

# 华泰保兴安悦债券型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 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：徽商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 08 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人徽商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|      |                                         |    |
|------|-----------------------------------------|----|
| § 1  | 重要提示及目录 .....                           | 2  |
| 1.1  | 重要提示 .....                              | 2  |
| 1.2  | 目录 .....                                | 3  |
| § 2  | 基金简介 .....                              | 5  |
| 2.1  | 基金基本情况 .....                            | 5  |
| 2.2  | 基金产品说明 .....                            | 5  |
| 2.3  | 基金管理人和基金托管人 .....                       | 5  |
| 2.4  | 信息披露方式 .....                            | 6  |
| 2.5  | 其他相关资料 .....                            | 6  |
| § 3  | 主要财务指标和基金净值表现 .....                     | 7  |
| 3.1  | 主要会计数据和财务指标 .....                       | 7  |
| 3.2  | 基金净值表现 .....                            | 7  |
| § 4  | 管理人报告 .....                             | 10 |
| 4.1  | 基金管理人及基金经理情况 .....                      | 10 |
| 4.2  | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....            | 11 |
| 4.3  | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....               | 11 |
| 4.4  | 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....           | 11 |
| 4.5  | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....           | 12 |
| 4.6  | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....              | 13 |
| 4.7  | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....               | 13 |
| 4.8  | 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....     | 13 |
| § 5  | 托管人报告 .....                             | 15 |
| 5.1  | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                | 15 |
| 5.2  | 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..  | 15 |
| 5.3  | 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....     | 15 |
| § 6  | 半年度财务会计报告（未经审计） .....                   | 16 |
| 6.1  | 资产负债表 .....                             | 16 |
| 6.2  | 利润表 .....                               | 17 |
| 6.3  | 净资产变动表 .....                            | 18 |
| 6.4  | 报表附注 .....                              | 19 |
| § 7  | 投资组合报告 .....                            | 37 |
| 7.1  | 期末基金资产组合情况 .....                        | 37 |
| 7.2  | 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                  | 37 |
| 7.3  | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....     | 37 |
| 7.4  | 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 37 |
| 7.5  | 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 37 |
| 7.6  | 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 .....    | 38 |
| 7.7  | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 38 |
| 7.8  | 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贵金属投资明细 ..... | 38 |
| 7.9  | 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 .....    | 38 |
| 7.10 | 本基金投资股指期货的投资政策 .....                    | 38 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....              | 38 |

|      |                                     |    |
|------|-------------------------------------|----|
| 7.12 | 投资组合报告附注 .....                      | 38 |
| § 8  | 基金份额持有人信息 .....                     | 40 |
| 8.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 40 |
| 8.2  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 40 |
| 8.3  | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....  | 40 |
| § 9  | 开放式基金份额变动 .....                     | 41 |
| § 10 | 重大事件揭示 .....                        | 42 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 .....                   | 42 |
| 10.2 | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....   | 42 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 42 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 .....                     | 42 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 42 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 42 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 42 |
| 10.8 | 其他重大事件 .....                        | 43 |
| § 11 | 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 46 |
| 11.1 | 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 ..... | 46 |
| 11.2 | 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 46 |
| § 12 | 备查文件目录 .....                        | 47 |
| 12.1 | 备查文件目录 .....                        | 47 |
| 12.2 | 存放地点 .....                          | 47 |
| 12.3 | 查阅方式 .....                          | 47 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                 |                    |                  |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 基金名称            | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金    |                  |
| 基金简称            | 华泰保兴安悦债券           |                  |
| 基金主代码           | 007540             |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                  |
| 基金合同生效日         | 2019 年 07 月 11 日   |                  |
| 基金管理人           | 华泰保兴基金管理有限公司       |                  |
| 基金托管人           | 徽商银行股份有限公司         |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 1,990,907,756.62 份 |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 华泰保兴安悦债券 A         | 华泰保兴安悦债券 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 007540             | 020741           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,202,711,542.57 份 | 788,196,214.05 份 |

注：本基金于 2024 年 02 月 07 日起新增 C 类份额。

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                     |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在谨慎控制组合净值波动率的前提下，本基金追求基金资产的长期、持续增值，并力争获得超越业绩比较基准的投资回报。                                                                              |
| 投资策略   | 本基金通过对宏观经济周期、市场利率走势和债券供求关系的分析和判断，灵活应用组合久期配置策略、类属资产配置策略、个券选择策略、息差策略、现金头寸管理策略等，在合理管理并控制组合风险的前提下，动态调整组合久期和债券结构，精选个券，获得债券市场的整体回报率及超额收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债总指数（全价）收益率                                                                                                                        |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。                                                                                         |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                         | 基金托管人                |
|---------|------|-------------------------------|----------------------|
| 名称      |      | 华泰保兴基金管理有限公司                  | 徽商银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 王相国                           | 张轶达                  |
|         | 联系电话 | 021-80299000                  | 0551-62667851        |
|         | 电子邮箱 | fund_xxpl@ehuatai.com         | tggz@hsbank.com.cn   |
| 客户服务电话  |      | 400-632-9090                  | 40088-96588          |
| 传真      |      | 021-60756968                  | 0551-65970481        |
| 注册地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号 3810 室 | 安徽省合肥市云谷路 1699 号徽银大厦 |
| 办公地址    |      | 上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层   | 安徽省合肥市云谷路 1699 号徽银大厦 |

|       |        |        |
|-------|--------|--------|
| 邮政编码  | 200126 | 230000 |
| 法定代表人 | 杨平     | 严琛     |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                     |
|---------------------|---------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报               |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.ehuataifund.com |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人办公场所及基金托管人住所   |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                        |
|--------|--------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 华泰保兴基金管理有限公司 | 上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2024年01月01日至2024年06月30日） |                |
|---------------|------------------------------|----------------|
|               | 华泰保兴安悦债券 A                   | 华泰保兴安悦债券 C     |
| 本期已实现收益       | 35,935,642.96                | 13,843,064.12  |
| 本期利润          | 70,894,913.31                | 4,914,858.58   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0543                       | 0.0084         |
| 本期加权平均净值利润率   | 5.10%                        | 0.79%          |
| 本期基金份额净值增长率   | 6.67%                        | 4.07%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2024年06月30日）            |                |
|               | 华泰保兴安悦债券 A                   | 华泰保兴安悦债券 C     |
| 期末可供分配利润      | 13,780,827.27                | 8,386,926.67   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0115                       | 0.0106         |
| 期末基金资产净值      | 1,283,536,400.42             | 839,839,160.15 |
| 期末基金份额净值      | 1.0672                       | 1.0655         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末（2024年06月30日）            |                |
|               | 华泰保兴安悦债券 A                   | 华泰保兴安悦债券 C     |
| 基金份额累计净值增长率   | 21.35%                       | 4.07%          |

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、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。

4、本基金于 2024 年 02 月 07 日起新增 C 类份额。本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

华泰保兴安悦债券 A

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | 2.31%    | 0.12%       | 0.72%      | 0.04%         | 1.59% | 0.08% |
| 过去三个月 | 2.09%    | 0.24%       | 0.98%      | 0.09%         | 1.11% | 0.15% |
| 过去六个月 | 6.67%    | 0.26%       | 2.24%      | 0.09%         | 4.43% | 0.17% |
| 过去一年  | 9.03%    | 0.19%       | 3.05%      | 0.08%         | 5.98% | 0.11% |
| 过去三年  | 14.74%   | 0.12%       | 6.26%      | 0.08%         | 8.48% | 0.04% |

|            |        |       |       |       |        |       |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 21.35% | 0.10% | 7.62% | 0.10% | 13.73% | 0.00% |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|

华泰保兴安悦债券 C

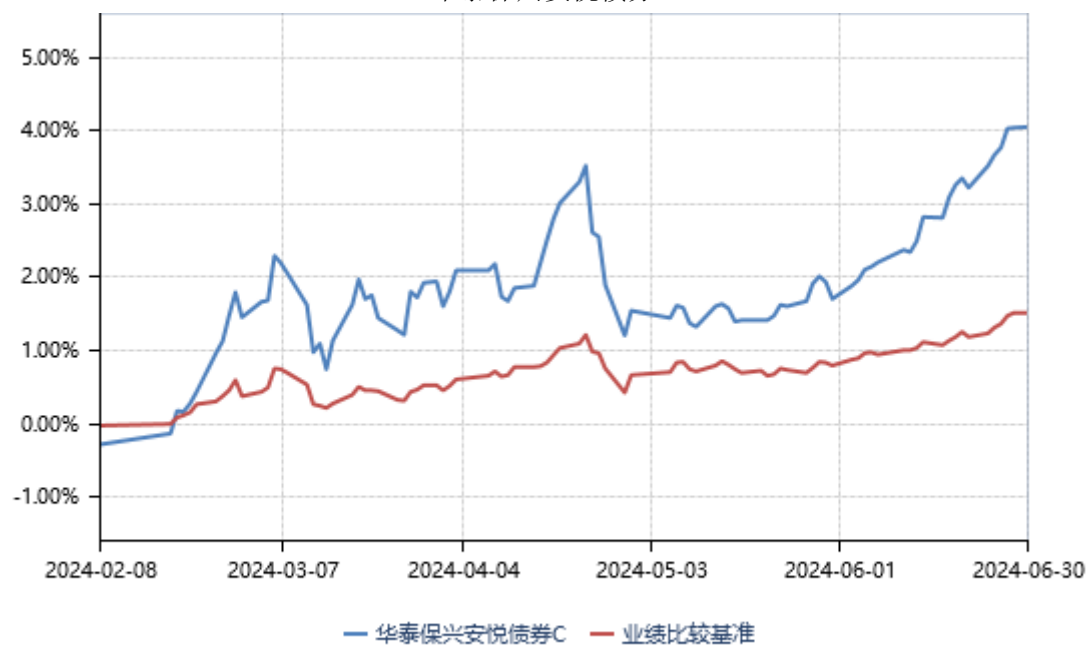
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月      | 2.31%    | 0.12%       | 0.72%      | 0.04%         | 1.59% | 0.08% |
| 过去三个月      | 2.07%    | 0.24%       | 0.98%      | 0.09%         | 1.09% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.07%    | 0.27%       | 1.53%      | 0.09%         | 2.54% | 0.18% |

注：本基金业绩比较基准为：中债总指数（全价）收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



华泰保兴安悦债券 C



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华泰保兴基金管理有限公司(以下或简称“公司”或“本公司”)经中国证监会证监许可[2016]1309号文核准,于2016年07月26日成立,公司股东分别为华泰保险集团股份有限公司(以下简称“华泰保险集团”)、上海飞恒资产管理中心(有限合伙)(以下简称“飞恒资产”)、上海旷正资产管理中心(有限合伙)(以下简称“旷正资产”)、上海泰颐资产管理中心(有限合伙)(以下简称“泰颐资产”)、上海哲昌资产管理中心(有限合伙)(以下简称“哲昌资产”)、上海志庄资产管理中心(有限合伙)(以下简称“志庄资产”)。公司注册资本人民币24,000万元,其中,华泰保险集团持股比例为85%,飞恒资产、旷正资产、泰颐资产、哲昌资产、志庄资产均为公司高级管理人员及核心业务骨干股权激励持股平台,合计持股比例为15%。2022年03月25日,公司设立北京分公司。目前,公司经营范围为基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。此外,公司还具有保险资金受托管理资格。

截至2024年06月30日,公司共管理30只公募基金,公募基金资产管理总规模为398.18亿元人民币,包括货币型、债券型、混合型、股票型等类型。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务                            | 任本基金的基金经理<br>(助理)期限 |      | 证券从<br>业年限 | 说明                                                                      |
|-----|-------------------------------|---------------------|------|------------|-------------------------------------------------------------------------|
|     |                               | 任职日期                | 离任日期 |            |                                                                         |
| 陈祺伟 | 基金经理、公司联席固定收益投资总监、固定收益投资二部总经理 | 2023年06月19日         | -    | 20年        | 复旦大学经济学硕士。历任上海银行金融市场部自营科主管、平安银行资金运营中心投资管理部总经理等职务。2023年3月加入华泰保兴基金管理有限公司。 |

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

2、基金的非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

## 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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管理办法》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，严格监控同一交易日内不同投资组合之间的反向交易。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年中国经济稳中向好。从先行指标来看，7 月份制造业 PMI 为 49.4%，比上月略降 0.1 个百分点，制造业景气度基本稳定；非制造业商务活动指数和综合 PMI 产出指数均为 50.2%，均比上月下降 0.3 个百分点。从产出看，中国经济总体保持扩张，持续回升向好但基础仍需巩固。工业方面，增加值继续保持较快增长，6 月份规模以上同比增长 5.3%。消费方面，6 月份社会消费品零售总额同比增长 2.0%，比上月减缓 1.7 个百分点。从投资来看，1-6 月份固定资产投资同比增长 3.9%，其中高技术制造业和高技术服务业投资分别增长 10.1%、11.7%。外需方面，上半年我国货物贸易进出口总值 19.8 万亿元人民币，同比增长 9.4%，展现出较强的韧性。

就业水平稳定。上半年，全国城镇调查失业率平均值为 5.1%，比一季度下降 0.1 个百分点，比上年同期下降 0.2 个百分点。从消费价格水平来看，商品供给充足，消费市场运行平稳，6 月 CPI 同比涨幅 0.2%。扣除食品和能源的核心 CPI 同比上涨 0.6%，保持温和上涨。另外服务价格上涨 0.7%。从生产价格看，PPI 同比降幅继续收窄。

国内货币政策方面，稳健的货币政策灵活适度、精准有效，强化逆周期调节，综合运用利率、准备金、再贷款等工具，切实服务实体经济，有效防控金融风险，为经济回升向好创造适宜的货币金融环境。7 月，人民银行决定于近期面向部分公开市场业务一级交易商开展国债借入操作，视情况开展临时正回购或临时逆回购操作。7 月，公开市场操作方面，7 天逆回购利率下调 10bp。另外，MLF 利率下调 20bp。

债券市场方面，整体收益率震荡下行。10 年国债在 4 月下旬冲高，之后下行。信用利差收窄，长期限利差收缩程度更为剧烈。1 年期 AAA 信用利差从 55bp 缩小至 48bp，5 年期 AAA 信用利差从 43bp 缩小至 29bp。同业存单收益率大幅下行，二季度 1Y 存单从 2.24 下行至 1.96。

报告期内，本基金增持了部分中长期国开债，结合相关利率债的波段操作，上半年组合整体运行状况良好。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰保兴安悦债券 A 份额净值为 1.0672 元，本报告期华泰保兴安悦债券 A 份额净值增长率为 6.67%，同期业绩比较基准收益率为 2.24%；截至本报告期末华泰保兴安悦债券 C 份额净值为 1.0655 元，本报告期华泰保兴安悦债券 C 份额净值增长率为 4.07%，同期业绩比较基准收益率为 1.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年下半年，国内经济将会保持稳中向好，高质量发展趋势。更大力度激发市场活力和内生动力，巩固和增强经济回升向好态势，促进经济持续健康发展。就业物价将保持总体稳定，居民收

入继续增加，新动能加快成长，高质量发展会取得新进展。

货币政策方面，中国人民银行将继续精准有力实施稳健的货币政策，持续改善和稳定市场预期，为实体经济稳定增长营造良好的货币金融环境。下半年，存在降低存款准备金率的可能性。

基金投资上，本基金主要投资于中长期利率债，围绕相关品种进行配置并辅之以适量交易。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理、科学和一致性，保护基金份额持有人的合法权益，成立了估值委员会。估值委员会负责制订、评估和修订公司的估值管理办法，定期评估估值程序和估值技术，对估值技术进行最终决策，指导和监督整个估值流程。估值委员会委员由公司首席财务官和投研部门、风险管理部、监察稽核部及运营保障部的指定人员担任。估值委员会委员在基金估值研究或运作方面具有丰富经验，熟悉相关法规、估值原则和估值技术，在估值工作中保持判断的专业性和客观性。

投研部门负责对特殊投资品种估值进行分析研究，并就可能影响投资品种公允价值的重大事项进行监控和报告，提出适用的估值模型和参数；负责对第三方估值机构的估值质量进行定期评估。风险管理部负责对特殊投资品种的估值技术和估值模型进行研究，通过实证分析等方法完善估值模型，验证投研部门提供的估值模型和参数并协助提供数据支持文件。监察稽核部检查、督促相关部门严格遵守法规和公司制度的规定，采用适当程序进行基金估值及调整；检查、督促相关部门及时进行信息披露；根据相关规定及估值委员会的决议对估值相关公告进行合规性审核。运营保障部根据相关法规和公司估值管理办法对基金进行估值；根据指定方法监控并汇报基金持有停牌股票的情况，根据公司估值委员会的决议进行估值并与托管人核对，与会计师事务所沟通；根据相关法规规定及时进行信息披露。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的固定收益品种/在证券交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金的基金合同等规定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金实施利润分配 4 次，利润分配合计 130,861,562.47 元，符合法律法规及基金合同的规定。具体分配情况参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰保兴安悦债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产           | 附注号        | 本期末<br>2024 年 06 月 30 日         | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                 |                                  |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 52,678,587.47                   | 3,101,078.21                     |
| 结算备付金         |            | -                               | -                                |
| 存出保证金         |            | -                               | -                                |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 1,911,490,271.61                | 1,114,019,075.20                 |
| 其中：股票投资       |            | -                               | -                                |
| 基金投资          |            | -                               | -                                |
| 债券投资          |            | 1,911,490,271.61                | 1,114,019,075.20                 |
| 资产支持证券投资      |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                               | -                                |
| 其他投资          |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | 120,039,452.06                  | -                                |
| 应收清算款         |            | -                               | -                                |
| 应收股利          |            | -                               | -                                |
| 应收申购款         |            | 93,790,171.14                   | 3,821,441.15                     |
| 递延所得税资产       |            | -                               | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                               | -                                |
| 资产总计          |            | 2,177,998,482.28                | 1,120,941,594.56                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024 年 06 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2023 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                 |                                  |
| 短期借款          |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债       |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                               | 82,016,788.57                    |
| 应付清算款         |            | 45,673,473.55                   | -                                |
| 应付赎回款         |            | 8,184,235.05                    | 37,686.57                        |
| 应付管理人报酬       |            | 440,629.96                      | 253,580.93                       |
| 应付托管费         |            | 130,215.40                      | 84,526.95                        |
| 应付销售服务费       |            | 45,176.65                       | -                                |
| 应付投资顾问费       |            | -                               | -                                |
| 应交税费          |            | -                               | -                                |

|             |         |                  |                  |
|-------------|---------|------------------|------------------|
| 应付利润        |         | -                | -                |
| 递延所得税负债     |         | -                | -                |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 149,191.10       | 252,921.77       |
| 负债合计        |         | 54,622,921.71    | 82,645,504.79    |
| <b>净资产：</b> |         |                  |                  |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 1,990,907,756.62 | 988,695,303.88   |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 132,467,803.95   | 49,600,785.89    |
| 净资产合计       |         | 2,123,375,560.57 | 1,038,296,089.77 |
| 负债和净资产总计    |         | 2,177,998,482.28 | 1,120,941,594.56 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，华泰保兴安悦债券 A 基金份额净值 1.0672 元，基金份额总额 1,202,711,542.57 份；华泰保兴安悦债券 C 基金份额净值 1.0655 元，基金份额总额 788,196,214.05 份。华泰保兴安悦债券份额总额合计为 1,990,907,756.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰保兴安悦债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号      | 本期<br>2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 01 月 01 日至<br>2023 年 06 月 30 日 |
|------------------------|----------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>         |          | 80,643,550.80                               | 20,199,580.88                                    |
| 1. 利息收入                |          | 522,886.84                                  | 340,609.42                                       |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.9  | 121,287.74                                  | 10,373.98                                        |
| 债券利息收入                 |          | -                                           | -                                                |
| 资产支持证券利息收入             |          | -                                           | -                                                |
| 买入返售金融资产收入             |          | 401,599.10                                  | 330,235.44                                       |
| 其他利息收入                 |          | -                                           | -                                                |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |          | 53,675,236.69                               | 16,232,784.11                                    |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.10 | -                                           | -                                                |
| 基金投资收益                 |          | -                                           | -                                                |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.11 | 53,675,236.69                               | 16,232,784.11                                    |
| 资产支持证券投资收益             | 6.4.7.12 | -                                           | -                                                |
| 贵金属投资收益                |          | -                                           | -                                                |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.13 | -                                           | -                                                |
| 股利收益                   | 6.4.7.14 | -                                           | -                                                |
| 其他投资收益                 |          | -                                           | -                                                |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | 26,031,064.81                               | 3,626,182.33                                     |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -                                           | -                                                |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.16 | 414,362.46                                  | 5.02                                             |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |          | 4,833,778.91                                | 3,304,978.33                                     |
| 1. 管理人报酬               |          | 2,768,318.55                                | 1,691,007.28                                     |

|                     |          |               |               |
|---------------------|----------|---------------|---------------|
| 2. 托管费              |          | 906,111.58    | 563,669.13    |
| 3. 销售服务费            |          | 231,684.31    | -             |
| 4. 投资顾问费            |          | -             | -             |
| 5. 利息支出             |          | 805,188.11    | 927,563.57    |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | 805,188.11    | 927,563.57    |
| 6. 信用减值损失           | 6.4.7.17 | -             | -             |
| 7. 税金及附加            |          | -             | -             |
| 8. 其他费用             | 6.4.7.18 | 122,476.36    | 122,738.35    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 75,809,771.89 | 16,894,602.55 |
| 减：所得税费用             |          | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 75,809,771.89 | 16,894,602.55 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -             | -             |
| 六、综合收益总额            |          | 75,809,771.89 | 16,894,602.55 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华泰保兴安悦债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期                                 |                 |                   |
|------------------------------------------|------------------------------------|-----------------|-------------------|
|                                          | 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |                 |                   |
|                                          | 实收基金                               | 未分配利润           | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                | 988,695,303.88                     | 49,600,785.89   | 1,038,296,089.77  |
| 二、本期期初净资产                                | 988,695,303.88                     | 49,600,785.89   | 1,038,296,089.77  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 1,002,212,452.74                   | 82,867,018.06   | 1,085,079,470.80  |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 75,809,771.89   | 75,809,771.89     |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | 1,002,212,452.74                   | 137,918,808.64  | 1,140,131,261.38  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 5,240,655,867.26                   | 406,483,305.67  | 5,647,139,172.93  |
| 2. 基金赎回款                                 | -4,238,443,414.52                  | -268,564,497.03 | -4,507,007,911.55 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                  | -130,861,562.47 | -130,861,562.47   |
| 四、本期期末净资产                                | 1,990,907,756.62                   | 132,467,803.95  | 2,123,375,560.57  |
| 项目                                       | 上期                                 |                 |                   |
|                                          | 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |                 |                   |
|                                          | 实收基金                               | 未分配利润           | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                | 1,114,061,725.75                   | 13,387,139.13   | 1,127,448,864.88  |
| 二、本期期初净资产                                | 1,114,061,725.75                   | 13,387,139.13   | 1,127,448,864.88  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”                         | 59,106,743.05                      | 18,900,659.66   | 78,007,402.71     |

|                                          |                  |               |                  |
|------------------------------------------|------------------|---------------|------------------|
| 号填列)                                     |                  |               |                  |
| (一)、综合收益总额                               | -                | 16,894,602.55 | 16,894,602.55    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 59,106,743.05    | 2,006,057.11  | 61,112,800.16    |
| 其中: 1. 基金申购款                             | 392,303,909.61   | 7,830,582.77  | 400,134,492.38   |
| 2. 基金赎回款                                 | -333,197,166.56  | -5,824,525.66 | -339,021,692.22  |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                | -             | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 1,173,168,468.80 | 32,287,798.79 | 1,205,456,267.59 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

|            |           |            |
|------------|-----------|------------|
| <u>王现成</u> | <u>陈庆</u> | <u>王云凌</u> |
| 基金管理人负责人   | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人    |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰保兴安悦债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]539号《关于准予华泰保兴安悦债券型证券投资基金注册的批复》注册,由华泰保兴基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴安悦债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币200,123,740.76元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0413号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰保兴安悦债券型证券投资基金基金合同》于2019年07月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,128,259.41份基金份额,其中认购资金利息折合4,518.65份基金份额。本基金的基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司,基金托管人为徽商银行股份有限公司。

根据基金管理人于2024年02月07日发布的《华泰保兴基金管理有限公司关于华泰保兴安悦债券型证券投资基金增加C类基金份额并修订基金合同和托管协议的公告》的规定,自2024年02月07日起对本基金增加C类基金份额,原基金份额全部自动划归为A类基金份额,并修订相关法律文件。根据更新的《华泰保兴安悦债券型证券投资基金基金合同》和《华泰保兴安悦债券型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、赎回时收取赎回费用的基金份额,称为A类基金份额;在投资人申购时不收取申购费用,赎回时收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销

售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分设不同的基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴安悦债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、地方政府债、商业银行金融债、央行票据）、债券回购、银行存款（协议存款、通知存款以及定期存款等）、同业存单、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票、权证，也不投资于企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券。本基金的业绩比较基准为：中债总指数（全价）收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 02 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》《华泰保兴安悦债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2024 年 06 月 30 日 |
|--------|-------------------------|
| 活期存款   | 52,678,587.47           |
| 等于：本金  | 52,675,457.79           |
| 加：应计利息 | 3,129.68                |

|                |               |
|----------------|---------------|
| 定期存款           | -             |
| 等于：本金          | -             |
| 加：应计利息         | -             |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -             |
| 存款期限 1-3 个月    | -             |
| 存款期限 3 个月以上    | -             |
| 其他存款           | -             |
| 等于：本金          | -             |
| 加：应计利息         | -             |
| 合计             | 52,678,587.47 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2024 年 06 月 30 日 |               |                  |               |
|---------------|-------|-------------------------|---------------|------------------|---------------|
|               |       | 成本                      | 应计利息          | 公允价值             | 公允价值变动        |
| 股票            |       | -                       | -             | -                | -             |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                       | -             | -                | -             |
| 债券            | 交易所市场 | -                       | -             | -                | -             |
|               | 银行间市场 | 1,855,094,450.99        | 19,299,521.61 | 1,911,490,271.61 | 37,096,299.01 |
|               | 小计    | 1,855,094,450.99        | 19,299,521.61 | 1,911,490,271.61 | 37,096,299.01 |
| 资产支持证券        |       | -                       | -             | -                | -             |
| 基金            |       | -                       | -             | -                | -             |
| 其他            |       | -                       | -             | -                | -             |
| 合计            |       | 1,855,094,450.99        | 19,299,521.61 | 1,911,490,271.61 | 37,096,299.01 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2024 年 06 月 30 日 |           |
|-------|-------------------------|-----------|
|       | 账面余额                    | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                       | -         |
| 银行间市场 | 120,039,452.06          | -         |
| 合计    | 120,039,452.06          | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2024 年 06 月 30 日 |
|--------------|-------------------------|
| 应付券商交易单元保证金  | -                       |
| 应付赎回费        | 391.58                  |
| 应付证券出借违约金    | -                       |
| 应付交易费用       | 35,623.16               |
| 其中：交易所市场     | -                       |
| 银行间市场        | 35,623.16               |
| 应付利息         | -                       |
| 应付审计费        | 44,204.02               |
| 应付信息披露费      | 59,672.34               |
| 应付银行间债券账户维护费 | 9,300.00                |
| 合计           | 149,191.10              |

6.4.7.7 实收基金

华泰保兴安悦债券 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |                   |
|---------------|------------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                                  | 账面金额              |
| 上年度末          | 988,695,303.88                           | 988,695,303.88    |
| 本期申购          | 2,037,686,742.57                         | 2,037,686,742.57  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,823,670,503.88                        | -1,823,670,503.88 |
| 本期末           | 1,202,711,542.57                         | 1,202,711,542.57  |

华泰保兴安悦债券 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |                   |
|---------------|------------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                                  | 账面金额              |
| 上年度末          | -                                        | -                 |
| 本期申购          | 3,202,969,124.69                         | 3,202,969,124.69  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,414,772,910.64                        | -2,414,772,910.64 |
| 本期末           | 788,196,214.05                           | 788,196,214.05    |

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金于 2024 年 02 月 07 日起新增 C 类份额。

6.4.7.8 未分配利润

华泰保兴安悦债券 A

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计         |
|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末           | 36,310,097.83  | 13,290,688.06  | 49,600,785.89   |
| 本期期初           | 36,310,097.83  | 13,290,688.06  | 49,600,785.89   |
| 本期利润           | 35,935,642.96  | 34,959,270.35  | 70,894,913.31   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 33,180,238.36  | 18,794,072.17  | 51,974,310.53   |
| 其中：基金申购款       | 70,662,456.94  | 95,130,688.66  | 165,793,145.60  |
| 基金赎回款          | -37,482,218.58 | -76,336,616.49 | -113,818,835.07 |
| 本期已分配利润        | -91,645,151.88 | -              | -91,645,151.88  |
| 本期末            | 13,780,827.27  | 67,044,030.58  | 80,824,857.85   |

华泰保兴安悦债券 C

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末           | -              | -               | -               |
| 本期期初           | -              | -               | -               |
| 本期利润           | 13,843,064.12  | -8,928,205.54   | 4,914,858.58    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 33,760,273.14  | 52,184,224.97   | 85,944,498.11   |
| 其中：基金申购款       | 86,715,237.57  | 153,974,922.50  | 240,690,160.07  |
| 基金赎回款          | -52,954,964.43 | -101,790,697.53 | -154,745,661.96 |
| 本期已分配利润        | -39,216,410.59 | -               | -39,216,410.59  |
| 本期末            | 8,386,926.67   | 43,256,019.43   | 51,642,946.10   |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 121,287.74                               |
| 定期存款利息收入  | -                                        |
| 其他存款利息收入  | -                                        |
| 结算备付金利息收入 | -                                        |
| 其他        | -                                        |
| 合计        | 121,287.74                               |

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                               | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|----------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益--利息收入                     | 24,619,625.25                 |
| 债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）<br>差价收入 | 29,055,611.44                 |
| 债券投资收益--赎回差价收入                   | -                             |
| 债券投资收益--申购差价收入                   | -                             |
| 合计                               | 53,675,236.69                 |

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 3,195,655,418.27              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 3,149,553,764.81              |
| 减：应计利息总额               | 16,993,758.27                 |
| 减：交易费用                 | 52,283.75                     |
| 买卖债券差价收入               | 29,055,611.44                 |

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 26,031,064.81                 |
| --股票投资     | -                             |
| --债券投资     | 26,031,064.81                 |
| --资产支持证券投资 | -                             |
| --基金投资     | -                             |

|                        |               |
|------------------------|---------------|
| —贵金属投资                 | —             |
| —其他                    | —             |
| 2. 衍生工具                | —             |
| —权证投资                  | —             |
| 3. 其他                  | —             |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | —             |
| 合计                     | 26,031,064.81 |

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|---------|------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 414,338.26                               |
| 基金转换费收入 | 24.20                                    |
| 合计      | 414,362.46                               |

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------|------------------------------------------|
| 审计费用       | 44,204.02                                |
| 信息披露费      | 59,672.34                                |
| 证券出借违约金    | —                                        |
| 银行间债券账户维护费 | 18,600.00                                |
| 合计         | 122,476.36                               |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据相关法规以及本基金的收益分配政策，本基金向截至 2024 年 07 月 30 日（除权日）登记在

册的全体份额持有人进行利润分配，A 类基金份额每 10 份基金份额派发红利 0.043 元，C 类基金份额每 10 份基金份额派发红利 0.043 元。本基金向截至 2024 年 08 月 29 日（除权日）登记在册的全体份额持有人进行利润分配，A 类基金份额每 10 份基金份额派发红利 0.043 元，C 类基金份额每 10 份基金份额派发红利 0.043 元。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系           |
|------------------------|-------------------|
| 华泰保兴基金管理有限公司（“华泰保兴基金”） | 基金管理人、登记机构、基金销售机构 |
| 徽商银行股份有限公司（“徽商银行”）     | 基金托管人             |
| 华泰人寿保险股份有限公司（“华泰寿险”）   | 基金管理人控股股东控制的机构    |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024年01月01日至2024年<br>06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年<br>06月30日 |
|------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 2,768,318.55                      | 1,691,007.28                           |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 691,209.02                        | 8,529.71                               |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 2,077,109.53                      | 1,682,477.57                           |

注：支付基金管理人华泰保兴基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                | 2024年01月01日至2024年<br>06月30日 | 2023年01月01日至2023年<br>06月30日 |
|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 906,111.58                  | 563,669.13                  |

注：2024 年 06 月 14 日前，支付基金托管人徽商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。根据《华泰保兴基金管理有限公司关于降低华泰保兴安悦债券型证券投资基金托管费率并修订基金合同和托管协议的公告》，自 2024 年 06 月 14 日起支付基金托管人徽商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 的年费率计提并支付，支付规则不变。

其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日      |               |      |
|----------------|------------------------------------|---------------|------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |               |      |
|                | 华泰保兴安悦债券<br>A                      | 华泰保兴安悦债券<br>C | 合计   |
| 华泰保兴基金         | -                                  | 0.60          | 0.60 |
| 合计             | -                                  | 0.60          | 0.60 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |               |      |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |               |      |
|                | 华泰保兴安悦债券<br>A                      | 华泰保兴安悦债券<br>C | 合计   |
| -              | -                                  | -             | -    |
| 合计             | -                                  | -             | -    |

注：本基金于 2024 年 02 月 07 日起新增 C 类份额。

支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华泰保兴基金，再由华泰保兴基金计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.10%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未持有过本基金份额。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

华泰保兴安悦债券 A

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2024 年 06 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |                  |
|-------|-------------------------|------------------|--------------------------|------------------|
|       | 持有的基金份额                 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额                  | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 华泰寿险  | 45,484,488.33           | 2.28%            | 43,329,217.19            | 4.38%            |

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金法律文件公布的费率执行。

##### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |            | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |           |
|-------|-------------------------------|------------|------------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                          | 当期利息收入     | 期末余额                               | 当期利息收入    |
| 徽商银行  | 52,678,587.47                 | 121,287.74 | 2,243,571.13                       | 10,373.98 |

注：本基金的银行存款由基金托管人徽商银行保管，按银行同业利率计息。

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

##### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

华泰保兴安悦债券 A

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日        | 场外<br>除息日        | 每 10 份基金<br>份额分红数 | 现金形式<br>发放总额  | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润<br>分配合计  | 备注 |
|----|------------------|------------------|-------------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 1  | 2024 年 03 月 26 日 | 2024 年 03 月 26 日 | 0.400             | 71,355,441.56 | 5,448,332.62  | 76,803,774.18 | -  |
| 2  | 2024 年 04 月 26 日 | 2024 年 04 月 26 日 | 0.043             | 5,425,648.93  | 837,735.62    | 6,263,384.55  | -  |
| 3  | 2024 年 06 月 05 日 | 2024 年 06 月 05 日 | 0.032             | 3,441,727.94  | 462,716.97    | 3,904,444.91  | -  |
| 4  | 2024 年 06 月 27 日 | 2024 年 06 月 27 日 | 0.043             | 3,941,956.71  | 731,591.53    | 4,673,548.24  | -  |
| 合计 |                  |                  | 0.518             | 84,164,775.14 | 7,480,376.74  | 91,645,151.88 | -  |

华泰保兴安悦债券 C

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日        | 场外<br>除息日        | 每 10 份基金<br>份额分红数 | 现金形式<br>发放总额  | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润<br>分配合计  | 备注 |
|----|------------------|------------------|-------------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 1  | 2024 年 03 月 26 日 | 2024 年 03 月 26 日 | 0.400             | 29,169,567.36 | 2,603,913.75  | 31,773,481.11 | -  |
| 2  | 2024 年 04 月 26 日 | 2024 年 04 月 26 日 | 0.043             | 2,397,207.58  | 449,373.82    | 2,846,581.40  | -  |
| 3  | 2024 年 06 月 05 日 | 2024 年 06 月 05 日 | 0.032             | 1,263,395.55  | 272,261.97    | 1,535,657.52  | -  |
| 4  | 2024 年 06 月 27 日 | 2024 年 06 月 27 日 | 0.042             | 2,531,019.18  | 529,671.38    | 3,060,690.56  | -  |
| 合计 |                  |                  | 0.517             | 35,361,189.67 | 3,855,220.92  | 39,216,410.59 | -  |

#### 6.4.12 期末 2024 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了分工明确、相互制约的风险管理组织架构体系。公司的风险管理组织架构体系由公司董事会、董事会风险控制委员会、经理层及其合规和风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部、各业务部门及全体员工共同组成。

董事会负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，对公司的风险控制承担最终责任；董事会下设风险控制委员会，负责对公司经营管理和投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督。公司经理层负责根据董事会批准的风险控制制度和

战略具体组织实施公司风险控制工作并对风险控制的有效性及其执行效果承担直接责任；总经理负责公司全面的风险控制工作，副总经理负责其分管业务范围的风险控制工作；公司经理层下设合规和风险管理委员会，负责协助经理层进行风险管理的咨询和议事，指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。在业务操作层面，督察长按照中国证监会有关监管规定开展风险管理工作，负责分管并领导监察稽核部、风险管理部独立履行监察稽核及风险管理职责；监察稽核部对公司的风险控制承担独立评估、检查和报告职责；风险管理部对公司的风险控制承担评估、分析、评价职责，具体而言，风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，使得各投资组合的投资范围及投资比例限制合规；参与各投资组合新股申购、债券申购以及银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证场外交易的事中合规控制，并完成各投资组合的投资风险及绩效分析。公司各业务部门负责执行公司的风险控制政策及决策，定期对本部门的风险进行全面评估，并对本部门风险控制的有效性负责；公司所有员工是本岗位风险控制的直接责任人，负责具体风险管理职责的实施。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险可能产生的损失。从定性的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的额度；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征通过特定的风险量化指标、模型、日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，以及可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人徽商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 153,602,361.71          | 70,307,756.83            |
| 合计     | 153,602,361.71          | 70,307,756.83            |

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | -                       | -                        |
| AAA 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 1,757,887,909.90        | 1,043,711,318.37         |
| 合计     | 1,757,887,909.90        | 1,043,711,318.37         |

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

于 2024 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以

及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----|--------|----------|-------|-------|-----|----|
|-----|--------|----------|-------|-------|-----|----|

|                          |                |                |               |                  |               |                  |
|--------------------------|----------------|----------------|---------------|------------------|---------------|------------------|
| 2024 年 06 月 30 日         |                |                |               |                  |               |                  |
| 资产                       |                |                |               |                  |               |                  |
| 货币资金                     | 52,678,587.47  | -              | -             | -                | -             | 52,678,587.47    |
| 结算备付金                    | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 存出保证金                    | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 交易性金融资产                  | -              | 153,602,361.71 | -             | 1,757,887,909.90 | -             | 1,911,490,271.61 |
| 衍生金融资产                   | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 买入返售金融资产                 | 120,039,452.06 | -              | -             | -                | -             | 120,039,452.06   |
| 应收清算款                    | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 应收股利                     | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 应收申购款                    | -              | -              | -             | -                | 93,790,171.14 | 93,790,171.14    |
| 递延所得税资产                  | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 其他资产                     | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 资产总计                     | 172,718,039.53 | 153,602,361.71 | -             | 1,757,887,909.90 | 93,790,171.14 | 2,177,998,482.28 |
| 负债                       |                |                |               |                  |               |                  |
| 短期借款                     | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 交易性金融负债                  | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 衍生金融负债                   | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 卖出回购金融资产款                | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 应付清算款                    | -              | -              | -             | -                | 45,673,473.55 | 45,673,473.55    |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -             | -                | 8,184,235.05  | 8,184,235.05     |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -             | -                | 440,629.96    | 440,629.96       |
| 应付托管费                    | -              | -              | -             | -                | 130,215.40    | 130,215.40       |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -             | -                | 45,176.65     | 45,176.65        |
| 应付投资顾问费                  | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 应交税费                     | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 应付利润                     | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 递延所得税负债                  | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 其他负债                     | -              | -              | -             | -                | 149,191.10    | 149,191.10       |
| 负债总计                     | -              | -              | -             | -                | 54,622,921.71 | 54,622,921.71    |
| 利率敏感度缺口                  | 172,718,039.53 | 153,602,361.71 | -             | 1,757,887,909.90 | 39,167,249.43 | 2,123,375,560.57 |
| 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 | 6 个月以内         | 6 个月-1 年       | 1-5 年         | 5 年以上            | 不计息           | 合计               |
| 资产                       |                |                |               |                  |               |                  |
| 货币资金                     | 3,101,078.21   | -              | -             | -                | -             | 3,101,078.21     |
| 结算备付金                    | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 存出保证金                    | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 交易性金融资产                  | -              | 70,307,756.83  | 40,505,377.05 | 1,003,205,941.32 | -             | 1,114,019,075.20 |
| 衍生金融资产                   | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 买入返售金融资产                 | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 应收清算款                    | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 应收股利                     | -              | -              | -             | -                | -             | -                |
| 应收申购款                    | -              | -              | -             | -                | 3,821,441.15  | 3,821,441.15     |

|           |                |               |               |                  |              |                  |
|-----------|----------------|---------------|---------------|------------------|--------------|------------------|
| 递延所得税资产   | -              | -             | -             | -                | -            | -                |
| 其他资产      | -              | -             | -             | -                | -            | -                |
| 资产总计      | 3,101,078.21   | 70,307,756.83 | 40,505,377.05 | 1,003,205,941.32 | 3,821,441.15 | 1,120,941,594.56 |
| 负债        | -              | -             | -             | -                | -            | -                |
| 短期借款      | -              | -             | -             | -                | -            | -                |
| 交易性金融负债   | -              | -             | -             | -                | -            | -                |
| 衍生金融负债    | -              | -             | -             | -                | -            | -                |
| 卖出回购金融资产款 | 82,016,788.57  | -             | -             | -                | -            | 82,016,788.57    |
| 应付清算款     | -              | -             | -             | -                | -            | -                |
| 应付赎回款     | -              | -             | -             | -                | 37,686.57    | 37,686.57        |
| 应付管理人报酬   | -              | -             | -             | -                | 253,580.93   | 253,580.93       |
| 应付托管费     | -              | -             | -             | -                | 84,526.95    | 84,526.95        |
| 应付销售服务费   | -              | -             | -             | -                | -            | -                |
| 应付投资顾问费   | -              | -             | -             | -                | -            | -                |
| 应交税费      | -              | -             | -             | -                | -            | -                |
| 应付利润      | -              | -             | -             | -                | -            | -                |
| 递延所得税负债   | -              | -             | -             | -                | -            | -                |
| 其他负债      | -              | -             | -             | -                | 252,921.77   | 252,921.77       |
| 负债总计      | 82,016,788.57  | -             | -             | -                | 628,716.22   | 82,645,504.79    |
| 利率敏感度缺口   | -78,915,710.36 | 70,307,756.83 | 40,505,377.05 | 1,003,205,941.32 | 3,192,724.93 | 1,038,296,089.77 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|--------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                    | 本期末（2024 年 06 月 30 日）       | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 75,349,944.22               | 30,972,389.05          |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -71,083,630.88              | -29,569,810.96         |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2024 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                       | -                        |
| 第二层次          | 1,911,490,271.61        | 1,114,019,075.20         |
| 第三层次          | -                       | -                        |
| 合计            | 1,911,490,271.61        | 1,114,019,075.20         |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具（2023 年 12 月 31 日：同）。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,911,490,271.61 | 87.76         |
|    | 其中：债券             | 1,911,490,271.61 | 87.76         |
|    | 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          | 120,039,452.06   | 5.51          |
|    | 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      | 52,678,587.47    | 2.42          |
| 8  | 其他各项资产            | 93,790,171.14    | 4.31          |
| 9  | 合计                | 2,177,998,482.28 | 100.00        |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期内未进行股票买卖交易。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | 1,390,737,296.20 | 65.50         |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 520,752,975.41   | 24.52         |
|    | 其中：政策性金融债 | 520,752,975.41   | 24.52         |
| 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） | -                | -             |

|    |      |                  |       |
|----|------|------------------|-------|
| 8  | 同业存单 | -                | -     |
| 9  | 其他   | -                | -     |
| 10 | 合计   | 1,911,490,271.61 | 90.02 |

## 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称       | 数量（张）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 220215 | 22 国开 15   | 3,700,000 | 398,758,300.55 | 18.78        |
| 2  | 230023 | 23 附息国债 23 | 3,300,000 | 371,880,786.89 | 17.51        |
| 3  | 220008 | 22 附息国债 08 | 3,100,000 | 364,586,256.83 | 17.17        |
| 4  | 220024 | 22 附息国债 24 | 3,200,000 | 364,003,672.13 | 17.14        |
| 5  | 230009 | 23 附息国债 09 | 1,700,000 | 196,640,904.37 | 9.26         |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

## 7.11 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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

本基金投资决策程序符合法律法规及公司投资制度有关规定，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

### 7.12.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额            |
|----|-------|---------------|
| 1  | 存出保证金 | -             |
| 2  | 应收清算款 | -             |
| 3  | 应收股利  | -             |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 93,790,171.14 |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 93,790,171.14 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别       | 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构          |            |                  |            |
|------------|--------------|---------------|----------------|------------|------------------|------------|
|            |              |               | 机构投资者          |            | 个人投资者            |            |
|            |              |               | 持有份额           | 占总份<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 华泰保兴安悦债券 A | 23,658       | 50,837.41     | 674,925,674.75 | 56.12%     | 527,785,867.82   | 43.88%     |
| 华泰保兴安悦债券 C | 30,466       | 25,871.34     | 140,937,705.53 | 17.88%     | 647,258,508.52   | 82.12%     |
| 合计         | 51,782       | 38,447.87     | 815,863,380.28 | 40.98%     | 1,175,044,376.34 | 59.02%     |

注：1、机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别       | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 华泰保兴安悦债券 A | 717,045.63 | 0.06%    |
|                  | 华泰保兴安悦债券 C | 136,329.19 | 0.02%    |
|                  | 合计         | 853,374.82 | 0.04%    |

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别       | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 华泰保兴安悦债券 A | 10~50             |
|                                | 华泰保兴安悦债券 C | 0                 |
|                                | 合计         | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 华泰保兴安悦债券 A | 10~50             |
|                                | 华泰保兴安悦债券 C | 0                 |
|                                | 合计         | 10~50             |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                  | 华泰保兴安悦债券 A       | 华泰保兴安悦债券 C       |
|-------------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2019 年 07 月 11 日）<br>基金份额总额 | 200,128,259.41   | —                |
| 本报告期期初基金份额总额                        | 988,695,303.88   | —                |
| 本报告期基金总申购份额                         | 2,037,686,742.57 | 3,202,969,124.69 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                       | 1,823,670,503.88 | 2,414,772,910.64 |
| 本报告期基金拆分变动份额                        | —                | —                |
| 本报告期期末基金份额总额                        | 1,202,711,542.57 | 788,196,214.05   |

注：1、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。

2、本基金于 2024 年 02 月 07 日起新增 C 类份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

自 2024 年 04 月 12 日起，尤小刚先生不再担任公司督察长，王相国先生新任公司督察长。

自 2024 年 04 月 16 日起，段方晓先生不再担任公司副总经理。

自 2024 年 05 月 27 日起，王现成先生不再担任公司资深副总经理、临时负责人，转任公司总经理，并继续兼任首席投资官。

本报告期内，基金托管人的资产托管部负责人变更为裴娟女士。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内，本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人的基金管理业务及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元。

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                                                | 法定披露方式                                         | 法定披露日期      |
|----|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|-------------|
| 1  | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告的提示性公告                             | 管理人网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》               | 2024年01月20日 |
| 2  | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告                                      | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                            | 2024年01月20日 |
| 3  | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加通华财富（上海）基金销售有限公司为销售机构及开通相关业务并参加其费率优惠活动的公告       | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》                    | 2024年02月06日 |
| 4  | 华泰保兴基金管理有限公司关于华泰保兴安悦债券型证券投资基金增加 C 类基金份额并修订基金合同和托管协议的公告              | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》                    | 2024年02月07日 |
| 5  | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金托管协议                                                 | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                            | 2024年02月07日 |
| 6  | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金基金合同                                                 | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                            | 2024年02月07日 |
| 7  | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金招募说明书更新（2024 年第 1 号）                                 | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                            | 2024年02月08日 |
| 8  | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金基金产品资料概要更新（2024 年第 1 号）                              | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、销售机构网站或网点                  | 2024年02月08日 |
| 9  | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西证券股份有限公司为销售机构及开通相关业务并参加其费率优惠活动的公告           | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2024年03月05日 |
| 10 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加中信建投证券股份有限公司为销售机构及开通相关业务并参加其费率优惠活动的公告           | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2024年03月06日 |
| 11 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国邮政储蓄银行股份有限公司邮你同赢平台为销售机构及开通相关业务并参加其费率优惠活动的公告 | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2024年03月08日 |
| 12 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏银行股份有限公司为销售机构及开通相关业务并参加其费率优惠活动的公告           | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2024年03月13日 |
| 13 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加北京坤元基                                           | 管理人网站、中国证监会基金电                                 | 2024年03月18日 |

|    |                                                                |                                                |             |
|----|----------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|-------------|
|    | 金销售有限公司为销售机构及开通相关业务并参加其费率优惠活动的公告                               | 子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》               |             |
| 14 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券股份有限公司等四家机构为销售机构及开通相关业务并参加其费率优惠活动的公告 | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2024年03月19日 |
| 15 | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金 2024 年度第 1 次分红公告                               | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》                    | 2024年03月26日 |
| 16 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告的提示性公告                            | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2024年03月29日 |
| 17 | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金 2023 年年度报告                                     | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                            | 2024年03月29日 |
| 18 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券股份有限公司为销售机构及开通相关业务并参加其费率优惠活动的公告      | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》       | 2024年03月29日 |
| 19 | 华泰保兴基金管理有限公司关于公司董事变更的公告                                        | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2024年03月30日 |
| 20 | 华泰保兴基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                         | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2024年04月13日 |
| 21 | 华泰保兴基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                         | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2024年04月17日 |
| 22 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告的提示性公告                        | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2024年04月22日 |
| 23 | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告                                 | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                            | 2024年04月22日 |
| 24 | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金 2024 年度第 2 次分红公告                               | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》                    | 2024年04月24日 |
| 25 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广基金销售有限公司为销售机构及开通相关业务并参加其费率优惠活动的公告  | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2024年05月08日 |
| 26 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券股份有限公司为销售机构及开通相关业务并参加其费率             | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上                  | 2024年05月15日 |

|    |                                                           |                                                |             |
|----|-----------------------------------------------------------|------------------------------------------------|-------------|
|    | 优惠活动的公告                                                   | 海证券报》《证券时报》《证券日报》                              |             |
| 27 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申港证券股份有限公司为销售机构及开通相关业务并参加其费率优惠活动的公告 | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》                    | 2024年05月27日 |
| 28 | 华泰保兴基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                    | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2024年05月28日 |
| 29 | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金 2024 年度第 3 次分红公告                          | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》                    | 2024年06月03日 |
| 30 | 华泰保兴基金管理有限公司关于公司董事变更的公告                                   | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2024年06月07日 |
| 31 | 华泰保兴基金管理有限公司关于网站、网上直销平台及微信交易平台暂停服务的公告                     | 管理人网站                                          | 2024年06月07日 |
| 32 | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金招募说明书更新（2024 年第 2 号）                       | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                            | 2024年06月13日 |
| 33 | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金托管协议                                       | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                            | 2024年06月13日 |
| 34 | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金基金合同                                       | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                            | 2024年06月13日 |
| 35 | 华泰保兴基金管理有限公司关于降低华泰保兴安悦债券型证券投资基金托管费率并修订基金合同和托管协议的公告        | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》                    | 2024年06月13日 |
| 36 | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金基金产品资料概要更新（2024 年第 2 号）                    | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、销售机构网站或网点                  | 2024年06月13日 |
| 37 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加长城证券股份有限公司为销售机构及开通相关业务并参加其费率优惠活动的公告 | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2024年06月21日 |
| 38 | 华泰保兴安悦债券型证券投资基金 2024 年度第 4 次分红公告                          | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》                    | 2024年06月25日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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              | 20240101-20240305, 20240315-20240318 | 475, 634, 507. 54 | -    | 475, 634, 507. 54 | -          | -    |
| 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于 2024 年 02 月 07 日起新增 C 类份额。详见《华泰保兴基金管理有限公司关于华泰保兴安悦债券型证券投资基金增加 C 类份额并修订基金合同和托管协议的公告》。

本基金托管费率于 2024 年 06 月 14 日起降低至 0.08%/年。详见《华泰保兴基金管理有限公司关于降低华泰保兴安悦债券型证券投资基金托管费率并修订基金合同和托管协议的公告》。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金募集的文件
- 2、《华泰保兴安悦债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《华泰保兴安悦债券型证券投资基金托管协议》
- 4、《华泰保兴安悦债券型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

### 12.2 存放地点

基金管理人办公场所及基金托管人住所

### 12.3 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

2024 年 08 月 30 日