

# 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

## 2022 年第 1 季度报告

2022 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 04 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|            |                                                                                                                                                                                                                  |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 华泰保兴安盈                                                                                                                                                                                                           |
| 基金主代码      | 007385                                                                                                                                                                                                           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                           |
| 基金合同生效日    | 2019 年 05 月 06 日                                                                                                                                                                                                 |
| 报告期末基金份额总额 | 541,990,162.96 份                                                                                                                                                                                                 |
| 投资目标       | 通过对股票、固定收益证券和现金等大类资产适度配置，运用稳健的个股和个券投资策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。                                                                                                                                             |
| 投资策略       | <p>封闭期内，本基金遵循经济周期性波动规律，动态把握不同资产类别在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，追求股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置。在严格控制投资风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。</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，减小基金净值的波动。</p> |
| 业绩比较基准     | 沪深 300 指数收益率*10%+中债总指数（全价）收益率*90%                                                                                                                                                                                |

|        |                                           |
|--------|-------------------------------------------|
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。 |
| 基金管理人  | 华泰保兴基金管理有限公司                              |
| 基金托管人  | 中国工商银行股份有限公司                              |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2022 年 01 月 01 日-2022 年 03 月 31 日） |
|-----------------|----------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | -7,065,921.46                          |
| 2. 本期利润         | 8,420,430.81                           |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0161                                 |
| 4. 期末基金资产净值     | 713,280,301.11                         |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.3160                                 |

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

2、上述基金业绩指标不包括持有人认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。

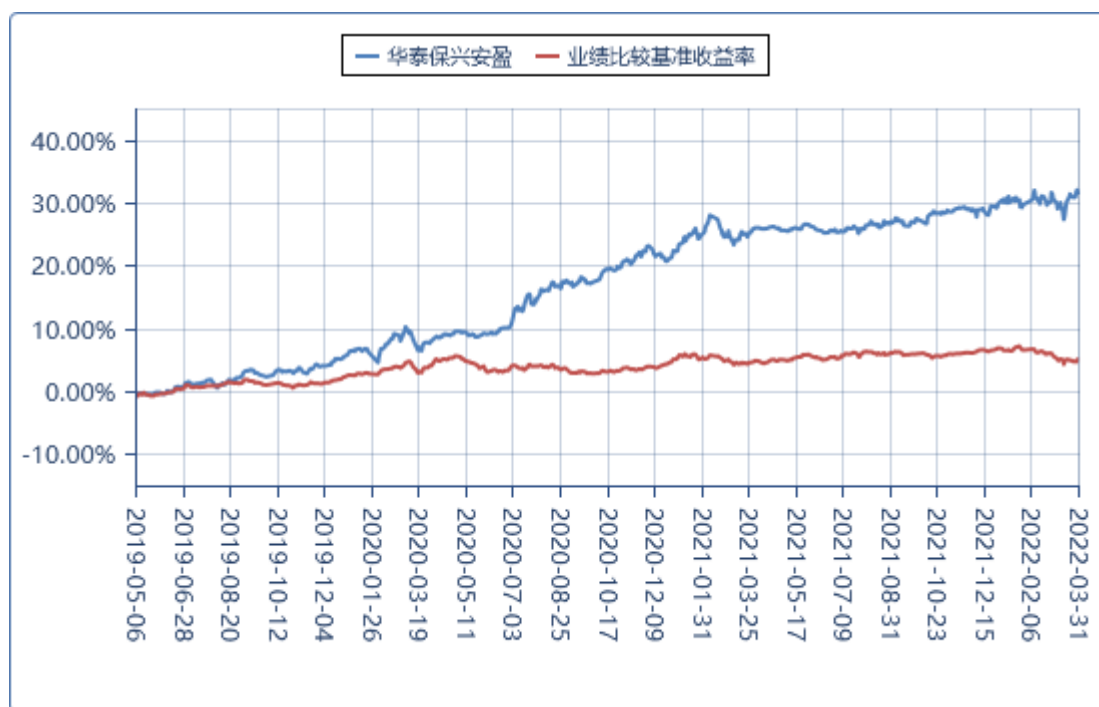
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 1.15%      | 0.52%         | -1.76%         | 0.18%                 | 2.91%  | 0.34% |
| 过去六个月          | 2.97%      | 0.41%         | -0.91%         | 0.15%                 | 3.88%  | 0.26% |
| 过去一年           | 4.40%      | 0.32%         | 0.32%          | 0.14%                 | 4.08%  | 0.18% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 31.60%     | 0.32%         | 5.29%          | 0.14%                 | 26.31% | 0.18% |

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*10%+中债总指数（全价）收益率\*90%。

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



## § 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 |        |                                                                                                                                   |
| 赵旭照 | 基金经理 | 2019 年 05 月 06 日 | -    | 7 年    | 北京大学金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员。2016 年 12 月加入华泰保兴基金管理有限公司，历任公司研究部研究员，现任研究部总经理助理。                                                      |
| 周咏梅 | 基金经理 | 2019 年 05 月 06 日 | -    | 15 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，现任固定收益投资部副总经理。 |

### 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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

股票方面，一季度国内宏观经济压力继续加大，尤其是 3 月份以来国内疫情再度爆发，部分重点城市

疫情严重，对经济运行带来额外的冲击，同时，国外环境纷繁复杂，俄乌战争爆发，大宗商品暴涨，美联储开始加息，美债收益率快速上行。在多重利空交织下，A 股一季度出现了较大幅度的下跌，申万一级行业中，除房地产、银行等少数稳增长行业录得正收益外，其他行业均出现不同程度下跌，多个行业跌幅超过 20%。债券方面，一季度债券收益率先下后上。1 月中旬央行降息，10 年国债收益率跌破 2.7%。春节后，房地产政策放松，叠加金融数据明显走强，债市开始回调。3 月上旬，银行理财及基金被赎回，债市波动剧烈，10 年国债收益率一度突破 2.85%，随着重点城市疫情的爆发，基本面下行压力加大，10 年国债收益率在 2.8% 附近窄幅震荡。信用债方面，一季度违约风险集中在民企房地产公司，高等级信用债收益率小幅上行，信用利差有所走阔。

报告期内，在账户操作层面，我们保持了偏中性的股票仓位，主要配置了生猪养殖和部分优质制造业个股。债券方面，我们继续持有中短久期的高等级信用债，并减持了转债。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为 1.3160 元，本报告期内基金份额净值增长率为 1.15%，同期业绩比较基准收益率为-1.76%。

#### 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 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  | 权益投资    | 151,371,992.70 | 21.20        |
|    | 其中：股票   | 151,371,992.70 | 21.20        |
| 2  | 基金投资    | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资  | 510,821,962.28 | 71.53        |
|    | 其中：债券   | 510,821,962.28 | 71.53        |
|    | 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          | 45,004,315.07  | 6.30   |
|   | 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      | 6,836,386.87   | 0.96   |
| 8 | 其他资产              | 102,837.62     | 0.01   |
| 9 | 合计                | 714,137,494.54 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 48,287,540.00  | 6.77         |
| B  | 采矿业              | 18,734.32      | 0.00         |
| C  | 制造业              | 94,892,727.40  | 13.30        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 310,950.00     | 0.04         |
| E  | 建筑业              | 3,878,126.00   | 0.54         |
| F  | 批发和零售业           | 58,120.56      | 0.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 16,541.00      | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 56,572.02      | 0.01         |
| J  | 金融业              | 3,791,601.40   | 0.53         |
| K  | 房地产业             | -              | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 18,861.96      | 0.00         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 26,465.94      | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 15,752.10      | 0.00         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 151,371,992.70 | 21.22        |

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 603363 | 傲农生物 | 1,600,000 | 38,080,000.00 | 5.34         |
| 2  | 002714 | 牧原股份 | 539,000   | 30,647,540.00 | 4.30         |
| 3  | 002567 | 唐人神  | 1,799,950 | 18,899,475.00 | 2.65         |
| 4  | 300498 | 温氏股份 | 800,000   | 17,640,000.00 | 2.47         |
| 5  | 002472 | 双环传动 | 700,000   | 14,553,000.00 | 2.04         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 6  | 601877 | 正泰电器 | 200,000 | 7,916,000.00 | 1.11 |
| 7  | 002241 | 歌尔股份 | 177,000 | 6,088,800.00 | 0.85 |
| 8  | 601702 | 华峰铝业 | 480,000 | 4,492,800.00 | 0.63 |
| 9  | 601117 | 中国化学 | 400,000 | 3,856,000.00 | 0.54 |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 80,000  | 3,744,000.00 | 0.52 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 10,222,281.77  | 1.43         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 170,719,402.04 | 23.93        |
|    | 其中：政策性金融债 | 46,018,800.00  | 6.45         |
| 4  | 企业债券      | 153,990,784.12 | 21.59        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 96,941,540.56  | 13.59        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 78,947,953.79  | 11.07        |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 510,821,962.28 | 71.62        |

#### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码    | 债券名称          | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 132015  | 18 中油 EB      | 380,000 | 39,596,395.62 | 5.55         |
| 2  | 2128027 | 21 招商银行小微债 03 | 350,000 | 35,624,975.34 | 4.99         |
| 3  | 190214  | 19 国开 14      | 300,000 | 30,514,693.15 | 4.28         |
| 4  | 188134  | 21 华泰 G5      | 250,000 | 25,765,745.21 | 3.61         |
| 5  | 110059  | 浦发转债          | 239,070 | 25,233,740.25 | 3.54         |

#### 5.6 报告期末按公允价值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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。



## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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 招商银行小微债 03（代码：2128027）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2021 年 5 月 21 日公布信息显示，2021 年 5 月 17 日，中国银保监会针对招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品、理财产品之间风险隔离不到位、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准、同业投资接受第三方金融机构信用担保、理财资金池化运作、利用理财产品准备金调节收益、高净值客户认定不审慎、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准、投资集合资金信托计划人数超限、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品、信贷资产非真实转让、全权委托业务不规范、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失、票据转贴现假卖断屡查屡犯、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目、理财资金认购商业银行增发的股票、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产、为定制公募基金提供投资顾问、为本行承销债券兑付提供资金支持、协助发行人以非市场化的价格发行债券、瞒报案件信息等二十七项违法违规事实，对招商银行处以罚款 7170 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〕16 号）。

经中国银保监会官网 2022 年 3 月 25 日公布信息显示，2022 年 3 月 21 日，中国银保监会针对招商银

行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贷款核销业务 EAST 数据、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据、漏报贷款承诺业务 EAST 数据、漏报委托贷款业务 EAST 数据、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差、EAST 系统分户账与总账比对不一致、漏报分户账 EAST 数据、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报等十三项违法违规事实，对招商银行处以罚款 300 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〔2022〕21 号）。

2、19 国开 14（代码：190214）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2022 年 3 月 25 日公布信息显示，2022 年 3 月 21 日，中国银保监会针对国家开发银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据、漏报贸易融资业务 EAST 数据、漏报贷款核销业务 EAST 数据、信贷资产转让业务 EAST 数据存在偏差、未报送债券投资业务 EAST 数据、漏报权益类投资业务 EAST 数据、漏报跟单信用证业务 EAST 数据、漏报保函业务 EAST 数据、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差、漏报分户账 EAST 数据、漏报授信信息 EAST 数据、EAST 系统《表外授信业务》表错报、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报、EAST 系统《关联关系》表漏报、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报、理财产品登记不规范等十七项违法违规事实，对国家开发银行处以罚款 440 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〔2022〕8 号）。

3、浦发转债（代码：110059）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会上海监管局官网 2021 年 4 月 30 日公布信息显示，2021 年 4 月 23 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”）2016 年 5 月至 2019 年 1 月未按规定开展代销业务的违法违规事实，对浦发银行处以责令改正并处罚款共计 760 万元的行政处罚，详见《上海银保监局行政处罚信息公开表》（沪银保监罚决字〔2021〕29 号）。

经中国银保监会官网 2021 年 7 月 16 日公布信息显示，2021 年 7 月 13 日，中国银保监会针对浦发银行监管发现的问题屡查屡犯、配合现场检查不力、内部控制制度修订不及时、信息系统管控有效性不足、未向监管部门真实反映业务数据、净值型理财产品估值方法使用不准确、未严格执行理财投资合作机构名单制管理、理财产品相互交易调节收益、使用理财资金偿还本行贷款、理财产品发行审批管理不到位、权益类理财产品投资非权益类资产超比例、公募理财产品持有单只证券市值超比例、投资集合资金信托计划

人数超限、面向非机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券、出具与事实不符的理财产品投资清单、私募理财产品销售文件未约定投资者冷静期、投资者投资私募理财产品金额不符合监管要求、理财产品资产配置与产品说明书约定不符、理财产品信息披露不合规、理财产品信息登记不规范、理财业务流动性风险管理不审慎、理财投资股票类业务管理不审慎、同业存款记入其他企业存款核算、同业投资投后检查流于形式、风险加权资产计量不准确、为无衍生品交易资格的机构发行结构性存款提供通道、结构性存款未实际嵌入金融衍生品、未落实委托贷款专户管理要求、借助通道违规发放委托贷款，承担实质性风险、委托贷款投向不合规、违规向委托贷款借款人收取手续费等三十一项违法违规行为，对浦发银行处以罚款 6920 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〕27 号）。

经中国银保监会官网 2022 年 3 月 25 日公布信息显示，2022 年 3 月 21 日，中国银保监会针对浦发银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据、漏报贸易融资业务 EAST 数据、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据、漏报债券投资业务 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据、漏报公募基金投资业务 EAST 数据、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据、错报跟单信用证业务 EAST 数据、错报保函业务 EAST 数据、错报贷款承诺业务 EAST 数据、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差、漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据、EAST 系统《表外授信业务》表错报、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报等十六项违法违规事实，对浦发银行处以罚款 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〔2022〕25 号）。

本基金投资 21 招商银行小微债 03（代码：2128027）、19 国开 14（代码：190214）以及浦发转债（代码：110059）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 招商银行小微债 03（代码：2128027）、19 国开 14（代码：190214）以及浦发转债（代码：110059）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。

### 5.11.2 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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 102,837.62 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 102,837.62 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1  | 132015 | 18 中油 EB | 39,596,395.62 | 5.55         |
| 2  | 110059 | 浦发转债     | 25,233,740.25 | 3.54         |
| 3  | 113044 | 大秦转债     | 5,433,417.81  | 0.76         |
| 4  | 110057 | 现代转债     | 2,434,848.10  | 0.34         |
| 5  | 113037 | 紫银转债     | 2,085,827.95  | 0.29         |
| 6  | 110079 | 杭银转债     | 498,463.60    | 0.07         |
| 7  | 113050 | 南银转债     | 225,660.56    | 0.03         |
| 8  | 123107 | 温氏转债     | 139,850.58    | 0.02         |

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 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

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 520,801,683.52 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 46,268,315.25  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 25,079,835.81  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 报告期期末基金份额总额               | 541,990,162.96 |

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情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有过本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目              | 持有份额总数        | 持有份额占基金总<br>份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额占基金总<br>份额比例 | 发起份额承诺持有<br>期限        |
|-----------------|---------------|------------------|---------------|------------------|-----------------------|
| 基金管理人固有<br>资金   | -             | -                | -             | -                | -                     |
| 基金管理人高级<br>管理人员 | -             | -                | -             | -                | -                     |
| 基金经理等人员         | -             | -                | -             | -                | -                     |
| 基金管理人股东         | 10,000,000.00 | 1.85%            | 10,000,000.00 | 1.85%            | 自基金合同生效之<br>日起不少于 3 年 |
| 其他              | -             | -                | -             | -                | -                     |
| 合计              | 10,000,000.00 | 1.85%            | 10,000,000.00 | 1.85%            | -                     |

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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%。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金募集的文件

- 2、《华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《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托管协议》
- 4、《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

## 10.2 存放地点

基金管理人办公场所及基金托管人住所

## 10.3 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](http://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  
2022 年 04 月 22 日