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年半年度报告摘要

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:二〇一九年八月二十九日

§1 重要提示及目录

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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月27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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

§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
基金简称	华泰保兴尊信定开
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	703,465,458.86份
基金合同存续期	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,确定基金资产在各固定收益类证券之间的配置比例。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。

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
信息披露负责人	姓名	尤小刚	田青
	联系电话	021-80299000	010-67595096
	电子邮箱	fund_xxpl@ehuatai.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-632-9090	95533
传真		021-60963566	010-66275853
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道88号4306室	北京市西城区金融大街25号
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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		杨平	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ehuataifund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	16,878,672.01
本期利润	15,436,098.72
加权平均基金份额本期利润	0.0225
本期加权平均净值利润率	2.10%
本期基金份额净值增长率	2.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	47,527,924.95
期末可供分配基金份额利润	0.0676
期末基金资产净值	759,736,555.77
期末基金份额净值	1.0800
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	8.00%

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、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。

3、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。

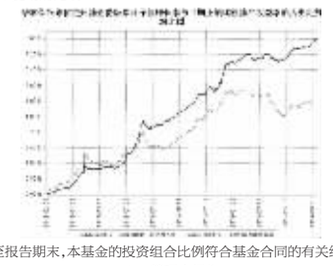
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.42%	0.02%	0.28%	0.03%	0.14%	-0.01%
过去三个月	0.73%	0.03%	-0.24%	0.06%	0.97%	-0.03%
过去六个月	2.16%	0.05%	0.24%	0.06%	1.92%	-0.01%
过去一年	6.32%	0.05%	2.82%	0.06%	3.50%	-0.01%
自基金合同生效起至今	8.00%	0.05%	4.89%	0.07%	3.11%	-0.02%

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份额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: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。

§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

本基金管理人为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,注册资本为人民币1.8亿元。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2019年6月30日,公司公募基金产品资产管理规模为142.20亿元。公司共管理十四只公募基金产品,具体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、华泰保兴尊合债券型证券投资基金、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、华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰保兴健康消费混合型证券投资基金。

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		
周咏栒	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。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 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

2019年上半年GDP同比增长为6.3%,其中一季度GDP为6.4%,生产需求均有所回升,二季度随着国外不确定性再次上升及中美贸易摩擦的升级,PMI也回落至荣枯线下方,二季度GDP为6.2%,名义GDP回升,6月部分经济数据有所回暖。具体来看,上半年制造业投资增速累计同比为3%,周期性制造业仍处于主动去库存阶段;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;基建投资累计增速小幅反弹至4.1%,地方债加速发行等积极财政政策产生了效果。上半年,社会消费品零售总额同比增长8.4%,6月份社会消费品零售总额同比增速明显反弹,汽车消费大幅好转是主要原因。从进出口来看,美国的关税上调对经济的负面影响逐步显现,出口增速延续下行的走势,进口增速下降更快,上半年出口增长6.1%,进口增长1.4%。从物价来看,上半年CPI同比上涨2.2%,涨幅比一季度扩大0.4个百分点,猪肉价格仍处于上行通道,蔬菜涨幅较大,PPI同比上涨0.3%,整体通胀温和可控。

债券市场方面,一季度长端收益率先下后上,短端收益率明显下行,收益率曲线陡峭化。二季度债券收益率先上后下,收益率曲线平坦化。4月初随着货币政策的边际微调,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。总的来看,今年上半年利率债小幅下行,变化不大,信用债短端收益率下行幅度大于长端,信用利差缩小。

基金投资方面,上半年本组合以中短期高等级信用债为主,保持中性久期,运用套息策略增强组合收益。

4.4.2 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2.16%,业绩比较基准收益率为0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,经济下行的压力仍然存在。制造业投资低位企稳,基建小幅反弹,地产销售增速或持续负增长,房地产融资的收紧使得地产投资承压。消费将弱中趋稳。在外需走弱的背景下,出口将继续承压。从货币政策来看,下半年货币政策将保持松紧适度,适时预调微调,保持流动性合理充裕。若经济下行压力加大,定向降准等货币政策仍有操作空间。

总体而言,下半年债券市场仍具有一定的机会。利率债震荡为主,需要把握交易的节奏,中高等级信用债信用利差已较低,考虑绝对收益率情况,可择机优化结构。

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。

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

根据相关法律法规、本基金的基金合同等规定以及基金的实际运作情况,本报告期内本基金未实施利润分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的规定实施利润分配。

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

本基金为发起式基金,截至报告期末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》第四十一条第一款规定。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	1,710,681.49	3,476,139.16
结算备付金		2,175,409.36	2,450,556.05
存出保证金		22,936.16	17,144.26
交易性金融资产	6.4.7.2	1,049,086,061.00	955,965,818.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,049,086,061.00	955,965,818.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	19,800,149.70
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	20,615,443.52	19,921,740.54
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,073,610,531.53	1,001,631,547.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		313,249,176.62	306,599,345.00
应付证券清算款		256.02	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		249,094.31	235,158.48
应付托管费		62,273.59	58,789.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,994.12	18,638.65
应交税费		57,559.00	49,933.87
应付利息		163,238.34	229,225.04
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	83,383.76	139,000.00
负债合计		313,873,975.76	307,330,090.66
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	703,465,458.86	656,706,831.72
未分配利润	6.4.7.10	56,271,096.91	37,594,625.33
所有者权益合计		759,736,555.77	694,301,457.05
负债和所有者权益总计		1,073,610,531.53	1,001,631,547.71

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0800元,基金份额总额703,465,458.86份。

6.2 利润表

会计主体:华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入		19,483,537.68	12,409,230.89
1.利息收入		17,510,693.88	11,770,844.80
其中:存款利息收入	6.4.7.11	49,928.54	172,118.29
债券利息收入		17,269,598.21	9,223,286.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		191,167.13	2,375,439.59
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		3,415,417.09	859,209.73
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,415,417.09	859,209.73
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-1,442,573.29	-220,823.64
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	-	-
减:二、费用		4,047,438.96	3,573,135.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,457,899.94	891,643.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	364,474.99	222,911.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	9,891.38	11,727.47
5. 利息支出		2,072,630.01	2,343,434.91
其中:卖出回购金融资产支出		2,072,630.01	2,343,434.91
6. 税金及附加		40,399.81	28,266.08
7. 其他费用	6.4.7.20	102,142.83	75,152.27
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		15,436,098.72	8,836,095.19
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		15,436,098.72	8,836,095.19

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30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)	656,706,831.72	37,594,625.33	694,301,457.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,436,098.72	15,436,098.72
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)	46,758,627.14	3,240,372.86	49,999,000.00
其中:1.基金申购款	46,758,627.14	3,240,372.86	49,999,000.00
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	703,465,458.86	56,271,096.91	759,736,555.77
项目	上年度可比期间 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30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)	559,996,000.00	-	559,996,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,836,095.19	8,836,095.19
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	559,996,000.00	8,836,095.19	568,832,095.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____王冠龙_____ _____王冠龙_____ ____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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金(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[2018]12号《关于准予华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金注册的批复》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《华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集559,996,000.00元,业经苏亚金诚会计师事务所(特殊普通合伙)苏亚审验[2018]3号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于2018年2月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为559,996,000.00份。本基金的基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金为定期开放式基金。封闭期为自基金合同生效日(含)起或每一开放期结束之日次日(含)起3个月的期间,开放期为自每一封闭期结束之日后第一个工作日(含)起五至二十个工作日,具体时间由基金管理人在上一封闭期结束前公告说明。本基金封闭期内不办理申购、赎回或其他业务,也不上市交易。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,000.00基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、次级债、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具等以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金的业绩比较基准为:中债综合(全价)指数收益率。

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8月28日批准报出。

6.4.2 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》、《华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年上半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2019年6月30日的财务状况以及2019年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本基金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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
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
华泰人寿保险股份有限公司	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 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无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,457,899.94	891,643.96
其中:支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

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0.40%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 × 0.40% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	364,474.99	222,911.01

注:支付基金托管人中国建设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。

6.4.8.2.3 销售服务费

注:本基金不收取销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日
基金合同生效日(2018年2月6日)持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.42%	1.79%

注:1. 期间申购/买入总份额含转换入、红利再投、强制调增份额,期间赎回/卖出总份额含转换出、强制调减份额。

2. 基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰财产保险有限公司	246,709,831.72	35.07%	246,709,831.72	37.57%
华泰人寿保险股份有限公司	399,997,000.00	56.86%	399,997,000.00	60.91%

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	1,710,681.49	26,325.06	49,400,243.12	85,272.24

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.9 利润分配情况

注:本基金本报告期内无利润分配。

6.4.10 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额202,249,176.62元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
091504001	15中国建投债01	2019年7月3日	101.46	50,000	5,073,000.00
091504002	15中国建投债02	2019年7月1日	101.90	200,000	20,380,000.00
111904030	19中国银行CD030	2019年7月4日	97.03	500,000	48,