

华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金  
2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰保兴基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十九日

## § 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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 25 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 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 7         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 15        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>16</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 16        |
| 6.2 利润表                                 | 17        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 18        |

|                                            |           |
|--------------------------------------------|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 19        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>37</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 37        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 37        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....     | 37        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 37        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 37        |
| 7.6 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.....    | 38        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 38        |
| 7.8 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贵金属投资明细..... | 38        |
| 7.9 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.....    | 38        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 38        |
| 7.11 投资组合报告附注.....                         | 38        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>40</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 40        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 40        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....     | 40        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....                   | 40        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>41</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>42</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 42        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....      | 42        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 42        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 42        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 42        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....         | 42        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 42        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 43        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>46</b> |
| 11.1 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.....    | 46        |

|                           |           |
|---------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... | 46        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>    | <b>47</b> |
| 12.1 备查文件目录.....          | 47        |
| 12.2 存放地点.....            | 47        |
| 12.3 查阅方式.....            | 47        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                           |
|------------|---------------------------|
| 基金名称       | 华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 华泰保兴尊享定开                  |
| 基金主代码      | 007767                    |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                    |
| 基金合同生效日    | 2019 年 9 月 2 日            |
| 基金管理人      | 华泰保兴基金管理有限公司              |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司              |
| 报告期末基金份额总额 | 234,816,120.61 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   | <p>封闭期内，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。</p> <p>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。</p> |
| 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                  | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 尤小刚                           | 郭明                  |
|         | 联系电话 | 021-80299000                  | 010-66105799        |
|         | 电子邮箱 | fund_xxpl@ehuatai.com         | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-632-9090                  | 95588               |
| 传真      |      | 021-60756968                  | 010-66105798        |
| 注册地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号 3810 室 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 办公地址    |      | 上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层   | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 邮政编码    |      | 200126                        | 100140              |
| 法定代表人   |      | 杨平                            | 陈四清                 |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                       |
|---------------------|---------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》                               |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.ehuataifund.com                   |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人办公地址：上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                        |
|--------|--------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 华泰保兴基金管理有限公司 | 上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层 |

## § 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(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日 ) |
|---------------|----------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 5,187,533.33                           |
| 本期利润          | 4,917,955.37                           |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0246                                 |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.38%                                  |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.43%                                  |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2020 年 6 月 30 日 )                |
| 期末可供分配利润      | 8,016,220.47                           |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0341                                 |
| 期末基金资产净值      | 243,540,048.69                         |
| 期末基金份额净值      | 1.0372                                 |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末( 2020 年 6 月 30 日 )                |
| 基金份额累计净值增长率   | 3.72%                                  |

注：1、本基金合同生效日为 2019 年 9 月 2 日，截止报告期末基金合同生效未满一年。

2、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。

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

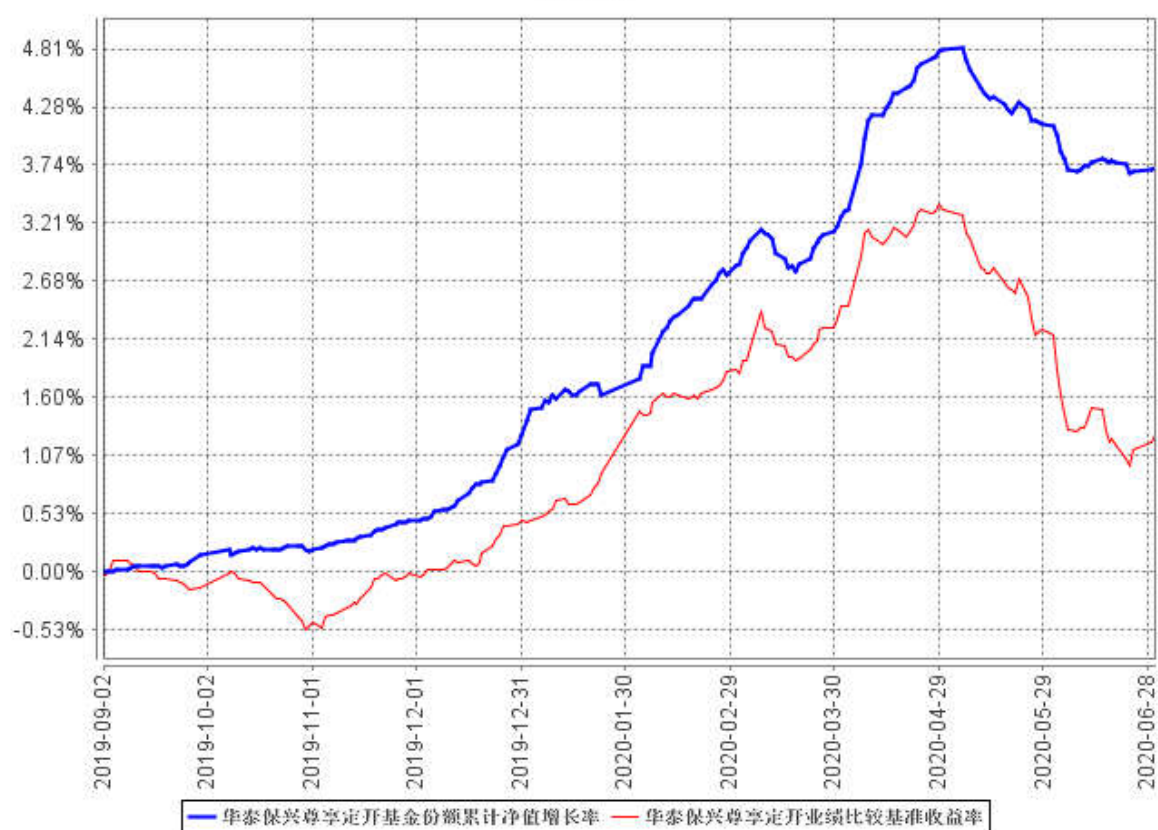
| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去一个月          | -0.38%       | 0.05%               | -0.94%             | 0.12%                 | 0.56% | -0.07% |
| 过去三个月          | 0.52%        | 0.08%               | -1.04%             | 0.12%                 | 1.56% | -0.04% |
| 过去六个月          | 2.43%        | 0.07%               | 0.79%              | 0.11%                 | 1.64% | -0.04% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 3.72%        | 0.06%               | 1.27%              | 0.09%                 | 2.45% | -0.03% |

注：1、本基金合同生效日为 2019 年 9 月 2 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份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

华泰保兴尊享定开基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2019 年 9 月 2 日生效，截止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

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，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”）。根据公司股东会决议并经中国证监会证监许可[2019]3003 号文核准，公司进行增资扩股。公司新增注册资本人民币 6,000 万元由华泰保险集团认购并已完成实缴。本次增资完成后，公司注册资本由人民币 18,000 万元增加至人民币 24,000 万元。其中，华泰保险集团持股比例为 85%，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 15%。公司根据相关法律法规及规范性文件的规定，就本次增加注册资本及股权变更事宜修改了公司章程相应条款。公司本次增加注册资本及股权变更、章程修改涉及的工商变更登记手续已于 2020 年 6 月 2 日在上海市市场监督管理局办理完毕，并已按有关规定向中国证监会及其上海监管局进行了备案。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司公募证券投资基金管理规模为人民币 185.45 亿元，包括华泰保兴尊享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、华泰保兴多策略三个月定期开放股票型发起式证券投资基金、华泰保兴安悦债券型证券投资基金、华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰保兴科荣混合型证券投资基金等 18 只产品。

#### 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 |        |                                                                                                                     |
| 周咏梅 | 基金经理 | 2019 年 9 月 2 日  | -    | 13 年   | 上海财经大学国际金融学硕士。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合规守信情况的说明

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，结合投资交易系统内的公平交易模块，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《华泰保兴基金管理有限公司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

2020 年上半年 GDP 同比下降 1.6%，一季度同比下降 6.8%，在新冠肺炎疫情得到有效控制下，二季度 GDP 同比增长 3.2%，略超市场预期，经济复苏继续呈现出工业生产好、投资回升快及消费复苏慢的总体格局。从生产端来看，6 月工业增加值同比增速为 4.8%，较 5 月加快 0.4 个百分点，其中电力、热力和水供应业生产较快。从需求端来看，随着 3 月复工复产的稳步推进，固定资产回升幅度符合预期，基础建设和房地产保持了较高增速，其中房地产投资较为突出，6 月单月同比为 2.1%，新开工和施工也开始提速，基建单月增速小幅放缓。进出口数据依然较好，可持续性仍有待观察。消费增速较为乏力，受到收入下降、支出意愿下降等制约，可选消费品消费需求依然较弱。从海外市场来看，6 月底以来，新兴国家疫情严重化，美国疫情大幅反弹，经济重启受限，海外继续实行宽松政策。

债券市场方面，一季度债券收益率随着疫情的发展而变化，国内外的两轮疫情冲击带动债券收益率的两次大幅下行，收益率曲线陡峭化。二季度债券收益率先下行，进入历史低位区间，后大幅上行，波动剧烈。4 月份央行调低了超额存款准备金率，0.35% 的超储利率打开了银行间回购利率的下限，收益率曲线陡峭化下行，但是 30 年国债上行约 3bp。5 月，央行重启了公开市场操作，但是价格保持不变，超出了市场的预期，收益率大幅上行。6 月，财政部公布发行特别国债，央行也多次表示货币政策将回归常态，收益率曲线平坦化上行，基本回到疫情开始的水平。

基金投资方面，上半年本组合以高等级信用债为主，一季度增加了久期和杠杆比例，5 月份大幅减持了利率债和 1-5 年信用债，适当兑现了收益。可转债方面，减持了部分偏债性可转债，

降低了转债仓位。

#### 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 1.0372 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.43%，业绩比较基准收益率为 0.79%。

#### 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，全球新冠肺炎疫情可能反复，但不改经济复苏趋势，经济将延续工业生产好、投资回升快及消费复苏慢的格局。随着发达国家经济逐步修复，我国下半年出口或趋于平稳。货币政策方面，货币政策回归正常化，央行将继续引导资金流入制造业及中小微企业，推动综合融资成本明显下降，政策将更加灵活适度、精准导向。财政政策方面，下半年财政支出加快，基建投资有望提高增速。

综上，我们认为经济基本面和货币政策并不支持债券收益率的大幅下行，由于二季度债券收益率上行较多，目前的收益率水平对配置户具有一定的价值，且经济增速放缓可能带来一定的预期差，也存在交易空间。可转债方面，如果权益市场情绪较好，可转债仍有一定的机会。

基金操作方面，下半年基金投资将在严控信用风险的前提下，提高信用债投资比例，获得稳定的提息收益。利率债方面，紧密跟踪基本面和政策面的变化，及时发现预期差，把握好交易机会。可转债方面，根据股票行业轮动，参与部分价格不高的个券，继续关注新转债，一级申购或者开盘逢低买入，增加转债仓位。

#### 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。

截止报告期末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，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 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

本报告期内，本基金托管人在对华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的管理人——华泰保兴基金管理有限公司在华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华泰保兴基金管理有限公司编制和披露的华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 30,470,253.60                  | 13,931,468.00                    |
| 结算备付金           |            | 1,439,998.99                   | 1,273,532.73                     |
| 存出保证金           |            | 6,611.92                       | 12,891.20                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 194,986,432.80                 | 239,320,709.90                   |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 194,986,432.80                 | 239,320,709.90                   |
| 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    | 65,000,180.00                  | 14,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 2,344,206.29                   | 2,326,566.96                     |
| 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            |            | 294,247,683.60                 | 270,865,168.79                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 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       |            | -                              | 55,999,851.50                    |
| 应付证券清算款         |            | 24,593,868.98                  | 12,120,215.99                    |
| 应付赎回款           |            | 25,926,462.90                  | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 68,062.79                      | 68,459.60                        |
| 应付托管费           |            | 8,507.82                       | 8,557.47                         |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 6,434.02                       | 8,642.94                         |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应交税费          |          | 8,773.78       | 17,457.39      |
| 应付利息          |          | -              | 227.68         |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 95,524.62      | 92,200.00      |
| 负债合计          |          | 50,707,634.91  | 68,315,612.57  |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 234,816,120.61 | 200,034,000.18 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 8,723,928.08   | 2,515,556.04   |
| 所有者权益合计       |          | 243,540,048.69 | 202,549,556.22 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 294,247,683.60 | 270,865,168.79 |

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0372 元，基金份额总额 234,816,120.61 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6<br>月 30 日 |
|-----------------------|------------|------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 6,130,855.76                             |
| 1.利息收入                |            | 3,562,130.17                             |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 28,388.12                                |
| 债券利息收入                |            | 3,485,436.44                             |
| 资产支持证券利息收入            |            | -                                        |
| 买入返售金融资产收入            |            | 48,305.61                                |
| 证券出借利息收入              |            | -                                        |
| 其他利息收入                |            | -                                        |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 2,838,303.55                             |
| 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   | 2,838,303.55                             |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.3 | -                                        |
| 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   | -269,577.96                              |
| 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   | -                                        |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 1,212,900.39                             |

|                     |            |              |
|---------------------|------------|--------------|
| 1. 管理人报酬            | 6.4.10.2.1 | 410,619.85   |
| 2. 托管费              | 6.4.10.2.2 | 51,327.40    |
| 3. 销售服务费            | 6.4.10.2.3 | -            |
| 4. 交易费用             | 6.4.7.19   | 4,258.56     |
| 5. 利息支出             |            | 628,574.79   |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | 628,574.79   |
| 6. 税金及附加            |            | 8,097.74     |
| 7. 其他费用             | 6.4.7.20   | 110,022.05   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 4,917,955.37 |
| 减：所得税费用             |            | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 4,917,955.37 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 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）                        | 200,034,000.18                        | 2,515,556.04 | 202,549,556.22 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 4,917,955.37 | 4,917,955.37   |
| 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）      | 34,782,120.43                         | 1,290,416.67 | 36,072,537.10  |
| 其中：1.基金申购款                             | 59,781,120.43                         | 2,217,879.57 | 61,999,000.00  |
| 2.基金赎回款                                | -24,999,000.00                        | -927,462.90  | -25,926,462.90 |
| 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）                        | 234,816,120.61                        | 8,723,928.08 | 243,540,048.69 |

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：

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| <u>王冠龙</u> | <u>王冠龙</u> | <u>王云凌</u> |
| 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

华泰保兴尊享三个月定期开放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[2019]183 号《关于准予华泰保兴尊享三个月定期开放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《华泰保兴尊享三个月定期开放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 199,998,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0490 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 9 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,034,000.18 份基金份额,其中认购资金利息折合 36,000.18 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,001,800.18 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《华泰保兴尊享三个月定期开放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、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、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)。本基金不投资股票、权证等权益类资产,但可持有因可转换债券转股或可交换债券换股所形成的股票(包括因持有该股票所派发的权证)以及投资分离交易可转债而产生的权证。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 2020 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<年度报告和中期报告>》、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》、《华泰保兴尊享三个月定期开放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 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 30,470,253.60          |
| 定期存款           | —                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | —                      |
| 存款期限 1-3 个月    | —                      |
| 存款期限 3 个月以上    | —                      |
| 其他存款           | —                      |
| 合计             | 30,470,253.60          |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

|               |       | 成本             | 公允价值           | 公允价值变动     |
|---------------|-------|----------------|----------------|------------|
| 股票            |       | -              | -              | -          |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -              | -              | -          |
| 债券            | 交易所市场 | 60,884,413.01  | 60,865,032.80  | -19,380.21 |
|               | 银行间市场 | 133,497,860.30 | 134,121,400.00 | 623,539.70 |
|               | 合计    | 194,382,273.31 | 194,986,432.80 | 604,159.49 |
| 资产支持证券        |       | -              | -              | -          |
| 基金            |       | -              | -              | -          |
| 其他            |       | -              | -              | -          |
| 合计            |       | 194,382,273.31 | 194,986,432.80 | 604,159.49 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 25,000,000.00          | -         |
| 银行间市场 | 40,000,180.00          | -         |
| 合计    | 65,000,180.00          | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,063.92               |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 648.00                 |
| 应收债券利息     | 2,334,180.09           |
| 应收资产支持证券利息 | -                      |

|            |              |
|------------|--------------|
| 应收买入返售证券利息 | 8,311.28     |
| 应收申购款利息    | -            |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -            |
| 应收出借证券利息   | -            |
| 其他         | 3.00         |
| 合计         | 2,344,206.29 |

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                      |
| 银行间市场应付交易费用 | 6,434.02               |
| 合计          | 6,434.02               |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|--------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金  | -                      |
| 应付赎回费        | -                      |
| 应付证券出借违约金    | -                      |
| 应付审计费        | 26,852.28              |
| 应付信息披露费      | 59,672.34              |
| 应付银行间债券账户维护费 | 9,000.00               |
| 合计           | 95,524.62              |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |
|------|---------------------------------------|----------------|
|      | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末 | 200,034,000.18                        | 200,034,000.18 |
| 本期申购 | 59,781,120.43                         | 59,781,120.43  |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期赎回(以“-”号填列) | -24,999,000.00 | -24,999,000.00 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -              | -              |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -              | -              |
| 本期申购          | -              | -              |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -              | -              |
| 本期末           | 234,816,120.61 | 234,816,120.61 |

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金每个封闭期为上一个开放期结束之日次日(含该日)起至 3 个月后对应日的前一日(含该日)，如该对应日不存在对应日期或为非工作日，则顺延至下一个工作日。本基金每个封闭期结束之日后第一个工作日(含该日)起进入下一个开放期。本基金每个开放期的期限原则上为一至二十个工作日。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分       | 未分配利润合计      |
|----------------|--------------|-------------|--------------|
| 上年度末           | 1,641,818.59 | 873,737.45  | 2,515,556.04 |
| 本期利润           | 5,187,533.33 | -269,577.96 | 4,917,955.37 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,186,868.55 | 103,548.12  | 1,290,416.67 |
| 其中：基金申购款       | 2,039,908.17 | 177,971.40  | 2,217,879.57 |
| 基金赎回款          | -853,039.62  | -74,423.28  | -927,462.90  |
| 本期已分配利润        | -            | -           | -            |
| 本期末            | 8,016,220.47 | 707,707.61  | 8,723,928.08 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 19,546.31                             |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 8,760.64                              |
| 其他        | 81.17                                 |
| 合计        | 28,388.12                             |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 2,838,303.55               |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                          |
| 合计                            | 2,838,303.55               |

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 311,720,056.95             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 303,512,261.33             |
| 减：应收利息总额                | 5,369,492.07               |
| 买卖债券差价收入                | 2,838,303.55               |

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------|----|
|------|----|

|                            | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | -269,577.96                     |
| ——股票投资                     | -                               |
| ——债券投资                     | -269,577.96                     |
| ——资产支持证券投资                 | -                               |
| ——贵金属投资                    | -                               |
| ——其他                       | -                               |
| 2. 衍生工具                    | -                               |
| ——权证投资                     | -                               |
| 3. 其他                      | -                               |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估<br>增值税 | -                               |
| 合计                         | -269,577.96                     |

#### 6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 286.06                                |
| 银行间市场交易费用 | 3,972.50                              |
| 交易基金产生的费用 | -                                     |
| 其中：申购费    | -                                     |
| 赎回费       | -                                     |
| 合计        | 4,258.56                              |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 审计费用       | 26,852.28                             |
| 信息披露费      | 59,672.34                             |
| 证券出借违约金    | -                                     |
| 银行间债券账户维护费 | 18,600.00                             |
| 银行汇划费用     | 4,897.43                              |
| 合计         | 110,022.05                            |

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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 |
| 中国工商银行股份有限公司     | 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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|                 |            |
|-----------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 410,619.85 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 51,327.40                  |

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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 × 0.05% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金不收取销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 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<br>2020 年 6 月 30 日 |                              | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |                              |
|------------------|------------------------|------------------------------|--------------------------|------------------------------|
|                  | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金<br>份额<br>占基金总份<br>额的比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金<br>份额<br>占基金总份<br>额的比例 |
| 华泰保险集团股份有限<br>公司 | 10,001,800.18          | 4.2594%                      | 10,001,800.18            | 5.0001%                      |

|              |                |          |                |          |
|--------------|----------------|----------|----------------|----------|
| 华泰财产保险有限公司   | 94,791,920.43  | 40.3686% | 60,009,800.00  | 29.9998% |
| 华泰人寿保险股份有限公司 | 130,022,400.00 | 55.372%  | 130,022,400.00 | 65.0001% |

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。

#### 6.4.10.6 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<br>名称    | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |           |
|--------------|---------------------------------------|-----------|
|              | 期末余额                                  | 当期利息收入    |
| 中国工商银行股份有限公司 | 30,470,253.60                         | 19,546.31 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了分工明确、相互制约的风险管理组织架构体系。公司的风险管理组织架构体系由公司董事会、董事会风险控制委员会、经理层及其合规和风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部、各业务部门及全体员工共同组成。

董事会负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，对公司的风险控制承担最终责任；董事会下设风险控制委员会，负责对公司经营管理和投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督。公司经理层负责根据董事会批准的风险控制制度和战略具体组织实施公司风险控制工作并对风险控制的有效性及其执行效果承担直接责任；总经理负责公司全面的风险控制工作，副总经理负责其分管业务范围的风险控制工作；公司经理层下设合规和风险管理委员会，负责协助经理层进行风险管理的咨询和议事，指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。在业务操作层面，督察长按照中国证监会有关监管规定开展风险管理工作，负责分管并领导监察稽核部、风险管理部独立履行监察稽核及风险管理职责；监察稽核部对公司的风险控制承担独立评估、检查和报告职责；风险管理部对公司的风险控制承担评估、分析、评价职责，具体而言，风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，使得各投资组合的投资范围及投资比例限制合规；参与各投资组合新股申购、债券申购以及银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证场外交易的事中合规控制，并完成各投资组合的投资风险及绩效分析。公司各业务部门负责执行公司的风险控制政策及决策，定期对本部门的风险进行全面评估，并对本部门风险控制的有效性负责；公司所有员工是本岗位风险控制的直接责任人，负责具体风险管理职责的实施。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险可能产生的损失。从定性的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的额度；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征通过特定的风险量化指标、模型、日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，以及可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 0.00                   | 0.00                     |
| A-1 以下 | 0.00                   | 0.00                     |
| 未评级    | 57,120,400.00          | 20,022,000.00            |
| 合计     | 57,120,400.00          | 20,022,000.00            |

注：未评级债券为国债、政策性金融债和短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 126,196,732.80         | 162,612,994.10           |
| AAA 以下 | 11,669,300.00          | 6,655,715.80             |
| 未评级    | 0.00                   | 30,618,000.00            |
| 合计     | 137,866,032.80         | 199,886,709.90           |

注：未评级债券为短期融资券。

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
|--------|------------------------|--------------------------|

|        |      |               |
|--------|------|---------------|
| AAA    | 0.00 | 19,412,000.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00          |
| 未评级    | 0.00 | 0.00          |
| 合计     | 0.00 | 19,412,000.00 |

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。本基金所持有的证券在证券交易所上市或在银行间市场进行交易，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过本基金资产净值的 10%，本基金与本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不超过该证券的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的 15%。本报告期末，除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受到限制不能自由转让的情况外，本基金持有的其他证券均能以合理价格适时变现。

此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过本基金持有的债券投资的公允价值。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年<br>以<br>上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|--------|----------|-------|---------------|-----|----|
|                        |        |          |       |               |     |    |

|                          |                |               |                | 上     |                |                |
|--------------------------|----------------|---------------|----------------|-------|----------------|----------------|
| 资产                       |                |               |                |       |                |                |
| 银行存款                     | 30,470,253.60  | -             | -              | -     | -              | 30,470,253.60  |
| 结算备付金                    | 1,439,998.99   | -             | -              | -     | -              | 1,439,998.99   |
| 存出保证金                    | 6,611.92       | -             | -              | -     | -              | 6,611.92       |
| 交易性金融资产                  | 88,657,668.00  | 8,648,000.00  | 97,680,764.80  | -     | -              | 194,986,432.80 |
| 买入返售金融资产                 | 65,000,180.00  | -             | -              | -     | -              | 65,000,180.00  |
| 应收利息                     | -              | -             | -              | -     | 2,344,206.29   | 2,344,206.29   |
| 资产总计                     | 185,574,712.51 | 8,648,000.00  | 97,680,764.80  | -     | 2,344,206.29   | 294,247,683.60 |
| 负债                       |                |               |                |       |                |                |
| 应付证券清算款                  | -              | -             | -              | -     | 24,593,868.98  | 24,593,868.98  |
| 应付赎回款                    | -              | -             | -              | -     | 25,926,462.90  | 25,926,462.90  |
| 应付管理人报酬                  | -              | -             | -              | -     | 68,062.79      | 68,062.79      |
| 应付托管费                    | -              | -             | -              | -     | 8,507.82       | 8,507.82       |
| 应付交易费用                   | -              | -             | -              | -     | 6,434.02       | 6,434.02       |
| 应交税费                     | -              | -             | -              | -     | 8,773.78       | 8,773.78       |
| 其他负债                     | -              | -             | -              | -     | 95,524.62      | 95,524.62      |
| 负债总计                     | -              | -             | -              | -     | 50,707,634.91  | 50,707,634.91  |
| 利率敏感度缺口                  | 185,574,712.51 | 8,648,000.00  | 97,680,764.80  | -     | -48,363,428.62 | 243,540,048.69 |
| 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 | 6 个月以内         | 6 个月-1 年      | 1-5 年          | 5 年以上 | 不计息            | 合计             |
| 资产                       |                |               |                |       |                |                |
| 银行存款                     | 13,931,468.00  | -             | -              | -     | -              | 13,931,468.00  |
| 结算备付金                    | 1,273,532.73   | -             | -              | -     | -              | 1,273,532.73   |
| 存出保证金                    | 12,891.20      | -             | -              | -     | -              | 12,891.20      |
| 交易性金融资产                  | 23,468,250.00  | 73,181,056.50 | 142,671,403.40 | -     | -              | 239,320,709.90 |
| 买入返售金融资产                 | 14,000,000.00  | -             | -              | -     | -              | 14,000,000.00  |
| 应收利息                     | -              | -             | -              | -     | 2,326,566.96   | 2,326,566.96   |
| 资产总计                     | 52,686,141.93  | 73,181,056.50 | 142,671,403.40 | -     | 2,326,566.96   | 270,865,168.79 |
| 负债                       |                |               |                |       |                |                |
| 卖出回购金融资产款                | 55,999,851.50  | -             | -              | -     | -              | 55,999,851.50  |
| 应付证券清算款                  | -              | -             | -              | -     | 12,120,215.99  | 12,120,215.99  |
| 应付管理人报酬                  | -              | -             | -              | -     | 68,459.60      | 68,459.60      |
| 应付托管费                    | -              | -             | -              | -     | 8,557.47       | 8,557.47       |
| 应付交易费用                   | -              | -             | -              | -     | 8,642.94       | 8,642.94       |
| 应付利息                     | -              | -             | -              | -     | 227.68         | 227.68         |
| 应交税费                     | -              | -             | -              | -     | 17,457.39      | 17,457.39      |

|         |               |               |                |   |               |                |
|---------|---------------|---------------|----------------|---|---------------|----------------|
| 其他负债    | -             | -             | -              | - | 92,200.00     | 92,200.00      |
| 负债总计    | 55,999,851.50 | -             | -              | - | 12,315,761.07 | 68,315,612.57  |
| 利率敏感度缺口 | -3,313,709.57 | 73,181,056.50 | 142,671,403.40 | - | -9,989,194.11 | 202,549,556.22 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                        |
|----|--------------------|---------------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                    | 本期末（2020 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 593,256.89                      | 1,130,282.32           |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -589,238.34                     | -1,122,682.84          |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 991,300.00 元，属于第二层次的余额为 193,995,132.80 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 14,654,706.50 元，第二层次 224,666,003.40 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 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            | 194,986,432.80 | 66.27         |
|    | 其中：债券             | 194,986,432.80 | 66.27         |
|    | 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          | 65,000,180.00  | 22.09         |
|    | 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      | 31,910,252.59  | 10.84         |
| 8  | 其他各项资产            | 2,350,818.21   | 0.80          |
| 9  | 合计                | 294,247,683.60 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | 4,984,500.00  | 2.05          |
| 2  | 央行票据      | —             | —             |
| 3  | 金融债券      | 19,142,500.00 | 7.86          |
|    | 其中：政策性金融债 | 9,013,500.00  | 3.70          |
| 4  | 企业债券      | —             | —             |
| 5  | 企业短期融资券   | 43,122,400.00 | 17.71         |
| 6  | 中期票据      | 75,885,500.00 | 31.16         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 51,851,532.80 | 21.29         |

|    |      |                |       |
|----|------|----------------|-------|
| 8  | 同业存单 | -              | -     |
| 9  | 其他   | -              | -     |
| 10 | 合计   | 194,986,432.80 | 80.06 |

## 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 012000263 | 20 厦国贸 SCP003 | 180,000 | 18,032,400.00 | 7.40         |
| 2  | 132008    | 17 山高 EB      | 169,970 | 17,479,714.80 | 7.18         |
| 3  | 102000043 | 20 申迪 MTN001  | 150,000 | 15,105,000.00 | 6.20         |
| 4  | 132007    | 16 凤凰 EB      | 140,100 | 14,290,200.00 | 5.87         |
| 5  | 101801455 | 18 中铝集 MTN005 | 100,000 | 10,197,000.00 | 4.19         |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期本基金未持有股票。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|----|----|
|----|----|----|

|   |         |              |
|---|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金   | 6,611.92     |
| 2 | 应收证券清算款 | —            |
| 3 | 应收股利    | —            |
| 4 | 应收利息    | 2,344,206.29 |
| 5 | 应收申购款   | —            |
| 6 | 其他应收款   | —            |
| 7 | 待摊费用    | —            |
| 8 | 其他      | —            |
| 9 | 合计      | 2,350,818.21 |

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|---------------|---------------|
| 1  | 132008 | 17 山高 EB | 17,479,714.80 | 7.18          |
| 2  | 132007 | 16 凤凰 EB | 14,290,200.00 | 5.87          |
| 3  | 132006 | 16 皖新 EB | 8,648,000.00  | 3.55          |
| 4  | 132013 | 17 宝武 EB | 8,341,968.00  | 3.43          |
| 5  | 132012 | 17 巨化 EB | 2,030,000.00  | 0.83          |
| 6  | 113017 | 吉视转债     | 991,300.00    | 0.41          |

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.11.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构          |            |       |            |
|--------------|---------------|----------------|------------|-------|------------|
|              |               | 机构投资者          |            | 个人投资者 |            |
|              |               | 持有份额           | 占总份<br>额比例 | 持有份额  | 占总份<br>额比例 |
| 3            | 78,272,040.20 | 234,816,120.61 | 100.00%    | 0.00  | 0.00%      |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末本公司的从业人员未持有本基金份额。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：期末本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目                  | 持有份额总<br>数        | 持有份<br>额占基<br>金总份<br>额比例<br>(%) | 发起份额总数        | 发起份额占<br>基金总份额<br>比例 (%) | 发起份额承诺持有期限            |
|---------------------|-------------------|---------------------------------|---------------|--------------------------|-----------------------|
| 基金管理<br>人固有资<br>金   | -                 | -                               | -             | -                        | -                     |
| 基金管理<br>人高级管<br>理人员 | -                 | -                               | -             | -                        | -                     |
| 基金经理<br>等人员         | -                 | -                               | -             | -                        | -                     |
| 基金管理<br>人股东         | 10,001,800<br>.18 | 4.26                            | 10,001,800.18 | 4.26                     | 自基金合同生效之日起<br>不少于 3 年 |
| 其他                  | -                 | -                               | -             | -                        | -                     |
| 合计                  | 10,001,800<br>.18 | 4.26                            | 10,001,800.18 | 4.26                     | -                     |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                               |                |
|-------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2019 年 9 月 2 日）基金份额总额 | 200,034,000.18 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 200,034,000.18 |
| 本报告期基金总申购份额                   | 59,781,120.43  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 24,999,000.00  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）      | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 234,816,120.61 |

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期基金管理人无重大人事变动。
- 2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。  
本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。  
本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 长江证券 | 2      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 国金证券 | 2      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 天风证券 | 2      | —    | —            | —         | —          | —  |

|      |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - |
| 平安证券 | 2 | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - |

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）有关规定，基金管理人多家证券经营机构进行了综合评估。

#### 1、专用交易单元的选择标准：

- （1）财务状况良好，经营行为规范；
- （2）研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向和个股分析的研究报告等信息服务；
- （3）内部管理规范、严谨，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

#### 2、专用交易单元的选择程序：

- （1）公司对交易单元所属券商进行综合评价，投资决策委员会根据综合评价的结果作出租用与否的决策；
- （2）公司研究部定期组织对交易单元所属券商的综合服务进行评价，由投资决策委员会对交易单元的交易量进行分配和调整。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 债券回购交易         |                | 权证交易 |              |
|------|----------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 长江证券 | 14,947,196.43  | 6.69%        | 231,200,000.00 | 24.74%         | -    | -            |
| 国金证券 | 9,739,765.18   | 4.36%        | 94,000,000.00  | 10.06%         | -    | -            |
| 天风证券 | 148,496,431.17 | 66.49%       | 487,500,000.00 | 52.16%         | -    | -            |
| 华泰证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 平安证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 国泰君安 | 50,166,828.99  | 22.46%       | 122,000,000.00 | 13.05%         | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|------|--------|--------|
|----|------|--------|--------|

|    |                                               |                                  |                 |
|----|-----------------------------------------------|----------------------------------|-----------------|
| 1  | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 4 季度报告的提示性公告       | 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》       | 2020 年 1 月 21 日 |
| 2  | 华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年第 4 季度报告      | 管理人网站                            | 2020 年 1 月 21 日 |
| 3  | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金春节假期延长期间交易规则调整的提示性公告        | 管理人网站                            | 2020 年 1 月 31 日 |
| 4  | 华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告        | 《上海证券报》及管理人网站                    | 2020 年 3 月 7 日  |
| 5  | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告                 | 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站 | 2020 年 3 月 19 日 |
| 6  | 华泰保兴基金管理有限公司关于延迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告          | 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站 | 2020 年 3 月 28 日 |
| 7  | 华泰保兴基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告        | 管理人网站                            | 2020 年 3 月 30 日 |
| 8  | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告的提示性公告       | 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》       | 2020 年 4 月 22 日 |
| 9  | 华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年第 1 季度报告      | 管理人网站                            | 2020 年 4 月 22 日 |
| 10 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告           | 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》       | 2020 年 4 月 24 日 |
| 11 | 华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年年度报告          | 管理人网站                            | 2020 年 4 月 24 日 |
| 12 | 华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金定期更新招募说明书及摘要（2020 年） | 管理人网站                            | 2020 年 5 月 30 日 |
| 13 | 华泰保兴基金管理有限公司关于公司住所变更的公告                       | 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站 | 2020 年 6 月 4 日  |
| 14 | 华泰保兴基金管理有限公司关于增加注册资本及股权变更的公告                  | 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站 | 2020 年 6 月 4 日  |
| 15 | 华泰保兴基金管理有限公司关于直销柜台及公司办公地址变更的                  | 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》       | 2020 年 6 月 8 日  |

|    |                                           |               |                 |
|----|-------------------------------------------|---------------|-----------------|
|    | 公告                                        | 日报》及管理人网站     |                 |
| 16 | 华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回和转换业务公告 | 《上海证券报》及管理人网站 | 2020 年 6 月 13 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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              | 20200101-20200630       | 60,009,800.00  | 59,781,120.43 | 24,999,000.00 | 94,791,920.43  | 40.37% |
|                                                                                                                       | 2              | 20200101-20200630       | 130,022,400.00 | 0.00          | 0.00          | 130,022,400.00 | 55.37% |
| 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：申购份额含红利再投、转换入份额。赎回份额含转换出份额。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金募集的文件
- 2、《华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《华泰保兴尊享三个月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、报告期内本基金在规定媒介披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人办公地址：上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层

### 12.3 查阅方式

- 1、营业时间内至基金管理人办公地址及基金托管人住所免费查阅
- 2、登录基金管理人网站 [www.ehuataifund.com](http://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

2020 年 8 月 29 日