华泰保兴货币市场基金

2018 第二季度 报告

2018年6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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月16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2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰保兴货币	
基金主代码	004493	
交易代码	004493	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年4月20日	
报告期末基金份额总额	6,316,591,449.57份	
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下,结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析,合理安排组合期限结构,积极选择投资工具,采取主动性的投资策略和精细化的操作手法,在控制的前提下,实现基金的投资目标。	
业绩比较基准	中国人民银行公布的7天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰保兴货币A	华泰保兴货币B
下属分级基金的交易代码	004493	004494
报告期末下属分级基金的份额总额	20,356,781.53份	6,296,234,668.04份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)	
	华泰保兴货币A	华泰保兴货币B
1. 本期已实现收益	227,722.47	56,530,216.90
2.本期利润	227,722.47	56,530,216.90
3.期末基金资产净值	20,356,781.53	6,296,234,668.04

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰保兴货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8970%	0.0011%	0.3366%	0.0000%	0.5604%	0.0011%

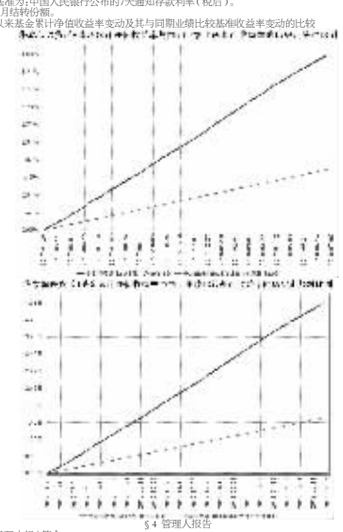
华泰保兴货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9577%	0.0011%	0.3366%	0.0000%	0.6211%	0.0011%

注:1.本基金业绩比较基准为:中国人民银行公布的7天通知存款利率(税后)。

2.本基金收益分配按月结转份额。

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



§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		
张挺	基金经理	2017年4月20日	-	7年	上海财经大学经济学硕士。历任华泰资产管理有限公司固定收益组合管理部债券研究员、投资助理、投资经理。在华泰资产管理有限公司任职期间,管理理组合类保险资产管理产品、集合型企业年金计划等。2016年8月加入华泰保兴基金管理有限公司。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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,结合投资交易系统中的公平交易模块,尽最大可能保证公平对待各投资组合;建立各投资组合投资信息严格管理及保密制度,保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离;加强对各投资组合投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

本报告期内,各投资组合不存在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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度,中国经济运行整体仍保持稳定,虽然基建投资和消费增速有所回落,但房地产投资在低库存情况下依然较强,对经济有一定支撑。随着资管新规的落地,表外融资受到限制,社融增速出现明显回落,企业融资环境趋紧,同时,中美贸易摩擦也给经济带来不确定性,因此,货币政策进行了一定的调整,市场资金利率水平出现明显的下行。

报告期内,基金操作上继续做好日常流动性管理,同时注重在资金面分析的基础上合理安排资产的到期期限,规避季末流动性紧张的风险,也有利于提高资产的配置收益。投资方向上仍以全国性股份制银行同业存款和同业存单为主,注重保持资产的安全性和流动性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期华泰保兴货币A的基金份额净值收益率为0.8970%,本报告期华泰保兴货币B的基金份额净值收益率为0.9577%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

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	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.91	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	39,999,860.00	0.63
	其中:买断式回购融资	-	

注:本基金报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本基金报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	52
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	53
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	35

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本基金报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	40.57	0.63
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	37.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	9.46	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	2.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	9.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.26	0.63

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未发生超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	709,968,699.95	11.24
	其中:政策性金融债	709,968,699.95	11.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	180,085,056.52	2.85
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,029,335,816.20	32.13
8	其他	-	-
9	合计	2,919,389,572.67	46.22
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111812052	18北京银行CD052	4,000,000	398,032,204.82	6.30
2	111810238	18兴业银行CD238	2,500,000	248,547,436.68	3.93
3	111809105	18浦发银行CD105	2,000,000	199,763,220.53	3.16
4	111820127	18广发银行CD127	2,000,000	199,548,391.38	3.16
5	111815270	18民生银行CD270	1,500,000	148,810,224.04	2.36
6	160208	16国开08	1,200,000	119,072,577.56	1.89
7	140202	14国开02	1,000,000	100,966,264.60	1.60
8	011801128	18华能集SCP005	1,000,000	100,053,754.64	1.58
9	170211	17国开11	1,000,000	99,850,735.18	1.58
10	180207	18国开07	1,000,000	99,826,671.39	1.58

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0802%
报告期内偏离度的最低值	0.0121%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0347%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:本基金报告期内未发生负偏离的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:本基金报告期内未发生正偏离的绝对值达到0.5%的情况。

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十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	149417	宁远03A1	1,000,000	100,000,000.00	1.58
2	1889112	18上和1A1	500,000	50,000,000.00	0.79

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金采用"摊余成本法"计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或面定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

5.9.2

1、18北京银行CD052(代码:111812052)为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。2017年8月8日,北京银监局针对北京银行未经核准提前授权部分人员实际履行高管人员职责的行为、同业业务严重违反审慎经营规则的违规事实,处以资令改正,并罚款人民币50万元的行政处罚。

2、18兴业银行CD238(代码:111810238)为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。2018年3月26日,中国人民银行福州中心支行针对兴业银行违反国库管理规定的违法违规事实,处以警告及罚款人民币5万元的行政处罚;经中国银保监会官网2018年5月4日发布信息显示,2018年4月19日,中国银行保险监督管理委员会针对兴业银行十二项违法违规行为,处以罚款5870万元的行政处罚。

3、18浦发银行CD105(代码:111809105)为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。经中国银保监会官网2018年5月4日发布信息显示,2018年2月12日,原中国银监会针对浦发银行十九项违法违规行为,处以罚款5845万元,没收违法所得10.927万元,罚没合计5885.927万元的行政处罚。

4、18广发银行CD127(代码:111820127)为华泰保兴货币市场基金的前十大持仓证券。2017年11月17日,原中国银监会针对广发银行十二项违法违规行为,处以警告,没收违法所得17553.79万元,并处3倍罚款52661.37万元,对其他违规行为罚款2000万元,罚没合计72215.16万元的行政处罚。

本基金投资18北京银行CD052、18兴业银行CD238、18浦发银行CD105、18广发银行CD127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18北京银行CD052、18兴业银行CD238、18浦发银行CD105、18广发银行CD127外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,325.31
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	27,776,361.84
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	27,777,687.15

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华泰保兴货币A	华泰保兴货币B
报告期初基金份额总额	25,968,456.33	5,691,864,737.55
报告期间基金总申购份额	17,586,099.01	8,320,303,991.46
报告期间基金总赎回份额	23,197,773.81	7,715,934,060.97
报告期末基金份额总额	20,356,781.53	6,296,234,668.04

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交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申赎	2018年4月26日	-5,000,000.00	-5,000,000.00	0.00%
2	红利再投	2018年4月27日	169,737.91	169,737.91	0.00%
3	申赎	2018年5月22日	-4,000,000.00	-4,000,000.00	0.00%
4	红利再投	2018年5月31日	169,751.08	169,751.08	0.00%
5	申赎	2018年6月27日	-4,000,000.00	-4,000,000.00	0.00%
6	红利再投	2018年6月29日	138,478.36	138,478.36	0.00%
合计			-12,522,032.65	-12,522,032.65	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:本基金本报告期内未发生单一投资者持有本基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金募集的文件

2、《华泰保兴货币市场基金基金合同》

3、《华泰保兴货币市场基金托管协议》

4、《华泰保兴货币市场基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、报告期内本基金在指定媒介披露的各项公告

7、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人办公场所,地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道88号金茂大厦4306室

9.3 查阅方式

1、营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅

2、登录基金管理人网站www.ehuataifund.com查阅

3、按打基金管理人客服热线电话400-632-9090查询

华泰保兴基金管理有限公司
2018年7月18日

华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月16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2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰保兴尊诚定开
基金主代码	004024
交易代码	004024
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2017年2月23日
报告期末基金份额总额	172,990,478.73份
投资目标	在谨慎投资的前提下,本基金力争战胜业绩比较基准,追求基金资产的长期、稳健、持续增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济运行状态、国家财政政策和货币政策、国家产业政策及资本市场资金环境的深入分析,积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平,结合定量分析方法,确定基金资产在各固定收益类证券之间的配置比例。本基金将主要投资策略包括买入与封闭期相匹配的债券,并持有到期,或者是持有运作期与封闭期相匹配的债券,获得本金和票息收入;同时,本基金还将在控制市场风险与流动性风险的前提下,灵活运用久期策略、期限结构配置策略、类属配置策略、信用债策略、个券挖掘策略及杠杆策略等多种投资策略,实施积极主动的组合管理,并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测,对债券组合进行动态调整。
业绩比较基准	中债综合指数(全价)收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,具有中等风险、中等预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。
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(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	2,352,448.94
2.本期利润	2,398,354.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0139
4.期末基金资产净值	184,436,948.58
5.期末基金份额净值	1.0662

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、所述基金业绩指标不包括持有人认购、申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。

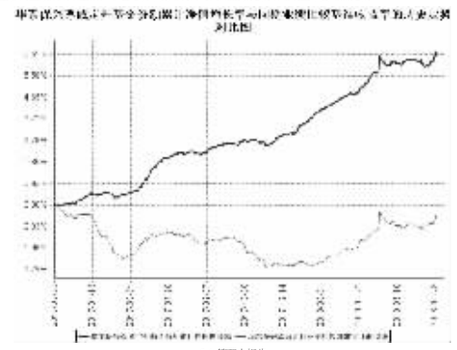
3.2 基金净值表现

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	1.32%	0.09%	1.01%	0.10%	0.31%	-0.01%

注:本基金业绩比较基准为:中债综合指数(全价)收益率。

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		
张挺	基金经理	2017年2月23日	-	7年	上海财经大学经济学硕士。历任华泰资产管理有限公司固定收益组合管理部债券研究员、投资助理、投资经理。在华泰资产管理有限公司任职期间,管理理组合类保险资产管理产品、集合型企业年金计划等。2016年8月加入华泰保兴基金管理有限公司。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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,结合投资交易系统中的公平交易模块,尽最大可能保证公平对待各投资组合;建立各投资组合投资信息严格管理及保密制度,保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离;加强对各投资组合投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

本报告期内,各投资组合不存在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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度,中国经济运行整体仍保持稳定,虽然基建投资和消费增速有所回落,但房地产投资在低库存情况下依然较强,对经济有一定支撑。随着资管新规的落地,表外融资受到限制,社融增速出现明显回落,企业融资环境趋紧,同时,中美贸易摩擦也给经济带来不确定性,因此,货币政策进行了一定的调整,市场资金利率水平出现明显的下行。

报告期内,债券市场出现分化,10年期政策性金融债利率下行45BP,中长端利率债和高等级信用债表现较好,与此同时,违约事件有所增加,一些资质较差的信用债跌幅较大。

基金投资方面,报告期内增持了中长期限的利率债,提高组合久期。信用债方面,继续通过投资受益于供给侧改革的短期限国企债券来获取稳定的票息收益,同时结合基金封闭运作的优势,适度使用套息策略来增强收益。可转债方面,考虑到转债估值水平已经较低,中长期来看开始具有投资价值,少量配置了部分低估值品种。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0662元;本报告期基金份额净值增长率为1.32%,业绩比较基准收益率为1.01%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	310,686,912.07	97.26
	其中:债券	310,686,912.07	97.26
	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	2,699,844.26	0.85
8	其他资产	6,049,411.74	1.89
9	合计	319,436,168.07	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:股票不属于本基金投资范围,本报告期末本基金未持有股票。

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

注:股票不属于本基金投资范围,本报告期末本基金未持有股票。

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	1,763,463.10	0.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	48,756,000.00	26.44
	其中:政策性金融债	48,756,000.00	26.44
4	企业债券	99,057,036.80	53.71
5	企业短期融资券	77,748,700.00	42.15
6	中期票据	58,418,900.00	31.67
7	可转债(可交换债)	15,264,812.17	8.28
8	同业存单	9,678,000.00	5.25
9	其他	-	-
10	合计	310,686,912.07	168.45

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	170404	17农发04	200,000	19,612,000.00	10.63
2	170210	17国开10	200,000	19,548,000.00	10.60
3	101659021	16陕煤化MTN001	150,000	14,973,000.00	8.12
4	136090	15绿地02	139,790	13,710,603.20	7.43
5	101458013	14淮北矿MTN002	130,000	13,133,900.00	7.12

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

注:本报告期末本基金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

注:贵金属不属于本基金投资范围,本报告期末本基金未持有贵金属。

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

注:权证不属于本基金投资范围,本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

国债期货不属于本基金投资范围,本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,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。

5.10.2

股票不属于本基金投资范围,本报告期末本基金未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,058.30
2	应收证券清算款	721,732.11
3	应收股利	-
4	应收利息	5,319,621.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,049,411.74

5.10.4 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	120001	16以岭EB	3,545,193.12	1.92
2	113502	嘉澳转债	1,084,491.00	0.59
3	123003	蓝思转债	927,474.10	0.50
4	128026	众兴转债	880,923.78	0.48
5	128019	久立转2	463,291.40	0.25

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:股票不属于本基金投资范围,本报告期末本基金未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,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	172,990,478.73
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)	-
报告期末基金份额总额	172,990,478.73

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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

注:本基金管理人本报告期内未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:本基金本报告期内未发生单一投资者持有本基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金募集的文件

2、《华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》

3、《华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》

4、《华泰保兴尊诚一年定期开放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、报告期内本基金在指定媒介披露的各项公告

7、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人办公场所,地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道88号金茂大厦4306室

9.3 查阅方式

1、营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅

2、登录基金管理人网站www.ehuataifund.com查阅

3、按打基金管理人客服热线电话400-632-9090查询

华泰保兴基金管理有限公司
2018年7月18日

华泰保兴尊合债券型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月16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2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰保兴尊合债券	
基金主代码	005159	
交易代码	005159	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年11月21日	
报告期末基金份额总额	134,920,999.97份	
投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的基础上,追求基金资产的长期稳定增值,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金通过对宏观经济运行状态、国家财政政策和货币政策、国家产业政策及资本市场资金环境的深入分析,积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平,结合定量分析方法,确定基金资产在各固定收益类证券之间的配置比例。本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下,灵活运用久期策略、类属配置策略、信用债策略、个券挖掘策略及杠杆策略等多种投资策略,实施积极主动的组合管理,并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测,对债券组合进行动态调整。	
业绩比较基准	中债综合(全价)指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰保兴尊合债券A	华泰保兴尊合债券C
下属分级基金的交易代码	005159	005160
报告期末下属分级基金的份额总额	100,282,186.20份	34,638,813.77份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)	
	华泰保兴尊合债券A	华泰保兴尊合债券C
1.本期已实现收益	576,227.27	415,174.22
2.本期利润	961,853.80	368,574.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.0096	0.0057
4.期末基金资产净值	103,357,657.47	35,654,989.05
5.期末基金份额净值	1.0307	1.0293