

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:2017年10月25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2017年10月24日核对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。

本报告附录中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至9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 000449

交易代码 000449

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2017年4月20日

报告期末基金份额总额 3,794,003,306.02份

在严控风险前提下,保持较高流动性的基础上,力争为基金份额持有人创造较高的投资回报。

本基金在投资组合构建的稳定性前提下,在相对封闭的外汇及股票市场、货币市场等投资品种进行分析,合理安排组合期限结构,择机选择投资工具,采取主动的投

资策略,通过资产配置和择时操作,在控制风险的前提下,实现基金的投

资目标。

本基金的业绩比较基准为:货币市场基金指数。

风险收益特征 本基金为货币市场基金,证券投资基金中的低风险品种,本基金的预期风险和预期收益低于股票型基

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 000449 000449

报告期末下属分级基金的份额总额 15,480,889,914份 3,768,522,418份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年7月1日 - 2017年9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 162,163.82 44,473,946.64

2.本期利润 162,163.82 44,473,946.64

3.期末基金资产净值 15,480,889,914份 3,768,522,418份

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本期已实现收益扣除本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本期报告期基金净值增长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) 净值收益率的标准差(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率的标准差(④)

过去三个月 0.9630% 0.0019% 0.3403% 0.0000%

0.6227% 0.0019%

0.0119%

华泰保兴货币B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率的标准差(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率的标准差(④)

过去三个月 1.0244% 0.0019% 0.3403% 0.0000%

0.6864% 0.0019%

0.0119%

注:本基金合同于2017年4月20日生效,截至报告期末基金合同生效不满一年。

2.本基金业绩比较基准为:中国银行公布的7天通知存款利率(税后)。

3.本基金收益分配为按月结转份额。

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

益表现

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年7月1日 - 2017年9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 8,267,616.42 6,602,366.16

2.本期利润 9,007,324.93 7,141,763.97

3.加权平均基金份额本期利润 0.1270 0.1197

4.期末基金资产净值 100,209,433.77 82,946,370.28

5.期末基金份额净值 1.0863 1.0874

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本期已实现收益扣除本期利润的金额相等。

4.3.2.2 异常交易行为的专项说明

为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.3 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.4 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.5 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.6 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.7 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.8 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.9 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.10 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.11 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.12 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.13 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.14 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.15 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.16 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.17 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.18 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.19 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.20 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.21 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.22 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.23 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.24 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.25 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.26 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.27 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.28 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.29 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.30 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.31 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.32 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.33 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.34 为规范运作行为,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》对境内内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等行为进行异常交易价格异常的情形进行了界定,并就其相应的监控、识别、分析与控制措施;公司禁止同一交易日内同一投资组合内买卖,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异常交易行为。

4.3.2.35