

华泰保兴货币市场基金  
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

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	6,956,178,564.04 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	24,199,939.22 份	6,931,978,624.82 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（2022年01月01日-2022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	95,228.86	44,267,668.95
2.本期利润	95,228.86	44,267,668.95
3.期末基金资产净值	24,199,939.22	6,931,978,624.82

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	0.4859%	0.0010%	0.3329%	0.0000%	0.1530%	0.0010%
过去六个月	1.0044%	0.0010%	0.6732%	0.0000%	0.3312%	0.0010%
过去一年	2.0201%	0.0010%	1.3500%	0.0000%	0.6701%	0.0010%
过去三年	6.3120%	0.0011%	4.0537%	0.0000%	2.2583%	0.0011%
自基金合同生效起 至今	13.4676%	0.0024%	6.6834%	0.0000%	6.7842%	0.0024%

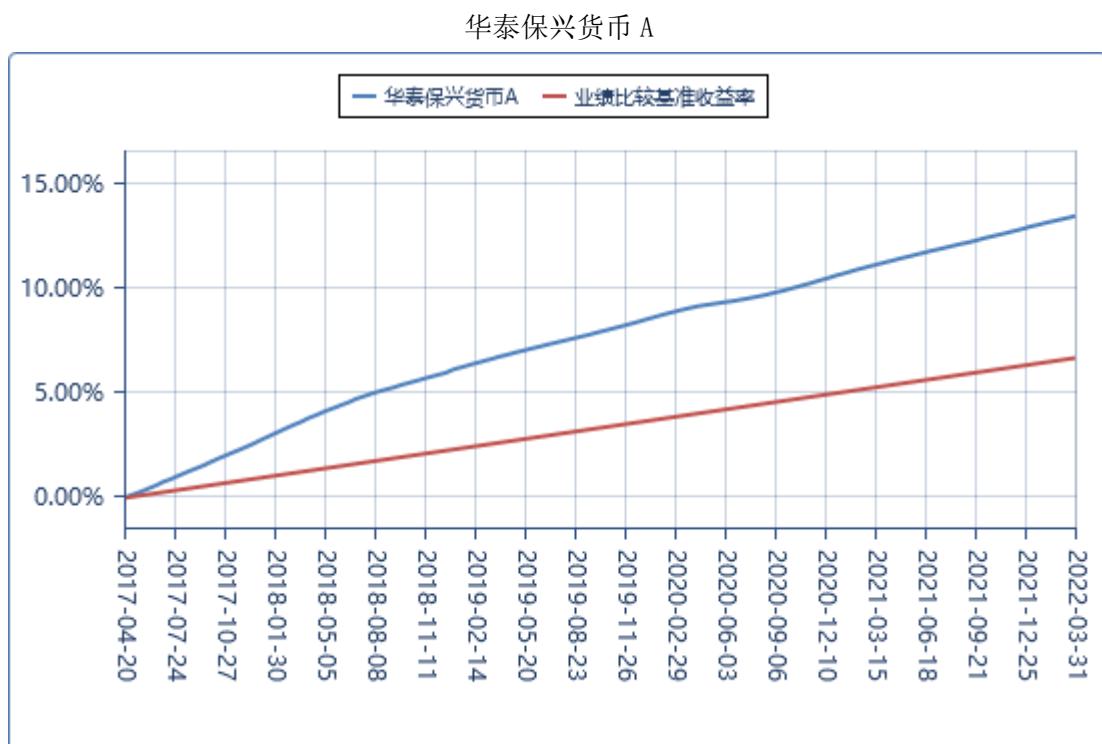
华泰保兴货币 B

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	0.5451%	0.0010%	0.3329%	0.0000%	0.2122%	0.0010%
过去六个月	1.1257%	0.0010%	0.6732%	0.0000%	0.4525%	0.0010%

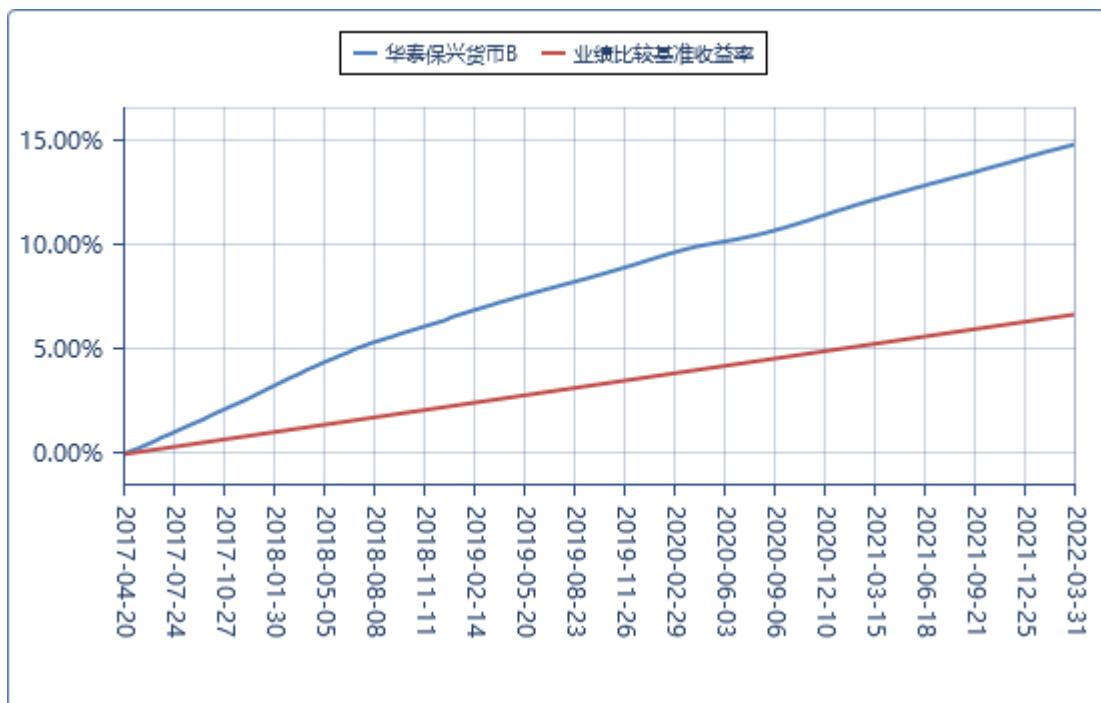
过去一年	2.2658%	0.0010%	1.3500%	0.0000%	0.9158%	0.0010%
过去三年	7.0815%	0.0011%	4.0537%	0.0000%	3.0278%	0.0011%
自基金合同生效起至今	14.8250%	0.0024%	6.6834%	0.0000%	8.1416%	0.0024%

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 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		
王海明	基金经理	2019 年 09 月 23 日	-	5 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遵规守信情况说明

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。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，结合投资交易系统中的公平交易模块，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

2022 年一季度经济起伏，其中疫情影响较大。1-2 月，新冠疫情零星爆发，总体控制较好。3 月开始，国内疫情的蔓延开始显著影响经济。从 1-2 月的经济数据来看，社消同比 6.7%，固定资产投资同比 12.2%，其中房地产投资同比 3.7%。但在疫情影响下，3 月的 PMI 开始回落。从高频数据来看，房地产销售同比在 -40% 左右，对后续的房地产投资带来压力。出口方面，同比高基数影响，叠加海外供应链放开、发达国家财政刺激政策退出，同比逐步回落走势。海外方面，美国失业率快速下降，通胀高企，导致美联储的加息节奏加快，可能最早在 5 月份开始缩表。10 年美债大幅上行，中美利差接近倒挂。国内物价方面，CPI 温和上涨，受猪肉价格同比下跌影响较大。在俄乌冲突爆发情况下，原油价格暴涨，可能形成输入型通胀。

国内货币政策方面，加大稳健的货币政策实施力度，增强前瞻性、精准性、自主性，发挥好货币政策工具的总量和结构双重功能。从债券市场来看，1月，在预期会宽松货币情况下，收益率下行。2月，社融数据较超预期，市场预期宽信用政策效果显现，收益率向上回调。从后续的经济金融数据来看，经济恢复的效果不明显。3月开始的疫情蔓延，对制造业和出口产生较大的不利影响。后续来看，需要跟踪 PMI、社融增速和房地产政策等变量。

报告期内，本基金的运作以保证资产的流动性为重要任务，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 0.4859%，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 0.5451%，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	5,070,400,763.90	68.90
	其中：债券	5,070,400,763.90	68.90
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	2,183,361,392.81	29.67
	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	5,299,255.07	0.07
4	其他资产	100,000,000.00	1.36
5	合计	7,359,061,411.78	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	2.97
	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	400,024,958.90	5.75
	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	51
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

### 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	70.37	5.75
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含) — 60 天	8.24	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含) — 90 天	4.98	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含) — 120 天	6.87	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含) — 397 天(含)	13.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.24	5.75

## 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

本基金报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 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	277,464,168.45	3.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	220,740,334.34	3.17
	其中：政策性金融债	220,740,334.34	3.17
4	企业债券	60,434,031.77	0.87
5	企业短期融资券	251,545,330.88	3.62
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,260,216,898.46	61.24
8	其他	-	-
9	合计	5,070,400,763.90	72.89
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	112111121	21 平安银行 CD121	3,000,000	299,547,753.02	4.31
2	112216046	22 上海银行 CD046	2,000,000	199,922,828.30	2.87
3	112217007	22 光大银行 CD007	2,000,000	199,639,439.95	2.87
4	012105334	21 大唐集 SCP011	1,000,000	100,600,814.17	1.45
5	112103036	21 农业银行 CD036	1,000,000	100,000,000.00	1.44
5	112115108	21 民生银行 CD108	1,000,000	100,000,000.00	1.44
7	112114043	21 江苏银行 CD043	1,000,000	99,968,452.75	1.44
8	112110151	21 兴业银行 CD151	1,000,000	99,961,659.45	1.44
9	112114045	21 江苏银行 CD045	1,000,000	99,952,427.14	1.44
10	112215011	22 民生银行 CD011	1,000,000	99,913,037.49	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	0.0453%
报告期内偏离度的最低值	0.0046%

报告期内每个工作日偏离度的简单平均值	0.0253%
--------------------	---------

### 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，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，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 平安银行 CD121（代码：112111121）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会云南监管局官网 2021 年 6 月 8 日公布信息显示，2021 年 5 月 28 日，中国银保监会云南监管局针对平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款、用于承接处置本行其他贷款风险，固定资产授信严重不审慎、贷款用途审查监控不到位、贷款资金挪用于借款人母公司归还股票质押融资，流动资金贷款用途审查监控不到位、贷款资金部分回流借款人用作银行承兑汇票质押存单，固定资产贷款用途审查监控不到位、贷款资金部分回流借款人或借款人关联公司用作银行承兑汇票保证金及购买理财产品等违法违规事实，对平安银行处以罚款人民币 210 万元的行政处罚，详见《中国银保监会云南监管局行政处罚信息公开表》（云银保监罚决字〔2021〕34 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，中国银保监会针对平安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、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贸易融资业务 EAST 数据、漏报抵押物价值 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据、漏报投资资产管理产品业务 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、EAST 系统《表外授信业务》表错报、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报、EAST 系统《关联关系》表漏报、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报等十五项违法违规事实，对招商银行处以罚款 400 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〕24 号）。

2、22 上海银行 CD046（代码：112216046）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 25 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”）未按照规定进行信息披露的违法违规事实，对上海银行处以责令改正、并处罚款 30 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〕31 号）。

经中国银保监会上海监管局官网 2021 年 7 月 12 日公布信息显示，2021 年 7 月 2 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”）2018 年 12 月该行某笔同业投资房地产企业合规审查严重违反审慎经营规则、2019 年 11 月该行某笔经营性物业贷款授信后管理严重违反审慎经营规则、2019 年 2 月至 4 月该行部分个人贷款违规用于购房、2020 年 5 月至 7 月该行对部分个人住房贷款借款人偿债能力审查不审慎、2020 年 7 月该行在助贷环节对第三方机构收费管理严重违反审慎经营规则、2020 年 6 月至 12 月该行部分业务以贷收费等六项违法违规事实，对上海银行处以责令改正、并处罚款共计 460 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〕72 号）。

经中国银保监会上海监管局官网 2021 年 11 月 30 日公布信息显示，2021 年 11 月 19 日，中国银保监会上海监管局针对上海银行未按规定报送统计报表的违法违规事实，对上海银行处以罚款 20 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〕174 号）。

经中国银保监会上海监管局官网 2022 年 2 月 23 日公布信息显示，2022 年 2 月 14 日，中国银保监会上海监管局针对上海银行 2015 年 3 月至 7 月该行同业投资业务违规接受第三方金融机构担保的违法违规事实，对上海银行处以责令改正、并处罚款 240 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〔2022〕13 号）。

3、22 光大银行 CD007（代码：112217007）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以

下违法违规行为：逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贷款核销业务 EAST 数据、漏报抵押物价值 EAST 数据、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据、漏报权益类投资业务 EAST 数据、未报送其他担保类业务 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、漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据、未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报、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《个人信贷业务借据》表错报、2018 年行政处罚问题依然存在等十八项违法违规事实，对光大银行处以罚款 490 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〕18 号）。

#### 4、21 农业银行 CD036（代码：112103036）为本基金的前十大持仓证券。

经中国银保监会官网 2021 年 12 月 14 日公布信息显示，2021 年 12 月 8 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“中国农业银行”）制定文件要求企业对公账户必须开通属于该行收费项目的动账短信通知服务、侵害客户自主选择权，农业银行河南分行和新疆分行转发并执行总行强制企业对公账户开通动账短信通知服务要求、违法行为情节较为严重等两项违法违规行为，对中国农业银行处以罚款 150 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〕38 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，中国银保监会针对中国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以下违法违规行为：漏报贷款核销业务 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据、未报送公募基金投资业务 EAST 数据、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据、其他担保类业务 EAST 数据存在偏差、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、未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报、EAST 系统《表外授信业务》表错报、EAST 系统《个人信贷业务借据》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、理财产品登记不规范、2018 年行政处罚问题依然存在等十七项违法违规事实，对中国农业银行处以罚款 480 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〕12 号）。

#### 5、21 民生银行 CD108（代码：112115108）和 22 民生银行 CD011（代码：112215011）为本基金的前

十大持仓证券。

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，中国银保监会针对中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）监管发现问题屡查屡犯，检查发现问题整改不到位，对责任人员的责任认定和问责不到位，内部制度管理不足、个别制度与监管要求冲突，配合现场检查不力，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，未严格执行理财投资合作机构名单制管理，理财业务整改转型不符合监管要求，违规调整理财产品收益，理财产品收益兑付不合规，违规调节理财业务利润，使用内部账户截留理财产品浮动管理费收入和承接风险资产，理财产品间相互交易资产调节收益，理财产品未实现账实相符、单独托管，理财产品投资清单未反映真实情况、合格投资者认定不审慎，开放式公募理财产品投资杠杆水平超标，公募理财产品持有单只证券市值比例超标，开放式公募理财产品流动性资产持有比例不达标，理财产品信息登记不规范，理财产品信息披露不规范，理财产品托管不尽职，违规开展委托资产管理业务，同业业务未实行专营部门制，同业业务交易对手管理不健全，同业业务统一授信管理不到位，违规将转贴现票据转为投资资产、未真实反映票据规模，会计核算不规范，发行虚假结构性存款产品，未对信贷资产收益权转让业务对应资产计提资本，委托贷款委托人资质审查不审慎等三十一项违法违规事实，对中国民生银行处以罚款 11450 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〕26 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，中国银保监会针对中国民生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：未报送贸易融资业务 EAST 数据、漏报贷款核销业务 EAST 数据、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据、债券投资业务 EAST 数据存在偏差、未报送权益类投资业务 EAST 数据、未报送公募基金投资业务 EAST 数据、未报送其他担保类业务 EAST 数据、未报送不可无条件撤销的贷款承诺业务 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 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差、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、报送不实数据、面向非机构客户发行的理财产品投资不良资产等十六项违法违规事实，对中国民生银行处以罚款 490 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〕20 号）。

6、21 兴业银行 CD151（代码：112110151）为本基金的前十大持仓证券。

经中国人民银行官网 2021 年 8 月 20 日公布信息显示，2021 年 8 月 13 日，中国人民银行针对兴业银

行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定的违法行为，对兴业银行处以罚款 5 万元的行政处罚，详见中国人民银行官网-行政处罚公示-银罚字【2021】26 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，中国银保监会针对兴业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：漏报贸易融资业务 EAST 数据、漏报贷款核销业务 EAST 数据、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据、漏报权益类投资业务 EAST 数据、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据、未报送跟单信用证业务 EAST 数据、漏报贷款承诺业务 EAST 数据、未报送委托贷款业务 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、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报等十四项违法违规事实，对兴业银行处以罚款 350 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〕22 号）。

本基金投资 21 平安银行 CD121（代码：112111121）、22 上海银行 CD046（代码、112216046）、22 光大银行 CD007（代码：112217007）、21 农业银行 CD036（代码：112103036）、21 民生银行 CD108（代码：112115108）、21 兴业银行 CD151（代码：112110151）以及 22 民生银行 CD011（代码：112215011）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 平安银行 CD121（代码：112111121）、22 上海银行 CD046（代码、112216046）、22 光大银行 CD007（代码：112217007）、21 农业银行 CD036（代码：112103036）、21 民生银行 CD108（代码：112115108）、21 兴业银行 CD151（代码：112110151）以及 22 民生银行 CD011（代码：112215011）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	-
4	应收申购款	100,000,000.00
5	其他应收款	-
6	其他	-

7	合计	100,000,000.00
---	----	----------------

### 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	14,976,524.47	7,528,940,543.36
报告期内期间基金总申购份额	33,703,311.90	10,695,578,955.01
减：报告期内期间基金总赎回份额	24,479,897.15	11,292,540,873.55
报告期末基金份额总额	24,199,939.22	6,931,978,624.82

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管理明细

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	2022 年 01 月 04 日	16,256.35	16,256.35	0.0000
2	红利再投	2022 年 01 月 05 日	3,612.20	3,612.20	0.0000
3	红利再投	2022 年 01 月 06 日	3,066.61	3,066.61	0.0000
4	红利再投	2022 年 01 月 07 日	3,017.67	3,017.67	0.0000
5	红利再投	2022 年 01 月 10 日	9,076.62	9,076.62	0.0000
6	红利再投	2022 年 01 月 11 日	2,926.17	2,926.17	0.0000
7	红利再投	2022 年 01 月 12 日	2,850.89	2,850.89	0.0000
8	红利再投	2022 年 01 月 13 日	2,832.11	2,832.11	0.0000
9	红利再投	2022 年 01 月 14 日	2,844.09	2,844.09	0.0000
10	红利再投	2022 年 01 月 17 日	8,494.44	8,494.44	0.0000
11	红利再投	2022 年 01 月 18 日	2,829.13	2,829.13	0.0000
12	红利再投	2022 年 01 月 19 日	2,890.21	2,890.21	0.0000
13	红利再投	2022 年 01 月 20 日	3,342.47	3,342.47	0.0000
14	红利再投	2022 年 01 月 21 日	2,911.59	2,911.59	0.0000
15	红利再投	2022 年 01 月 24 日	8,503.31	8,503.31	0.0000
16	红利再投	2022 年 01 月 25 日	4,273.54	4,273.54	0.0000
17	红利再投	2022 年 01 月 26 日	3,055.74	3,055.74	0.0000

18	红利再投	2022 年 01 月 27 日	3,108.26	3,108.26	0.0000
19	红利再投	2022 年 01 月 28 日	3,169.55	3,169.55	0.0000
20	红利再投	2022 年 02 月 07 日	31,945.63	31,945.63	0.0000
21	红利再投	2022 年 02 月 08 日	3,095.43	3,095.43	0.0000
22	红利再投	2022 年 02 月 09 日	2,873.71	2,873.71	0.0000
23	红利再投	2022 年 02 月 10 日	2,802.16	2,802.16	0.0000
24	红利再投	2022 年 02 月 11 日	2,863.93	2,863.93	0.0000
25	红利再投	2022 年 02 月 14 日	8,514.31	8,514.31	0.0000
26	红利再投	2022 年 02 月 15 日	2,771.70	2,771.70	0.0000
27	红利再投	2022 年 02 月 16 日	2,729.81	2,729.81	0.0000
28	红利再投	2022 年 02 月 17 日	2,757.46	2,757.46	0.0000
29	红利再投	2022 年 02 月 18 日	2,724.67	2,724.67	0.0000
30	红利再投	2022 年 02 月 21 日	8,695.77	8,695.77	0.0000
31	红利再投	2022 年 02 月 22 日	2,756.49	2,756.49	0.0000
32	红利再投	2022 年 02 月 23 日	2,811.77	2,811.77	0.0000
33	红利再投	2022 年 02 月 24 日	3,271.31	3,271.31	0.0000
34	红利再投	2022 年 02 月 25 日	2,826.77	2,826.77	0.0000
35	红利再投	2022 年 02 月 28 日	8,613.12	8,613.12	0.0000
36	红利再投	2022 年 03 月 01 日	2,857.15	2,857.15	0.0000
37	红利再投	2022 年 03 月 02 日	2,854.61	2,854.61	0.0000
38	红利再投	2022 年 03 月 03 日	2,794.16	2,794.16	0.0000
39	红利再投	2022 年 03 月 04 日	2,723.44	2,723.44	0.0000
40	红利再投	2022 年 03 月 07 日	8,077.41	8,077.41	0.0000
41	红利再投	2022 年 03 月 08 日	2,668.85	2,668.85	0.0000
42	红利再投	2022 年 03 月 09 日	3,911.11	3,911.11	0.0000
43	红利再投	2022 年 03 月 10 日	3,844.49	3,844.49	0.0000
44	红利再投	2022 年 03 月 11 日	2,605.76	2,605.76	0.0000
45	红利再投	2022 年 03 月 14 日	8,073.68	8,073.68	0.0000
46	红利再投	2022 年 03 月 15 日	2,673.46	2,673.46	0.0000
47	红利再投	2022 年 03 月 16 日	3,484.51	3,484.51	0.0000
48	红利再投	2022 年 03 月 17 日	2,746.11	2,746.11	0.0000
49	红利再投	2022 年 03 月 18 日	2,768.36	2,768.36	0.0000
50	红利再投	2022 年 03 月 21 日	8,531.22	8,531.22	0.0000
51	红利再投	2022 年 03 月 22 日	2,782.09	2,782.09	0.0000
52	红利再投	2022 年 03 月 23 日	2,753.23	2,753.23	0.0000
53	红利再投	2022 年 03 月 24 日	2,693.04	2,693.04	0.0000
54	红利再投	2022 年 03 月 25 日	2,932.87	2,932.87	0.0000
55	红利再投	2022 年 03 月 28 日	11,606.11	11,606.11	0.0000

56	红利再投	2022 年 03 月 29 日	3,125.60	3,125.60	0.0000
57	红利再投	2022 年 03 月 30 日	4,073.62	4,073.62	0.0000
58	红利再投	2022 年 03 月 31 日	4,932.50	4,932.50	0.0000
合计			276,628.37	276,628.37	

注：基金申赎包含转换业务。

## § 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](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