

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 3 季度报告

2022 年 09 月 30 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 10 月 26 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 10 月 24 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 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 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	508,395,833.11 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	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。 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*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 07 月 01 日-2022 年 09 月 30 日）
1. 本期已实现收益	11,177,292.23
2. 本期利润	3,484,134.13
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0069
4. 期末基金资产净值	677,944,354.16
5. 期末基金份额净值	1.3335

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、所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。

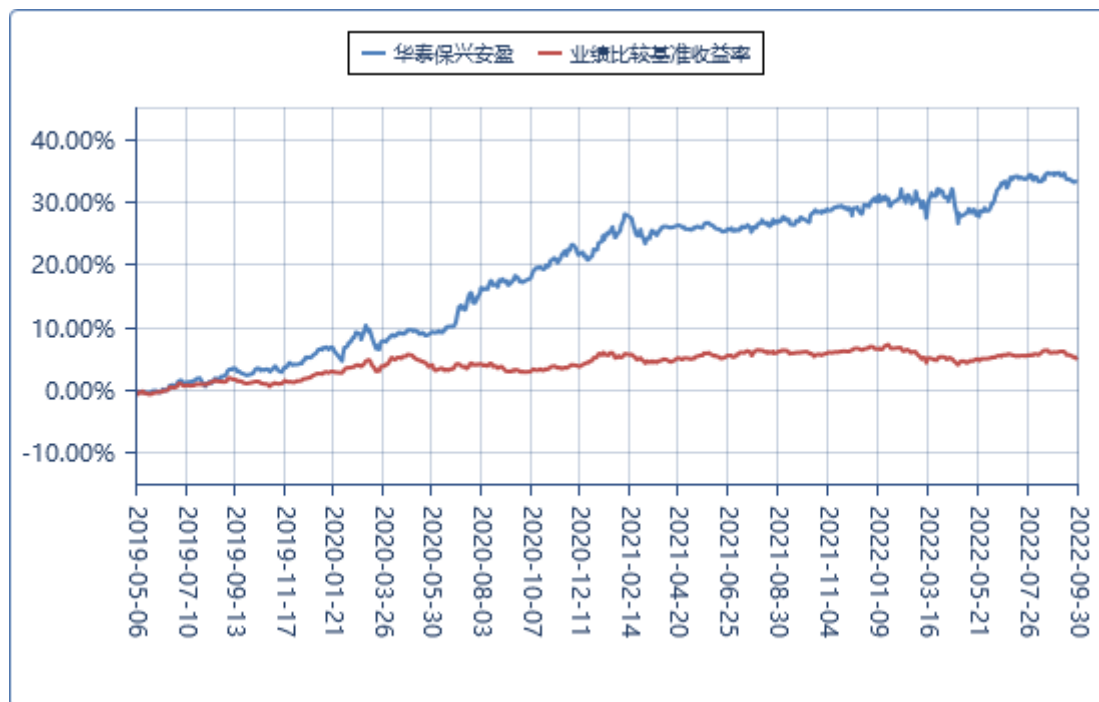
3.2 基金净值表现

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	0.58%	0.23%	-0.85%	0.11%	1.43%	0.12%
过去六个月	1.33%	0.35%	-0.19%	0.13%	1.52%	0.22%
过去一年	4.34%	0.38%	-1.10%	0.14%	5.44%	0.24%
过去三年	29.97%	0.34%	3.75%	0.15%	26.22%	0.19%
自基金合同生效起 至今	33.35%	0.32%	5.09%	0.14%	28.26%	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、公司研究部总经理助理	2019 年 05 月 06 日	—	8 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。
周咏梅	基金经理、公司固定收益投资部副总经理	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。

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

三季度宏观经济修复动能有所减弱，除了阶段性的高温限电影响以外，地产和疫情仍是重要约束。股票方面，A 股经历了二季度的大幅反弹之后，三季度整体震荡下行，上证综指下跌 11%，创业板指下跌 18.5%，能源、公用事业、农业等板块跌幅较小，电力设备、电子、汽车、医药等成长板块跌幅较大。账户操作层面，我们三季度整体保持谨慎，仓位有小幅下降。

债券方面，债券收益率曲线陡峭化下行，信用利差继续缩小。1 年期全国股份制银行存单从 2.28% 下降至 1.99%，10 年国债从 2.82% 下行至 2.76%。7 月债市受益于不断创新低的资金利率，短端资产收益率下行顺畅，同时市场也修正了经济复苏的预期，对地产的前景更加悲观，中长期债券收益率亦下行。8 月房地产销售低迷，疫情点状爆发，经济预期较弱，央行超预期降息推动了中长期债券收益率跌破年内低点，超长债交易活跃，市场情绪很高。9 月债券市场震荡加剧，兑现浮盈力量上升，市场对利好有所钝化，中长期流动性券收益率回到了降息之前，而市场整体资金面仍松，其它债券收益率持平。账户操作层面，我们三季度继续持有中短久期的高等级信用债，阶段性加仓了中期利率债。

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 1.3335 元，本报告期内基金份额净值增长率为 0.58%，同期业绩比较基准收益率为-0.85%。

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	56,902,848.23	8.26
	其中：股票	56,902,848.23	8.26
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	621,792,501.16	90.25
	其中：债券	621,792,501.16	90.25
	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	-	-
	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	10,121,380.22	1.47
8	其他资产	133,849.12	0.02
9	合计	688,950,578.73	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	12,485,080.00	1.84
B	采矿业	-	-
C	制造业	37,364,875.22	5.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,940.85	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	18,679.98	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	278,682.65	0.04
J	金融业	3,155,000.00	0.47
K	房地产业	3,355,500.00	0.49
L	租赁和商务服务业	17,013.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	121,434.29	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	42,019.64	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	45,155.60	0.01
R	文化、体育和娱乐业	5,467.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	56,902,848.23	8.39

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股票投资明细

5.3.1 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	002714	牧原股份	229,000	12,485,080.00	1.84
2	002311	海大集团	160,000	9,644,800.00	1.42

3	002567	唐人神	950,000	7,571,500.00	1.12
4	002459	晶澳科技	100,000	6,404,000.00	0.94
5	600519	贵州茅台	3,200	5,992,000.00	0.88
6	688526	科前生物	280,000	5,810,000.00	0.86
7	002968	新大正	150,000	3,355,500.00	0.49
8	002142	宁波银行	100,000	3,155,000.00	0.47
9	688032	禾迈股份	928	1,019,213.12	0.15
10	301363	美好医疗	4,447	136,345.02	0.02

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	29,952,332.77	4.42
2	央行票据	—	—
3	金融债券	250,857,898.08	37.00
	其中：政策性金融债	128,933,993.70	19.02
4	企业债券	133,812,006.04	19.74
5	企业短期融资券	10,092,013.70	1.49
6	中期票据	96,956,181.65	14.30
7	可转债（可交换债）	80,404,410.51	11.86
8	同业存单	19,717,658.41	2.91
9	其他	—	—
10	合计	621,792,501.16	91.72

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	092218001	22 农发清发 01	500,000	50,800,328.77	7.49
2	132015	18 中油 EB	380,000	40,087,178.63	5.91
3	2128027	21 招商银行小微债 03	350,000	35,440,587.67	5.23
4	110059	浦发转债	239,070	25,712,273.24	3.79
5	188134	21 华泰 G5	250,000	25,616,143.84	3.78

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、22 农发清发 01（代码：092218001）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农业发展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、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、错报信贷资产转让业务 EAST 数据、未报送债券投资业务 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据、银行承兑汇票业务 EAST 数据存在偏差、漏报跟单信用证业务 EAST 数据、未报送贷款承诺业务 EAST 数据、未报送委托贷款业务 EAST 数据、EAST 系统分户账与总账比对不一致、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《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》表漏报等十七项违法违规事实，对中国农业发展银行处以罚款 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〕10 号）。

2、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 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股份有限公司（以下简称“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）。

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，中国银保监会针对上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“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 22 农发清发 01（代码：092218001）、21 招商银行小微债 03（代码：2128027）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 22 农发清发 01（代码：092218001）、21 招商银行小微债 03（代码：2128027）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	68,420.84

2	应收证券清算款	65,428.28
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	133,849.12

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	40,087,178.63	5.91
2	110059	浦发转债	25,712,273.24	3.79
3	113044	大秦转债	5,546,945.21	0.82
4	113052	兴业转债	3,197,755.89	0.47
5	110057	现代转债	2,290,786.96	0.34
6	113037	紫银转债	2,081,682.19	0.31
7	110079	杭银转债	500,948.09	0.07
8	113050	南银转债	227,149.05	0.03

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 （元）	占基金资产净值 比例（%）	流通受限情况说明
1	301363	美好医疗	136,345.02	0.02	新股未上市

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	481,089,588.23
报告期期间基金总申购份额	29,806,244.88
减：报告期期间基金总赎回份额	2,500,000.00
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	508,395,833.11

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 2022 年 05 月 06 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

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 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 10 月 26 日