

华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金
2019 年半年度报告

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。

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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§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.....	12
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.....	12
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	37
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.11 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的情况.....	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.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	45
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.....	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	45

§12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	华泰保兴尊诚定开
基金主代码	004024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 2 月 23 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
报告期末基金份额总额	3,480,235,229.55 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。本基金的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，或者是持有回售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，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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	尤小刚
	联系电话	021-80299000
	电子邮箱	fund_xxpl@ehuatai.com
客户服务电话	400-632-9090	95566
传真	021-60963566	010-66594942
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 1 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世	北京市西城区复兴门内大街 1

	纪大道 88 号金茂大厦 4306 室	号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	杨平	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.chuataifund.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

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	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号金茂大厦 4306 室

§ 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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	26,683,044.23
本期利润	35,740,930.97
加权平均基金份额本期利润	0.0189
本期加权平均净值利润率	1.65%
本期基金份额净值增长率	6.45%
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	268,140,726.63
期末可供分配基金份额利润	0.0770
期末基金资产净值	3,946,724,380.19
期末基金份额净值	1.1340
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	19.05%

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

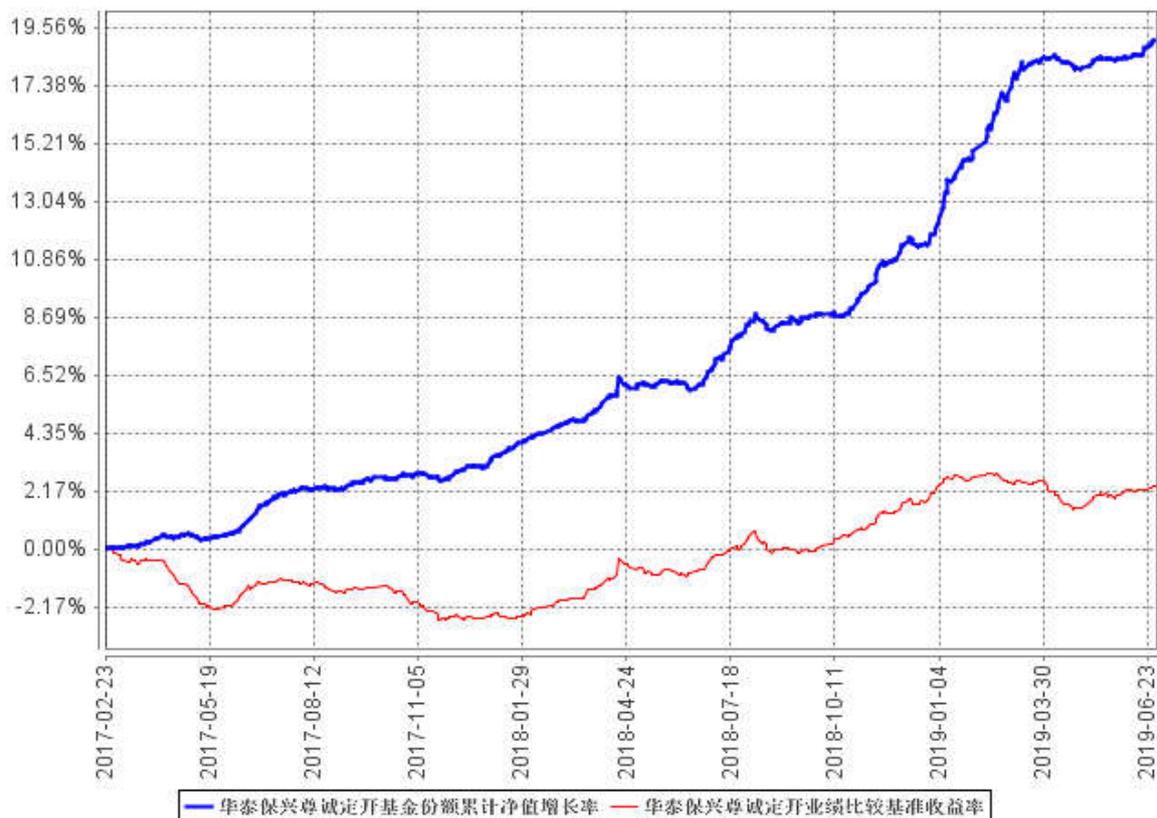
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.57%	0.04%	0.28%	0.03%	0.29%	0.01%
过去三个月	0.52%	0.04%	-0.24%	0.06%	0.76%	-0.02%
过去六个月	6.45%	0.11%	0.24%	0.06%	6.21%	0.05%
过去一年	11.66%	0.10%	2.82%	0.06%	8.84%	0.04%
自基金合同生效起至今	19.05%	0.08%	2.34%	0.06%	16.71%	0.02%

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

华泰保兴尊诚定开基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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		
张挺	基金经理	2017 年 2 月 23 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，权益市场总体上涨，可转债指数也大幅上涨，虽然二季度有所回调，但仍为上半年表现最优的债券品种。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，可转债坚持绝对收益的投资思路，在市场上涨后减持了部分涨幅较大的品种，市场调整之后，从中长期投资价值的角度继续增持低估值品种。利率债保持久期稳定，信用债主要增持中短期限高等级债。

4.4.2 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 1.1340 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.45%，业绩比较基准收益率为 0.24%。

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，从中长期来看具备较好的投资价值。

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

本报告期内本基金实施利润分配 1 次，分红方案为每 10 份基金份额发放现金红利 0.56 元，权益登记日及除息日：2019 年 4 月 29 日，现金红利发放日：2019 年 4 月 30 日。本基金的利润分配符合法律法规及基金合同的规定。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，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以及基金费用开支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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、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：华泰保兴尊诚一年定期开放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	10,139,379.80	1,253,488.18
结算备付金		10,865,249.19	1,318,671.61
存出保证金		279,636.37	5,226.68
交易性金融资产	6.4.7.2	4,267,514,892.73	324,661,082.63
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,267,514,892.73	324,661,082.63
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	692,864,009.29	-
应收证券清算款		-	497,982.26
应收利息	6.4.7.5	44,051,148.96	5,117,648.97
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,025,714,316.34	332,854,100.33
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		1,070,168,000.00	138,749,393.22
应付证券清算款		4,996,079.45	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,938,988.73	98,213.34
应付托管费		646,329.58	32,737.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	34,694.21	11,705.38

应交税费		153,354.29	28,796.72
应付利息		946,790.64	119,610.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	105,699.25	363,000.00
负债合计		1,078,989,936.15	139,403,456.84
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,480,235,229.55	172,990,478.73
未分配利润	6.4.7.10	466,489,150.64	20,460,164.76
所有者权益合计		3,946,724,380.19	193,450,643.49
负债和所有者权益总计		5,025,714,316.34	332,854,100.33

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1340 元，基金份额总额 3,480,235,229.55 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰保兴尊诚一年定期开放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 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		46,572,784.30	9,575,331.62
1.利息收入		51,433,034.64	7,133,505.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	252,618.83	39,249.29
债券利息收入		47,191,470.09	7,077,158.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,988,945.72	17,098.21
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-13,918,883.92	405,347.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-13,918,883.92	405,347.63
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	9,057,886.74	2,036,478.11
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	746.84	0.26
减：二、费用		10,831,853.33	2,683,494.43

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,403,575.29	599,104.40
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,134,525.10	199,701.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	37,089.63	10,899.34
5. 利息支出		2,015,013.59	1,645,883.33
其中：卖出回购金融资产支出		2,015,013.59	1,645,883.33
6. 税金及附加		105,571.67	21,603.07
7. 其他费用	6.4.7.20	136,078.05	206,302.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		35,740,930.97	6,891,837.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		35,740,930.97	6,891,837.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰保兴尊诚一年定期开放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）	172,990,478.73	20,460,164.76	193,450,643.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,740,930.97	35,740,930.97
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）	3,307,244,750.82	604,838,160.74	3,912,082,911.56
其中：1.基金申购款	3,323,202,958.18	607,722,683.35	3,930,925,641.53
2.基金赎回款	-15,958,207.36	-2,884,522.61	-18,842,729.97
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）	-	-194,550,105.83	-194,550,105.83
五、期末所有者权益（基金净值）	3,480,235,229.55	466,489,150.64	3,946,724,380.19
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 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)	235,509,292.82	7,341,382.91	242,850,675.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,891,837.19	6,891,837.19
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)	-62,518,814.09	-2,786,750.25	-65,305,564.34
其中：1.基金申购款	57,884,484.74	2,705,345.27	60,589,830.01
2.基金赎回款	-120,403,298.83	-5,492,095.52	-125,895,394.35
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)	172,990,478.73	11,446,469.85	184,436,948.58

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

华泰保兴尊诚一年定期开放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[2016]2836号《关于准予华泰保兴尊诚一年定期开放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《华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 235,436,393.33 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(2017)第 141 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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》于 2017 年 2 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 235,509,292.82 份，其中认购资金利息折合基金份额 72,899.49 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

为中国银行股份有限公司。

本基金为定期开放式基金。封闭期为自基金合同生效日(含)起或每一开放期结束之日次日(含)起 12 个月的期间,开放期为自每一封闭期结束之日后第一个工作日(含)起五至二十个工作日,具体时间由基金管理人在上一封闭期结束前公告说明。本基金封闭期内不办理申购、赎回或其他业务,也不上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、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、可转换债券(含分离交易可转债)、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)。本基金不投资股票、权证等权益类资产,但可持有因可转换债券转股或可交换债券换股所形成的股票(包括因持有该股票所派发的权证)以及投资可分离债券而产生的权证。本基金的业绩比较基准为中债综合指数(全价)收益率。

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》、《华泰保兴尊诚一年定期开放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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	10,139,379.80
定期存款	-
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	-
合计	10,139,379.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	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	2,020,064,669.82	2,022,010,592.73
	银行间市场	2,234,028,648.91	2,245,504,300.00
	合计	4,254,093,318.73	4,267,514,892.73
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,254,093,318.73	4,267,514,892.73	13,421,574.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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 2019 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,000,000.00	-
银行间市场	672,864,009.29	-
合计	692,864,009.29	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,308.38
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	4,889.40
应收债券利息	42,826,276.73
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,216,548.55
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	125.90
合计	44,051,148.96

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	34,694.21
合计	34,694.21

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
----	------------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付信息披露费	74,383.76
应付审计费	22,315.49
应付银行间债券账户维护费	9,000.00
合计	105,699.25

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	172,990,478.73	172,990,478.73
本期申购	3,323,202,958.18	3,323,202,958.18
本期赎回(以“-”号填列)	-15,958,207.36	-15,958,207.36
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	3,480,235,229.55	3,480,235,229.55

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

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	16,372,445.92	4,087,718.84	20,460,164.76
本期利润	26,683,044.23	9,057,886.74	35,740,930.97
本期基金份额交易产生的变动数	419,635,342.31	185,202,818.43	604,838,160.74
其中：基金申购款	421,644,854.50	186,077,828.85	607,722,683.35
基金赎回款	-2,009,512.19	-875,010.42	-2,884,522.61
本期已分配利润	-194,550,105.83	-	-194,550,105.83
本期末	268,140,726.63	198,348,424.01	466,489,150.64

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
	活期存款利息收入
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	36,094.55
其他	130,971.68
合计	252,618.83

6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-13,918,883.92
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	-13,918,883.92

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,641,267,824.32
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,565,892,956.77
减：应收利息总额	89,293,751.47
买卖债券差价收入	-13,918,883.92

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	9,057,886.74
——股票投资	-
——债券投资	9,057,886.74
——资产支持证券投资	-
——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	9,057,886.74

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	746.84
合计	746.84

注：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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	10,219.63
银行间市场交易费用	26,870.00
合计	37,089.63

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
----	----------------------------

审计费用	22,315.49
信息披露费	74,383.76
债券账户维护费	18,600.00
银行汇划费用	20,778.80
合计	136,078.05

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

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	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。

6.4.10 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

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。

6.4.10.2 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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,403,575.29	599,104.40
其中：支付销售机构的客户维护费	25,254.11	33,274.89

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 0.60%的费率计提，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 × 0.60% / 当年天数。

6.4.10.2.2 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1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,134,525.10	199,701.41

注：支付基金托管人中国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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金不收取销售服务费。

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

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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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

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	189,367,888.89	5.44%	19,999,900.00	11.56%
华泰保险集团股份有限 公司	17,729,674.13	0.51%	-	-
华泰人寿保险股份有限 公司	397,447,028.50	11.42%	20,002,600.00	11.56%
华泰人寿保险股份有限 公司-分红账户 2	46,223,526.31	1.33%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.10.5 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1月1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
中国银行股份有限公司	10,139,379.80	85,552.60	1,365,606.26	13,626.54

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

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2019年4月29日	-	2019年4月29日	0.5600	187,665,005.34	6,885,100.49	194,550,105.83	
合计	-		-	0.5600	187,665,005.34	6,885,100.49	194,550,105.83	

6.4.12 期末（2019 年 6 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

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	7,420	742,000.00	742,000.00	-
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	4,120	412,000.00	412,000.00	-
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	3,060	306,000.00	306,000.00	-
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	670	67,000.00	67,000.00	-
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	560	56,000.00	56,000.00	-

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 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

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，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 1,070,168,000.00 元，于 2019 年 7 月 1 日、2019 年 7 月 3 日先后到期。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。

6.4.13 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约责任，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。本基金的银行活期存款存放在本基金的托管人中国银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险较低。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	721,110,000.00	10,090,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	130,250,000.00	13,133,900.00
合计	851,360,000.00	23,223,900.00

注：未评级债券为超短期融资券。

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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	2,172,392,728.4	129,804,460.00
AAA 以下	585,029,882.13	107,300,159.13
未评级	658,732,282.20	64,332,563.50
合计	3,416,154,892.73	301,437,182.63

注：未评级债券为国债和政策性银行债。

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于约定开放日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于开放期内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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。本基金所持有的证券在证券交易所上市或在银行间市场进行交易，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过本基金资产净值的 10%，本基金与本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不超过该证券的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的 15%。本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不超过该上市公司可流通股股票的 15%。本报告期末，除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受到限制不能自由转让的情况外，本基金持有的其他证券均能以合理价格适时变现。此外，本基金还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，其上限一般不超过本基金持有的债券投资的公允价值。

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。

本基金主要投资于证券交易所及银行间同业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 2019年6月30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						
银行存款	10,139,379.80	-	-	-	-	10,139,379.80
结算备付金	10,865,249.19	-	-	-	-	10,865,249.19
存出保证金	279,636.37	-	-	-	-	279,636.37
交易性金融资产	1,264,999,868.33	380,807,923.20	1,976,249,919.00	645,457,182.20	-	4,267,514,892.73
买入返售金融资产	692,864,009.29	-	-	-	-	692,864,009.29
应收利息	-	-	-	-	44,051,148.96	44,051,148.96
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,979,148,142.98	380,807,923.20	1,976,249,919.00	645,457,182.20	44,051,148.96	5,025,714,316.34
负债						
卖出回购金融资产款	1,070,168,000.00	-	-	-	-	1,070,168,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	4,996,079.45	4,996,079.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,938,988.73	1,938,988.73
应付托管费	-	-	-	-	646,329.58	646,329.58
应付交易费用	-	-	-	-	34,694.21	34,694.21
应付利息	-	-	-	-	946,790.64	946,790.64

应交税费	-	-	-	-	153,354.29	153,354.29
其他负债	-	-	-	-	105,699.25	105,699.25
负债总计	1,070,168,000.00	-	-	-	8,821,936.15	1,078,989,936.15
利率敏感度缺口	908,980,142.98	380,807,923.20	1,976,249,919.00	645,457,182.20	35,229,212.81	3,946,724,380.19
上年度末 2018 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						
银行存款	1,253,488.18	-	-	-	-	1,253,488.18
结算备付金	1,318,671.61	-	-	-	-	1,318,671.61
存出保证金	5,226.68	-	-	-	-	5,226.68
交易性金融资产	59,879,381.20	110,673,442.53	105,218,195.40	48,890,063.50	-	324,661,082.63
应收证券清算款	-	-	-	-	497,982.26	497,982.26
应收利息	-	-	-	-	5,117,648.97	5,117,648.97
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	62,456,767.67	110,673,442.53	105,218,195.40	48,890,063.50	5,615,631.23	332,854,100.33
负债						
卖出回购金融资产款	138,749,393.22	-	-	-	-	138,749,393.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	98,213.34	98,213.34
应付托管费	-	-	-	-	32,737.79	32,737.79
应付交易费用	-	-	-	-	11,705.38	11,705.38
应付利息	-	-	-	-	119,610.39	119,610.39
应交税费	-	-	-	-	28,796.72	28,796.72
其他负债	-	-	-	-	363,000.00	363,000.00
负债总计	138,749,393.22	-	-	-	654,063.62	139,403,456.84
利率敏感度缺口	-76,292,625.55	110,673,442.53	105,218,195.40	48,890,063.50	4,961,567.61	193,450,643.49

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	除市场利率发生变动之外的其他风险变量保持不变。		
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 （2019 年 6 月 30 日）	上年度末 （2018 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-28,815,556.81	-2,163,362.49
	市场利率下降 25 个基点	29,327,199.84	2,201,543.44

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和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 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 270,861,771.53 元，属于第二层次的余额为 3,996,653,121.20 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 33,919,638.83 元，第二层次 290,741,443.80 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,267,514,892.73	84.91
	其中：债券	4,267,514,892.73	84.91
	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	692,864,009.29	13.79
	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	21,004,628.99	0.42
8	其他各项资产	44,330,785.33	0.88
9	合计	5,025,714,316.34	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	87,305,782.20	2.21
2	央行票据	-	-

3	金融债券	622,485,500.00	15.77
	其中：政策性金融债	571,426,500.00	14.48
4	企业债券	1,550,266,320.00	39.28
5	企业短期融资券	851,360,000.00	21.57
6	中期票据	649,736,800.00	16.46
7	可转债（可交换债）	506,360,490.53	12.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,267,514,892.73	108.13

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	071900028	19 东方证券 CP001	2,000,000	200,260,000.00	5.07
2	136830	16 中信 G1	1,800,000	180,180,000.00	4.57
3	112857	19 广发 03	1,500,000	150,210,000.00	3.81
4	136826	16 国网 01	1,348,000	134,853,920.00	3.42
5	180406	18 农发 06	1,000,000	105,900,000.00	2.68

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

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

本报告期末本基金未持有股票。

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	279,636.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	44,051,148.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,330,785.33

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	132012	17 巨化 EB	84,320,000.00	2.14
2	132007	16 凤凰 EB	60,695,919.00	1.54
3	132009	17 中油 EB	29,667,000.00	0.75
4	132015	18 中油 EB	27,409,200.00	0.69
5	110033	国贸转债	26,265,421.50	0.67
6	113508	新风转债	22,138,600.00	0.56
7	113017	吉视转债	16,825,317.30	0.43
8	123003	蓝思转债	14,515,500.00	0.37
9	128048	张行转债	8,393,600.00	0.21
10	128020	水晶转债	5,708,841.03	0.14
11	128026	众兴转债	2,828,700.00	0.07
12	113503	泰晶转债	2,244,000.00	0.06
13	110048	福能转债	1,670,700.00	0.04
14	113502	嘉澳转债	1,648,690.00	0.04
15	113522	旭升转债	1,245,600.00	0.03

16	113509	新泉转债	489,150.00	0.01
----	--------	------	------------	------

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

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
7,850	443,342.07	3,456,238,169.25	99.31%	23,997,060.30	0.69%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,117,824.73	0.03%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

注：期末本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人均未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年2月23日）基金份额总额	235,509,292.82
本报告期期初基金份额总额	172,990,478.73
本报告期期间基金总申购份额	3,323,202,958.18
减:本报告期期间基金总赎回份额	15,958,207.36
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	3,480,235,229.55

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) 本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。
 (2) 2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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、基金托管业务的诉讼。

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	
长城证券	2	-	-	-	-	
长江证券	2	-	-	-	-	
东方证券	2	-	-	-	-	

广发证券	2	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-
申万证券	2	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-
国泰君安	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
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	142,791,719.04	6.83%	227,000,000.00	4.11%	-	-
东方证券	146,986,833.06	7.03%	583,300,000.00	10.55%	-	-
广发证券	81,468,721.25	3.89%	229,000,000.00	4.14%	-	-
中信建投	37,717,286.52	1.80%	430,000,000.00	7.78%	-	-
海通证券	1,048,363,880.57	50.11%	1,250,000,000.00	22.62%	-	-
申万证券	17,451,132.44	0.83%	55,500,000.00	1.00%	-	-
天风证券	224,750,514.12	10.74%	624,000,000.00	11.29%	-	-

兴业证券	267,877,539.26	12.80%	1,816,168,000.00	32.86%	-	-
国泰君安	93,710,273.88	4.48%	312,000,000.00	5.65%	-	-

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旗下基金 2018 年 12 月 31 日资产净值公告	管理人网站	2019 年 1 月 2 日
2	华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	《上海证券报》及管理人网站	2019 年 1 月 21 日
3	华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回和转换业务公告	《上海证券报》及管理人网站	2019 年 3 月 9 日
4	华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金 2018 年年度报告及摘要	《上海证券报》及管理人网站	2019 年 3 月 26 日
5	华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金更新招募说明书及摘要（2019 年第 1 号）	《上海证券报》及管理人网站	2019 年 4 月 9 日
6	华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	《上海证券报》及管理人网站	2019 年 4 月 20 日
7	华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金分红公告	《上海证券报》及管理人网站	2019 年 4 月 26 日
8	华泰保兴基金管理有限公司关于上海汇付基金销售有限公司终止销售华泰保兴基金管理有限公司旗下基金的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2019 年 4 月 30 日
9	华泰保兴基金管理有限公司关于上海攀赢基金销售有限公司终止销售华泰保兴基金管理有限公司旗下基金的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2019 年 4 月 30 日
10	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构及开通申（认）购业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2019 年 5 月 15 日
11	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构及开通申（认）购等业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2019 年 5 月 29 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	20190312-20190314, 20190320-20190402	20,002,600.00	377,444,428.50	0.00	397,447,028.50	11.42%
	2	20190315-20190320	0.00	254,301,093.50	0.00	254,301,093.50	7.31%
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：报告期内，申购份额含转换入份额、红利再投资份额和基金成立认购份额，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

无。

§ 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

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

12.3 查阅方式

- 1、营业时间内至基金管理人及基金托管人住所免费查阅
- 2、登录基金管理人网站 www.huataifund.com 查阅
- 3、拨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

2019 年 8 月 29 日