

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26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。						
本报告自2017年7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	004493					
交易代码	004493					
基金运作方式	契约开放式					
基金合同生效日	2017年3月24日					
报告期末基金份额总额	2,784,003,382.09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收益。					
投资策略	本基金采取稳健的资产配置策略，在符合投资合同约定的前提下，积极利用国内外宏观经济环境、金融市场价格变动、资金流动趋势、货币市场收益率期限利差等因素进行综合分析，合理配置资产组合，并动态调整资产组合，实现基金资产的增值。					
业绩比较基准	中国人民银行公布的大通知存款利率（税后）					
风险收益特征	本基金为货币型基金，是证券投资基金中的低风险品种，本基金的风险预期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					
下属二级基金的金基金数	华泰保兴货币A 华泰保兴货币B					
下属二级基金的交易代码	004493 004494					
报告期末下属二级基金的分额总额	15,480,889,948 3,768,522,418.34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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)					
1.本期已实现收益	华泰保兴货币B 152,163,622					
2.本期利润	44,473,966.94					
3.期末基金资产净值	3,768,522,418.34					
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，由货币型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	0.9030%	0.0019%	0.0430%	0.0000%	0.6227%	0.0019%
华泰保兴货币B						
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	1.0244%	0.0019%	0.0430%	0.0000%	0.6841%	0.0019%
注：1、本基金基金合同于2017年4月20日生效，截止本报告期末基金合同生效未满半年。						
2、本基金业绩比较基准为：中国人民银行公布的大通知存款利率（税后）。						
3、本基金收益分配为按月结转累计。						
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对比图						

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26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。						
本报告自2017年7月1日起至9月30日止。						
§ 2 基金产品概况						
基金简称	华泰保兴吉丰					
基金主代码	004374					
交易代码	004374					
基金运作方式	契约开放式					
基金合同生效日	2017年3月24日					
报告期末基金份额总额	168,387,080.29份					
投资目标	通过积极主动的分散化投资策略，把握不同时期股票市场上涨带来的投资机会，力争在严格控制风险的前提下满足投资者实现资产增值的投资需求。					
投资策略	本基金根据股票市场和固定收益类资产市场行情进行资产配置，力求在符合投资合同约定的前提下，积极利用国内外宏观经济环境、金融市场价格变动、资金流动趋势、货币市场收益率期限利差等因素进行综合分析，合理配置资产组合，并动态调整资产组合，实现基金资产的增值。					
业绩比较基准	沪深300指数收益率*70%+中债总指数（全价）收益率*30%					
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有中高风险、中高预期收益特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高收益型混合型基金和股票型基金。					
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					
下属二级基金的金基金数	华泰保兴吉丰A 华泰保兴吉丰B					
下属二级基金的交易代码	004374 004375					
报告期末下属二级基金的分额总额	82,079,546.69份 76,278,414.27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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)					
	华泰保兴吉丰A 华泰保兴吉丰B					
1.本期已实现收益	8,287,336.62 5,402,356.16					
2.本期利润	9,307,428.02 7,141,762.97					
3.加权平均基金份额净值	0.1327 0.1197					
4.期末基金资产净值	100,209,433.77 82,046,370.38					
5.期末基金份额净值	1.0883 1.0874					
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，由混合型基金采用公允价值法核算，因此公允价值变动收益不为零，本期已实现收益和本期利润的金额不相等。						
2、本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*70%+中债总指数（全价）收益率*30%。						
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						
华泰保兴吉丰A						
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	13.76%	1.21%	3.11%	0.41%	10.65%	0.80%
华泰保兴吉丰B						
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	13.72%	1.21%	3.11%	0.41%	10.61%	0.80%
注：1、本基金基金合同于2017年3月24日生效，截止本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：沪深300指数收益率*70%+中债总指数（全价）收益率*30%。						
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对比图						

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26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。	
本报告自2017年7月1日起至9月30日止。	
§ 2 基金产品概况	
基金简称	华泰保兴尊诚正开
基金主代码	004024
交易代码	004024
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2017年2月23日
报告期末基金份额总额	236,509,282.02份
投资目标	在谨慎投资的前提下，本基金力争实现长期资本增值，追求基金资产的长期、稳健、持续增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济运行状况、国家财政货币政策、国内宏观经济政策及资本市场走势等因素进行综合分析，合理配置资产组合，并动态调整资产组合，实现基金资产的增值。本基金采取稳健的资产配置策略，在符合投资合同约定的前提下，积极利用国内外宏观经济环境、金融市场价格变动、资金流动趋势、货币市场收益率期限利差等因素进行综合分析，合理配置资产组合，并动态调整资产组合，实现基金资产的增值。
业绩比较基准	中债综合指数（全价）收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，具有中低风险，中低风险收益特征，其风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和股票型基金。
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

§ 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（2017年7月1日 - 2017年9月30日）
1.本期已实现收益	2,478,297.70
2.本期利润	2,477,327.70
3.期末基金份额净值	0.0109
4.期末基金资产净值	241,789,617.19
5.期末基金资产净值	1,007.07
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、本基金业绩指标并不包括持有人认购、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据。	
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	

益率变动的比较

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	0.9030%	0.0019%	0.0430%	0.0000%	0.6227%	0.0019%

注：1、本基金基金合同于2017年4月20日生效，截止本报告期末基金合同生效未满半年。

2、按照本货币基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，截止本报告期末基金尚未完成建仓。

## 4. 基金管理人

### 4.1 基金管理人（华泰保兴）简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业资格	说明
张强	基金经理	2017年4月26日		6年	上海交通大学经济学硕士，2010年进入华泰证券资产管理部从事固定收益组合管理策略研究及投资管理，投资经历丰富。在华泰资产管理部担任公职期间，曾管理过华泰现金增利等基金，基金合同存续期间总计约2000亿元，2016年10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，规范运作本基金和基金基金合同约定，并未发生任何因违反法律法规而受到中国证监会行政处罚，也未发生任何因违反法律法规而受到中国证监会公开谴责。本报告期内，基金运作无违法违规，未发生基金合同或其他相关法律规定的有损于基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况  
报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究投资决策和组合构建机制，实行各投资组合的公平交易；在投资决策环节，保证各投资组合投资决策的公平性；在交易环节，严格执行公平交易制度；在事后监控环节，保证各投资组合投资行为的公平性。报告期内，未发现异常交易行为，未发现异常交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明  
报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究投资决策和组合构建机制，实行各投资组合的公平交易；在投资决策环节，保证各投资组合投资决策的公平性；在交易环节，严格执行公平交易制度；在事后监控环节，保证各投资组合投资行为的公平性。报告期内，未发现异常交易行为，未发现异常交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明  
报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究投资决策和组合构建机制，实行各投资组合的公平交易；在投资决策环节，保证各投资组合投资决策的公平性；在交易环节，严格执行公平交易制度；在事后监控环节，保证各投资组合投资行为的公平性。报告期内，未发现异常交易行为，未发现异常交易行为。

4.3.4 异常交易行为的专项说明  
报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究投资决策和组合构建机制，实行各投资组合的公平交易；在投资决策环节，保证各投资组合投资决策的公平性；在交易环节，严格执行公平交易制度；在事后监控环节，保证各投资组合投资行为的公平性。报告期内，未发现异常交易行为，未发现异常交易行为。

4.3.5 异常交易行为的专项说明  
报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究投资决策和组合构建机制，实行各投资组合的公平交易；在投资决策环节，保证各投资组合投资决策的公平性；在交易环节，严格执行公平交易制度；在事后监控环节，保证各投资组合投资行为的公平性。报告期内，未发现异常交易行为，未发现异常交易行为。

4.3.6 异常交易行为的专项说明  
报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究投资决策和组合构建机制，实行各投资组合的公平交易；在投资决策环节，保证各投资组合投资决策的公平性；在交易环节，严格执行公平交易制度；在事后监控环节，保证各投资组合投资行为的公平性。报告期内，未发现异常交易行为，未发现异常交易行为。

4.3.7 异常交易行为的专项说明  
报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究投资决策和组合构建机制，实行各投资组合的公平交易；在投资决策环节，保证各投资组合投资决策的公平性；在交易环节，严格执行公平交易制度；在事后监控环节，保证各投资组合投资行为的公平性。报告期内，未发现异常交易行为，未发现异常交易行为。

# 华泰保兴吉

“0%”。

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：1、本基金基金合同于2017年3月24日生效，截止本报告期末基金合同生效未满一年。

2、截至报告期末，本基金的投资组合比例符合基金合同的相关规定。

4.1 基金经理（或基金小组）简介

姓名	职务	任本基金基金经理 任职日期	离任日期	证券从业年 限	说明
向晓敏	基金经 理	2017年3 月24日	-	7年	上海交通大学硕士，CFA。历任华泰资产管理有限公司权益部高级研究员、投资经理、高级投资助理。在华泰资产管理有限公司任职期间，曾管理华泰永兴保险股份有限公司权益类资产、保险类有价证券投资组合账户，对权益类资产投资、组合类固定收益资产管理经验和年限总计约7年。2016年8月加入华泰永兴基金管理有限公司。
傅奕奕	基金经 理	2017年3 月24日	-	5年	上海交通大学经济学硕士，历任华泰资产管理有限公司固定收益部基金研究员、投资助理、权益投资助理兼研究员，现任资产管理部二部、计算机部等职务。2016年8月加入华泰永兴基金管理有限公司。

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作合规情况的说明

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《本基金合同》、《华泰永兴投资、勤勉尽责的受托管理》等基金合同、内控管理制度基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，基金运作无法违规，未履行基金合同或其他投资承诺事项持有不利后果。

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：公平对待投资组合、禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的证券交易活动。建立统一的投资管理平台，使各投资组合得到公司的投资研究服务，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执行流程；实行集中交易制度和交易分配制度，以“时间优先、价格优先”为基本原则，实行集中交易系统下的公平交易制度，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基金非公开投资信息的有效隔离；加强对各投资组合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事后评估体系等。

本报告期内，各投资组合不存在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

报告期内，公司对于各投资组合的基金合同、公司制定《异常交易监控与报告制度》对于涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利用不正当交易行为内幕交易和价格操纵情形进行了界定，并拟定相应的监测、识别、分析和报告程序；公司禁止同一交易日内不同一投资组合内部、不同投资组合之间的反向交易以及其他可能损害不公平交易利益的交易行为。

公司对于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、3、5、10日内）的期间交易、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。

# 华泰保兴尊诚

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	1.04%	0.03%	-0.15%	0.03%	1.19%	0.00%

注：1、本基金合同生效日为2017年2月23日，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金业绩比较基准为：中债综合指数（全价）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

华泰保兴尊诚基金净值增长率与业绩比较基准收益率对比图

注：1、本基金基金合同于2017年2月23日生效，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理）简介

姓名	职务	任本基金基金经理期间		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张挺	基金经理	2017年7月23日	-	6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部组合管理助理、研究员、交易助理、投资经理。在华泰资产管理有限公司任职期间，曾管理组合类保本基金资产管理产品，集合型现金类计划等，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，规范运作文件要求和基金基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人追求最大利益。本报告期内，基金运作无违法违规，未发生基金合同或其他损害基金份额持有人利益的行为。

### 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，禁止坐视利益冲突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和信息披露共享平台，使各投资组合得到公平的投研信息服务；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，保证不同投资组合的经理之间重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资组合和交易员行为的监督稽核工作。建立有效的收益交易信息日报及跟踪分析机制。

## 华泰保兴货币市场基金

## 2017年第三季度报告

上行业逐步配置同业存单，并在季末资金利率高企时在货币市场适度融出资金，以增强基金收益。			
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0.90630%，本报告期华泰保兴货币B的基金份额净值收益率为1.0244%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%。			
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基金资产净值低于五千万的情形。			
§ 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	2,136,860,763.30	62.68
	其中：债券	2,136,860,763.30	62.68
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,104,073,464.12	27.18
	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	807,007,633.52	19.87
4	合计	15,402,207.39	0.38
5	其他资产	4,662,334,066.33	100.00
5.2 报告期末按市值占基金资产净值比例的前十名债券投资明细			
序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券投资公允价值	7.54	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
2	报告期内债券投资公允价值	7.28	
	其中：买断式回购融资	-	
注：本基金报告期内债券投资公允价值占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日收盘后公允价值占基金资产净值的比例。			
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	82		
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88		
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	38		
报告期末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	占基金资产净值比例(%)	占基金资产净值比例(%)
1	30天以内	34.65	7.28
	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	-	-
2	30天-60天	-	-
	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	-	-
3	60天-90天	38.04	-
	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	-	-
4	90天-120天	10.50	-
	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	-	-
5	120天-397天(含)	23.78	-
	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	-	-
	合计	106.96	7.28
5.4 报告期末投资组合平均剩余期限超过240天情况说明			

## 华泰保兴吉丰混合型基金发起式证券投资基金

## 2017年第三季度报告

<p>本报告期内，未发现基金资产组合可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。</p> <p>三、中期报告：报告期内，有色金属行业景气度回升，取得了一定的收益。九月上旬公布经济数据超预期，整体经济需求未降温，由于近期现货市场溢价补库存后企稳和贸易库存存库均较松，对现货价格造成一定的影响，期货市场对此反应更为激烈，出现了较大幅度下跌。考虑到相关行业的股票价格已经出现了较大幅度的上涨，我们在三季度末减持了周期行业前期超配的仓位，布局了部分景气度回升好的消费品行业，同时也布局了年初基金未布局好且估值性价比高的消费电子和新能源汽车个股。总体上，我们认为周期行业在二季度超配后企稳，本轮跌价与库存结束相连，明年一季度周期行业有望迎来景气齐升的投资机会，今年年底可能见到行业重新布局周期行业的机会。</p>			
<p>45 报告期末基金的基本面表现</p> <p>截至本报告期末华泰保兴吉丰A基金资产净值规模为1.0883亿，本报告期基金份额净值增长率为1.0874%，相比本报告期末华泰保兴吉丰B基金资产净值规模为1.0874亿，本报告期基金份额净值增长率为1.0872%，同期业绩比较基准收益率为3.11%。</p>			
<p>46 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明</p> <p>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基金资产净值低于五千万元的情形。</p>			
<p>§ 5 投资组合报告</p>			
<p>5.1 报告期末基金资产组合情况</p>			
序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	163,966,842.03	85.76
其中：股票	163,966,842.03	85.76	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
其中：债券	-	-	-
4	资产支持证券	-	-
4.1	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	11,063,110.36	5.78
8	其他资产	16,196,883.62	8.47
9	合计	191,216,836.01	100.00
<p>5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合</p>			
<p>5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合</p>			
代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	制造业	-	-
C	建筑业	143,147,218.56	78.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.46	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息、软件和信息技术服务业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,434,172.03	1.98
J	金融业	17,043,766.00	9.21
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,289.59	0.06
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		163,966,842.03	89.82