华泰保兴货币市场基金 2018年年度报告摘要

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
送出日期:二〇一九年三月二十六日

§1 重要提示

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。本年度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2019年3月22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。

本报告期自2018年01月01日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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4月20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	7,326,550,223.56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	42,977,780.30份	7,283,572,443.26份

2.2 基金产品说明

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。	
	华泰保兴货币A	华泰保兴货币B
下属分级基金的风险收益特征	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。	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。

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	王永民
	联系电话	021-80299000	010-66594896
	电子邮箱	fund_xxpl@ehuatai.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-632-9090	95566
传真		021-60963566	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ehuataifund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018年		2017年4月20日(基金合同生效日)-2017年12月31日	
	华泰保兴货币A	华泰保兴货币B	华泰保兴货币A	华泰保兴货币B
本期已实现收益	721,877.18	231,392,569.42	498,735.65	120,832,784.22
本期利润	721,877.18	231,392,569.42	498,735.65	120,832,784.22
本期净值收益率	3.2777%	3.5257%	2.7141%	2.8876%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末	
期末基金资产净值	42,977,780.30	7,283,572,443.26	15,238,836.82	5,323,166,344.44
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,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、本基金收益分配为按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

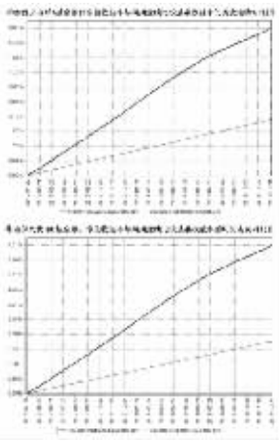
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6359%	0.0017%	0.3403%	0.0000%	0.2956%	0.0017%
过去六个月	1.3348%	0.0018%	0.6805%	0.0000%	0.6543%	0.0018%
过去一年	3.2777%	0.0023%	1.3500%	0.0000%	1.9277%	0.0023%
自基金合同生效起至今	6.0808%	0.0022%	2.2968%	0.0000%	3.7840%	0.0022%

华泰保兴货币B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.6966%	0.0017%	0.3403%	0.0000%	0.3563%	0.0017%
过去六个月	1.4572%	0.0018%	0.6805%	0.0000%	0.7767%	0.0018%
过去一年	3.5257%	0.0023%	1.3500%	0.0000%	2.1757%	0.0023%
自基金合同生效起至今	6.5151%	0.0022%	2.2968%	0.0000%	4.2183%	0.0022%

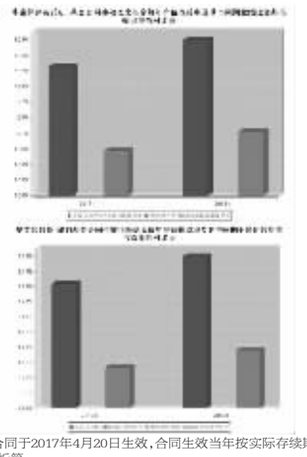
注:本基金业绩比较基准为:中国人民银行公布的7天通知存款利率(税后)。

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



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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2017年4月20日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

华泰保兴货币A

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2018	708,263.66	-	13,613.52	721,877.18	
2017	493,334.63	-	5,401.02	498,735.65	
合计	1,201,598.29	-	19,014.54	1,220,612.83	

单位:人民币元

华泰保兴货币B

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2018	229,963,327.87	-	1,429,241.55	231,392,569.42	
2017	118,842,003.20	-	1,990,781.02	120,832,784.22	
合计	348,805,331.07	-	3,420,022.57	352,225,353.64	

§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,注册资本1.8亿元人民币,公司股东分别为华泰保险集团股份有限公司(下称"华泰保险集团")、上海飞恒资产管理中心(有限合伙)(下称"飞恒资产")、上海旷正资产管理中心(有限合伙)(下称"旷正资产")、上海泰颐资产管理中心(有限合伙)(下称"泰颐资产")、上海哲昌资产管理中心(有限合伙)(下称"哲昌资产")、上海志庄资产管理中心(有限合伙)(下称"志庄资产"),其中,华泰保险集团持股比例为80%,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20%。

截至2018年12月31日,公司公募证券投资基金管理规模为人民币101.05亿元,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、华泰保兴策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、华泰保兴尊合债券型证券投资基金、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等12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			
张提	基金经理	2017年4月20日	-	7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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(证监会公告[2011]18号),公司制定了《华泰保兴基金管理有限公司公平交易制度》,该制度及控制方法适用公司管理所有投资组合(包括封闭式基金、开放式基金、社保组合、企业年金、特定客户资产管理组合等),对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时包括投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节。

研究分析方面,公司研究部全面负责公司各投资组合投资业务的研究工作,研究部公平地为各投资组合管理部门提供研究服务,其研究报告在不同的投资组合之间均可共享,且在研究报告内容、质量、数量及提供时间上均保持公平性。公司所有研究报告均在公司内部研究报告系统上统一发布。

授权和投资决策方面,对于证券投资基金业务,分别明确基金投资决策委员会、基金投资部负责人、基金经理的职责和权限划分,并合理确定基金经理的投资权限,基金投资决策委员会、基金投资部负责人等管理机构和人员不得对基金经理在授权范围内的投资活动进行干预。基金经理在授权范围内可以自主决策,但超过投资权限的操作需要经过严格的审批;对于特定客户资产管理业务,分别明确专户投资决策委员会、专户投资部负责人、专户投资经理等各投资决策主体的职责和权限划分,合理确定专户投资部负责人及投资经理的投资权限。专户投资决策委员会和专户投资部负责人等管理机构和人员不得对专户投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。专户投资经理在授权范围内可以自主决策,但超过投资权限的操作需要经过严格的审批。公司建立严格的投资组合投资信息管理及保密制度。在投资交易管理系统中设置基金经理/投资经理的查询和操作权限,并进行定期检查系统中的权限设置情况,确保不同基金经理/投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息均做到相互隔离。

交易执行方面,公司实行集中交易制度,设立独立交易室,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。所有投资对象的投资指令必须经由交易室负责人或其授权人审核分配至交易员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待,原则上应保证不同投资组合在同一时点就同一投资对象下达的相同方向的投资指令分配给同一交易员完成。交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时,除需经过公平性审核的例外指令外,必须开启系统的公平交易开关:(一)对于同一时间段的不同交易价格,投资交易系统对于不同投资组合一律按价格优先的顺序成交;(二)对于同一时间段的相同交易价格,投资交易系统对于不同投资组合自动按比例分配成交量,即按照不同投资组合平均分配的原则。

事后监督,风险管理部负责对不同投资组合公平交易行为进行交易价差等数量化分析,并通过定量分析结果对公平交易的过程、结果实施监督:每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析;每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行1日、3日、5日同向交易价差分析。如果在上述分析期间内,公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况,应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制,针对潜在问题完善公平交易制度,并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 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,结合投资交易系统中的公平交易模块,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。

4.3.3 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

2018年,国内经济增长呈现前高后低的走势,GDP增速从一季度的6.8%逐季下行至四季度的6.4%。房地产销售面积增速有所回落,但由于前期去库存情况良好,投资仍有韧性,新开工面积保持较快增长。货币政策方面,随着社融增速的下行,债券市场违约事件频发,央行保持资金面合理充裕,引导资金支持实体经济。物价方面,PPI同比有所回落,CPI低位震荡。

报告期内,货币政策根据经济运行形势进行调整,货币市场利率逐步下行,市场资金面整体较为宽松。存单利率水平大幅下行,目前已经达到2016年以来低位。

基金投资方面,报告期内,在继续做好日常流动性管理的基础上,合理安排资产的到期期限,季末时点积极融出资金提高收益。在债券市场信用事件频发背景下,基金投资仍以AAA级银行同业存款和同业存单为主,保持资产的安全性和流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期华泰保兴货币A的基金份额净值收益率为3.2777%,本报告期华泰保兴货币B的基金份额净值收益率为3.5257%,同期业绩比较基准收益率为1.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受社融增速较低,工业品价格下行,中美贸易摩擦等因素的影响,预计2019年经济增长仍面临一定下行压力。在此背景下,预计央行仍将维护市场流动性合理宽裕,引导资金更多地支持实体经济,但为了抑制资产泡沫,预计货币政策仍将保持稳健,短端资金利率总体将保持低位稳定。

基金投资上,主要投资方向仍是信用资质较好的银行同业存单及同业存款,保持资产的安全性和流动性,并且注意合理安排资产的到期结构,以便把握资产配置的时机。

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。估值委员会委员由分管运营的副总经理、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公司制度的规定,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

根据本基金基金合同中收益分配的有关规定,本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,每月集中支付。本报告期内本基金应分配收益232,114,446.60元,实际分配收益232,114,446.60元。

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")在华泰保兴货币市场基金(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、基金净值收益率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 托管人对本年度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(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具的是标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华泰保兴货币市场基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	1,609,127,893.13	1,802,090,156.61
结算备付金	5,204,545.45	-
存出保证金	-	5,813.92
交易性金融资产	3,045,471,008.09	3,320,388,983.39
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,045,471,008.09	3,320,388,983.39
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	2,649,732,754.62	346,930,480.40
应收证券清算款	-	-
应收利息	23,657,187.54	23,978,052.24
应收股利	-	-
应收申购款	300.00	501,080.97
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,333,193,688.83	5,493,894,567.53

负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
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	-	150,919,653.62
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	2,000.00
应付管理人报酬	1,992,675.75	1,515,814.21
应付托管费	603,841.16	459,337.63
应付销售服务费	67,360.87	48,924.65
应付交易费用	96,353.10	71,413.69
应交税费	27,197.28	-
应付利息	-	149,060.43
应付利润	3,439,037.11	1,996,182.04
递延所得税负债	-	-
其他负债	417,000.00	327,000.00
负债合计	6,643,465.27	155,489,386.27
所有者权益:		
实收基金	7,326,550,223.56	5,338,405,181.26
未分配利润	-	-
所有者权益合计	7,326,550,223.56	5,338,405,181.26
负债和所有者权益总计	7,333,193,688.83	5,493,894,567.53

注:1.报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.00元,基金份额总额7,326,550,223.56份,其中A类基金份额42,977,780.30份,B类基金份额7,283,572,443.26份。

2.本财务报表的实际编制期间为2018年度,比较财务报表的实际编制期间为2017年4月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体:华泰保兴货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年4月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入	266,023,090.25	141,230,875.95
1.利息收入	262,015,552.71	140,100,222.88
其中:存款利息收入	69,809,097.69	51,191,755.37
债券利息收入	125,573,383.11	74,821,198.61
资产支持证券利息收入	3,985,309.63	530,136.99
买入返售金融资产收入	62,647,762.28	13,557,131.91
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	4,007,001.91	1,130,653.07
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,007,316.99	1,130,790.06
资产支持证券投资收益	-315.08	-136.99
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	535.63	-
减:二、费用	33,908,643.65	19,899,356.08
1. 管理人报酬	22,376,083.14	9,876,267.83
2. 托管费	6,780,631.28	2,992,806.35
3. 销售服务费	733,709.10	330,904.67
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	3,472,388.33	6,280,106.12
其中:卖出回购金融资产支出	3,472,388.33	6,280,106.12
6. 税金及附加	33,559.39	-
7. 其他费用	512,272.41	419,269.11
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	232,114,446.60	121,331,519.87
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	232,114,446.60	121,331,519.87

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰保兴货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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)	5,338,405,181.26	-	5,338,405,181.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	232,114,446.60	232,114,446.60
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)	1,988,145,042.30	-	1,988,145,042.30
其中:1.基金申购款	35,405,710,163.13	-	35,405,710,163.13
2.基金赎回款	-33,417,565,120.83	-	-33,417,565,120.83
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)	-	-232,114,446.60	-232,114,446.60
五、期末所有者权益(基金净值)	7,326,550,223.56	-	7,326,550,223.56
	上年度可比期间 2017年4月20日(基金合同生效日)至2017年12月31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)	5,833,947,478.52	-	5,833,947,478.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	121,331,519.87	121,331,519.87
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)	-495,542,297.26	-	-495,542,297.26
其中:1.基金申购款	19,698,293,870.30	-	19,698,293,870.30
2.基金赎回款	-20,193,836,167.56	-	-20,193,836,167.56
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)	-	-121,331,519.87	-121,331,519.87
五、期末所有者权益(基金净值)	5,338,405,181.26	-	5,338,405,181.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____王冠龙_____ _____寻卫国_____ _____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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰保兴货币市场基金(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[2016]2924号《关于准予华泰保兴货币市场基金注册的批复》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《华泰保兴货币市场基金基金合同》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5,833,532,329.13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447号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰保兴货币市场基金基金合同》于2017年4月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,833,947,478.52份,其中认购资金利息折合415,149.39份。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《华泰保兴货币市场基金基金合同》和《华泰保兴货币市场基金招募说明书》的规定,本基金根据基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量不同,分设不同类别的基金份额,各类基金份额按照不同的费率计提销售服务费。其中,基金账户最低基金份额余额为1份,且按照0.25%的年费率计提销售服务费的称为A类份额;基金账户最低基金份额余额为5,000,000份,且按照0.01%的年费率计提销售服务费的称为B类份额;本基金A类份额及B类份额分设不同的基金代码。由于基金费用的不同,本基金A类份额及B类份额将分别计算和公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴货币市场基金基金合同》的有关规定,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。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)。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰保兴基金管理有限公司于2019年3月25日批准报出。

7.4.2 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(年度报告和半年度报告)》、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》、《华泰保兴货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018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2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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的说明

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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 关联方关系

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、注册登记机构、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
华泰保险集团股份有限公司	基金管理人的主要股东
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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注: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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年4月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	22,376,083.14	9,876,267.83
其中:支付销售机构的客户维护费	68,034.72	98,460.46

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0.33%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年4月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,780,631.28	2,992,806.35

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0.10%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:日托管费=前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

7.4.8.2.3 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 2018年1月1日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴货币A	华泰保兴货币B	合计
华泰保兴基金管理有限公司	51,692.15	671,130.16	722,822.31
中国银行股份有限公司	5,417.29	0.00	5,417.29
合计	57,109.44	671,130.16	728,239.60
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年4月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴货币A	华泰保兴货币B	合计