

华泰保兴货币市场基金 2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

§ 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 2020 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 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	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 4 月 20 日	
报告期末基金份额总额	6,946,637,422.81 份	
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上，力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下，结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，采取主动性的投资策略和精细化的操作手法，在控制的前提下，实现基金的投资目标。	
业绩比较基准	中国人民银行公布的 7 天通知存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为货币市场基金。本基金的预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰保兴货币 A	华泰保兴货币 B
下属分级基金的交易代码	004493	004494

报告期末下属分级基金的份额总额	27,704,024.14 份	6,918,933,398.67 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（2020年7月1日－2020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	99,336.82	34,115,080.36
2. 本期利润	99,336.82	34,115,080.36
3. 期末基金资产净值	27,704,024.14	6,918,933,398.67

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰保兴货币 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.4550%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.1147%	0.0010%
过去六个月	0.7948%	0.0012%	0.6768%	0.0000%	0.1180%	0.0012%
过去一年	1.9302%	0.0013%	1.3537%	0.0000%	0.5765%	0.0013%
过去三年	8.1044%	0.0024%	4.0537%	0.0000%	4.0507%	0.0024%
自基金合同生效起至今	9.9474%	0.0026%	4.6603%	0.0000%	5.2871%	0.0026%

华泰保兴货币 B

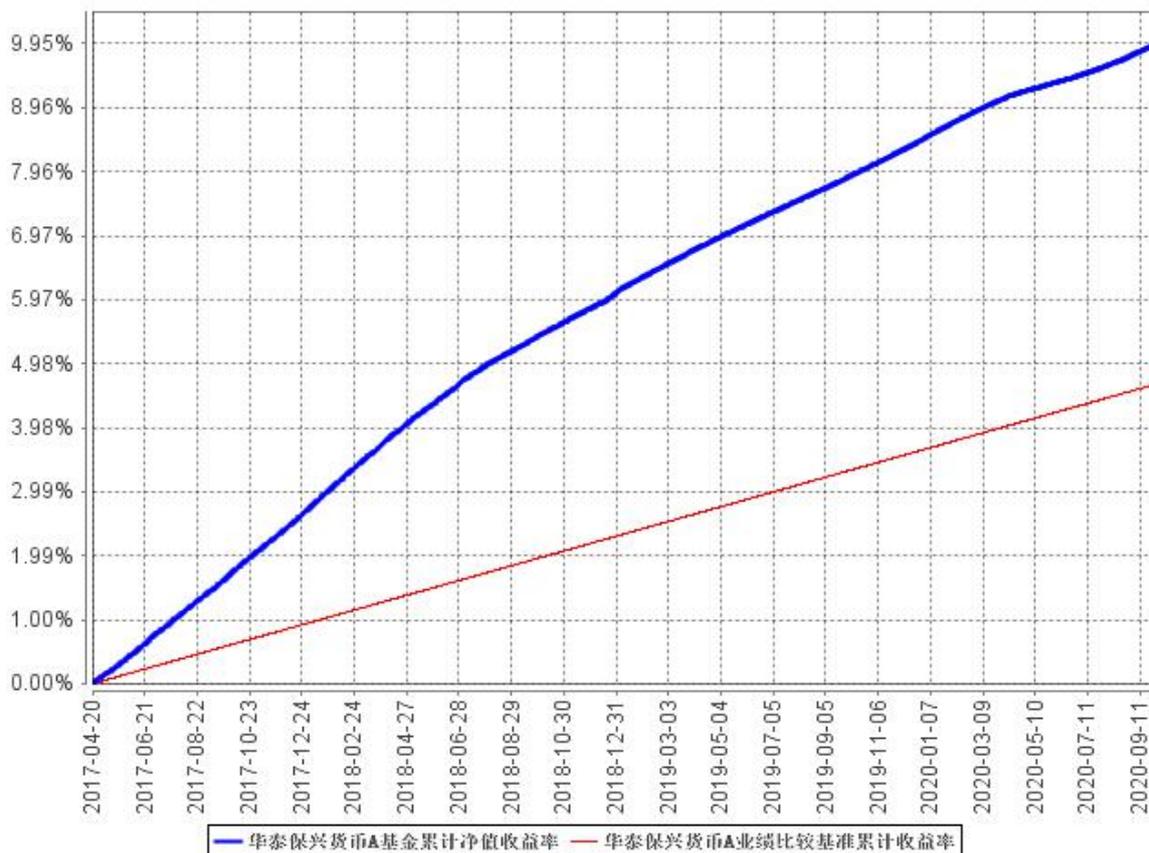
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.5156%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.1753%	0.0010%
过去六个月	0.9158%	0.0012%	0.6768%	0.0000%	0.2390%	0.0012%
过去一年	2.1752%	0.0013%	1.3537%	0.0000%	0.8215%	0.0013%
过去三年	8.8866%	0.0024%	4.0537%	0.0000%	4.8329%	0.0024%
自基金合同生效起至今	10.8628%	0.0026%	4.6603%	0.0000%	6.2025%	0.0026%

注：1、本基金业绩比较基准为：中国人民银行公布的 7 天通知存款利率（税后）。

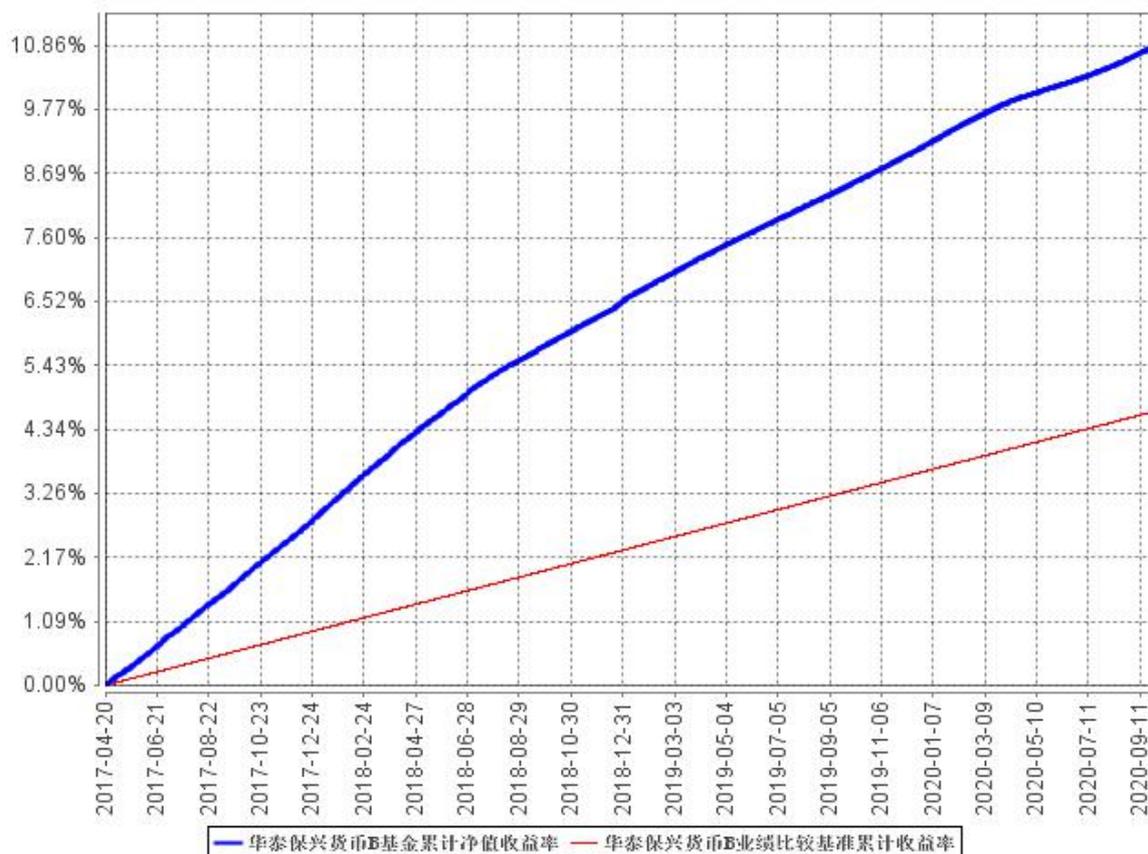
2、本基金收益分配为按日结转份额。

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

华泰保兴货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰保兴货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王海明	基金经理	2019年9月23日	-	4年	上海财经大学硕士研究生。曾任华泰资产管理有限公司固定收益投资部研究员。2016年8月加入华泰保兴基金管理有限公司，历任投资助理、华泰保兴货币市场基金基金经理助理。
章劲	基金经理	2019年9月18日	-	15年	上海大学文学学士。历任上海银行人力资源部科员、资金营运中心交易员、经理，华夏基金管理有限公司基金经理、华泰资产管理有限公司投资管理部副总经理、投资管理部总经理、固定收益投资部总经

					理、证券投资副总监、证券投资总监。2016 年 8 月加入华泰保兴基金管理有限公司，现任公司副总经理兼首席投资官。
--	--	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、规范性文件要求和本基金基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，本基金运作无重大违法违规行为，投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度的执行情况主要包括：公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究报告发布和信息共享平台，使各投资组合得到公平的投资研究服务；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行投资授权制度及授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度，以“时间优先、价格优先”为基本原则，结合投资交易系统内的公平交易模块，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《异常交易监控与报告制度》对涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行了界定，并拟定相应的监控、识别、分析与防控措施；公司禁止同一交易日内同一投资组合内部、不同投资组合之间的反向交易以及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。

公司对各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1 日、3 日、5 日）内的同向交易、反向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，未发现违反公平交易制度的异

常交易行为。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年三季度，国内经济从新冠肺炎疫情影响中稳步恢复。1-8 月份，工业增加值同比增长 0.4%，增速实现由负转正。8 月份，社会消费品零售同比增长 0.5%，为今年以来首次正增长。受益于海外需求旺盛，出口数据超预期。从先行指标来看，9 月 PMI 为 51.5%，比上月上升 0.5 个百分点，表明制造业景气有所回升。海外方面，美联储 9 月议息会议表示将保持利率不变，未来数月将延续当前的资产购买节奏。

物价方面，居民消费价格自今年 2 月以来呈现下降态势。8 月份 CPI 同比上涨 2.4%，分项来看，猪肉供给有所改善，涨幅有所收窄。总体而言，四季度 CPI 受猪肉价格的影响逐渐减小。

债券收益率曲线在三季度平坦化上行，短端上行幅度大于长端。投资、消费和出口数据向好，社融增速走高强化了市场对经济复苏的预期。央行保持稳健的货币政策要更加灵活适度、精准导向，综合运用并创新多种货币政策工具，保持流动性合理充裕。

报告期内，本基金主要投资信用资质较好的同业存单和银行存款，维持资产较高流动性和安全性，合理安排资产的到期期限。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期华泰保兴货币 A 的基金份额净值收益率为 0.4550%，本报告期华泰保兴货币 B 的基金份额净值收益率为 0.5156%，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者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	4,384,364,804.41	60.69
	其中：债券	4,384,364,804.41	60.69
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,373,148,679.72	32.85
	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	307,283,621.49	4.25
4	其他资产	159,136,204.24	2.20
5	合计	7,223,933,309.86	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.16	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额 (元)	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	274,399,188.40	3.95
	其中：买断式回购融资	-	-

注：本报告期内本基金债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：本基金报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	41
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	45
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	35

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过 120 天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	65.06	3.95
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	18.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	4.01	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	3.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	10.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	101.70	3.95

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	348,982,317.85	5.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,758,733,216.52	25.32
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,276,649,270.04	32.77
8	其他	-	-
9	合计	4,384,364,804.41	63.11
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112016093	20 上海银行 CD093	2,000,000	199,936,473.34	2.88
2	012002608	20 中电路桥 SCP006	1,500,000	149,884,037.65	2.16
3	209939	20 贴现国债 39	1,500,000	149,519,569.93	2.15
4	012002835	20 首旅 SCP029	1,000,000	99,982,699.13	1.44
5	012001563	20 联合水泥 SCP015	1,000,000	99,968,355.65	1.44
6	012002705	20 中电路桥 SCP007	1,000,000	99,963,168.80	1.44
7	012002491	20 象屿股份 SCP009	1,000,000	99,959,032.14	1.44
8	012002492	20 中电路桥 SCP004	1,000,000	99,947,603.93	1.44
9	111909357	19 浦发银行 CD357	1,000,000	99,905,823.92	1.44

10	112010262	20 兴业银行 CD262	1,000,000	99,901,714.35	1.44
10	112009262	20 浦发银行 CD262	1,000,000	99,901,714.35	1.44

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0177%
报告期内偏离度的最低值	-0.0225%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0123%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本报告期内本基金未发生负偏离的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本报告期内本基金未发生正偏离的绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用“摊余成本法”计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚情况的说明

1、20 上海银行 CD093（代码：112016093）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2020 年 8 月 14 日公布信息显示，2020 年 8 月 14 日，中国银保监会上海监管局针对上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）在 2014 年至 2019 年期间存在的违规向资本金不足、“四证”不全的房地产项目发放贷款，以其他贷款科目发放房地产开发贷款、并购贷款管理严重违反审慎经营规则、经营性物业贷款管理严重违反审慎经营规则、个人贷款业务严重违反审慎经营规则、流动资金贷款业务严重违反审慎经营规则、违规向关系人发放信用贷款、发放贷款用于偿还银行承兑汇票垫款、贷款分类不准确、违规审批转让不符合不良贷款认定标准的信贷资产、虚增存贷款、违规收费、票据业务严重违反审慎经营规则、同业资金投向管理严重违反审慎经营规则、理财业务严重违反审慎经营规则、委托贷款业务严重违反审慎经营规则、

内保外贷业务严重违反审慎经营规则、衍生品交易人员管理严重违反审慎经营规则、监事会履职严重不到位、未经任职资格许可实际履行高级管理人员职责、关联交易管理严重不审慎、押品估值管理严重违反审慎经营规则、未按规定保存重要信贷档案导致分类信息不准确、不完整、未按规定报送统计报表等二十三项违法违规行为，对上海银行处以责令改正、没收违法所得 27.155092 万元、罚款 1625 万元、罚没合计 1652.155092 万元的行政处罚，详见上海银保监局行政处罚信息公开表（沪银保监银罚决字（2020）14 号）。

经中国人民银行上海总部 2019 年 11 月 14 日公布信息显示，2019 年 11 月 2 日，中国人民银行上海总部针对上海银行违反支付业务规定的违法行为，对上海银行处以没收违法所得 1,762,787.61 元、并处以 1,762,787.61 元罚款、共计 3,525,575.22 元，同时对相关高级管理人员作出处罚的行政处罚，详见中国人民银行上海分行行政处罚信息公示表（2019 年第 191 期，上海银罚字（2019）22 号）。

2、19 浦发银行 CD357（代码：111909357）、20 浦发银行 CD262（代码：112009262）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2020 年 8 月 11 日公布信息显示，2020 年 8 月 10 日，中国银保监会上海监管局针对上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）未按专营部门制规定开展同业业务、同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目、延迟支付同业投资资金吸收存款、为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保、未按规定进行贷款资金支付管理与控制、个人消费贷款贷后管理未尽职、通过票据转贴现业务调节信贷规模、银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职、办理无真实贸易背景的贴现业务、委托贷款资金来源审查未尽职、未按权限和程序办理委托贷款业务、未按权限和程序办理非融资性保函业务等十二项违法违规事实，对浦发银行处以责令改正、罚款共计 2100 万元的行政处罚，详见《上海银保监局行政处罚信息公开表》（沪银保监银罚决字（2020）12 号）。

3、20 兴业银行 CD262（代码：112010262）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2020 年 9 月 4 日公布信息显示，2020 年 8 月 31 日，中国银保监会福建监管局针对兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保等违法违规事实，对兴业银行处以没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元的行政处罚，详见福建银保监局行政处罚信息公开表（闽银保监罚决字（2020）24 号）。

经中国人民银行福州中心支行 2020 年 9 月 11 日公布信息显示，2020 年 9 月 4 日，中国人民

银行福州中心支行针对兴业银行为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定、为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性、违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性、违反银行卡收单外包管理规定、未按规定履行客户身份识别义务等五项违法违规行为，对兴业银行处以警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款的行政处罚，详见福州中支行政处罚信息公示表（福银罚字〔2020〕35 号）。

本基金投资 20 上海银行 CD093（代码：112016093）、19 浦发银行 CD357（代码：111909357）、20 浦发银行 CD262（代码：112009262）、20 兴业银行 CD262（代码：112010262）的投资决策程序，符合法律法规及公司投资制度有关规定。

除 20 上海银行 CD093（代码：112016093）、19 浦发银行 CD357（代码：111909357）、20 浦发银行 CD262（代码：112009262）、20 兴业银行 CD262（代码：112010262）外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	347.48
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	9,031,350.74
4	应收申购款	150,104,506.02
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	159,136,204.24

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰保兴货币 A	华泰保兴货币 B
报告期期初基金份额总额	20,842,640.25	5,699,453,261.64
报告期期间基金总申购份额	26,652,775.74	7,795,432,490.40
报告期期间基金总赎回份额	19,791,391.85	6,575,952,353.37

报告期期末基金份额总额	27,704,024.14	6,918,933,398.67
-------------	---------------	------------------

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利再投	2020年7月1日	3,040.24	3,040.24	0.00%
2	红利再投	2020年7月2日	2,743.23	2,743.23	0.00%
3	红利再投	2020年7月3日	2,761.62	2,761.62	0.00%
4	红利再投	2020年7月6日	8,228.76	8,228.76	0.00%
5	红利再投	2020年7月7日	2,384.94	2,384.94	0.00%
6	红利再投	2020年7月8日	2,525.30	2,525.30	0.00%
7	红利再投	2020年7月9日	2,248.48	2,248.48	0.00%
8	红利再投	2020年7月10日	2,261.58	2,261.58	0.00%
9	红利再投	2020年7月13日	6,954.13	6,954.13	0.00%
10	红利再投	2020年7月14日	2,407.38	2,407.38	0.00%
11	红利再投	2020年7月15日	2,427.63	2,427.63	0.00%
12	红利再投	2020年7月16日	2,620.65	2,620.65	0.00%
13	红利再投	2020年7月17日	2,631.34	2,631.34	0.00%
14	红利再投	2020年7月20日	8,237.83	8,237.83	0.00%
15	红利再投	2020年7月21日	2,797.88	2,797.88	0.00%
16	红利再投	2020年7月22日	2,765.91	2,765.91	0.00%
17	红利再投	2020年7月23日	2,936.56	2,936.56	0.00%
18	红利再投	2020年7月24日	2,785.23	2,785.23	0.00%
19	红利再投	2020年7月27日	7,918.90	7,918.90	0.00%
20	红利再投	2020年7月28日	2,788.46	2,788.46	0.00%
21	红利再投	2020年7月29日	2,684.47	2,684.47	0.00%
22	红利再投	2020年7月30日	2,738.23	2,738.23	0.00%
23	红利再投	2020年7月31日	2,648.81	2,648.81	0.00%
24	红利再投	2020年8月3日	8,408.47	8,408.47	0.00%
25	红利再投	2020年8月4日	2,708.28	2,708.28	0.00%
26	红利再投	2020年8月5日	2,691.10	2,691.10	0.00%
27	红利再投	2020年8月6日	2,666.84	2,666.84	0.00%
28	红利再投	2020年8月7日	2,604.05	2,604.05	0.00%
29	红利再投	2020年8月10日	7,920.78	7,920.78	0.00%
30	红利再投	2020年8月11日	4,547.71	4,547.71	0.00%
31	红利再投	2020年8月12日	2,692.76	2,692.76	0.00%
32	红利再投	2020年8月13日	2,632.24	2,632.24	0.00%
33	红利再投	2020年8月14日	3,100.55	3,100.55	0.00%
34	红利再投	2020年8月17日	8,200.26	8,200.26	0.00%

35	红利再投	2020 年 8 月 18 日	2,732.11	2,732.11	0.00%
36	红利再投	2020 年 8 月 19 日	2,773.74	2,773.74	0.00%
37	红利再投	2020 年 8 月 20 日	2,775.80	2,775.80	0.00%
38	红利再投	2020 年 8 月 21 日	2,832.45	2,832.45	0.00%
39	红利再投	2020 年 8 月 24 日	8,661.91	8,661.91	0.00%
40	红利再投	2020 年 8 月 25 日	2,909.29	2,909.29	0.00%
41	红利再投	2020 年 8 月 26 日	4,720.14	4,720.14	0.00%
42	红利再投	2020 年 8 月 27 日	4,904.06	4,904.06	0.00%
43	红利再投	2020 年 8 月 28 日	4,080.71	4,080.71	0.00%
44	红利再投	2020 年 8 月 31 日	9,499.81	9,499.81	0.00%
45	红利再投	2020 年 9 月 1 日	3,151.73	3,151.73	0.00%
46	红利再投	2020 年 9 月 2 日	3,104.45	3,104.45	0.00%
47	红利再投	2020 年 9 月 3 日	4,370.20	4,370.20	0.00%
48	红利再投	2020 年 9 月 4 日	3,153.01	3,153.01	0.00%
49	红利再投	2020 年 9 月 7 日	9,083.98	9,083.98	0.00%
50	红利再投	2020 年 9 月 8 日	3,075.10	3,075.10	0.00%
51	红利再投	2020 年 9 月 9 日	3,794.10	3,794.10	0.00%
52	红利再投	2020 年 9 月 10 日	3,209.89	3,209.89	0.00%
53	红利再投	2020 年 9 月 11 日	3,492.98	3,492.98	0.00%
54	红利再投	2020 年 9 月 14 日	9,892.67	9,892.67	0.00%
55	红利再投	2020 年 9 月 15 日	3,128.24	3,128.24	0.00%
56	红利再投	2020 年 9 月 16 日	3,129.90	3,129.90	0.00%
57	红利再投	2020 年 9 月 17 日	3,159.96	3,159.96	0.00%
58	红利再投	2020 年 9 月 18 日	3,357.43	3,357.43	0.00%
59	红利再投	2020 年 9 月 21 日	9,628.33	9,628.33	0.00%
60	红利再投	2020 年 9 月 22 日	3,190.41	3,190.41	0.00%
61	红利再投	2020 年 9 月 23 日	3,173.01	3,173.01	0.00%
62	红利再投	2020 年 9 月 24 日	2,694.94	2,694.94	0.00%
63	红利再投	2020 年 9 月 25 日	3,293.19	3,293.19	0.00%
64	红利再投	2020 年 9 月 28 日	11,970.96	11,970.96	0.00%
65	红利再投	2020 年 9 月 29 日	3,538.57	3,538.57	0.00%
66	红利再投	2020 年 9 月 30 日	3,741.38	3,741.38	0.00%
合计			275,935.05	275,935.05	

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金募集的文件
- 2、《华泰保兴货币市场基金基金合同》
- 3、《华泰保兴货币市场基金托管协议》
- 4、《华泰保兴货币市场基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、报告期内本基金在规定媒介披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人办公场所，地址：上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层

9.3 查阅方式

- 1、营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅
- 2、登录基金管理人网站 www.ehuataifund.com 查阅
- 3、拨打基金管理人客服热线电话 400-632-9090（免长途话费）查询

华泰保兴基金管理有限公司

2020 年 10 月 28 日