华泰保兴基金管理有限公司华泰保兴货币市场基金更新招募说明书摘要

（2018年第2号）

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

重要提示

本基金经2016年11月30日中国证监会证监许可【2016】2924号文准予注册并募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金的注册，并不表明其对本基金的价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。本基金是一只货币市场基金，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。

本基金投资于货币市场，每万份基金净收益会因为货币市场波动等因素产生波动，投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的市场风险；基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险；由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险；因投资的债券发行主体信用状况恶化或交易对手违约产生的信用风险；投资本基金特有的其他风险等等。

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件。基金的过往业绩并不代表未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本基金单一投资者持有的基金份额数量不得达到或者超过本基金基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本次更新的招募说明书已经基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年10月20日，有关财务数据截止日为2018年9月30日，净值表现数据截止日为2018年6月30日，财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：华泰保兴基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道88号4306室
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
邮政编码：200120
法定代表人：杨平
成立时间：2016年7月26日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监许可[2016]1309号
组织形式：有限责任公司
注册资本：人民币壹亿捌仟万元整
存续期限：持续经营
联系人：王珊珊
电话：（021）80299000
传真：（021）60963566
股东名称及其出资比例如下：

股东名称	出资比例
华泰保险集团股份有限公司	80%
上海飞恒资产管理中心（有限合伙）	4.4%
上海旷正资产管理中心（有限合伙）	4.4%
上海泰颐资产管理中心（有限合伙）	4.4%
上海哲昌资产管理中心（有限合伙）	4.4%
上海志庄资产管理中心（有限合伙）	2.4%

（二）主要成员情况

1、董事会成员

杨平先生，董事长，硕士。历任北京国际信托投资公司国际金融部项目经理、外汇交易部部门经理兼首席交易员，蒙特利尔银行北京分行资金部和市场部高级经理，中国人民保险公司投资管理部投资总监，中国人民保险资产管理公司银行同业部、外汇投资部主管副总经理，中国人民保险（香港）有限公司投资部总经理，长城证券有限责任公司副总裁（任职期间曾兼任景顺长城基金管理公司董事）；2013年2月起任华泰保险集团股份有限公司副总经理，2015年4月起，任华泰资产管理有限公司董事、总经理兼CEO。2016年7月起任华泰保兴基金管理有限公司董事长、法定代表人。2017年4月起任华泰宝利投资管理有限公司董事长。

赵明浩先生，董事，硕士。历任哈尔滨市经委办公室副主任、哈尔滨经济技术开发区工业发展股份有限公司副总经理，香港新世纪国际投资有限公司董事、副总经理。1996年参与筹建华泰财产保险股份有限公司，并先后担任公司副总经理，常务副总经理兼首席运营官，总经理兼首席执行官。现任华泰保险集团股份有限公司副董事长兼总经理，华泰资产管理有限公司董事长、中国保险行业协会副会长。

王冠龙先生，董事，硕士。历任黑龙江省经济信息中心经济信息处分析员、哈尔滨市经济技术开发区工业发展股份有限公司职员；1996年7月起，历任华泰财产保险股份有限公司投资部业务经理、副总经理、投资管理中心副总经理；2005年1月起，历任华泰资产管理有限公司副总经理、常务副总经理兼首席运营官（任职期间曾兼任公司董事会秘书、华泰资产管理（香港）有限公司董事）。2016年7月起任华泰保兴基金管理有限公司总经理。

陆建忠先生，独立董事，学士，中国注册会计师，中国九三学社社员。历任上海市日用五金工业公司财务科科员，上海海事大学会计学教师、副教授，安达信会计师事务所合伙人、普华永道中天会计师事务所合伙人，上海德安会计师事务所市场拓展总监，大信会计师事务所（特殊普通合伙）上海分所注册会计师，2014年8月至2016年9月任中兴华会计师事务所（特殊普通合伙）合伙人；2016年10月至今任大华会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师。

欧阳军先生，独立董事，硕士。历任湖北省国际信托投资公司职员、交通银行总行职员、中国证券登记结算有限公司上海分公司职员、德恒证券有限责任公司法律事务主任、国浩律师集团（上海）事务所律师，2006年1月至今任上海市锦天城律师事务所律师、高级合伙人。

夏立军先生，独立董事，博士，教授。2006年7月至2011年3月，历任上海财经大学会计学院讲师、硕士生导师、教授、博士生导师；2011年3月至今任上海交通大学安泰经济与管理学院教授、博士生导师、会计系主任。

2、监事

吕通云女士，股东监事，硕士。历任太古可口可乐饮料有限公司中国区人力资源主管，美国建立尔电子有限公司人力资源经理，美国冠远科技股份有限公司亚太区人力资源经理，金鹰国际货运代理有限公司华北区人力资源及质量管理经理，瑞泰人寿保险有限公司人力资源总监兼董事会秘书、组织发展副总裁兼董事会秘书，原华泰财产保险股份有限公司人力资源部总经理、人力资源总监，华泰保险集团人力资源总监兼人力资源部总经理。现任华泰保险集团股份有限公司副总经理兼首席人才官、首席风险官。

戚烈旭先生，职工监事，硕士。历任东北财经大学职员，华泰资产管理有限公司信用评级分析师、风险合规部总经理助理、风险合规部副总经理（主持工作）、证券投资中心风险管理部负责人，2016年8月起加入华泰保兴基金管理有限公司，现任风险管理部总经理。

3、高级管理人员

杨平先生，董事长。简历同上。

王冠龙先生，总经理。简历同上。

章劲先生，副总经理，学士。历任上海银行人力资源部科员、资金营运中心交易员、经理，华夏基金管理有限公司基金经理、华泰资产管理有限公司投资管理部副总经理、投资管理部总经理、固定收益投资部总经理、证券投资副总监、证券投资总监。2016年8月起任华泰保兴基金管理有限公司副总经理兼首席投资官。

寻卫国先生，副总经理，博士。历任中国工商银行资产托管部托管业务运作中心副主任科员、主任科员、副处长，中国工商银行资产托管部交易监督处副处长（主持工作）、处长，广发银行股份有限公司托管部副总经理、总经理。2016年8月起任华泰保兴基金管理有限公司副总经理兼首席运营官。

王现成先生，副总经理，硕士。历任中国建设银行股份有限公司总行行长办公室主任科员、资金部本币交易室主任科员、资金部上海交易中心主任科员、金融市场部副处长、处长，平安信托有限责任公司固定收益部董事总经理。2016年11月起加入华泰保兴基金管理有限公司，现任公司副总经理。

尤小刚先生，督察长，硕士。历任中国南车集团戚墅堰机车车辆厂职员，江苏南通开发区管委会招商局干部，中国证监会稽查总队副调研员。2015年9月加入华泰保险集团股份有限公司参与筹备基金管理公司，2016年7月起任华泰保兴基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

张挺先生，基金经理，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。

5、基金投资决策委员会成员

主任：章劲（副总经理、首席投资官）
委员：王冠龙（总经理）
赵健（研究部总经理）
尚烁徽（基金经理）
张挺（基金经理）

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

名称：中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人：陈四清
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管部门信息披露联系人：王永民
传真：（010）66594942
中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2018年9月30日，中国银行已托管679只证券投资基金，其中境内基金642只，QDII基金37只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”、“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人，具体包括基金管理人直销柜台、网上直销平台、微信交易平台。

名称：华泰保兴基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道88号4306室
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
邮政编码：200120
法定代表人：杨平
成立时间：2016年7月26日
联系人：王珊珊
电话：（021）80299058
传真：（021）60963577
客户服务电话：400-632-9090，021-80210198
网上直销平台（网址）：www.ehuataifund.com
微信交易平台（微信公众号）：htbxjj99

2、其他销售机构

（1）中国银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
法定代表人：陈四清
客服电话：95566
网址：www.boc.cn

（2）上海天天基金销售有限公司
住所：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层
法定代表人：其实
客服电话：4001818188
网址：fund.eastmoney.com/

（3）中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人：王常青
客服电话：400-8888-108
网址：www.csc108.com

（4）申万宏源证券有限公司
住所：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅
客服电话：95523
网址：www.swhysc.com

（5）申万宏源西部证券有限公司
住所：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人：韩志谦
客服电话：400-800-0562
网址：www.hysec.com

（6）上海攀赢基金销售有限公司
住所：上海市闸北区广中西路1207号306室
法定代表人：田为奇
客服电话：021-68889082
网址：www.pytz.cn

（7）上海汇付基金销售有限公司
住所：上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元
法定代表人：金佶
客服电话：400-821-3999
网址：Licaijia.chinapnr.com

（8）北京肯特瑞基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
法定代表人：江卉
客服电话：400-088-8816
网址：http://jr.jd.com/

（9）上海好买基金销售有限公司
住所：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
法定代表人：杨文斌
客服电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com

（10）浙江同花顺基金销售有限公司
住所：浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903
法定代表人：凌顺平
客服电话：4008-773-772
网址：http://www.5ifund.com

（11）上海基煜基金销售有限公司
住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
法定代表人：王翔
客服电话：4008-205-369
网址：www.jiyufund.com.cn

（12）珠海盈米基金销售有限公司
住所：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人：肖雯
客服电话：020-89629066
网址：www.yingmi.cn

（13）江苏汇林保大基金销售有限公司
住所：南京市高淳区砖墙集镇78号
法定代表人：吴言林
客服电话：025-56663409
网址：www.huilinbd.com

（14）北京汇成基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人：王伟刚
客服电话：400-619-9059
网址：www.hcjijin.com

（15）广州银行股份有限公司
住所：广州市天河区珠江东路30号
法定代表人：黄子励
客服电话：400-83-96699
网址：www.gzcb.com.cn

（16）中民财富基金销售（上海）有限公司
住所：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
法定代表人：弭洪军
客服电话：400-876-5716
网址：www.cmiwm.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

（二）登记机构

名称：华泰保兴基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道88号4306室
邮政编码：200120
法定代表人：杨平
联系人：陈集杰
电话：（021）80299000
传真：（021）60963542

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市海华永泰律师事务所
住所：上海浦东东方路69号裕景国际商务广场A座15层
办公地址：上海浦东东方路69号裕景国际商务广场A座15层
负责人：张诚
电话：（021）58773177
传真：（021）58773268
联系人：梁丽金
经办律师：梁丽金、张兰

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：潘晓怡
经办注册会计师：周星、潘晓怡

四、基金的简介

本基金经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》准予注册，由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定进行募集。本基金基金合同于2017年4月20日生效。

（一）基金的名称

华泰保兴货币市场基金

（二）基金的类别

货币市场基金

（三）基金的运作方式

契约型开放式

五、基金的投资

（一）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。

（二）投资范围

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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（三）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，在严格控制风险的前提下，实现基金的投资目标。具体包括：

1、短期利率水平预期策略

深入分析对短期货币市场有影响的宏观经济形势、财政与货币政策、短期市场资金供求等因素，对未来短期内不同市场、不同品种的市场利率进行积极的判断，形成合理的短期利率走势预期，并据此调整基金组合的期限结构和品种配置计划。

2、收益率曲线分析策略

货币市场收益率曲线的形状反映当时短期利率水平之间的关系，反映市场对较短期限经济状况的判断及对未来短期经济走势的预期。收益率曲线策略即在不同期限投资品种之间进行配置，通过考察收益率曲线的动态变化及预期变化，寻求在一段时期内获取因收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。

3、组合剩余期限策略、期限配置策略

通过对组合资产剩余期限的设计、跟踪、调整，保持合理的现金流，动态控制组合的平均剩余期限，以满足可能的、突发的现金需求，同时保持组合的稳定收益；特别在债券投资中，根据收益率曲线的情况，投资一定剩余期限的品种，稳定收益，锁定风险，满足组合目标期限。

4、类别品种配置策略

在保持组合资产相对稳定的条件下，根据各类短期金融工具的市场规模、收益性和流动性，决定各类资产的配置比例；再通过评估各类资产的收益水平、市场偏好、投资限制、基金投资目标等确定不同类别资产的具体资产配置比例。

5、流动性管理策略

在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下，通过基金资产安排（包括现金库存、资产变现、剩余期限管理或其他措施），在保持基金资产高流动性的前提下，确保基金的稳定收益。

6、回购策略

当预期市场利率下跌或者走势平稳时，通过将剩余期限相对较长的短期债券进行回购质押，融资后再购买短期债券。在融资成本低于短期债券收益率时，该投资策略的运用可实现正收益。

7、资产支持证券投资策略

当前国内资产支持证券主要为以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产的信贷资产证券化产品，本基金侧重于对基础资产质量及未来现金流的分析，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的投资比例、信用等级并密切跟踪评级变化，采用分散投资方式以降低流动性风险。

8、其他金融工具投资策略

本基金将密切跟踪银行大额存单、承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品的动向，一旦监管机构允许基金参与此类融工具投资，本基金将在届时相应法律法规的框架内，根据对该金融工具的研究，制定符合本基金投资目标的投资策略，在充分考虑该投资品种风险和收益特征的前提下，谨慎投资。

（四）业绩比较基准

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）。

通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。

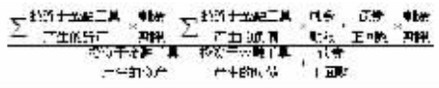
如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

（五）风险收益特征

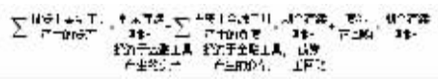
本基金为货币市场基金。本基金的预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

（六）投资组合平均剩余期限（天）和平均剩余存续期限（天）的计算

1、平均剩余期限（天）的计算公式如下：



2、平均剩余存续期限（天）的计算公式如下：



3、各类资产和负债剩余期限和剩余存续期限的确定

（1）银行活期存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期限为0天；证券清算款的剩余期限和剩余存续期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算；

（2）回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；买断式回购产生的待回购债券的剩余期限和剩余存续期限为该基础债券的剩余期限，待返售债券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；

（3）银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；有存款期限，根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以存款协议中约定的通知期计算；

（4）中央银行票据的剩余期限和剩余存续期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算；

（5）组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。

（6）对其它金融工具，本基金管理人将基于审慎原则，根据法律法规或中国证监会的规定、或参照行业公认的方法计算其剩余期限和剩余存续期限。

平均剩余期限和剩余存续期限的计算结果保留至整数位，小数点后四舍五入。如法律法规或中国证监会对剩余期限和剩余存续期限计算方法另有规定的从其规定。

（七）基金投资组合报告

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2018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。

本投资组合报告所载数据截至2018年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	3,387,005,295.81	50.56
	其中：债券	3,224,980,295.81	48.14
	资产支持证券	162,025,000.00	2.42
2	买入返售金融资产	2,307,015,140.55	34.44
	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	984,515,804.69	14.70
4	其他资产	20,929,184.80	0.31
5	合计	6,699,465,425.85	100.00

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	0.72	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额		
	其中：买断式回购融资	-	-

注：本基金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。

3、基金投资组合平均剩余期限

（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	53
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	55
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过120天的情况。

（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	49.75	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	19.41	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	18.34	-
	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）	12.25	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.76	

4、报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未发生超过240天的情况。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	471,463,894.07	7.04
	其中：政策性金融债	471,463,894.07	7.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,021,145,431.48	15.25
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,732,370,970.26	25.88
8	其他	-	-
9	合计	3,224,980,295.81	48.17
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

6、报告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

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	111809261	18浦发银行CD261	3,500,000	348,207,631.59	5.20
2	071800029	18中信CP007BC	3,400,000	339,990,614.95	5.08
3	180407	18农发07	2,700,000	271,221,896.63	4.05
4	111809217	18浦发银行CD217	2,000,000	199,758,682.67	2.98
5	111891082	18贵阳银行CD016	2,000,000	199,572,063.46	2.98
6	111810412	18兴业银行CD412	2,000,000	199,067,995.46	2.97
7	111811252	18平安银行CD252	2,000,000	199,006,606.56	2.97
8	111809223	18浦发银行CD223	1,500,000	149,729,814.47	2.24
9	011800876	18京国资SCP001	1,000,000	100,361,676.04	1.50
10	011800209	18国药控股SCP001	1,000,000	100,327,363.84	1.50

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	0.1088%
报告期内偏离度的最低值	0.0210%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0652%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金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

本基金报告期内未发生正偏离的绝对值达到0.5%的情况。

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十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	156005	宁运06A1	1,000,000.00	100,000,000.00	1.49
2	149731	宁运05A1	500,000.00	50,000,000.00	0.75
3	1889112	18上和1A1	500,000.00	12,025,000.00	0.18

9、投资组合报告附注

（1）基金计价方法说明

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，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

（2）本基金投资的前十名证券的发行主体本期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、处罚的情形如下：

①18兴业银行CD412（代码：111810412）为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。2018年3月26日，中国人民银行福州中心支行针对兴业银行违反国库管理规定的违法违规事实，处以警告及罚款人民币5万元的行政处罚；经中国银保监会官网2018年5月4日发布信息显示，2018年4月19日，中国银行保险监督管理委员会针对兴业银行十二项违法违规行为，处以罚款5870万元的行政处罚。

②18平安银行CD252（代码：111811252）为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。经中国人民银行2018年8月1日发布信息显示，2018年7月26日，中国人民银行对浦发银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告等反洗钱违法违规行为出具了银反洗罚决字（2018）2号行政处罚决定书。

③18浦发银行CD261（代码：111809261）、18浦发银行CD217（代码：111809217）、18浦发银行CD223（代码：111809223）为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。经中国银保监会官网2018年5月4日发布信息显示，2018年2月12日，原中国银监会针对浦发银行十九项违法违规行为，处以罚款5845万元，没收违法所得10.927万元，罚没合计5855.927万元的行政处罚；经中国人民银行2018年8月1日发布信息显示，2018年7月26日，中国人民银行对浦发银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等反洗钱违法违规行为出具了银反洗罚决字（2018）3号行政处罚决定书。

本基金投资18兴业银行CD412、18平安银行CD252、18浦发银行CD261、18浦发银行CD217、18浦发银行CD223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18兴业银行CD412、18平安银行CD252、18浦发银行CD261、18浦发银行CD217、18浦发银行CD223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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,441.05
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	20,927,643.75
4	应收申购款	100.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	20,929,184.80

（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。

六、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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

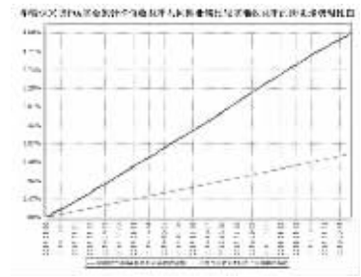
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
基金合同生效日至2017年12月31日	2.7141%	0.0017%	0.9468%	0.0000%	1.7673%	0.0017%
2018年1月1日至2018年6月30日	1.9173%	0.0012%	0.6695%	0.0000%	1.2478%	0.0012%
基金合同生效日至2018年6月30日	4.6835%	0.0015%	1.6163%	0.0000%	3.0672%	0.0015%

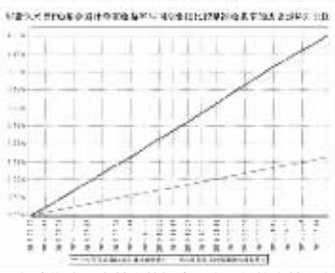
华泰保兴货币B

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
基金合同生效日至2017年12月31日	2.8876%	0.0017%	0.9468%	0.0000%	1.9408%	0.0017%
2018年1月1日至2018年6月30日	2.0389%	0.0012%	0.6695%	0.0000%	1.3694%	0.0012%
基金合同生效日至2018年6月30日	4.9853%	0.0015%	1.6163%	0.0000%	3.3690%	0.0015%

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）。

2、自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比（2017年4月20日至2018年6月30日）





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。

七、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、基金销售服务费；
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费用等；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金的证券交易或结算费用；
8、基金的银行汇划费用；
9、证券账户开户费用、账户维护费用；
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、与基金运作有关的费用

（1）申购费

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金份额的申购与赎回”一章。

（2）赎回费

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金份额的申购与赎回”一章。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、《基金合同》生效前的相关费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定，针对全部或部分份额类别，调整基金销售服务费率等相关费率。调低前述费率的，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须按基金合同的规定进行公告并办理备案手续。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

八、招募说明书更新部分的说明

《华泰保兴货币市场基金更新招募说明书（2018年第2号）》依据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券投资基金销售管理办法》《证券投资基金信息披露管理办法》《证券投