	5,152.13	5,152.13	0.0000
28	红利再投	2022 年 08 月 09 日	1,708.42	1,708.42	0.0000
29	红利再投	2022 年 08 月 10 日	3,781.55	3,781.55	0.0000
30	红利再投	2022 年 08 月 11 日	1,815.82	1,815.82	0.0000
31	红利再投	2022 年 08 月 12 日	1,803.14	1,803.14	0.0000
32	红利再投	2022 年 08 月 15 日	6,729.87	6,729.87	0.0000
33	红利再投	2022 年 08 月 16 日	3,243.27	3,243.27	0.0000
34	红利再投	2022 年 08 月 17 日	3,793.79	3,793.79	0.0000
35	红利再投	2022 年 08 月 18 日	2,511.05	2,511.05	0.0000
36	红利再投	2022 年 08 月 19 日	1,578.23	1,578.23	0.0000
37	红利再投	2022 年 08 月 22 日	4,504.68	4,504.68	0.0000
38	红利再投	2022 年 08 月 23 日	1,380.08	1,380.08	0.0000
39	红利再投	2022 年 08 月 24 日	1,368.98	1,368.98	0.0000
40	红利再投	2022 年 08 月 25 日	2,927.09	2,927.09	0.0000
41	红利再投	2022 年 08 月 26 日	3,457.84	3,457.84	0.0000
42	红利再投	2022 年 08 月 29 日	5,138.04	5,138.04	0.0000
43	红利再投	2022 年 08 月 30 日	1,765.57	1,765.57	0.0000
44	红利再投	2022 年 08 月 31 日	1,882.24	1,882.24	0.0000
45	红利再投	2022 年 09 月 01 日	6,930.28	6,930.28	0.0000
46	红利再投	2022 年 09 月 02 日	2,748.49	2,748.49	0.0000
47	红利再投	2022 年 09 月 05 日	6,073.70	6,073.70	0.0000
48	红利再投	2022 年 09 月 06 日	2,987.25	2,987.25	0.0000
49	红利再投	2022 年 09 月 07 日	2,565.97	2,565.97	0.0000
50	红利再投	2022 年 09 月 08 日	2,334.83	2,334.83	0.0000
51	红利再投	2022 年 09 月 09 日	2,515.46	2,515.46	0.0000
52	红利再投	2022 年 09 月 13 日	7,247.00	7,247.00	0.0000
53	红利再投	2022 年 09 月 14 日	1,644.70	1,644.70	0.0000
54	红利再投	2022 年 09 月 15 日	1,346.68	1,346.68	0.0000
55	红利再投	2022 年 09 月 16 日	1,376.66	1,376.66	0.0000

56	红利再投	2022 年 09 月 19 日	5,556.65	5,556.65	0.0000
57	红利再投	2022 年 09 月 20 日	2,030.47	2,030.47	0.0000
58	红利再投	2022 年 09 月 21 日	3,425.63	3,425.63	0.0000
59	红利再投	2022 年 09 月 22 日	2,060.75	2,060.75	0.0000
60	红利再投	2022 年 09 月 23 日	5,070.54	5,070.54	0.0000
61	红利再投	2022 年 09 月 26 日	7,457.24	7,457.24	0.0000
62	红利再投	2022 年 09 月 27 日	2,355.92	2,355.92	0.0000
63	红利再投	2022 年 09 月 28 日	3,322.17	3,322.17	0.0000
64	红利再投	2022 年 09 月 29 日	2,740.81	2,740.81	0.0000
65	红利再投	2022 年 09 月 30 日	4,277.42	4,277.42	0.0000
合计			224,166.19	224,166.19	

注：基金申赎包含转换业务。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本报告期内无单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20%。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 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、报告期内本基金在规定媒介披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人办公场所及基金托管人住所

9.3 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（免长途话费）查询

华泰保兴基金管理有限公司
2022 年 10 月 26 日