

华泰保兴吉年福定期开放灵活配置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	华泰保兴吉年福
基金主代码	005522
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 28 日
报告期末基金份额总额	166,884,215.38 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，灵活运用多种投资策略，把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	（一）封闭期投资策略 本基金遵循经济周期性波动规律，通过定性与定量分析，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。 （二）开放期投资策略 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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中债总指数（全价）收益率*50%
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	-11,372,234.08
2. 本期利润	-8,337,616.90
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0500
4. 期末基金资产净值	225,917,229.51
5. 期末基金份额净值	1.3537

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。

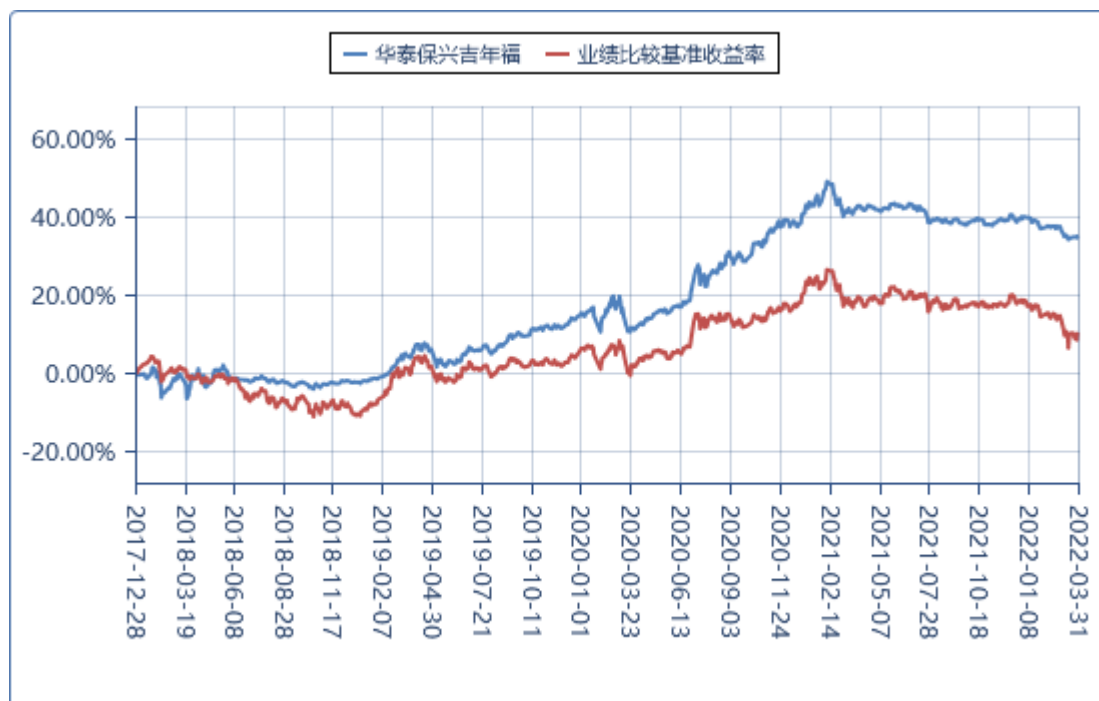
3.2 基金净值表现

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 ①	净值增长率 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	-3.56%	0.25%	-7.54%	0.74%	3.98%	-0.49%
过去六个月	-2.40%	0.24%	-6.43%	0.59%	4.03%	-0.35%
过去一年	-4.92%	0.26%	-7.18%	0.57%	2.26%	-0.31%
过去三年	28.25%	0.52%	7.53%	0.63%	20.72%	-0.11%
自基金合同生效起 至今	35.37%	0.53%	10.13%	0.65%	25.24%	-0.12%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*50%+中债总指数（全价）收益率*50%。

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	2018 年 01 月 15 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。
赵健	基金经理	2018 年 06 月 12 日	—	11 年	复旦大学硕士。历任海通证券股份有限公司研究所助理分析师、分析师、高级分析师、首席分析师。2016 年 8 月加入华泰保兴基金管理有限公司，现任研究部总经理。

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

1 季度经济整体偏弱，社融内生需求一般，但政策底已经出现，财政货币政策逐步发力，3 月下旬疫

情开始扩散，影响了物流和消费，短期经济压力较大，受此影响，一季度权益市场表现较差，创业板大幅调整。本基金坚持低回撤策略，在一季度保持了相对较低的仓位，重点配置了安全边际较高的通信、消费个股，寻找确定性收益。

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 1.3537 元，本报告期内基金份额净值增长率为-3.56%，同期业绩比较基准收益率为-7.54%。

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	权益投资	27,039,806.69	11.90
	其中：股票	27,039,806.69	11.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	81,492,957.87	35.86
	其中：债券	81,492,957.87	35.86
	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	88,100,000.00	38.76
	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	29,527,836.24	12.99
8	其他资产	1,111,772.54	0.49
9	合计	227,272,373.34	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	-	-
B	采矿业	161,380.00	0.07
C	制造业	21,458,410.89	9.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	124,100.00	0.05
E	建筑业	3,519,564.00	1.56
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	105,941.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	173,670.00	0.08
K	房地产业	1,399,688.00	0.62
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	97,052.80	0.04
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	27,039,806.69	11.97

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	300628	亿联网络	60,800	4,727,200.00	2.09
2	002832	比音勒芬	184,500	4,357,890.00	1.93
3	601117	中国化学	365,100	3,519,564.00	1.56
4	002372	伟星新材	116,200	2,377,452.00	1.05
5	600519	贵州茅台	1,200	2,062,800.00	0.91
6	603180	金牌厨柜	58,200	1,882,188.00	0.83
7	600690	海尔智家	65,700	1,517,670.00	0.67
8	002968	新大正	34,000	1,230,800.00	0.54
9	002594	比亚迪	4,500	1,034,100.00	0.46
10	000887	中鼎股份	67,400	1,011,674.00	0.45

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	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	20,542,371.51	9.09
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	21,043,513.92	9.31
8	同业存单	39,907,072.44	17.66
9	其他	—	—
10	合计	81,492,957.87	36.07

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	132009	17 中油 EB	200,330	21,043,513.92	9.31
2	2028029	20 交通银行 01	200,000	20,542,371.51	9.09
3	112103049	21 农业银行 CD049	200,000	19,958,727.67	8.83
4	112104029	21 中国银行 CD029	200,000	19,948,344.77	8.83

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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、20 交通银行 01（代码：2028029）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，中国银保监会针对交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）理财业务和同业业务制度不健全、理财业务数据与事实不符、部分理财业务发展与监管导向不符、理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资、理财资金违规投向土地储备项目、理财产品相互交易调节收益、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、公募理财产品投资单只证券超限额、理财资金违规投向交易所上市交易的股票、理财资金投资非标资产比照贷款管理不到位、私募理财产品销售文件未约定冷静期、开放式公募理财产品资产配置未达到流动性管理监管比例要求、理财产品信息登记不及时、理财产品信息披露不合规、同业业务交易对手名单调整不及时、将同业存款纳入一般性存款核算、同业账户管理不规范、违规增加政府性债务，且同业投资抵质押物风险管理有效性不足、结构性存款产品衍生品交易无真实交易对手和交易行为、未严格审查委托贷款资金来源、违规向委托贷款借款人收取手续费、利用理财资金与他行互投不良资产收益权，实现不良资产虚假出表、监管检查发现问题屡查屡犯等二十三项违法违规事实，对交通银行处以罚款 4100 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）28 号）。

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，中国人民银行针对交通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，对交通银行处以罚款 62 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】23 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，中国银保监会针对交通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：漏报不良贷款余额 EAST 数据、贸易融资业务 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、未报送权益类投资业务 EAST 数据、未报送其他担保类业务 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 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差、EAST 系统分户账与总账比对不一致、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十五项违法违规事实，对交通银行处以罚款 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〕15 号）。

2、21 农业银行 CD049（代码：112103049）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）。

3、21 中国银行 CD029（代码：112104029）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，中国银保监会针对中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款、违规向关系人发放信用贷款、向无资金缺口企业发放流动资金贷款、存款月末冲时点、为无真实贸易背景企业签发银行承兑汇票、贷款管理不严，信贷资金被挪用、票据贴现资金直接回流至出票人或其关联人账户、理财产品质押贸易融资业务风险控制有效性不足、超比例发放并购贷款、向未经备案的跨境并购业务提供并购贷款、违规为私募股权基金收购境内企业发放并购贷款、超授权期限办理汇出汇款融资业务、与名单外交易对手开展同业业务、违规为他行开立投融资性同业账户、以同业返存方式不当吸收存款、自营和代客理财业务未能实现风险隔离、面向一般客户销售的理财产品投资二级市场股票、未按规定向投资者充分披露理财产

品投资非标准化债权风险状况、违规向四证不全房地产项目提供融资、理财资金违规用于支付土地款或置换股东购地借款、理财资金违规用于土地储备项目、理财非标融资入股商业银行、理财非标融资用于商业银行注册验资、超授信额度提供理财非标融资、买入返售业务标的资产不合规、个人住房贷款业务搭售保险产品、单家分支行代销 3 家以上保险公司保险产品、主承销债券包销余券未通过风险处置专户处置、通过平移贷款延缓风险暴露、债券投资业务未分类，表内人民币债券未计提减值准备、与资产管理公司合作设立有限合伙基金，不洁净转让不良资产、迟报案件信息、案件问责不到位、提供质价不符的服务、违规收取福费廷风险承担费、违规向部分已签约代发工资客户收取年费等三十六项违法违规行为，对中国银行处以罚没 8761.355 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）11 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、漏报贷款核销业务 EAST 数据、漏报抵押物价值 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、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据、漏报其他担保类业务 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、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》表错报、EAST 系统《对公信贷分户账》表错报、理财产品登记不规范、2018 年行政处罚问题依然存在等十八项违法违规事实，对中国银行处以罚款 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）13 号）。

本基金投资 20 交通银行 01（代码：2028029）、21 农业银行 CD049（代码：112103049）以及 21 中国银行 CD029（代码：112104029）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 交通银行 01（代码：2028029）、21 农业银行 CD049（代码：112103049）以及 21 中国银行 CD029（代码：112104029）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	58,132.89
2	应收证券清算款	1,053,639.65
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	1,111,772.54

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	132009	17 中油 EB	21,043,513.92	9.31

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	166,884,215.38
报告期期间基金总申购份额	—
减：报告期期间基金总赎回份额	—
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	166,884,215.38

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

本基金发起份额承诺的持有期限已于 2020 年 12 月 28 日届满 3 年。

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20220331	113,716,206.55	-	-	113,716,206.55	68.14%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：申购份额含红利再投、转换入份额。赎回份额含转换出份额。

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、《华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《华泰保兴吉年福定期开放灵活配置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 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