

华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

2018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：中国建设银行股份有限公司

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、董监高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。
本基金年度报告经三分之二以上独立董事签字确认。

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。

基金经理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请仔细阅读基金的招募说明书及其更新。

本报告书摘录了基金合同生效日至2018年12月31日止。

本年度报告摘要简要报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金名称	华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
基金主代码	00646
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月16日
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期本基金份额总额	656,706,331.72份
基金合同存续期间	不定期

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，追求货币基金资产的长期增值，力求获得高于行业平均水平的稳定收益。

本基金在封闭期内及开放期采取不同的投资策略，在封闭期内，本基金将根据宏观经济、国家财政政策和货币政策、国家产业政策及资金市场环境的深入分析，积极把握宏观经济发展趋势，动态调整资产配置比例，力争在严格控制风险的前提下，为投资者创造稳定的收益。

本基金在开放期将根据宏观经济、行业政策、利率走势、信用评级、流动性偏好、期限偏好、预期收益率等因素，通过综合分析，精选具有较高流动性的品种，力争在严格控制风险的前提下，为投资者创造较高的收益。

本基金在开放期将根据宏观经济、行业政策、利率走势、信用评级、流动性偏好、期限偏好、预期收益率等因素，通过综合分析，精选具有较高流动性的品种，力争在严格控制风险的前提下，为投资者创造较高的收益。

投资策略 在开放期内，本基金将根据宏观经济、国家财政政策和货币政策、国家产业政策及资金市场环境的深入分析，积极把握宏观经济发展趋势，动态调整资产配置比例，力争在严格控制风险的前提下，为投资者创造稳定的收益。

业债比较基准 中债综合(全价)指数收益率

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	中国建设银行股份有限公司
姓名	尤小刚	田卉
信息披露负责人	朱小刚	田卉
联系电话	021-60290000	010-67500096
电子邮箱	fund_xpb@163.com	tianjing12@bjcb.com
客户服务电话	400-632-9000	96633
传真	021-60936566	010-66275893

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 www.ehuatiefund.com

基金年度报告备置地 本基金管理人住所

§ 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2月6日(基金合同生效日)-2018年12月31日	
本期已实现收益	26,663,361.22	
加权平均基金份额本期利润	0.0673	
本期基金份额净值增长率	6.72%	
3.1.2 期间数据和指标	2018年末	
期末可供基金份额利润	0.0430	
期末基金份额净值	694,301,457.06	
期末基金份额净值	1,067.2	

注：1.本基金合同生效日为2018年2月6日，截止报告期末基金合同生效未满一年。

2.本期实现收益指基金本期收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣减相关税费后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.期末可供分配利润是指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。

4.所述业绩指标不包括持有人认购、申购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

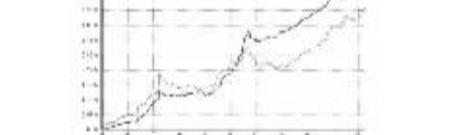
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1.本基金合同生效日为2018年2月6日，截止报告期末基金合同生效未满一年。

2.本基金合同规定的基金的组合比例符合基金合同的有关约定。

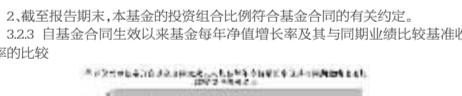
3.2.2 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1.本基金合同生效日为2018年2月6日，截止报告期末基金合同生效未满一年。

2.本基金合同规定的基金的组合比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 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：1.本基金合同生效日为2018年2月6日，2018年度的相关数据根据当年实际存续期（2018年2月6日至2018年12月31日）计算。

注：本基金自2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其费率计提的基金的名称

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1亿元人民币，公司股东分别为华泰保兴集团有限公司（下称“华泰保兴”）、华泰保兴资产管理有限公司（下称“华泰保兴”）、上海飞乐资产管理有限公司（下称“飞乐”）、上海泰盛资产管理有限公司（下称“泰盛”）、上海泰富资产管理有限公司（下称“泰富”）。

4.1.2 基金经理的姓名及基金经理的从业经验

基金经理周咏梅，女，11年金融行业从业经验，历任华泰保兴基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理，现任华泰保兴基金管理有限公司基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内，基金管理人严格按照法律法规、基金合同、基金托管协议及其他有关规定，履行诚实守信、勤勉尽责的基本义务，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。

4.3 管理人对报告期内本基金投资运作的专项说明

本报告期内，本基金按照基金合同的约定，结合本基金的实际情况，严格执行基金合同和托管协议的约定，对本基金的资产进行了合理的配置，确保本基金的投资运作符合法律法规的规定，不存在损害基金份额持有人利益的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的经营业绩和业绩表现的说明

2018年，本基金实现了良好的经营业绩，全年实现收益6.72%，远超业绩比较基准6.2%。

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年，本基金主要通过配置利率债、高等级信用债、可转债等固定收益类资产，同时适当配置少量权益类资产，整体上实现了较好的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的绩效评价

2018年，本基金实现了良好的经营业绩，全年实现收益6.72%，远超业绩比较基准6.2%。

4.4.3 对基金未来投资运作的展望

2019年，本基金将继续坚持“固收+”策略，通过配置利率债、高等级信用债、可转债等固定收益类资产，同时适当配置少量权益类资产，整体上实现了较好的投资回报。

4.5 管理人对报告期内基金估值政策和程序的说明

本基金的估值政策和估值程序符合《基金合同》的有关规定。

4.6 管理人对报告期内基金费用计提方法的说明

本基金的费用计提方法符合《基金合同》的有关规定。

4.7 管理人对报告期内基金收益分配政策的说明

本基金的收益分配政策符合《基金合同》的有关规定。

4.8 管理人对中期报告编制的说明

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.9 管理人对中期报告的披露说明

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.10 管理人对中期报告的复核意见

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.11 管理人对中期报告的提示性说明

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.12 管理人对中期报告的法律意见

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.13 管理人对中期报告的提示性说明

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.14 管理人对中期报告的提示性说明

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.15 管理人对中期报告的提示性说明

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.16 管理人对中期报告的提示性说明

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.17 管理人对中期报告的提示性说明

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.18 管理人对中期报告的提示性说明

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.19 管理人对中期报告的提示性说明

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.20 管理人对中期报告的提示性说明

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.21 管理人对中期报告的提示性说明

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.22 管理人对中期报告的提示性说明

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金定期报告的内容与格式指引第2号——中期报告》等法律法规的要求，编制并披露了本基金的中期报告。

4.23 管理人对中期报告的提示性说明