华泰保兴尊利债券型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019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：中国工商银行股份有限公司
送出日期：二〇一九年八月二十九日

§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。本半年度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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月27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2019年1月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金名称	华泰保兴尊利债券型证券投资基金	
基金简称	华泰保兴尊利债券	
基金主代码	005908	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年6月25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	
报告期末基金份额总额	175,602,266.78份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰保兴尊利债券A	华泰保兴尊利债券C
下属分级基金的交易代码	005908	005909
报告期末下属分级基金的份额总额	173,455,793.84份	2,146,472.94份

2.2基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资金流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，并通过积极主动的投资管理，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将基于宏观经济周期变化，确定利率变动方向和趋势，合理安排资产组合的配置结构，在控制投资风险的前提下获取超过债券市场平均收益水平的投资业绩。此外，本基金还将适度参与股票投资，通过积极地个股精选来增强基金资产的收益。
业绩比较基准	中债综合指数（全价）收益率×90%+沪深300 指数收益率×10%
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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	尤小刚	郭明
	联系电话	021-80299000	010-66105799
	电子邮箱	fund_xxpl@ehuatai.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-632-9090	95588
传真		021-60963566	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道88号4306室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道88号金茂大厦4306室	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		杨平	陈四清

2.4信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ehuataifund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§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

基金级别	华泰保兴尊利债券A	华泰保兴尊利债券C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019年1月1日 － 2019年6月30日）	报告期（2019年1月1日 － 2019年6月30日）
本期已实现收益	3,647,349.10	440,258.13
本期利润	3,765,538.01	950,744.37
加权平均基金份额本期利润	0.0189	0.0510
本期加权平均净值利润率	1.81%	4.90%
本期基金份额净值增长率	2.42%	2.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2019年6月30日）	
期末可供分配利润	5,642,437.31	60,576.60
期末可供分配基金份额利润	0.0325	0.0282
期末基金资产净值	181,115,239.70	2,231,987.13
期末基金份额净值	1.0442	1.0398
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2019年6月30日）	
基金份额累计净值增长率	4.42%	3.98%

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、期末可供分配利润是指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、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

华泰保兴尊利债券A

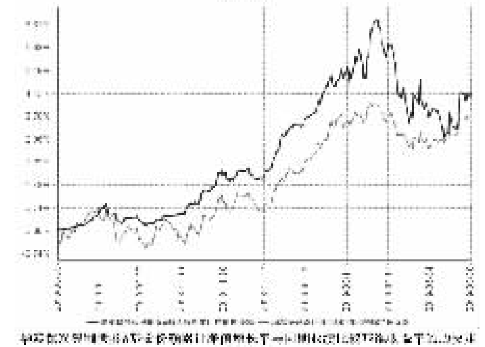
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.52%	0.25%	0.79%	0.10%	-0.27%	0.15%
过去三个月	-1.15%	0.30%	-0.27%	0.14%	-0.88%	0.16%
过去六个月	2.42%	0.25%	2.78%	0.14%	-0.36%	0.11%
过去一年	4.37%	0.18%	3.69%	0.15%	0.68%	0.03%
自基金合同生效起至今	4.42%	0.18%	3.71%	0.15%	0.71%	0.03%

华泰保兴尊利债券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	0.47%	0.25%	0.79%	0.10%	-0.32%	0.15%
过去三个月	-1.26%	0.30%	-0.27%	0.14%	-0.99%	0.16%
过去六个月	2.20%	0.25%	2.78%	0.14%	-0.58%	0.11%
过去一年	3.93%	0.18%	3.69%	0.15%	0.24%	0.03%
自基金合同生效起至今	3.98%	0.18%	3.71%	0.15%	0.27%	0.03%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率＊90%+沪深300指数收益率＊10%。

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



注：截至报告期末，本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§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

本基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司，经中国证监会证监许可〔2016〕1309号文核准，于2016年7月26日成立，注册资本为人民币1.8亿元。公司股东分别为华泰保险集团股份有限公司（下称“华泰保险集团”）、上海飞恒资产管理中心（有限合伙）（下称“飞恒资产”）、上海旷正资产管理中心（有限合伙）（下称“旷正资产”）、上海泰颐资产管理中心（有限合伙）（下称“泰颐资产”）、上海哲昌资产管理中心（有限合伙）（下称“哲昌资产”）、上海志庄资产管理中心（有限合伙）（下称“志庄资产”），其中，华泰保险集团持股比例为80%，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20%。

截至2019年6月30日，公司公募基金产品资产管理规模为142.20亿元。公司共管理十四只公募基金产品，具体包括华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金、华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金、华泰保兴货币市场基金、华泰保兴尊合债券型证券投资基金、华泰保兴策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、华泰保兴成长优选混合型证券投资基金、华泰保兴尊利债券型证券投资基金、华泰保兴尊颐定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰保兴研究智选灵活配置混合型证券投资基金、华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金、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、华泰保兴健康消费混合型证券投资基金。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
章劲	基金经理	2018年6月22日	-	13年	上海大学文学学士。历任上海银行人力资源部科员、资金营运中心交易员、经理，华夏基金管理有限公司基金经理、华泰资产管理有限公司投资管理部副总经理、投资管理部总经理、固定收益投资部总经理、证券投资副总监、证券投资总监。2016年8月加入华泰保兴基金管理有限公司，担任公司副总经理兼首席投资官。
张挺	基金经理	2018年6月22日	-	8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，曾管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，结合投资交易系统中的公平交易模块，尽最大可能保证公平对待各投资组合；建立各投资组合投资信息严格管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对各投资组合投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

本报告期内，未发现各投资组合因非公平交易等导致的利益输送行为及其他违反公平交易制度的情况，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待不同的投资组合，公司制定《异常交易监控与报告制度》对涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行了界定，并拟定相应的监控、识别、分析与防控措施；公司禁止同一交易日内同一投资组合内部、不同投资组合之间的反向交易以及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。

公司对各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易、反向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易制度的异常交易行为。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4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

2019年上半年，国内经济运行总体保持稳定，二季度下行压力有所显现。社融、M2增速略有回升，央行货币政策仍保持银行间市场流动性合理充裕。物价呈现食品较强、非食品较弱的特征，总体CPI温和回升。美债利率大幅下行，中美利差有所扩大，人民币汇率保持稳定。

报告期内，一季度权益市场大幅上涨，可转债指数也大幅上涨，虽然二季度受中美贸易战和外资短期买卖等因素的影响，股票市场冲高回落，并带动可转债市场的回调，但仍为上半年表现最优的两个投资品种。利率债先跌后涨，整体机会不大。宽信用政策取得一定效果，信用债整体表现优于利率债。

基金投资方面，债券部分仍配置中短期限高等级国企债，以获取票息收益。股票和转债部分由于未能预料贸易战有所升级的情况出现，因此股票和转债仓位未有明显下降，导致基金净值出现较大幅度回撤。

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尊利债券A基金份额净值为1.0442元，本报告期基金份额净值增长率为2.42%；截至本报告期末华泰保兴尊利债券C基金份额净值为1.0398元，本报告期基金份额净值增长率为2.20%；同期业绩比较基准收益率为2.78%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年下半年，经济下行压力依然存在，经济增速可能会继续小幅回落。房地产投资增速同比可能会逐步回落，工业品价格仍面临下行风险，制造业投资仍将保持较低增速。政策方面，央行仍将保持稳健货币政策，通过定向降准等方式支持实体经济，全面降息降准的可能性不大。

总体而言，经济偏弱背景下，利率风险仍然不大，利率债有望延续慢牛行情；信用债需注意规避风险；可转债估值仍较低，从中长期来看依然具备较好的投资价值；股票市场在承受内外压力的作用下，难以很快出现一季度的系统性机会，同样由于企业盈利的积累和股指回调后估值也回到较低的水平，因此继续大幅下跌的概率也不高，股票市场更可能呈现震荡分化的局面。

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。估值委员会委员由分管运营的副总经理、研究部、风险管理部、监察稽核部和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。

研究部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，对拟采用的估值方法进行初步判断，提出适用的估值模型和参数。风险管理部负责对特殊投资品种的估值方法和估值模型进行研究，通过实证分析等方法完善估值模型，验证研究部提供的估值模型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。

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，本报告期内本基金未实施利润分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的规定实施利润分配。

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遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华泰保兴尊利债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，华泰保兴尊利债券型证券投资基金的管理人——华泰保兴基金管理有限公司在华泰保兴尊利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华泰保兴尊利债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华泰保兴基金管理有限公司编制和披露的华泰保兴尊利债券型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：华泰保兴尊利债券型证券投资基金
报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,553,339.60	3,993,210.15
结算备付金		569,011.81	419,576.13
存出保证金		21,798.25	15,390.82
交易性金融资产	6.4.7.2	193,868,213.26	245,805,109.40
其中：股票投资		9,576,890.00	4,867,540.00
基金投资		-	-
债券投资		184,291,323.26	240,937,569.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	8,000,000.00	84,850,427.78
应收证券清算款		118,609.44	93,293.57
应收利息	6.4.7.5	2,785,809.29	3,367,469.91
应收股利		-	-
应收申购款		20.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		206,916,801.65	338,544,477.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债：			
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		23,000,000.00	80,000,000.00
应付证券清算款		-	1,020,015.00
应付赎回款		208,676.80	151,554.78
应付管理人报酬		122,211.24	168,178.46
应付托管费		32,589.63	44,847.58
应付销售服务费		841.60	21,645.26
应付交易费用	6.4.7.7	101,464.27	29,052.16
应交税费		8,704.74	9,921.14
应付利息		9,641.10	73,799.42
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	85,445.44	113,113.78
负债合计		23,569,574.82	81,632,127.58
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	175,602,266.78	252,120,822.14
未分配利润	6.4.7.10	7,744,960.05	4,791,528.04
所有者权益合计		183,347,226.83	256,912,350.18
负债和所有者权益总计		206,916,801.65	338,544,477.76

注：报告截止日2019年6月30日，华泰保兴尊利债券A基金份额净值1.0442元，基金份额总额173,455,793.84份；华泰保兴尊利债券C基金份额净值1.0398元，基金份额总额2,146,472.94份。华泰保兴尊利债券份额总额合计为175,602,266.78份。

6.2利润表

会计主体：华泰保兴尊利债券型证券投资基金
本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月25日（基金合同生效日）至2018年6月30日
一、收入		6,252,802.33	241,953.64
1.利息收入		2,968,980.93	241,953.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	30,743.62	157,183.34
债券利息收入		2,809,595.27	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		128,642.04	84,770.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,634,584.53	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,309,225.96	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,747,568.69	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	196,241.80	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	628,675.15	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	20,561.72	-
减：二、费用		1,536,519.95	58,929.90
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	849,199.14	36,141.01
2.托管费	6.4.10.2.2	226,453.04	9,637.60
3.销售服务费	6.4.10.2.3	39,140.92	9,261.07
4.交易费用	6.4.7.19	137,133.68	-
5.利息支出		180,583.51	-
其中：卖出回购金融资产支出		180,583.51	-
6.税金及附加		4,242.54	-
7.其他费用	6.4.7.20	99,767.12	3,890.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,716,282.38	183,023.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,716,282.38	183,023.74

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰保兴尊利债券型证券投资基金
本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	252,120,822.14	4,791,528.04	256,912,350.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,716,282.38	4,716,282.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-76,518,555.36	-1,762,850.37	-78,281,405.73
其中：1.基金申购款	71,260,326.99	3,803,110.29	75,063,437.28
2.基金赎回款	-147,778,882.35	-5,565,960.66	-153,344,843.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	175,602,266.78	7,744,960.05	183,347,226.83
项目	上年度可比期间 2018年6月25日（基金合同生效日）至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	351,684,749.31	-	351,684,749.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	183,023.74	183,023.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	351,684,749.31	183,023.74	351,867,773.05

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：

王冠龙	王冠龙	王云凌
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

华泰保兴尊利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〔2018〕622号《关于准予华泰保兴尊利债券型证券投资基金注册的批复》核准，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《华泰保兴尊利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351,658,056.30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（2018）第0431号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰保兴尊利债券型证券投资基金基金合同》于2018年6月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为351,684,749.31份，其中认购资金利息折合基金份额26,693.01份。本基金的基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华泰保兴尊利债券型证券投资基金基金合同》和《华泰保兴尊利债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购/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。在投资人认购/申购时收取认购/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；在投资人认购/申购时不收取认购/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、C类基金份额分别设置代码。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，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴尊利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，包括国内依法发行交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债、中期票据、短期融资券、政府支持机构债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等。本基金可同时投资于国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等品种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）。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率×90%+沪深300 指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰保兴基金管理有限公司于2019年8月28日批准报出。

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2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（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〈年度报告和半年度报告〉》、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》、《华泰保兴尊利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2019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2019年6月30日的财务状况以及2019年上半年度的经营成果和基金净值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〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2012〕85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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股票、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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

（4）基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

（5） 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华泰保险集团股份有限公司	基金管理人的主要股东
上海飞恒资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海旷正资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海泰颐资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海哲昌资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海志庄资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
华泰财产保险有限公司	基金管理人的主要股东控制的机构
华泰人寿保险股份有限公司	基金管理人的主要股东控制的机构

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。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月25日（基金合同生效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	849,199.14	36,141.01
其中：支付销售机构的客户维护费	49,781.10	4,128.87

注：支付基金管理人华泰保兴基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%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 × 0.75% / 当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月25日（基金合同生效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	226,453.04	9,637.60

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.20%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：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.8.2.3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 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴尊利债券A	华泰保兴尊利债券C	合计
华泰保兴基金管理有限公司	0.00	31,125.59	31,125.59
中国工商银行股份有限公司	0.00	7,370.80	7,370.80
合计	0.00	38,496.39	38,496.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年6月25日（基金合同生效日）至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴尊利债券A	华泰保兴尊利债券C	合计
华泰保兴基金管理有限公司	0.00	8,057.36	8,057.36
中国工商银行股份有限公司	0.00	1,203.66	1,203.66
合计	0.00	9,261.02	9,261.02

注：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管理有限公司，再由华泰保兴基金管理有限公司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分别为0.40%。其计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值 × 0.40%/ 当年天数。

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2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

份额单位：份

华泰保兴尊利债券A

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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
华泰财产保险有限公司	19,999,400.00	11.389%	19,999,400.00	7.9325%
华泰人寿保险股份有限公司	29,999,600.00	17.0838%	29,999,600.00	11.8989%

6.4.8.5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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年6月25日（基金合同生效日）至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,553,339.60	20,135.57	6,696,286.58	46,072.24

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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。

6.4.8.7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。

6.4.9利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配。

6.4.10期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113537	文灿转债	2019年6月12日	2019年7月5日	新债未上市	100.00	100.00	2,060	206,000.00	206,000.00	-
113027	华钰转债	2019年6月18日	2019年7月10日	新债未上市	100.00	100.00	1,440	144,000.00	144,000.00	-
113028	环境转债	2019年6月20日	2019年7月8日	新债未上市	100.00	100.00	550	55,000.00	55,000.00	-
123027	蓝晓转债	2019年6月13日	2019年7月4日	新债未上市	100.00	100.00	450	45,000.00	45,000.00	-
128069	华森转债	2019年6月26日	2019年7月11日	新债未上市	100.00	100.00	330	33,000.00	33,000.00	-

6.4.10.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.10.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1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。

6.4.10.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额23,000,000.00元，于2019年7月1日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.11有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

（a） 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。

（b） 持续的以公允价值计量的金融工具

（i） 各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为54,912,545.26元，属于第二层次的余额为138,955,668.00元，无属于第三层次的余额（2018年12月31日：第一层次24,771,792.70元，第二层次221,033,316.70元，无第三层次）。

（ii） 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股票和债券，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股票和债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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

（iii） 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

（c） 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2018年12月31日：同）。

（d） 不以公允价值计量的金融工具

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。

（2）其他

除公允价值外，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	9,576,890.00	4.63
	其中：股票	9,576,890.00	4.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	184,291,323.26	89.07
	其中：债券	184,291,323.26	89.07
	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	8,000,000.00	3.87
	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	2,122,351.41	1.03
8	其他各项资产	2,926,236.98	1.41
9	合计	206,916,801.65	100.00

7.2期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	130,300.00	0.07
C	制造业	7,014,450.00	3.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	234,000.00	0.13
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	944,800.00	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	499,800.00	0.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	275,250.00	0.15
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	212,520.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	265,770.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,576,890.00	5.22

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603826	坤彩科技	80,000	1,175,200.00	0.64
2	601012	隆基股份	50,000	1,155,500.00	0.63
3	002882	金龙羽	70,000	844,900.00	0.46
4	002240	威华股份	80,000	671,200.00	0.37
5	603883	老百姓	10,000	584,800.00	0.32
6	001965	招商公路	60,000	499,800.00	0.27
7	603179	新泉股份	35,000	453,250.00	0.25
8	600987	航民股份	60,000	396,600.00	0.22
9	603233	大参林	8,000	360,000.00	0.20
10	000661	长春高新	1,000	338,000.00	0.18
11	603589	口子窖	5,000	322,100.00	0.18
12	603181	皇马科技	20,000	297,000.00	0.16
13	601211	国泰君安	15,000	275,250.00	0.15
14	600763	通策医疗	3,000	265,770.00	0.14
15	603737	三棵树	6,000	261,240.00	0.14
16	603393	新天然气	10,000	234,000.00	0.13
17	603225	新凤鸣	18,000	224,820.00	0.12
18	000902	新洋丰	20,000	214,600.00	0.12
19	300662	科锐国际	6,000	212,520.00	0.12
20	300567	精测电子	3,000	157,560.00	0.09
21	002332	仙琚制药	20,000	135,200.00	0.07
22	000968	蓝焰控股	10,000	116,100.00	0.06
23	300450	先导智能	3,000	100,800.00	0.05
24	300596	利安隆	3,000	91,200.00	0.05
25	002648	卫星石化	5,000	74,400.00	0.04
26	603507	振江股份	3,000	63,540.00	0.03
27	603379	三美股份	1,000	37,340.00	0.02
28	600968	海油发展	4,000	14,200.00	0.01

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603939	益丰药房	2,791,104.00	1.09
2	603883	老百姓	2,445,639.00	0.95
3	603826	坤彩科技	1,968,594.20	0.77
4	601012	隆基股份	1,936,691.00	0.75
5	000902	新洋丰	1,842,022.00	0.72
6	601225	陕西煤业	1,683,260.00	0.66
7	300567	精测电子	1,571,392.00	0.61
8	603179	新泉股份	1,430,433.00	0.56
9	603393	新天然气	1,429,325.00	0.56
10	000968	蓝焰控股	1,382,001.00	0.54
11	002240	威华股份	1,361,594.00	0.53
12	600987	航民股份	1,348,844.00	0.53
13	002727	一心堂	1,308,999.00	0.51
14	300751	迈为股份	1,166,830.00	0.45
15	002129	中环股份	1,148,644.21	0.45
16	002882	金龙羽	1,005,928.00	0.39
17	603260	合盛硅业	1,001,317.00	0.39
18	600600	青岛啤酒	996,209.00	0.39
19	002332	仙琚制药	990,671.00	0.39
20	000525	红太阳	982,451.00	0.38

7.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603939	益丰药房	2,919,628.00	1.14
2	601225	陕西煤业	2,133,252.00	0.83
3	600987	航民股份	1,940,944.72	0.76
4	603179	新泉股份	1,815,675.20	0.71
5	603883	老百姓	1,748,796.00	0.68
6	002240	威华股份	1,703,073.00	0.66
7	000902	新洋丰	1,601,454.00	0.62
8	000968	蓝焰控股	1,494,662.00	0.58
9	002727	一心堂	1,394,271.00	0.54
10	300567	精测电子	1,324,551.00	0.52
11	300751	迈为股份	1,222,983.00	0.48
12	603393	新天然气	1,073,518.60	0.42
13	600600	青岛啤酒	1,067,117.00	0.42
14	000525	红太阳	1,028,119.00	0.40
15	002129	中环股份	1,027,850.00	0.40
16	002867	周大生	907,698.00	0.35
17	002462	嘉事堂	906,117.00	0.35
18	601012	隆基股份	894,094.12	0.35
19	300632	光莆股份	838,439.25	0.33
20	603260	合盛硅业	803,184.00	0.31

7.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	55,704,503.78
卖出股票收入（成交）总额	50,123,446.11

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	12,047,200.00	6.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,007,000.00	5.46
	其中：政策性金融债	10,007,000.00	5.46
4	企业债券	71,892,500.00	39.21
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,259,000.00	11.05
7	可转债（可交换债）	70,085,623.26	38.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	184,291,323.26	100.51

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	120002	18中原EB	99,900	10,865,124.00	5.93
2	101800916	18王府井集MTN001	100,000	10,232,000.00	5.58
3	180017	18附息国债17	100,000	10,214,000.00	5.57
4	112734	18招路01	100,000	10,183,000.00	5.55
5	143712	18招商G5	100,000	10,174,000.00	5.55

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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11投资组合报告附注

7.11.1本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.11.2本基金投资的前十名股票中，无基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.11.3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	21,798.25
2	应收证券清算款	118,609.44
3	应收股利	-
4	应收利息	2,785,809.29
5	应收申购款	20.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,926,236.98

7.11.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113508	新凤转债	8,000,085.00	4.36
2	113509	新泉转债	2,837,070.00	1.55
3	110030	格力转债	2,305,769.40	1.26
4	113019	玲珑转债	2,184,200.00	1.19
5	113525	台华转债	1,897,299.30	1.03
6	110048	福能转债	1,670,700.00	0.91
7	132015	18中油EB	1,566,240.00	0.85
8	128025	特一转债	1,276,536.80	0.70
9	113522	旭升转债	1,245,600.00	0.68
10	132012	17巨化EB	827,328.00	0.45
11	132013	17宝武EB	499,700.00	0.27
12	127006	敖东转债	353,395.00	0.19
13	113524	奇精转债	149,760.00	0.08
14	128046	利尔转债	93,637.60	0.05

7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.11.6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。

§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（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华泰保兴尊利债券A	122	1,421,768.80	165,389,485.09	95.35%	8,066,308.75	4.65%
华泰保兴尊利债券C	91	23,587.61	0.00	0.00%	2,146,472.94	100.00%
合计	206	852,438.19	165,389,485.09	94.18%	10,212,781.69	5.82%

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	华泰保兴尊利债券A	1,051,874.64	0.61%
	华泰保兴尊利债券C	7,475.88	0.35%
	合计	1,059,350.52	0.60%

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的情况

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	华泰保兴尊利债券A	50~100
	华泰保兴尊利债券C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰保兴尊利债券A	50~100
	华泰保兴尊利债券C	0
	合计	50~100

§9开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰保兴尊利债券A	华泰保兴尊利债券C
基金合同生效日（2018年6月25日）基金份额总额	182,710,626.36	168,974,122.95
本报告期期初基金份额总额	196,013,042.40	56,107,779.74
本报告期期间基金总申购份额	55,455,564.93	15,804,762.06
减：本报告期期间基金总赎回份额	78,012,813.49	69,766,068.86
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	173,455,793.84	2,146,472.94

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。

§10重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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

（1）本报告期基金管理人无重大人事变动。
（2）本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、基金财产、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

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

10.7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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	2	36,667,412.20	34.70%	26,081.45	34.70%	-
长江证券	2	35,350,605.16	33.45%	25,144.85	33.45%	-
国泰君安证券	2	32,470,739.53	30.72%	23,096.57	30.72%	-
国金证券	2	1,194,353.00	1.13%	849.52	1.13%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字〔2007〕48号）有关规定，基金管理人对多家证券经营机构进行了综合评估。

1、专用交易单元的选择标准：

（1）财务状况良好，经营行为规范；

（2）研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向和个股分析的研究报告等信息服务；

（3）内部管理规范、严谨，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

2、专用交易单元的选择程序：

（1）公司对交易单元所属券商进行综合评价，投资决策委员会根据综合评价的结果作出租用与否的决策；

（2）公司研究部定期组织对交易单元所属券商的综合服务进行评价，由投资决策委员会对交易单元的交易量进行分配和调整。

10.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
天风证券	37,999,053.61	32.71%	316,000,000.00	29.90%	-	-
长江证券	53,281,695.01	45.87%	435,000,000.00	41.15%	-	-
国泰君安证券	17,640,736.01	15.19%	273,000,000.00	25.83%	-	-
国金证券	7,247,083.53	6.24%	33,000,000.00	3.12%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

§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

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

11.2影响投资者决策的其他重要信息

无。

华泰保兴基金管理有限公司
2019年8月29日