

华泰保兴货币市场基金
2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 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：2023 年 01 月 20 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 2023 年 01 月 18 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 10 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 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	6,452,775,561.23 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	23,578,287.59 份	6,429,197,273.64 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 10 月 01 日-2022 年 12 月 31 日）	
	华泰保兴货币 A	华泰保兴货币 B
1. 本期已实现收益	84,451.29	31,519,069.49
2. 本期利润	84,451.29	31,519,069.49
3. 期末基金资产净值	23,578,287.59	6,429,197,273.64

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	0.3681%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.0278%	0.0010%
过去六个月	0.7452%	0.0016%	0.6805%	0.0000%	0.0647%	0.0016%
过去一年	1.6304%	0.0017%	1.3500%	0.0000%	0.2804%	0.0017%
过去三年	5.7897%	0.0015%	4.0537%	0.0000%	1.7360%	0.0015%
过去五年	11.7274%	0.0021%	6.7537%	0.0000%	4.9737%	0.0021%
自基金合同生效起 至今	14.7599%	0.0025%	7.7005%	0.0000%	7.0594%	0.0025%

华泰保兴货币 B

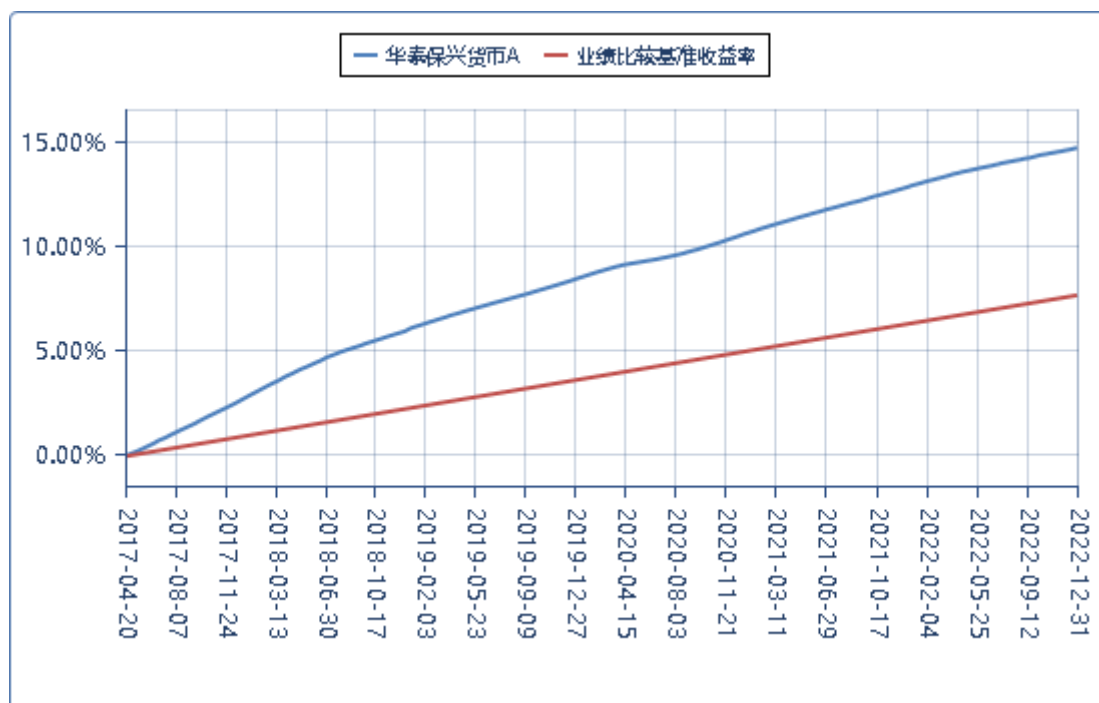
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4290%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.0887%	0.0011%

过去六个月	0.8674%	0.0016%	0.6805%	0.0000%	0.1869%	0.0016%
过去一年	1.8744%	0.0017%	1.3500%	0.0000%	0.5244%	0.0017%
过去三年	6.5550%	0.0015%	4.0537%	0.0000%	2.5013%	0.0015%
过去五年	13.0780%	0.0021%	6.7537%	0.0000%	6.3243%	0.0021%
自基金合同生效起至今	16.3432%	0.0025%	7.7005%	0.0000%	8.6427%	0.0025%

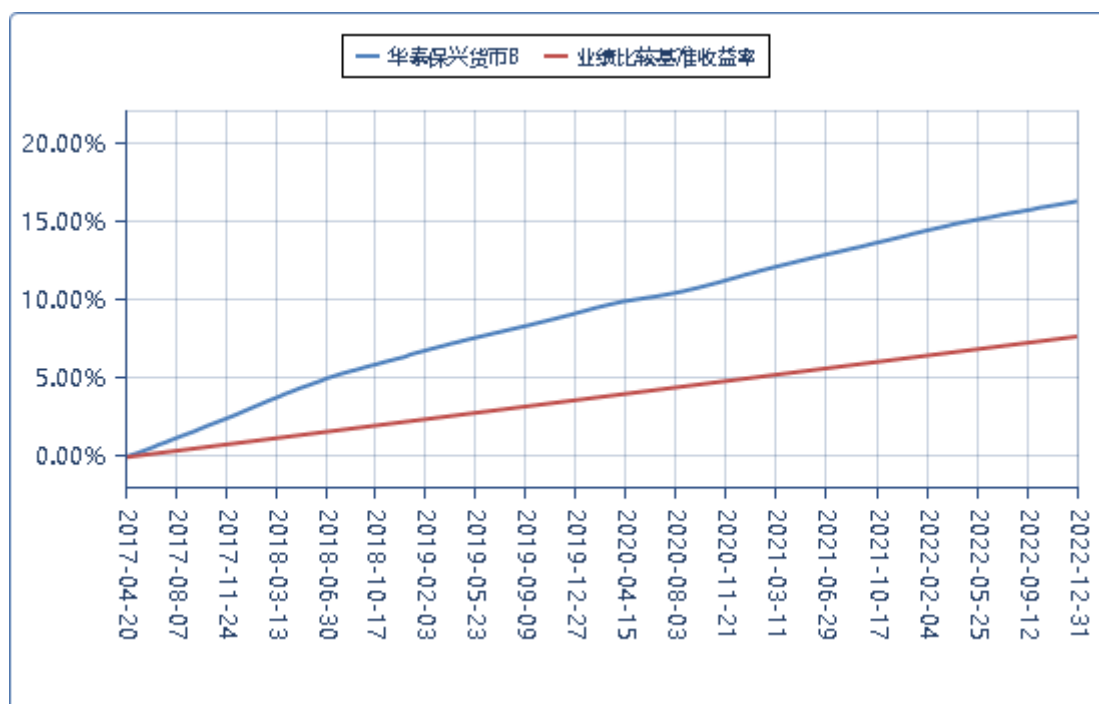
注：本基金业绩比较基准为：中国人民银行公布的 7 天通知存款利率（税后）。

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合规守信情况说明

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 年四季度，防疫政策有重大调整，短期内对经济的影响较大。具体来看，10 月社消零售同比-0.5%，11 月跌幅扩大至-5.9%。固定资产投资方面，1-11 月累计同比 5.3%，不及 1-10 月的 5.8%。其中基础设施建设投资仍较快，房地产投资处于负增区间。虽然官方出台了较多的促进房地产销售的刺激政策，从销售数据来看，政策效果还未显现。出口方面，11 月出口同比-8.7%。随着海外财政货币政策的退坡和经济衰退预期，出口面临下行风险。PMI 数据连续 3 月跌破荣枯线，预计较为悲观。整体而言，疫情政策的放开，导致消费数据的下滑，但投资方面受到的影响相对较小。物价方面，居民消费价格保持相对低位，主要食品价格涨幅回落。四季度，PPI 同比涨幅进入负值区间，受去年同期对比基数较高影响。后续来看，

消费动能可能释放，可能短期加大结构性通胀压力。海外方面，美国的就业数据较好，失业率保持低位，通胀数据同比最高点可能已经过去，但前瞻数据显示有衰退可能。美联储表态较为鹰派，利率有可能在 2023 年保持较高位置。从美债收益率来看，市场对后期经济下行预期较强。

国内货币政策方面，央行综合运用多种货币政策工具，保持流动性合理充裕。四季度，降准 0.25 个百分点，释放长期资金约 5000 亿元。从债券市场来看，在 10 月底收益率创新低之后开始上行。银行理财的净值下跌引发的赎回，放大了波动。在监管机构对市场机构进行窗口指导之后，债券收益率趋于下行。后续来看，需要跟踪疫情恢复之后的高频数据，房地产销售、社融和前瞻数据等。

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 0.3681%，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 0.4290%，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	4,757,953,318.86	70.96
	其中：债券	4,757,953,318.86	70.96
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,931,811,538.16	28.81
	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	7,199,249.04	0.11
4	其他资产	8,000,400.00	0.12
5	合计	6,704,964,506.06	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	5.14	
	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	249,240,677.48	3.86
	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	51
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	76
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	38

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	50.63	3.86
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	20.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	8.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	10.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	13.20	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	103.61	3.86

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	290,403,158.21	4.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	205,331,863.49	3.18
	其中：政策性金融债	205,331,863.49	3.18
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	623,777,709.62	9.67
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,638,440,587.54	56.39
8	其他	-	-
9	合计	4,757,953,318.86	73.73
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	112215337	22 民生银行 CD337	3,000,000	297,754,457.57	4.61
2	112209032	22 浦发银行 CD032	2,500,000	249,278,969.61	3.86
3	112203075	22 农业银行 CD075	2,000,000	198,126,824.12	3.07
4	112210069	22 兴业银行 CD069	1,500,000	149,667,571.68	2.32
5	160404	16 农发 04	1,000,000	103,297,903.02	1.60
6	220201	22 国开 01	1,000,000	102,033,960.47	1.58
7	112206003	22 交通银行 CD003	1,000,000	99,977,357.09	1.55
8	112211001	22 平安银行 CD001	1,000,000	99,974,970.75	1.55
9	112206008	22 交通银行 CD008	1,000,000	99,957,977.46	1.55
10	229958	22 贴现国债 58	1,000,000	99,947,921.44	1.55

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	0.0391%
报告期内偏离度的最低值	-0.0754%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0343%

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 民生银行 CD337（代码：112215337）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，中国银保监会针对中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）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：未报送贸易融资业务 EAST 数据、漏报贷款核销业务 EAST 数据、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据、债券投资业务 EAST 数据存在偏差、未报送权益类投资业务 EAST 数据、未报送公募基金投资业务 EAST 数据、未报送其他担保类业务 EAST 数据、未报送不可无条件撤销的贷款承诺业务 EAST 数据、漏报委托贷款业务 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《表外授信业务》表错报、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报、报送不实数据、面向非机构客户发行的理财产品投资不良资产等十六项违法违规事实，对中国民生银行处以罚款 490 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（2022）20 号）》。

2、22 浦发银行 CD032（代码：112209032）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，中国银保监会针对上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）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、漏报信贷

资产转让业务 EAST 数据、漏报债券投资业务 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据、漏报公募基金投资业务 EAST 数据、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据、错报跟单信用证业务 EAST 数据、错报保函业务 EAST 数据、错报贷款承诺业务 EAST 数据、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、漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据、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《对公信贷分户账》表漏报等十六项违法违规事实，对浦发银行处以罚款 420 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〔2022〕25 号）》。

3、22 农业银行 CD075（代码：112203075）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2022 年 10 月 28 日公布信息显示，2022 年 9 月 30 日，中国银保监会针对中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）理财业务存在以下违法违规行为：作为托管机构，存在未及时发现理财产品投资集中度超标情况；理财托管业务违反资产独立性原则要求，操作管理不到位，对中国农业银行处以罚款 150 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〔2022〕52 号）》。

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，中国银保监会针对中国农业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：漏报贷款核销业务 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据、未报送公募基金投资业务 EAST 数据、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据、其他担保类业务 EAST 数据存在偏差、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、漏报分户账 EAST 数据、未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报、EAST 系统《表外授信业务》表错报、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报、EAST 系统《关联关系》表漏报、理财产品登记不规范、2018 年行政处罚问题依然存在等十七项违法违规事实，对中国农业银行处以罚款 480 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〔2022〕12 号）》。

4、22 兴业银行 CD069（代码：112210069）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2022 年 11 月 4 日公布信息显示，2022 年 9 月 9 日，中国银保监会针对兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）债券承销业务严重违反审慎经营规则的主要违法违规事实，对兴业银行处以罚款 150 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〔2022〕41 号)》。

经中国银保监会官网 2022 年 10 月 28 日公布信息显示, 2022 年 9 月 28 日, 中国银保监会针对兴业银行理财业务存在老产品规模在部分时点出现反弹、未按规定开展理财业务内部审计、同业理财产品未持续压降、单独使用区间数值展示业绩比较基准、理财托管业务违反资产独立性原则要求等五项违法违规行为, 对兴业银行处以罚款 450 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〔2022〕50 号)》。

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, 中国银保监会针对兴业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: 漏报贸易融资业务 EAST 数据、漏报贷款核销业务 EAST 数据、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据、漏报权益类投资业务 EAST 数据、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据、未报送跟单信用证业务 EAST 数据、漏报贷款承诺业务 EAST 数据、未报送委托贷款业务 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、漏报分户账 EAST 数据、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报等十四项违法违规事实, 对兴业银行处以罚款 350 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〔2022〕22 号)》。

5、16 农发 04 (代码: 160404) 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, 中国银保监会针对中国农业发展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: 漏报不良贷款余额 EAST 数据、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贷款核销业务 EAST 数据、漏报抵押物价值 EAST 数据、错报信贷资产转让业务 EAST 数据、未报送债券投资业务 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据、银行承兑汇票业务 EAST 数据存在偏差、漏报跟单信用证业务 EAST 数据、未报送贷款承诺业务 EAST 数据、未报送委托贷款业务 EAST 数据、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《对公信贷分户账》表漏报等十七项违法违规事实, 对中国农业发展银行处以罚款 480 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〔2022〕10 号)》。

6、22 国开 01 (代码: 220201) 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，中国银保监会针对国家开发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：未报送逾期 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、信贷资产转让业务 EAST 数据存在偏差、未报送债券投资业务 EAST 数据、漏报权益类投资业务 EAST 数据、漏报跟单信用证业务 EAST 数据、漏报保函业务 EAST 数据、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、漏报分户账 EAST 数据、漏报授信信息 EAST 数据、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《关联关系》表漏报、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报、理财产品登记不规范等十七项违法违规事实，对国家开发银行处以罚款 440 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〔2022〕8 号）》。

7、22 交通银行 CD003（代码：112206003）和 22 交通银行 CD008（代码：112206008）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2022 年 11 月 4 日公布信息显示，2022 年 9 月 9 日，中国银保监会针对交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）个人经营贷款挪用至房地产市场、个人消费贷款违规流入房地产市场、总行对分支机构管控不力承担管理责任的主要违法违规事实，对交通银行处以罚款 500 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〔2022〕46 号）》。

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，中国银保监会针对交通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：漏报不良贷款余额 EAST 数据、贸易融资业务 EAST 数据存在偏差、漏报贷款核销业务 EAST 数据、漏报抵押物价值 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据、未报送其他担保类业务 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、EAST 系统《表外授信业务》表错报、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报、EAST 系统《关联关系》表漏报、理财产品登记不规范、2018 年行政处罚问题依然存在等十五项违法违规事实，对交通银行处以罚款 420 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〔2022〕15 号）》。

8、22 平安银行 CD001（代码：112211001）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，中国银保监会针对平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）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：不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贸易融资业务 EAST 数据、漏报抵押物价值 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据、漏报委托贷款业务 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、漏报分户账 EAST 数据、EAST 系统《表外授信业务》表错报、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报、EAST 系统《关联关系》表漏报、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报等十五项违法违规事实，对平安银行处以罚款 400 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（2022）24 号）》。

本基金投资 22 民生银行 CD337（代码：112215337）、22 浦发银行 CD032（代码：112209032）、22 农业银行 CD075（代码：112203075）、22 兴业银行 CD069（代码：112210069）、16 农发 04（代码：160404）、22 国开 01（代码：220201）、22 交通银行 CD003（代码：112206003）、22 交通银行 CD008（代码：112206008）以及 22 平安银行 CD001（代码：112211001）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 民生银行 CD337（代码：112215337）、22 浦发银行 CD032（代码：112209032）、22 农业银行 CD075（代码：112203075）、22 兴业银行 CD069（代码：112210069）、16 农发 04（代码：160404）、22 国开 01（代码：220201）、22 交通银行 CD003（代码：112206003）、22 交通银行 CD008（代码：112206008）以及 22 平安银行 CD001（代码：112211001）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	8,000,400.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	8,000,400.00

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	27,087,951.29	7,960,628,081.77
报告期期间基金总申购份额	36,019,646.16	6,928,231,679.05
减：报告期期间基金总赎回份额	39,529,309.86	8,459,662,487.18
报告期期末基金份额总额	23,578,287.59	6,429,197,273.64

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10月10日	30,448.50	30,448.50	0.0000
2	红利再投	2022年10月11日	2,927.10	2,927.10	0.0000
3	红利再投	2022年10月12日	2,437.43	2,437.43	0.0000
4	红利再投	2022年10月13日	2,121.09	2,121.09	0.0000
5	红利再投	2022年10月14日	1,895.85	1,895.85	0.0000
6	红利再投	2022年10月17日	6,027.86	6,027.86	0.0000
7	红利再投	2022年10月18日	2,209.39	2,209.39	0.0000
8	红利再投	2022年10月19日	1,886.34	1,886.34	0.0000
9	红利再投	2022年10月20日	2,120.74	2,120.74	0.0000
10	申赎	2022年10月20日	12,000,000.00	12,000,000.00	0.0000
11	红利再投	2022年10月21日	2,288.09	2,288.09	0.0000
12	红利再投	2022年10月24日	6,819.01	6,819.01	0.0000
13	红利再投	2022年10月25日	2,099.88	2,099.88	0.0000
14	红利再投	2022年10月26日	2,076.73	2,076.73	0.0000
15	红利再投	2022年10月27日	3,667.57	3,667.57	0.0000
16	红利再投	2022年10月28日	2,458.38	2,458.38	0.0000
17	红利再投	2022年10月31日	8,869.51	8,869.51	0.0000
18	红利再投	2022年11月01日	2,419.45	2,419.45	0.0000
19	红利再投	2022年11月02日	2,495.60	2,495.60	0.0000
20	红利再投	2022年11月03日	4,007.90	4,007.90	0.0000
21	红利再投	2022年11月04日	2,477.92	2,477.92	0.0000
22	红利再投	2022年11月07日	7,525.85	7,525.85	0.0000
23	红利再投	2022年11月08日	2,218.27	2,218.27	0.0000
24	红利再投	2022年11月09日	2,955.92	2,955.92	0.0000

25	红利再投	2022 年 11 月 10 日	2,435.57	2,435.57	0.0000
26	红利再投	2022 年 11 月 11 日	2,520.36	2,520.36	0.0000
27	红利再投	2022 年 11 月 14 日	8,179.15	8,179.15	0.0000
28	红利再投	2022 年 11 月 15 日	2,638.95	2,638.95	0.0000
29	红利再投	2022 年 11 月 16 日	2,670.78	2,670.78	0.0000
30	红利再投	2022 年 11 月 17 日	2,659.13	2,659.13	0.0000
31	红利再投	2022 年 11 月 18 日	3,802.37	3,802.37	0.0000
32	红利再投	2022 年 11 月 21 日	7,270.22	7,270.22	0.0000
33	红利再投	2022 年 11 月 22 日	2,865.03	2,865.03	0.0000
34	红利再投	2022 年 11 月 23 日	2,751.92	2,751.92	0.0000
35	红利再投	2022 年 11 月 24 日	1,533.51	1,533.51	0.0000
36	红利再投	2022 年 11 月 25 日	1,627.07	1,627.07	0.0000
37	红利再投	2022 年 11 月 28 日	8,909.94	8,909.94	0.0000
38	红利再投	2022 年 11 月 29 日	2,861.61	2,861.61	0.0000
39	红利再投	2022 年 11 月 30 日	2,858.25	2,858.25	0.0000
40	红利再投	2022 年 12 月 01 日	2,810.78	2,810.78	0.0000
41	红利再投	2022 年 12 月 02 日	2,954.27	2,954.27	0.0000
42	红利再投	2022 年 12 月 05 日	9,525.29	9,525.29	0.0000
43	红利再投	2022 年 12 月 06 日	2,918.11	2,918.11	0.0000
44	红利再投	2022 年 12 月 07 日	2,727.95	2,727.95	0.0000
45	红利再投	2022 年 12 月 08 日	2,611.76	2,611.76	0.0000
46	红利再投	2022 年 12 月 09 日	3,254.89	3,254.89	0.0000
47	红利再投	2022 年 12 月 12 日	8,513.62	8,513.62	0.0000
48	红利再投	2022 年 12 月 13 日	2,689.28	2,689.28	0.0000
49	红利再投	2022 年 12 月 14 日	2,587.22	2,587.22	0.0000
50	红利再投	2022 年 12 月 15 日	2,740.40	2,740.40	0.0000
51	红利再投	2022 年 12 月 16 日	2,820.28	2,820.28	0.0000
52	红利再投	2022 年 12 月 19 日	8,771.29	8,771.29	0.0000
53	红利再投	2022 年 12 月 20 日	2,877.68	2,877.68	0.0000
54	红利再投	2022 年 12 月 21 日	2,867.52	2,867.52	0.0000
55	红利再投	2022 年 12 月 22 日	2,976.68	2,976.68	0.0000
56	红利再投	2022 年 12 月 23 日	3,130.60	3,130.60	0.0000
57	红利再投	2022 年 12 月 26 日	10,593.73	10,593.73	0.0000
58	红利再投	2022 年 12 月 27 日	3,241.61	3,241.61	0.0000
59	红利再投	2022 年 12 月 28 日	4,991.57	4,991.57	0.0000
60	红利再投	2022 年 12 月 29 日	5,310.08	5,310.08	0.0000
61	红利再投	2022 年 12 月 30 日	4,358.07	4,358.07	0.0000
合计			12,255,310.92	12,255,310.92	

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

2023 年 01 月 20 日