

华泰保兴货币市场基金
2021 年第一季度报告

2021 年 03 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：2021 年 04 月 22 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 04 月 19 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 03 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	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 04 月 20 日	
报告期末基金份额总额	8,236,496,092.12 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	26,784,660.65 份	8,209,711,431.47 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（2021 年 01 月 01 日-2021 年 03 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	169,970.87	47,395,928.29
2. 本期利润	169,970.87	47,395,928.29
3. 期末基金资产净值	26,784,660.65	8,209,711,431.47

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于本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。

2、本基金的收益分配是按日结转份额。

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	0.5494%	0.0008%	0.3329%	0.0000%	0.2165%	0.0008%
过去六个月	1.1582%	0.0009%	0.6732%	0.0000%	0.4850%	0.0009%
过去一年	1.9622%	0.0015%	1.3500%	0.0000%	0.6122%	0.0015%
过去三年	7.1978%	0.0018%	4.0537%	0.0000%	3.1441%	0.0018%
自基金合同生效起至 今	11.2208%	0.0025%	5.3334%	0.0000%	5.8874%	0.0025%

华泰保兴货币 B

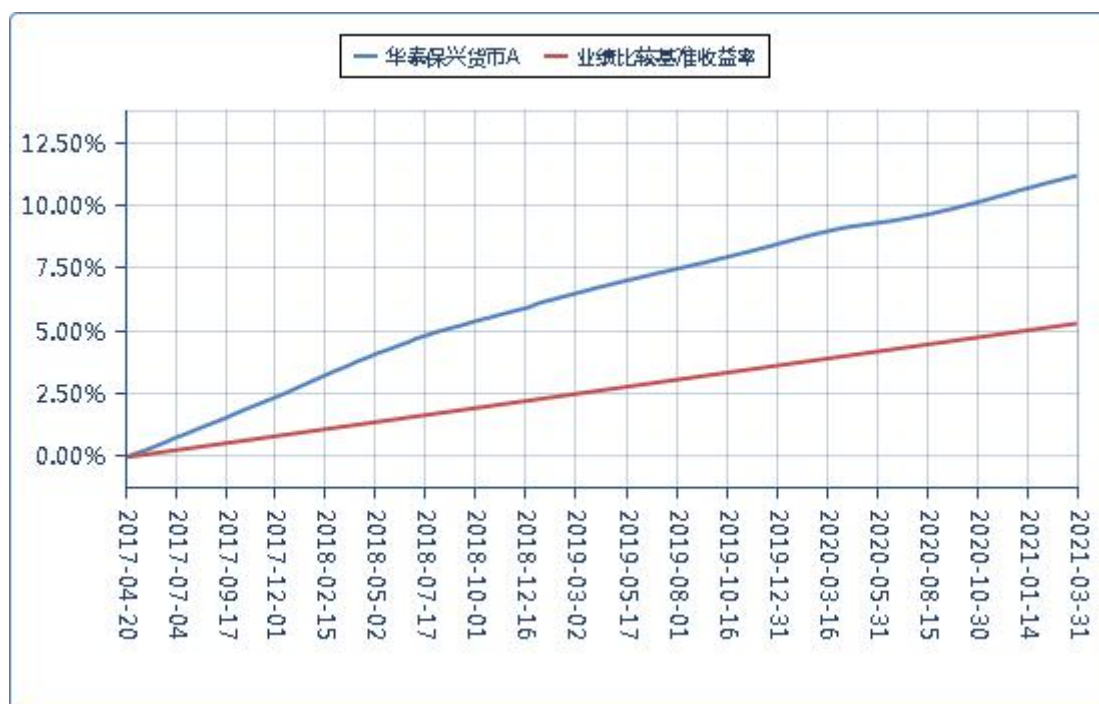
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6091%	0.0008%	0.3329%	0.0000%	0.2762%	0.0008%
过去六个月	1.2792%	0.0009%	0.6732%	0.0000%	0.6060%	0.0009%
过去一年	2.2068%	0.0015%	1.3500%	0.0000%	0.8568%	0.0015%
过去三年	7.9735%	0.0018%	4.0537%	0.0000%	3.9198%	0.0018%
自基金合同生效起至	12.2810%	0.0025%	5.3334%	0.0000%	6.9476%	0.0025%

今						
---	--	--	--	--	--	--

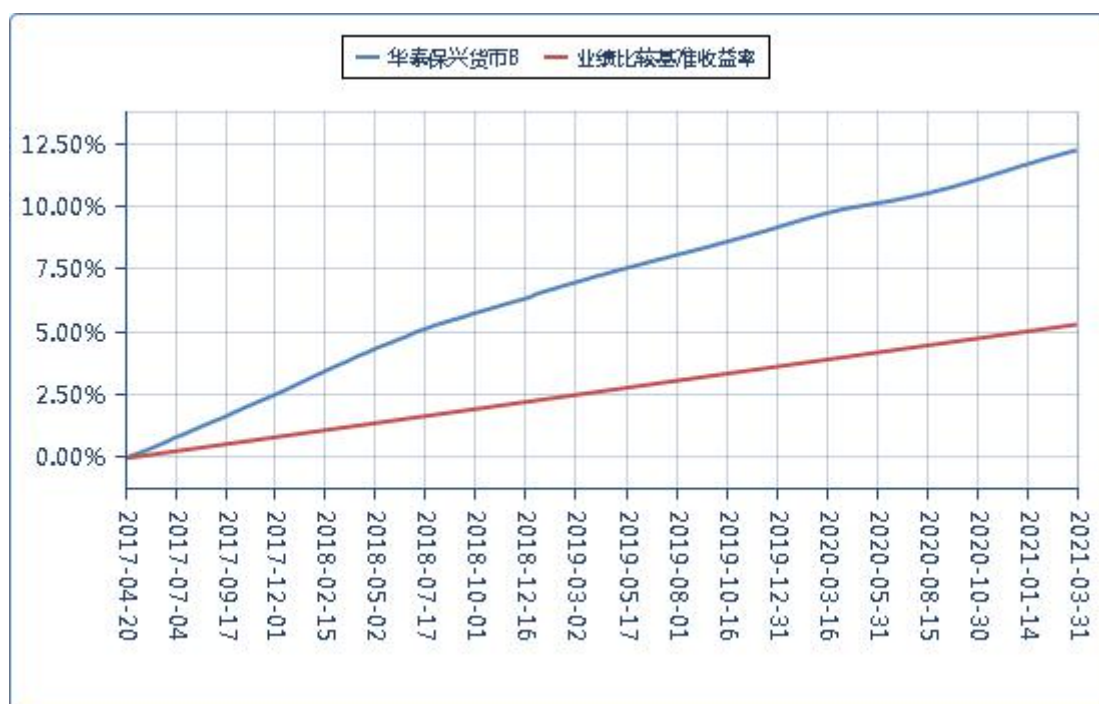
注：本基金业绩比较基准为：中国人民银行公布的 7 天通知存款利率（税后）

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



华泰保兴货币 B



§ 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 09 月 18 日	2021 年 03 月 31 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。
王海明	基金经理	2019 年 09 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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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不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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年一季度，中国经济仍处于疫情之后恢复之中，一季度因基数原因，读数将偏高。开年至春节，全国各地有零星新冠肺炎确诊病例，随着防疫措施得当和气温转暖，疫情得到有效控制。国内消费增速高企，一二线房地产放量上涨。工业增加值和制造业投资加快，居民与企业的中长期信贷需求旺盛。3 月，PMI 大幅回升，虽然其中包含了部分季节性因素。出口方面，欧美的财政刺激政策，加大了居民对中国商品的需求。美国的大规模刺激政策，带动了原油、铜等大宗商品的上涨。投资者对美国经济的预期好转，今年以来 10 年期美债收益率上行 80bp 左右。全球发达国家的疫苗接种已经加快，对全球经济的预期相对去年底更加乐观。物价方面，一季度消费者价格指数同比略高于 0，受去年基数影响较大。PPI 同比开始走高，工业品的需求较好，带动了价格上涨。

国内货币政策方面，稳健的货币政策保持连续性、稳定性、可持续性，预期管理科学有效，保持对经济恢复的必要支持力度。从市场利率来看，1 月底银行间回购利率超预期上行，但是从 2 月开始，一直延续了较为充裕的局面。信用政策保持紧缩，防止贷款违规流入房地产行业。另外，今年的财政政策也会收敛，可能会保持货币当前适度宽松的状态。

报告期内，本基金的运作以保证资产的安全性、流动性为重要任务，在关键时点增加了组合的剩余期限，增加了组合的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，华泰保兴货币 A 份额净值收益率为 0.5494%，同期业绩比较基准收益率为 0.3329%；华泰保兴货币 B 份额净值收益率为 0.6091%，同期业绩比较基准收益率为 0.3329%。

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	6,403,469,458.35	67.08
	其中：债券	6,403,469,458.35	67.08
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	2,723,529,205.29	28.53
	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	405,483,056.82	4.25
4	其他资产	13,792,716.92	0.14
5	合计	9,546,274,437.38	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	5.69	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	1,306,607,440.09	15.86

其中：买断式回购融资	-	-
------------	---	---

注：报告期内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

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 20%。

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	54
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	42

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

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	71.47	15.86
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	21.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	6.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	11.83	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		115.73	15.86

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

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

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	49,853,293.58	0.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	479,762,047.66	5.82
	其中：政策性金融债	479,762,047.66	5.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	499,974,054.02	6.07
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,373,880,063.09	65.24
8	其他	-	-
9	合计	6,403,469,458.35	77.75
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名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	200406	20 农发 06	2,000,000	199,931,123.87	2.43
2	112116028	21 上海银行 CD028	2,000,000	199,901,555.66	2.43
3	112116029	21 上海银行 CD029	2,000,000	199,886,203.70	2.43
4	112116032	21 上海银行 CD032	2,000,000	199,843,546.79	2.43
5	112110077	21 兴业银行 CD077	2,000,000	199,463,497.17	2.42
6	112015377	20 民生银行 CD377	2,000,000	199,235,134.66	2.42
7	112193051	21 广州银行 CD004	2,000,000	199,148,146.94	2.42
8	112003024	20 农业银行 CD024	1,800,000	179,826,881.95	2.18
9	112014060	20 江苏银行 CD060	1,500,000	149,553,658.31	1.82
10	112017178	20 光大银行 CD178	1,300,000	128,664,280.80	1.56

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	0.0555%
报告期内偏离度的最低值	-0.0535%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0232%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到 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

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 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名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末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 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

1、21 上海银行 CD028（代码：112116028）、21 上海银行 CD029（代码：112116029）以及 21 上海银行 CD032（代码：112116032）为本基金的前十大持仓证券。

根据中国银保监会上海监管局官网 2020 年 8 月 14 日公布信息显示，2020 年 8 月 14 日上海银保监局针对上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）2014 年至 2019 年存在违规向资本金不足、“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）。

经中国银保监会上海监管局官网 2020 年 11 月 25 日公布信息显示，2020 年 11 月 18 日上海银保监局针对上海银行 2014 年至 2018 年绩效考评管理严重违反审慎经营规则、2018 年未按规定延期支付 2017 年度绩效薪酬等两项违法违规行为，对上海银行处以责令改正，并处罚款共计 80 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）25 号）。

2、21 兴业银行 CD077（代码：112110077）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 民生银行 CD377（代码：112015377）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 7 月 14 日，中国银保监会针对中国民生银行股份有限公司（以下简称“民生银行”）违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资、为“四证”不全的房地产项目提供融资、违规为土地储备中心提供融资、违规为地方政府提供融资，接受地方政府担保或承诺、多名股东在已派出董事的情况下，以推荐代替提名方式推举独立董事及监事、多名股东在股权质押超比例的情况下违规在股东大会上行使表决权，派出董事在董事会上的表决权也未受限、股东持股份额发生重大变化未向监管部门报告、多名拟任高管人员及董事未经核准即履职、关联交易不合规、理财产品风险信息披露不合规、年报信息披露不真实、贷款资金被挪用，虚增贷款、以贷转存，虚增存款、贸易背景审查不尽职、向关系人发放信用贷款、违规转让正常类信贷资产、违规转让不良资产、同业投资他行非保本理财产品审查不到位，接受对方机构违规担保，少计风险加权资产、同业投资未穿透

底层资产计提资本拨备，少计风险加权资产、同业存放业务期限超过一年、违规开展票据转贴现交易、个别理财产品管理费长期未入账、理财业务风险隔离不充分、违规向非高净值客户销售投向股权类资产的理财产品、非标准化资产纳入标准化资产统计，实际非标债权资产比例超监管要求、违规出具补充协议及与事实不符的投资说明、以代销名义变相向本行授信客户融资，并承担兜底风险、向不符合条件的借款人办理收益权转让再融资业务、代理福费廷业务违规承担风险，会计处理不规范、迟报瞒报多起案件（风险信息）等三十项违法违规行为，对民生银行处以没收违法所得 296.47 万元，罚款 10486.47 万元，罚没合计 10782.94 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〕43 号）。

4、20 农业银行 CD024（代码：112003024）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2020 年 5 月 9 日公布信息显示，2020 年 4 月 22 日，中国银保监会针对中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）“两会一层”境外机构管理履职不到位、国别风险管理不满足监管要求、信贷资金被挪用作保证金、未将集团成员纳入集团客户统一授信管理等四项违法违规行为，对农业银行处以罚款合计 200 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〕11 号）。

经中国银保监会官网 2020 年 5 月 9 日公布信息显示，2020 年 4 月 22 日，中国银保监会针对农业银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在资金交易信息漏报严重、信贷资产转让业务漏报、贸易融资业务漏报、分户账明细记录应报未报、分户账账户数据应报未报、关键且应报字段漏报或填报错误等六项违法违规行为，对农业银行处以罚款合计 230 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〕12 号）。

经中国银保监会官网 2020 年 8 月 28 日公布信息显示，2020 年 7 月 13 日，中国银保监会针对农业银行向关系人发放信用贷款、批量处置不良资产未公告、批量处置不良资产未向监管部门报告、违规转让正常类贷款、个人住房贷款首付比例违规、流动资金贷款被用于固定资产投资、超过实际需求发放流动资金贷款、贷后管理缺失导致企业套取扶贫贷款资金用于房地产开发、贷款用于偿还银行承兑汇票垫款、承兑业务贸易背景审查不严、保理业务授权管理不到位、贴现资金直接回流至银行承兑汇票出票人、贷款资金直接转存银行承兑汇票保证金、信贷资金用于兑付到期理财资产、信贷资金用于承接承销债券、销售非保本理财产品违规出具承诺函、提供与事实不符的报告、理财产品相互交易、相互调节收益、面向一般个人投资者销售的理财产品投向股权投资、将系统内资金纳入一般存款核算，虚增存款、开立同业银行结算账

户不合规、个别人员未经核准即履行高管人员职责、对小微企业不当收费、未按规定报送案件等二十四项违法违规事项，对农业银行处以没收违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 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〕36 号）。

经中国银保监会官网 2020 年 12 月 7 日公布信息显示，2020 年 12 月 7 日，中国银保监会针对农业银行收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费）等违法违规行为，对农业银行处以没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元，罚没金额合计 198.36 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〕66 号）。

经中国银保监会官网 2021 年 1 月 29 日公布信息显示，2021 年 1 月 19 日，中国银保监会针对农业银行发生重要信息系统突发事件未报告、制卡数据违规明文留存、生产网络、分行无线互联网络保护不当、数据安全较粗放，存在数据泄露风险、网络信息系统存在较多漏洞、互联网门户网站泄露敏感信息等六项违法违规行为，对农业银行处以罚款 420 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〔2021〕1 号）。

5、20 江苏银行 CD060（代码：112014060）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）。

6、20 光大银行 CD178（代码：112017178）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2020 年 5 月 9 日公布信息显示，2020 年 4 月 20 日，中国银保监会针对中国光大银行股份有限公司（以下简称“光大银行”）监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在分户账明细记录应报未报、关键且应报字段漏报或填报错误、向检查组提供与事实不符的材料、账户设置不能如实反映业务实际等四项违法违规行为，对光大银行处以罚款合计 160 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〕5 号）。

本基金投资 21 上海银行 CD028（代码：112116028）、21 上海银行 CD029（代码：112116029）、21 上

海银行 CD032（代码：112116032）、21 兴业银行 CD077（代码：112110077）、20 民生银行 CD377（代码：112015377）、20 农业银行 CD024（代码：112003024）、20 江苏银行 CD060（代码：112014060）以及 20 光大银行 CD178（代码：112017178）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 21 上海银行 CD028（代码：112116028）、21 上海银行 CD029（代码：112116029）、21 上海银行 CD032（代码：112116032）、21 兴业银行 CD077（代码：112110077）、20 民生银行 CD377（代码：112015377）、20 农业银行 CD024（代码：112003024）、20 江苏银行 CD060（代码：112014060）以及 20 光大银行 CD178（代码：112017178）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	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	13,792,716.92
4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	13,792,716.92

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	32,104,355.64	7,087,636,478.79
报告期期间基金总申购份额	121,491,137.07	6,740,448,187.38
减：报告期期间基金总赎回份额	126,810,832.06	5,618,373,234.70
报告期期末基金份额总额	26,784,660.65	8,209,711,431.47

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	2021 年 01 月 04 日	17,409.14	17,409.14	-
2	红利再投	2021 年 01 月 05 日	4,057.99	4,057.99	-
3	红利再投	2021 年 01 月 06 日	4,014.92	4,014.92	-
4	红利再投	2021 年 01 月 07 日	3,415.33	3,415.33	-
5	红利再投	2021 年 01 月 08 日	3,538.99	3,538.99	-
6	红利再投	2021 年 01 月 11 日	9,536.11	9,536.11	-
7	红利再投	2021 年 01 月 12 日	3,087.18	3,087.18	-
8	红利再投	2021 年 01 月 13 日	3,096.18	3,096.18	-
9	红利再投	2021 年 01 月 14 日	4,259.50	4,259.50	-
10	红利再投	2021 年 01 月 15 日	4,087.80	4,087.80	-
11	红利再投	2021 年 01 月 18 日	10,804.63	10,804.63	-
12	红利再投	2021 年 01 月 19 日	4,355.38	4,355.38	-
13	红利再投	2021 年 01 月 20 日	3,815.38	3,815.38	-
14	红利再投	2021 年 01 月 21 日	3,439.11	3,439.11	-
15	红利再投	2021 年 01 月 22 日	3,532.00	3,532.00	-
16	红利再投	2021 年 01 月 25 日	10,784.34	10,784.34	-
17	红利再投	2021 年 01 月 26 日	4,241.95	4,241.95	-
18	红利再投	2021 年 01 月 27 日	3,939.40	3,939.40	-
19	红利再投	2021 年 01 月 28 日	4,530.86	4,530.86	-
20	红利再投	2021 年 01 月 29 日	4,433.23	4,433.23	-
21	红利再投	2021 年 02 月 01 日	12,242.73	12,242.73	-
22	红利再投	2021 年 02 月 02 日	4,265.94	4,265.94	-
23	红利再投	2021 年 02 月 03 日	4,152.72	4,152.72	-
24	红利再投	2021 年 02 月 04 日	4,067.02	4,067.02	-
25	红利再投	2021 年 02 月 05 日	3,759.85	3,759.85	-
26	红利再投	2021 年 02 月 08 日	12,169.19	12,169.19	-
27	红利再投	2021 年 02 月 09 日	3,715.04	3,715.04	-
28	红利再投	2021 年 02 月 10 日	3,684.94	3,684.94	-
29	红利再投	2021 年 02 月 18 日	28,955.63	28,955.63	-
30	红利再投	2021 年 02 月 19 日	3,474.06	3,474.06	-
31	红利再投	2021 年 02 月 22 日	10,135.18	10,135.18	-
32	红利再投	2021 年 02 月 23 日	3,377.15	3,377.15	-
33	红利再投	2021 年 02 月 24 日	4,975.36	4,975.36	-
34	红利再投	2021 年 02 月 25 日	3,381.48	3,381.48	-
35	红利再投	2021 年 02 月 26 日	3,481.64	3,481.64	-
36	红利再投	2021 年 03 月 01 日	10,187.36	10,187.36	-
37	红利再投	2021 年 03 月 02 日	3,337.30	3,337.30	-

38	红利再投	2021 年 03 月 03 日	3,419.07	3,419.07	-
39	红利再投	2021 年 03 月 04 日	3,516.28	3,516.28	-
40	红利再投	2021 年 03 月 05 日	4,823.70	4,823.70	-
41	红利再投	2021 年 03 月 08 日	11,032.10	11,032.10	-
42	红利再投	2021 年 03 月 09 日	3,302.76	3,302.76	-
43	红利再投	2021 年 03 月 10 日	3,324.90	3,324.90	-
44	红利再投	2021 年 03 月 11 日	3,555.13	3,555.13	-
45	红利再投	2021 年 03 月 12 日	4,766.18	4,766.18	-
46	红利再投	2021 年 03 月 15 日	9,419.37	9,419.37	-
47	红利再投	2021 年 03 月 16 日	3,192.75	3,192.75	-
48	红利再投	2021 年 03 月 17 日	3,203.16	3,203.16	-
49	红利再投	2021 年 03 月 18 日	3,857.87	3,857.87	-
50	红利再投	2021 年 03 月 19 日	3,478.66	3,478.66	-
51	红利再投	2021 年 03 月 22 日	10,331.76	10,331.76	-
52	红利再投	2021 年 03 月 23 日	3,325.92	3,325.92	-
53	红利再投	2021 年 03 月 24 日	3,357.49	3,357.49	-
54	红利再投	2021 年 03 月 25 日	3,344.12	3,344.12	-
55	红利再投	2021 年 03 月 26 日	3,404.95	3,404.95	-
56	红利再投	2021 年 03 月 29 日	11,086.66	11,086.66	-
57	红利再投	2021 年 03 月 30 日	3,535.06	3,535.06	-
58	红利再投	2021 年 03 月 31 日	3,528.43	3,528.43	-
合计			332,548.33	332,548.33	

§ 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

本报告期内无单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20%。

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及基金托管人住所

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 04 月 22 日