华泰保兴货币市场基金

2019年第二季度报告

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：二〇一九年七月十七日

§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2019年7月15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2019年4月1日起至6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	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	6,701,147,091.13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	17,428,616.17份	6,683,718,474.96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（2019年4月1日 - 2019年6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	115,766.64	41,446,319.20
2.本期利润	115,766.64	41,446,319.20
3.期末基金资产净值	17,428,616.17	6,683,718,474.96

注：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。

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	0.5393%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.2027%	0.0004%

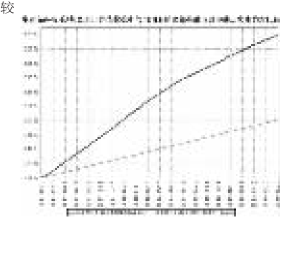
华泰保兴货币B

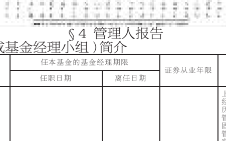
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6001%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.2635%	0.0004%

注：1、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、本基金收益分配自2019年5月10日起由“按月结转份额”调整为“按日结转份额”。

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





§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			
张挺	基金经理	2017年4月20日	-	8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，无损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，本基金运作无重大违法违规行为，投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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。

4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度，国内经济增长下行压力再度显现，工业增加值和PMI均较一季度回落，社融、M2增速略有回升，央行货币政策仍保持银行间市场流动性合理充裕。物价呈现食品较强、非食品较弱的特征，5月CPI回升至2.7%。美债利率大幅下行，中美利差有所扩大，人民币汇率保持稳定。

二季度，银行间市场流动性保持合理充裕，回购利率、存单利率保持低位稳定。包商银行托管后银行存单等级利差有所扩大。

报告期内，基金投资上，主要投资信用资质较好的银行存单和存款，保持资产较高流动性和安全性，合理安排资产的到期期限。

4.5 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0.5393%，本报告期华泰保兴货币B的基金份额净值收益率为0.6001%，同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

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	2,843,782,052.40	40.95
	其中：债券	2,843,782,052.40	40.95
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,436,456,854.70	35.09
	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	1,611,119,434.88	23.20
4	其他资产	52,666,758.07	0.76
5	合计	6,944,025,100.05	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	0.45	
	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	238,799,640.60	3.56
	其中：买断式回购融资	-	-

注：本报告期内本基金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

注：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。

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	41
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	50
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：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。

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	59.20	3.56
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	21.60	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	14.72	-
	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）	7.32	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		102.84	3.56

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

注：本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。

5.5 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	582,028,456.31	8.69
	其中：政策性金融债	582,028,456.31	8.69
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	19,999,867.24	0.30
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,241,753,728.85	33.45
8	其他	-	-
9	合计	2,843,782,052.40	42.44
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	111907092	19招商银行CD092	3,000,000	298,277,170.71	4.45
2	111817200	18光大银行CD200	2,000,000	199,757,474.42	2.98
3	111997350	19宁波银行CD085	2,000,000	199,308,300.23	2.97
4	111817188	18光大银行CD188	2,000,000	199,198,997.48	2.97
5	111903074	19农业银行CD074	2,000,000	198,795,245.08	2.97
6	111808251	18中信银行CD251	1,500,000	149,815,729.84	2.24
7	190201	19国开01	1,200,000	119,867,476.20	1.79
8	180202	18国开02	1,000,000	101,077,002.66	1.51
9	150203	15国开03	1,000,000	100,611,240.18	1.50
10	120231	12国开31	1,000,000	100,019,161.74	1.49

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	0.0324%
报告期内偏离度的最低值	-0.0138%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0080%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本报告期内本基金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

注：本报告期内本基金未发生正偏离的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 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

注：本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

1、19宁波银行CD085（代码：111997350）为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。2018年12月13日，宁波银监局针对宁波银行个人贷款资金违规流入房市、购买理财的违法违规行为，对宁波银行处以20万元罚款的行政处罚（详见甬银监罚决字[2018]45号行政处罚决定书）；2019年6月28日，宁波银保监局针对宁波银行违反信贷政策、违反房地产行业政策、违规开展存贷业务、员工管理不到位、向监管部门报送的报表不准确等违法违规事实，对宁波银行处以罚款人民币270万元、并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分的行政处罚（详见甬银保监罚决字[2019]59号行政处罚决定书）；2019年6月28日，宁波银保监局针对宁波银行销售行为不合规、双录管理不到位等违法违规事实，对宁波银行处以罚款人民币30万元、并责令该行对相关直接责任人给予记录处分的行政处罚（详见甬银保监罚决字[2019]62号行政处罚决定书）。

2、18光大银行CD200（代码：111817200）、18光大银行CD188（代码：111817188）为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。2018年11月9日，中国银保监会针对光大银行内控管理严重违反审慎经营规则等违法违规行为，对光大银行处以人民币1120万元的行政处罚（详见银保监银罚决字[2018]10号行政处罚决定书）。

3、18中信银行CD251（代码：111808251）为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。2018年11月19日，中国银保监会针对中信银行理财资金违规缴纳土地款等违法违规行为，对中信银行给予罚款人民币2280万元的行政处罚（详见银保监银罚决字[2018]14号行政处罚决定书）。

本基金投资19宁波银行CD085、18光大银行CD200、18光大银行CD188、18中信银行CD251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19宁波银行CD085、18光大银行CD200、18光大银行CD188、18中信银行CD251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	22,366,758.07
4	应收申购款	30,300,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	52,666,758.07

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。

§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	33,949,759.22	5,284,353,913.12
报告期期间基金总申购份额	8,186,914.13	9,138,421,629.77
报告期期间基金总赎回份额	24,708,057.18	7,739,057,067.93
报告期期末基金份额总额	17,428,616.17	6,683,718,474.96

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	申赎	2019年4月26日	-11,000,000.00	-11,000,000.00	0.00%
2	红利再投	2019年4月30日	38,316.82	38,316.82	0.00%
3	红利再投	2019年5月13日	7,059.21	7,059.21	0.00%
4	红利再投	2019年5月14日	506.06	506.06	0.00%
5	红利再投	2019年5月15日	498.87	498.87	0.00%
6	红利再投	2019年5月16日	497.84	497.84	0.00%
7	红利再投	2019年5月17日	504.68	504.68	0.00%
8	红利再投	2019年5月20日	1,537.83	1,537.83	0.00%
9	红利再投	2019年5月21日	512.93	512.93	0.00%
10	红利再投	2019年5月22日	524.18	524.18	0.00%
11	红利再投	2019年5月23日	516.71	516.71	0.00%
12	红利再投	2019年5月24日	524.74	524.74	0.00%
13	红利再投	2019年5月27日	1,553.80	1,553.80	0.00%
14	红利再投	2019年5月28日	528.15	528.15	0.00%
15	红利再投	2019年5月29日	547.93	547.93	0.00%
16	红利再投	2019年5月30日	533.80	533.80	0.00%
17	红利再投	2019年5月31日	540.27	540.27	0.00%
18	红利再投	2019年6月3日	1,623.85	1,623.85	0.00%
19	红利再投	2019年6月4日	529.37	529.37	0.00%
20	红利再投	2019年6月5日	530.12	530.12	0.00%
21	红利再投	2019年6月6日	461.55	461.55	0.00%
22	红利再投	2019年6月10日	2,055.58	2,055.58	0.00%
23	红利再投	2019年6月11日	515.47	515.47	0.00%
24	红利再投	2019年6月12日	516.79	516.79	0.00%
25	红利再投	2019年6月13日	514.35	514.35	0.00%
26	红利再投	2019年6月14日	510.01	510.01	0.00%
27	红利再投	2019年6月17日	1,561.91	1,561.91	0.00%
28	红利再投	2019年6月18日	519.84	519.84	0.00%
29	红利再投	2019年6月19日	497.32	497.32	0.00%
30	红利再投	2019年6月20日	540.56	540.56	0.00%
31	红利再投	2019年6月21日	525.36	525.36	0.00%
32	红利再投	2019年6月24日	1,533.61	1,533.61	0.00%
33	红利再投	2019年6月25日	514.46	514.46	0.00%
34	红利再投	2019年6月26日	542.44	542.44	0.00%
35	红利再投	2019年6月27日	539.80	539.80	0.00%
36	红利再投	2019年6月28日	548.50	548.50	0.00%
合计			-10,930,715.29	-10,930,715.29	

§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

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有本基金份额比例达到或超过20%的情况。

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、报告期内本基金在指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，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

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查询

华泰保兴基金管理有限公司
2019年7月17日

华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

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
报告送出日期：二〇一九年七月十七日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月15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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰保兴尊信定开
基金主代码	005645
交易代码	005645
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月6日
报告期末基金份额总额	703,465,458.86份
投资目标	在严格控制风险和保持资金流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。封闭期内，本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，灵活运用久期策略、期限结构配置策略、类属配置策略、信用债策略、个券挖掘策略及杠杆策略等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，对债券组合进行动态调整。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，重点考虑债券的安全性和流动性，确保组合债券有较高的变现能力，并严格控制基金组合的杠杆比例。同时，基金管理人将密切关注基金的申购赎回情况，对投资组合的现金比例进行结构化管理。通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，有效分配基金的现金流，保持本基金在开放期的充分流动性。
业绩比较基准	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，其风险与预期收益低于混合型基金和股票型基金、高于货币市场基金。
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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（2019年4月1日 - 2019年6月30日）
1.本期已实现收益	8,471,274.05
2.本期利润	5,502,310.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0078
4.期末基金资产净值	759,736,555.77
5.期末基金份额净值	1.0800

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。

2、所述基金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要低于所列数字。

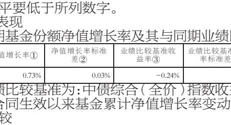
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	0.73%	0.03%	-0.24%	0.06%	0.97%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§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		
周咏梅	基金经理	2018年2月6日	-	12年	国际金融学硕士。历任华泰资产管理有限公司固定收益组合管理部投资助理、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等。2016年8月加入华泰保兴基金管理有限公司，历任专户投资一部投资经理。

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，无损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，本基金运作无重大违法违规行为，投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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。

4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度以来，国外不确定性再次上升，中美贸易摩擦升级，国内经济增长再次承压，PMI回落至荣枯线下方，工业增加值增速放缓。具体来看，制造业投资增长乏力，1-5月份累计同比仅为2.7%；地产投资增速虽然韧性很足，但是地产销售出现了明显的分化，三四线城市因棚改收缩而销量走弱，销售面积增速的下降未来或拖累投资；随着地方债发行的加速，基建投资小幅反弹，但回升幅度低于市场预期。5月份社会消费品零售总额同比增速有所反弹，但居民的高杠杆弱化了减税对消费的影响，消费弱中趋稳。从进出口来看，美国的关税上调对经济的负面影响开始显现，出口增速延续下行的走势，进口增速下降更快，在外需走弱的背景下，出口仍将承压。从物价来看，猪肉价格处于上行通道，涨幅有所趋缓，水果涨幅较大，但仍在可控范围内。从货币政策来看，央行的逆周期调整政策可能会强化。包商银行被接管导致银行及非银金融机构对中小银行负债的配置需求明显下降，中小银行“去杠杆”的压力上升，央行仍需保持资金面的相对宽松。

从债券市场来看，随着货币政策的边际微调，4月份债券收益率出现了15bp-40bp的上行。4月下旬，随着中美贸易摩擦的升级，债券市场开始逆转。5月6日，央行宣布对部分中小银行进行了定向降准，资金面持续宽松，债券收益率快速下行。包商银行被接管后，资金市场出现了严重的分层，市场风险偏好下降，低等级信用债收益率上行，高等级债券收益率下降。二季度以来，收益率曲线平坦化，7-10 年期政策性银行金融债收益率小幅下行，3-5年期金融债上行约10bp，1年金融债上行约20bp。基金投资方面，一季度本组合以中短期高等级信用债为主，小幅降低久期，获取票息收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0800元；本报告期基金份额净值增长率为0.73%，业绩比较基准收益率为-0.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,049,086,061.00	97.72
	其中：债券	1,049,086,061.00	97.72
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,886,090.85	0.36
8	其他资产	20,638,379.68	1.92
9	合计	1,073,610,531.53	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本报告期末本基金未持有股票。

5.3 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股票投资明细

注：本报告期末本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（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	142,244,000.00	18.72
	其中：政策性金融债	20,240,000.00	2.66
4	企业债券	183,631,561.00	24.17
5	企业短期融资券	110,560,000.00	14.55
6	中期票据	564,135,500.00	74.25
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	48,515,000.00	6.39
9	其他	-	-
10	合计	1,049,086,061.00	138.09

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	101800075	18凤凰传媒MTN001	500,000	51,770,000.00	6.81
2	101754036	17中航工MTN001	500,000	51,440,000.00	6.77
3	101558032	15宁沪高MTN001	500,000	50,905,000.00	6.70
4	111904030	19中国银行CD030	500,000	48,515,000.00	6.39
5	1728015	17招商银行02	400,000	40,792,000.00	5.37

5.6 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

注：本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本报告期末本基金未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现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。

5.10.2

本报告期末本基金未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	22,936.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,615,443.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,638,379.68

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金未持有股票。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	703,465,458.86
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	703,465,458.86

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情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.42

注：本基金本报告期内基金管理人未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.42	10,000,000.00	1.42	自基金合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	-
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	-
合计	10,000,000.00	1.42	10,000,000.00	1.42	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190401-20190630	246,709,831.72	0.00	0.00	246,709,831.72	35.07%
	2	20190401-20190630	399,997,000.00	0.00	0.00	399,997,000.00	56.86%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额和基金认购成立份额。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金募集的文件
2、《华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》
3、《华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金托管协议》
4、《华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》
5、基金管理人业务资格批件、营业执照
6、报告期内本基金在指定媒介披露的各项公告
7、中国证监会要求的其他文件

10.2 存放地点

基金管理人办公场所，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

10.3 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查询

华泰保兴基金管理有限公司
2019年7月17日

华泰保兴尊颐定期开放债券型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人：华泰保兴基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一九年七月十七日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月15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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰保兴尊颐定开
基金主代码	006188
交易代码	006188
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年7月26日
报告期末基金份额总额	396,455,997.77份
投资目标	在严格控制风险和保持资金流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。 （一）封闭期投资策略 本基金通过对宏观经济运行状态、国家财政政策和货币政策、国家产业政策及资本市场资金环境的深入分析，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，结合定量分析方法，确定基金资产在各类债券资产之间的配置比例。本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，灵活运用久期策略、期限结构配置策略、类属配置策略、信用债策略、个券挖掘策略及杠杆策略等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，对债券组合进行动态调整。 （二）开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，重点考虑债券的安全性和流动性，确保组合债券有较高的变现能力，并严格控制基金组合的杠杆比例。 同时，基金管理人将密切关注基金的申购赎回情况，对投资组合的现金比例进行结构化管理。通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，有效分配基金的现金流，保持本基金在开放期的充分流动性。
业绩比较基准	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。
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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（2019年4月1日 - 2019年6月30日）
1.本期已实现收益	6,496,479.85
2.本期利润	1,992,745.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0049
4.期末基金资产净值	417,039,489.40
5.期末基金份额净值	1.0519

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。

2、所述基金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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

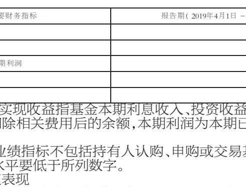
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	0.48%	0.04%	-0.24%	0.06%	0.72%	-0.02%

注：1、本基金合同生效日为2018年7月26日，截止报告期末基金合同生效未满一年。

2、本基金业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金基金合同于2018年7月26日生效，截止报告期末基金合同生效未满一年。

§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		
周咏梅	基金经理	2018年7月26日	-	12年	国际金融学硕士。历任华泰资产管理有限公司固定收益组合管理部投资助理、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等。2016年8月加入华泰保兴基金管理有限公司，历任专户投资一部投资经理。

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，无损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，本基金运作无重大违法违规行为，投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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。

4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度以来，国外不确定性再次上升，中美贸易摩擦升级，国内经济增长再次承压，PMI回落至荣枯线下方，工业增加值增速放缓。具体来看，制造业投资增长乏力，1-5月份累计同比仅为2.7%；地产投资增速虽然韧性很足，但是地产销售出现了明显的分化，三四线城市因棚改收缩而销量走弱，销售面积增速的下降未来或拖累投资；随着地方债发行的加速，基建投资小幅反弹，但回升幅度低于市场预期。5月份社会消费品零售总额同比增速有所反弹，但居民的高杠杆弱化了减税对消费的影响，消费弱中趋稳。从进出口来看，美国的关税上调对经济的负面影响开始显现，出口增速延续下行的走势，进口增速下降更快，在外需走弱的背景下，出口仍将承压。从物价来看，猪肉价格处于上行通道，涨幅有所趋缓，水果涨幅较大，但仍在可控范围内。从货币政策来看，央行的逆周期调整政策可能会强化。包商银行被接管导致银行及非银金融机构对中小银行负债的配置需求明显下降，中小银行“去杠杆”的压力上升，央行仍需保持资金面的相对宽松。

从债券市场来看，随着货币政策的边际微调，4月份债券收益率出现了15bp-40bp的上行。4月下旬，随着中美贸易摩擦的升级，债券市场开始逆转。5月6日，央行宣布对部分中小银行进行了定向降准，资金面持续宽松，债券收益率快速下行。包商银行被接管后，资金市场出现了严重的分层，市场风险偏好下降，低等级信用债收益率上行，高等级债券收益率下降。二季度以来，收益率曲线平坦化，7-10 年期政策性银行金融债收益率小幅下行，3-5年期金融债上行约10bp，1年金融债上行约20bp。可转债市场在经历了4月份的暴跌后，6月中旬开始上涨。基金投资方面，二季度本组合以中短期高等级信用债为主，并仍持有部分低估值的可转债，同时通过有选择性地参与可转债一级市场申购以获取收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0519元；本报告期基金份额净值增长率为0.48%，业绩比较基准收益率为-0.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	586,943,616.96	97.44
	其中：债券	586,943,616.96	97.44
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,073,574.45	0.68
8	其他资产	11,377,433.37	1.89
9	合计	602,394,624.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本报告期末本基金未持有股票。

5.3 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股票投资明细

注：本报告期末本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	4,081,249.60	0.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	41,141,741.00	9.87
	其中：政策性金融债	10,553,741.00	2.53
4	企业债券	79,271,400.00	19.01
5	企业短期融资券	100,481,000.00	24.09
6	中期票据	308,462,500.00	73.96
7	可转债（可交换债）	53,505,726.36	12.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	586,943,616.96	140.74

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	101758037	17粤电MTN001	300,000	30,663,000.00	7.35
2	122431	15闽高速	300,000	30,420,000.00	7.29
3	101800823	18广州地铁MTN004	300,000	30,417,000.00	7.29
4	011802052	18鲁西化工SCP006	300,000	30,186,000.00	7.24
5	101900113	19中油股MTN001	300,000	30,021,000.00	7.20

5.6 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

注：本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本报告期末本基金未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现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。

5.10.2

本报告期末本基金未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	12,369.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,365,064.18
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,377,433.37

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132012	17巨化EB	14,880,000.00	3.57
2	132007	16凤凰EB	12,988,537.00	3.11
3	113508	新凤转债	5,033,512.60	1.21
4	132006	16皖新EB	2,093,600.00	0.50
5	128014	永东转债	964,200.00	0.23

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金未持有股票。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	415,663,642.79
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	19,207,645.02
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	396,455,997.77

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情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.52

注：本基金本报告期内基金管理人未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	2.52	10,000,000.00	2.52	自基金合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	-
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	-
合计	10,000,000.00	2.52	10,000,000.00	2.52	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190401-20190630	99,999,000.00	0.00	0.00	99,999,000.00	25.22%
	2	20190401-20190630	219,206,645.02	0.00	0.00	219,206,645.02	55.29%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额和基金认购成立份额。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金募集的文件
2、《华泰保兴尊颐定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
3、《华泰保兴尊颐定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
4、《华泰保兴尊颐定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》
5、基金管理人业务资格批件、营业执照
6、报告期内本基金在指定媒介披露的各项公告
7、中国证监会要求的其他文件

10.2 存放地点

基金管理人办公场所，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

10.3 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查询

华泰保兴基金管理有限公司
2019年7月17日