

华泰保兴货币市场基金 2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 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：二〇二一年一月二十二日

§ 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 2021 年 1 月 20 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 10 月 1 日起至 12 月 31 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	7,119,740,834.43 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	32,104,355.64 份	7,087,636,478.79 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 10 月 1 日 — 2020 年 12 月 31 日）	
	华泰保兴货币 A	华泰保兴货币 B
1. 本期已实现收益	196,962.83	49,793,324.70
2. 本期利润	196,962.83	49,793,324.70
3. 期末基金资产净值	32,104,355.64	7,087,636,478.79

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	0.6055%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.2652%	0.0010%
过去六个月	1.0632%	0.0013%	0.6805%	0.0000%	0.3827%	0.0013%
过去一年	1.9671%	0.0014%	1.3537%	0.0000%	0.6134%	0.0014%
过去三年	7.6902%	0.0022%	4.0537%	0.0000%	3.6365%	0.0022%
自基金合同生效起至今	10.6131%	0.0026%	5.0005%	0.0000%	5.6126%	0.0026%

华泰保兴货币 B

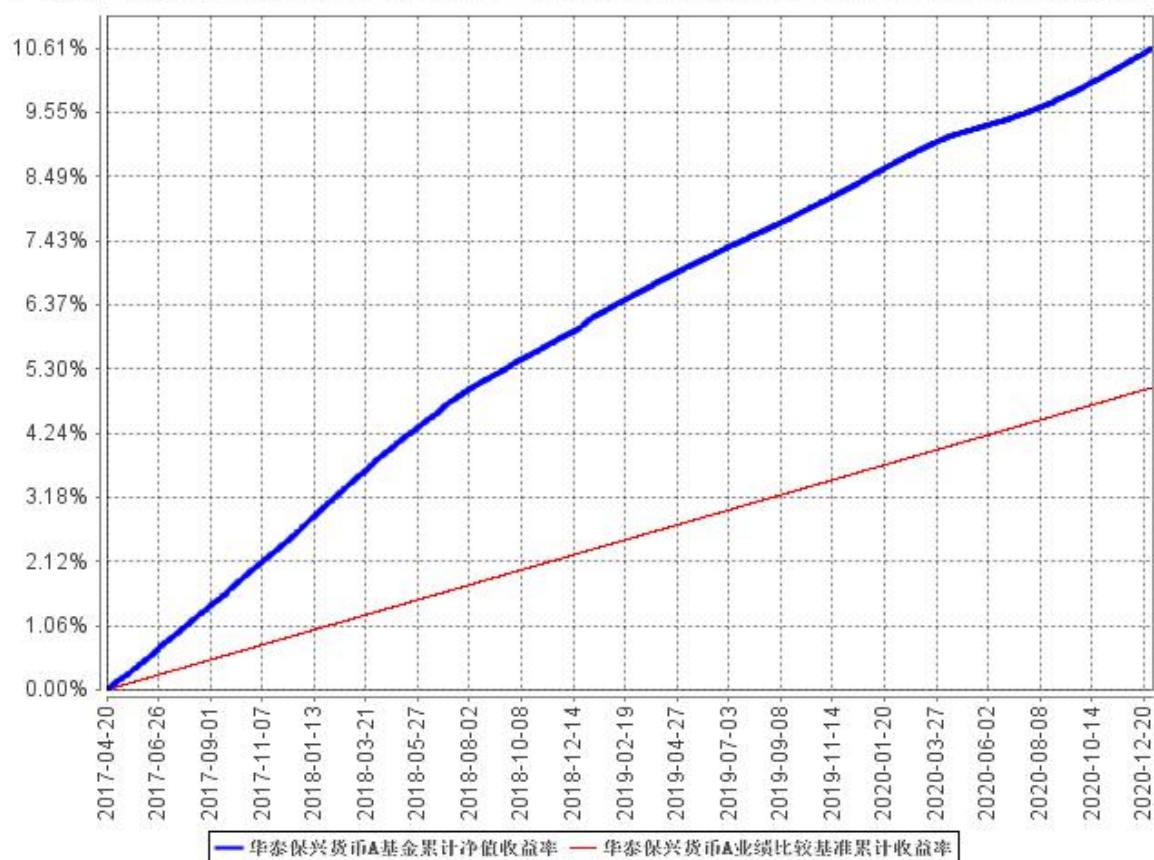
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.6661%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.3258%	0.0010%
过去六个月	1.1851%	0.0013%	0.6805%	0.0000%	0.5046%	0.0013%
过去一年	2.2120%	0.0014%	1.3537%	0.0000%	0.8583%	0.0014%
过去三年	8.4691%	0.0022%	4.0537%	0.0000%	4.4154%	0.0022%
自基金合同生效起至今	11.6012%	0.0026%	5.0005%	0.0000%	6.6007%	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）。

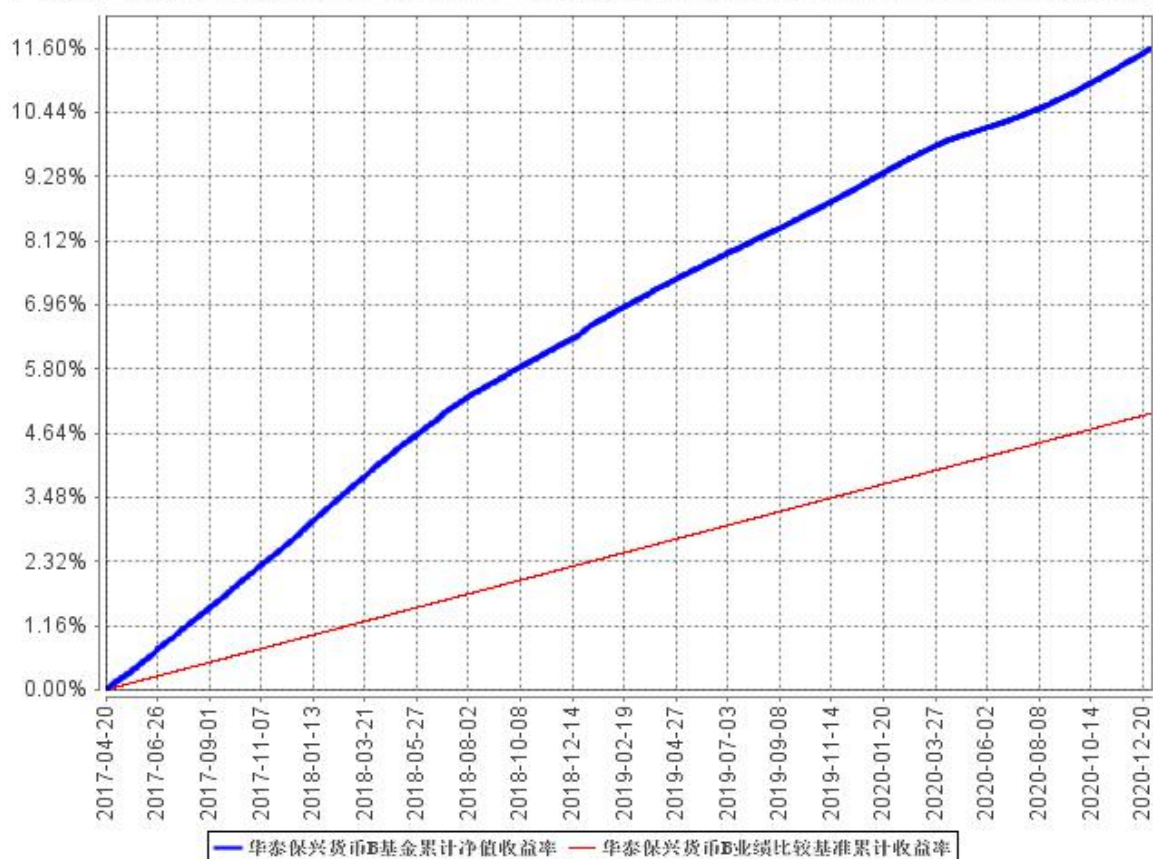
2、本基金收益分配为按日结转份额。

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		
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。
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。
--	--	--	--	--	---

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，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 年第四季度，国内经济稳步回升，但速度放缓。11 月份，工业增加值同比增长 7.0%，增速为今年以来新高。促进消费政策不断发力，居民消费需求稳步释放，社会消费品零售总额 11 月单月同比 5.0%。固定资产投资方面，制造业投资增速恢复较快，但是基建投资未见明显回升。房地产行业受监管政策影响，后续投资可能放缓。物价方面，居民消费价格自今年 2 月以来呈现下降态势。11 月 CPI 同比-0.5%，主要受去年同期基数较高影响。工业品的需求持续回暖，价格继续回升，PPI 环比由上月持平转为上涨 0.5%。从先行指标来看，12 月 PMI51.9%，较上月回落 0.2 个百分点。海外方面，美国通过了新的财政刺激法案，美债收益率上行。

债券收益率曲线在四季度上行之后下移。四季度开始，债券市场整体为震荡行情。永城煤电违约之后，债券收益率普遍上行，低等级及周期性行业的信用债抛售压力较大。在人民银行投放流动性情况下，收益率曲线下移，利率债收益率下行幅度大于信用债，债券市场情绪逐渐好转。

政策方面，央行保持稳健的货币政策要灵活精准、合理适度，继续发挥好结构性货币政策工具和信贷政策精准滴灌作用。财政方面，积极的财政政策提质增效、更可持续，保持对经济恢复的必要支持力度，政策操作上要更加精准有效，不急转弯，把握好政策时度效。

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 0.6055%，本报告期华泰保兴货币 B 的基金份额净值收益率为 0.6661%，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	4,007,471,369.21	56.26

	其中：债券	4,007,471,369.21	56.26
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,383,618,675.44	33.47
	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	702,027,321.52	9.86
4	其他资产	29,557,977.79	0.41
5	合计	7,122,675,343.96	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	5.06	
	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	-	-
	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	45
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	49
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

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	64.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

2	30 天(含)-60 天	18.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	3.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	0.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天（含）	12.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.63	-

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	298,841,852.63	4.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,990,240.73	1.69
	其中：政策性金融债	119,990,240.73	1.69
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	249,882,387.75	3.51
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,338,756,888.10	46.89
8	其他	-	-
9	合计	4,007,471,369.21	56.29
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	112009020	20 浦发银行 CD020	3,000,000	299,524,372.35	4.21
2	112010413	20 兴业银行 CD413	2,000,000	199,797,823.54	2.81
3	112020215	20 广发银行 CD215	2,000,000	199,351,766.41	2.80
4	112071042	20 宁波银行 CD194	1,500,000	149,609,748.22	2.10
5	072000249	20 申万宏源 CP008BC	1,000,000	100,000,360.29	1.40
6	200201	20 国开 01	1,000,000	99,989,791.33	1.40

7	012003702	20 三一 SCP011	1,000,000	99,914,846.22	1.40
8	112007008	20 招商银行 CD008	1,000,000	99,905,689.98	1.40
9	112011255	20 平安银行 CD255	1,000,000	99,897,134.52	1.40
10	112014003	20 江苏银行 CD003	1,000,000	99,888,851.32	1.40

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	0.0401%
报告期内偏离度的最低值	-0.0319%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0124%

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 浦发银行 CD020（代码：112009020）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”）在 2013 年至 2018 年期间存在的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）。

2、20 兴业银行 CD413（代码：112010413）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）。

经中国人民银行官网 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）。

3、20 广发银行 CD215（代码：112020215）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2020 年 7 月 15 日公布信息显示，2020 年 7 月 7 日，中国银保监会广东监管局针对广发银行股份有限公司（以下简称“广发银行”）贷款分类、从业人员处罚信息报送、信用卡“财智金”业务贷后管理严重违反审慎经营规则等违法违规事实，对广发银行处以罚款 220 万元的行政处罚，详见《广东银保监局行政处罚信息公开表》（粤银保监罚决字〔2020〕27 号）。

经中国银保监会官网 2020 年 9 月 4 日公布信息显示，2020 年 6 月 29 日，中国银保监会针对广发银行向关系人发放信用贷款、对个人贷款资金使用未做到有效跟踪监控，使消费性贷款用于支付购房首付款、违规办理无真实贸易背景银行承兑汇票、对银行承兑汇票贸易背景审查不规范、信贷资金购买本行理财产品、以贷款资金作为保证金发放贷款、不良贷款转让不规范、违规向房地产开发企业发放流动资金贷款、违规向资本金不到位的房地产开发企业发放贷款、资金以同业投资形式违规投向房地产领域、理财资金违规投向房地产企业、面向不合格个人投资者发行理财产品投资权益性资产、未按规定向投资者披露理财产品投资非标准化债权资产情况、向地方政府

违规融资, 要求地方政府违规提供担保承诺、投资交易本行主承销债券超规定比例、信用卡透支用于非消费领域、案件信息报送不规范、未经任职资格核准履行高级管理人员职责、违规提前发放应延期支付的绩效薪酬、股东违规提名董事及监事、股权质押管理不到位等二十一项违法违规事实, 对广发银行处以没收违法所得 511.53 万元、罚款 8771.53 万元, 罚没合计 9283.06 万元的行政处罚, 详见《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表》(银保监罚决字〔2020〕14 号)。

4、20 宁波银行 CD194 (代码: 112071042) 为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2020 年 10 月 27 日公布信息显示, 2020 年 10 月 16 日, 宁波银保监局针对宁波银行股份有限公司 (以下简称 “宁波银行”) 授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位的违法违规事实, 对宁波银行处以罚款人民币 30 万元的行政处罚, 并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分, 详见《宁波银保监局行政处罚信息公开表》(甬银保监罚决字〔2020〕48 号)。

5、20 国开 01 (代码: 200201) 为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2021 年 1 月 8 日公布信息显示, 2020 年 12 月 25 日, 中国银保监会针对国家开发银行违规的政府购买服务项目提供融资、项目资本金管理不到位, 棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况、违规变相发放土地储备贷款、设置不合理存款考核要求, 以贷转存, 虚增存款、贷款风险分类不准确、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产、违规进行信贷资产拆分转让, 隐匿信贷资产质量、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品、扶贫贷款存贷挂钩、易地扶贫搬迁贷款 “三查” 不尽职, 部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁、未落实同业业务交易对手名单制监管要求、以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资, 未纳入同业借款业务管理、以协定存款方式吸收同业存款, 未纳入同业存款业务管理、风险隔离不到位, 违规开展资金池理财业务、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况、逾期未整改, 屡查屡犯, 违规新增业务、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表、违规收取小微企业贷款承诺费、收取财务顾问费质价不符、利用银团贷款承诺费浮利分费、向检查组提供虚假整改说明材料、未如实提供信贷资产转让台账、案件信息迟报、瞒报、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位等二十四项违法违规行为, 对国家开发银行处以罚款 4880 万元的行政处罚, 详见《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表》(银保监罚决字〔2020〕67 号)。

6、20 平安银行 CD255 (代码: 112011255) 为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2020 年 2 月 3 日公布信息显示, 2020 年 1 月 20 日, 中国银保监会深圳

监管局针对平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成、代理保险销售的人员为非商业银行人员、汽车消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平、个人消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平、个人经营性贷款分类结果不能反映真实风险水平、汽车消费贷款和汽车抵押贷款贷前调查存在缺失、汽车消费及经营贷款审查不到位、个人汽车贷款和汽车抵押贷款业务存在同一抵押物重复抵押、个别汽车消费贷款和汽车抵押贷款用途管控不力，贷款资金被挪用、个人消费贷款及个人经营性贷款用途管控不力，贷款资金被挪用、部分个人消费贷款未按要求进行受托支付、信用卡现金分期用途管控不力、代销产品风险评级结果与合作机构评级结果不一致，未采用较高风险评级的评级结果、代销产品底层资产涉及本行非标资产，没有实现代销业务与其他业务的风险隔离、“双录”管理审慎性不足，理财销售人员销售话术不当等十五项违法违规事实，对平安银行处以罚款 720 万元的行政处罚，详见《中国银保监会深圳监管局行政处罚信息公开表》（深银保监罚决字〔2020〕7 号）。

经中国银保监会官网 2020 年 10 月 27 日公布信息显示，2020 年 10 月 16 日，宁波银保监局针对平安银行贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等违法违规事实，对平安银行处以罚款 100 万元的行政处罚，详见《宁波银保监局行政处罚信息公开表》（甬银保监罚决字〔2020〕66 号）。

7、20 江苏银行 CD003（代码：112014003）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2020 年 12 月 31 日公布信息显示，2020 年 12 月 30 日，江苏银保监局针对江苏银行股份有限公司（以下简称“江苏银行”）个人贷款资金用途管控不严、发放流动资金贷款偿还银行承兑汇票垫款、理财投资和同业投资非标准化债权资产未严格比照自营贷款管理、个人理财资金对接项目资本金、理财业务未与自营业务相分离、理财资金投资非标准化债权资产的余额超监管比例要求等六项违法违规事实，对江苏银行处以罚款人民币 240 万元的行政处罚，详见《江苏银保监局行政处罚信息公开表》（苏银保监罚决字〔2020〕88 号）。

本基金投资 20 浦发银行 CD020（代码：112009020）、20 兴业银行 CD413（代码：112010413）、20 广发银行 CD215（代码：112020215）、20 宁波银行 CD194（代码：112071042）、20 国开 01（代码：200201）、20 平安银行 CD255（代码：112011255）以及 20 江苏银行 CD003（代码：112014003）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 浦发银行 CD020（代码：112009020）、20 兴业银行 CD413（代码：112010413）、20 广发银行 CD215（代码：112020215）、20 宁波银行 CD194（代码：112071042）、20 国开 01（代码：200201）、20 平安银行 CD255（代码：112011255）以及 20 江苏银行 CD003（代码：112014003）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	285.13
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	9,557,692.66
4	应收申购款	20,000,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	29,557,977.79

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	27,704,024.14	6,918,933,398.67
报告期期间基金总申购份额	72,689,054.66	7,542,237,735.60
报告期期间基金总赎回份额	68,288,723.16	7,373,534,655.48
报告期期末基金份额总额	32,104,355.64	7,087,636,478.79

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 10 月 9 日	33,926.93	33,926.93	0.00%
2	红利再投	2020 年 10 月 12 日	10,788.03	10,788.03	0.00%
3	红利再投	2020 年 10 月 13 日	4,129.50	4,129.50	0.00%
4	红利再投	2020 年 10 月 14 日	3,739.31	3,739.31	0.00%
5	红利再投	2020 年 10 月 15 日	5,071.74	5,071.74	0.00%
6	红利再投	2020 年 10 月 16 日	3,106.56	3,106.56	0.00%
7	红利再投	2020 年 10 月 19 日	9,482.38	9,482.38	0.00%
8	红利再投	2020 年 10 月 20 日	3,761.21	3,761.21	0.00%
9	红利再投	2020 年 10 月 21 日	3,866.06	3,866.06	0.00%
10	红利再投	2020 年 10 月 22 日	4,302.87	4,302.87	0.00%
11	红利再投	2020 年 10 月 23 日	4,385.68	4,385.68	0.00%

12	红利再投	2020 年 10 月 26 日	9,909.87	9,909.87	0.00%
13	红利再投	2020 年 10 月 27 日	3,330.84	3,330.84	0.00%
14	红利再投	2020 年 10 月 28 日	5,932.08	5,932.08	0.00%
15	红利再投	2020 年 10 月 29 日	3,711.13	3,711.13	0.00%
16	红利再投	2020 年 10 月 30 日	3,861.78	3,861.78	0.00%
17	红利再投	2020 年 11 月 2 日	11,131.64	11,131.64	0.00%
18	红利再投	2020 年 11 月 3 日	3,788.07	3,788.07	0.00%
19	红利再投	2020 年 11 月 4 日	4,044.29	4,044.29	0.00%
20	红利再投	2020 年 11 月 5 日	3,682.76	3,682.76	0.00%
21	红利再投	2020 年 11 月 6 日	3,299.44	3,299.44	0.00%
22	红利再投	2020 年 11 月 9 日	9,947.98	9,947.98	0.00%
25	红利再投	2020 年 11 月 10 日	3,251.98	3,251.98	0.00%
26	红利再投	2020 年 11 月 11 日	3,975.26	3,975.26	0.00%
27	红利再投	2020 年 11 月 12 日	4,037.49	4,037.49	0.00%
28	红利再投	2020 年 11 月 13 日	4,300.09	4,300.09	0.00%
29	红利再投	2020 年 11 月 16 日	11,727.52	11,727.52	0.00%
30	红利再投	2020 年 11 月 17 日	4,825.03	4,825.03	0.00%
31	红利再投	2020 年 11 月 18 日	3,712.22	3,712.22	0.00%
32	红利再投	2020 年 11 月 19 日	3,653.70	3,653.70	0.00%
33	红利再投	2020 年 11 月 20 日	4,704.63	4,704.63	0.00%
34	红利再投	2020 年 11 月 23 日	12,880.70	12,880.70	0.00%
35	红利再投	2020 年 11 月 24 日	3,693.98	3,693.98	0.00%
36	红利再投	2020 年 11 月 25 日	3,811.70	3,811.70	0.00%
37	红利再投	2020 年 11 月 26 日	4,907.24	4,907.24	0.00%
38	红利再投	2020 年 11 月 27 日	3,947.40	3,947.40	0.00%
39	红利再投	2020 年 11 月 30 日	12,389.43	12,389.43	0.00%
40	红利再投	2020 年 12 月 1 日	4,058.48	4,058.48	0.00%
41	红利再投	2020 年 12 月 2 日	3,801.71	3,801.71	0.00%
42	红利再投	2020 年 12 月 3 日	3,677.48	3,677.48	0.00%
43	红利再投	2020 年 12 月 4 日	4,499.46	4,499.46	0.00%
44	红利再投	2020 年 12 月 7 日	10,864.92	10,864.92	0.00%
45	红利再投	2020 年 12 月 8 日	3,587.16	3,587.16	0.00%
46	红利再投	2020 年 12 月 9 日	3,610.97	3,610.97	0.00%
47	红利再投	2020 年 12 月 10 日	3,791.64	3,791.64	0.00%
48	红利再投	2020 年 12 月 11 日	4,539.75	4,539.75	0.00%
49	红利再投	2020 年 12 月 14 日	11,364.46	11,364.46	0.00%
50	红利再投	2020 年 12 月 15 日	3,777.87	3,777.87	0.00%
51	红利再投	2020 年 12 月 16 日	3,856.65	3,856.65	0.00%
52	红利再投	2020 年 12 月 17 日	4,206.34	4,206.34	0.00%
53	红利再投	2020 年 12 月 18 日	3,894.25	3,894.25	0.00%

54	红利再投	2020 年 12 月 21 日	11,614.26	11,614.26	0.00%
55	红利再投	2020 年 12 月 22 日	4,955.62	4,955.62	0.00%
56	红利再投	2020 年 12 月 23 日	3,957.40	3,957.40	0.00%
57	红利再投	2020 年 12 月 24 日	4,988.36	4,988.36	0.00%
58	红利再投	2020 年 12 月 25 日	3,874.39	3,874.39	0.00%
59	红利再投	2020 年 12 月 28 日	13,047.05	13,047.05	0.00%
60	红利再投	2020 年 12 月 29 日	4,324.80	4,324.80	0.00%
61	红利再投	2020 年 12 月 30 日	4,699.46	4,699.46	0.00%
62	红利再投	2020 年 12 月 31 日	4,391.73	4,391.73	0.00%
合计			360,402.73	360,402.73	

注：本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§ 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

2021 年 1 月 22 日