

# 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

## 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：中国工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。

基金托管人中国工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	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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	12
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	12
§ 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	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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	净资产变动表	17
6.4	报表附注	18
§ 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	38
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
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	40
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	41
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	41
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	41
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41

7.12	投资组合报告附注 .....	41
§ 8	基金份额持有人信息 .....	44
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
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 .....	44
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	44
§ 9	开放式基金份额变动 .....	45
§ 10	重大事件揭示 .....	46
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4	基金投资策略的改变 .....	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8	其他重大事件 .....	48
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
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 .....	51
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
§ 12	备查文件目录 .....	52
12.1	备查文件目录 .....	52
12.2	存放地点 .....	52
12.3	查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	华泰保兴安盈
基金主代码	007385
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 05 月 06 日
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	260,169,055.05 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过对股票、固定收益证券和现金等大类资产适度配置，运用稳健的个股和个券投资策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金主要投资策略包括：</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金遵循经济周期性波动规律，动态把握不同资产类别在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，追求股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度配置。在严格控制投资风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*10%+中债总指数（全价）收益率*90%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 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	王相国	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		021-60756968	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号 3810 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	上海市浦东新区博成路 1101 号 华泰金融大厦 9 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200126	100140
法定代表人	杨平	廖林

## 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）
本期已实现收益	-6,630,825.05
本期利润	-3,041,284.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0088
本期加权平均净值利润率	-0.65%
本期基金份额净值增长率	-0.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024年06月30日）
期末可供分配利润	88,044,629.95
期末可供分配基金份额利润	0.3384
期末基金资产净值	350,249,949.37
期末基金份额净值	1.3462
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024年06月30日）
基金份额累计净值增长率	34.62%

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。

#### 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	-1.59%	0.17%	0.31%	0.06%	-1.90%	0.11%
过去三个月	-0.46%	0.18%	0.68%	0.08%	-1.14%	0.10%
过去六个月	-0.39%	0.22%	2.15%	0.10%	-2.54%	0.12%
过去一年	-0.67%	0.19%	1.77%	0.10%	-2.44%	0.09%
过去三年	7.05%	0.27%	1.74%	0.12%	5.31%	0.15%
自基金合同生效起至今	34.62%	0.28%	7.62%	0.13%	27.00%	0.15%

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

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收

### 费率变动的比较





## § 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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周咏梅	基金经理、公司固定收益投资二部副总经理	2019年05月06日	-	17年	上海财经大学国际金融学硕士。历任华泰资产管理有限公司固定收益组合管理部投资助理、投资经理。在华泰资产管理有限公司任职期间,曾管理组合类保险资产管理产品等。2016年8月加入华泰保兴基金管理有限公司,历任专户投资一部投资经理。
赵旭照	基金经理、公司研究部副总经理(主持工作)	2019年05月06日	-	10年	北京大学金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员。2016年12月加入华泰保兴基金管理有限公司,历任公司研究部研究员、权益投资部基金经理、研究部总经理助理。

黄俊卿	基金经理助理	2023 年 12 月 29 日	-	8 年	新西兰梅西大学硕士研究生，CFA。曾任华泰资产管理有限公司交易室交易员、华泰保兴基金管理有限公司研究部研究员、专户投资部投资经理。现任华泰保兴基金管理有限公司权益投资部基金经理助理。
-----	--------	---------------------	---	-----	---

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

股票方面，上半年 A 股呈现出显著的分化特征，一方面，大小市值分化，大市值股票表现整体优于中小市值，从沪深 300 到中证 500，到中证 1000、2000，跌幅逐次扩大。另一方面，行业分化，银行、煤炭、公用事业、家电、石油石化等红利、大宗商品相关行业取得一定的涨幅，但消费、医药、地产链等行业普遍出现 10%以上的跌幅。A 股分化行情与宏观经济的表现密切相关，上半年宏观经济呈现出外强内弱的特征，出口好于预期，但内需延续 2023 年下半年以来相对疲弱的趋势，地产和消费是两个核心的拖累项。

债券方面，一季度长债收益率下行较多，二季度收益率曲线陡峭化下行，中短端优于超长端，信用优于利率，信用债的期限利差也大幅缩窄。其中，1Y 同业存单从年初的 2.42%下行至 1.96%，3 年 AAA 下行约 57bp 至 2.14%，10 年国债下行约 35bp 至 2.21%，30 年国债下行约 40bp 至 2.43%。账户操作方面，我们减仓了电子、社服，小幅增加了生猪养殖、医药的持仓。同时继续增持了中长久期的利率债，并小幅增持了具有相对性价比的转债资产。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为 1.3462 元，本报告期内基金份额净值增长率为-0.39%，同期业绩比较基准收益率为 2.15%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，外需面临美国经济衰退、大选等不确定因素的干扰，有下行风险，内需方面，政策转向稳内需，预计下半年将继续加力，以保证经济增速相对稳定。股票方面，我们认为 A 股目前具备很高的性价比，沪深 300 目前 PB 处于过去 10 年 5%分位以内，考虑到当前的利率已经显著下台

阶，对应的 A 股的风险补偿已经到了非常高的水平。虽然短期视角无法精确判断经济基本面什么时间能够拐头向上，但积极因素正在累积，例如美国降息确定性提升将打开中国货币政策空间，国内政策也已经开始转向稳内需等。行业方面，我们重点关注短期股价在低位、中期具备成长/改善空间、竞争格局良好的行业，主要是消费、医药、地产链、化工等。债券方面，择机配置信用债，提高组合收益率，同时紧密跟踪基本面和政策面的变化，把握好利率债的波段交易机会。

#### 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——华泰保兴基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现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

本托管人依法对华泰保兴基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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：华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金

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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	4,126,492.95	889,057.33
结算备付金		737,565.72	1,153,532.90
存出保证金		47,484.41	70,873.07
交易性金融资产	6.4.7.2	352,348,713.95	611,436,396.50
其中：股票投资		54,072,664.13	102,277,860.60
基金投资		-	-
债券投资		298,276,049.82	509,158,535.90
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	5,500,000.00	20,997,019.06
应收清算款		2,320.00	927,567.06
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		362,762,577.03	635,474,445.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 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		10,000,000.00	78,056,278.37
应付清算款		1,998,766.35	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		133,696.80	188,343.82
应付托管费		16,712.11	23,542.99
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,310.76	9,705.07

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	358,141.64	399,325.52
负债合计		12,512,627.66	78,677,195.77
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	260,169,055.05	411,971,208.93
未分配利润	6.4.7.8	90,080,894.32	144,826,041.22
净资产合计		350,249,949.37	556,797,250.15
负债和净资产总计		362,762,577.03	635,474,445.92

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3462 元，基金份额总额 260,169,055.05 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-1,356,165.55	11,909,970.49
1. 利息收入		101,828.83	581,983.22
其中：存款利息收入	6.4.7.9	35,067.90	45,370.26
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		66,760.93	536,612.96
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,047,535.30	17,519,696.87
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-13,715,791.12	4,941,391.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	7,960,264.99	12,109,555.28
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	707,990.83	468,750.32
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	3,589,540.92	-6,191,709.60
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		1,685,118.58	1,926,883.50
1. 管理人报酬		927,819.20	1,283,450.15
2. 托管费		115,977.40	160,431.31
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-



5. 利息支出		505,279.43	340,418.15
其中：卖出回购金融资产支出		505,279.43	340,418.15
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		5,087.50	12,123.61
8. 其他费用	6.4.7.18	130,955.05	130,460.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-3,041,284.13	9,983,086.99
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-3,041,284.13	9,983,086.99
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-3,041,284.13	9,983,086.99

### 6.3 净资产变动表

会计主体：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

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	411,971,208.93	144,826,041.22	556,797,250.15
二、本期期初净资产	411,971,208.93	144,826,041.22	556,797,250.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-151,802,153.88	-54,745,146.90	-206,547,300.78
（一）、综合收益总额	-	-3,041,284.13	-3,041,284.13
（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）	-151,802,153.88	-51,703,862.77	-203,506,016.65
其中：1. 基金申购款	7.41	2.53	9.94
2. 基金赎回款	-151,802,161.29	-51,703,865.30	-203,506,026.59
（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	260,169,055.05	90,080,894.32	350,249,949.37
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	413,576,349.21	137,273,047.84	550,849,397.05
二、本期期初净资产	413,576,349.21	137,273,047.84	550,849,397.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	35,414,421.22	22,235,923.92	57,650,345.14
（一）、综合收益总额	-	9,983,086.99	9,983,086.99
（二）、本期基金份额交易产生的	35,414,421.22	12,252,836.93	47,667,258.15

净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	127,932,869.47	44,948,310.19	172,881,179.66
2. 基金赎回款	-92,518,448.25	-32,695,473.26	-125,213,921.51
(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	448,990,770.43	159,508,971.76	608,499,742.19

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:

王现成                      陈庆                      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

华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金(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]544号《关于准予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《华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式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人民币110,055,000.00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0283号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于2019年05月06日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为110,055,000.00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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》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股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票以及存托凭证)、全国中小企业股份转让系统挂牌精选层股票(简称“新三板精选层股票”)、债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券))、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他存款)、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率

\*10%+中债总指数（全价）收益率\*90%。

#### 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》《华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式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[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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 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 2024 年 06 月 30 日
活期存款	4,126,492.95
等于：本金	4,125,406.34

加：应计利息	1,086.61
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	4,126,492.95

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	60,510,860.65	-	54,072,664.13	-6,438,196.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	86,121,261.20	873,732.46	1,033,750.66
	银行间市场	205,386,280.08	2,169,255.50	2,691,769.92
	小计	291,507,541.28	3,042,987.96	3,725,520.58
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	352,018,401.93	3,042,987.96	352,348,713.95	-2,712,675.94

#### 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 2024 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,500,000.00	-

#### 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 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	249,387.74
其中：交易所市场	233,448.06
银行间市场	15,939.68
应付利息	-
应付审计费	39,781.56
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	358,141.64

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 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	411,971,208.93	411,971,208.93
本期申购	7.41	7.41
本期赎回（以“-”号填列）	-151,802,161.29	-151,802,161.29
本期末	260,169,055.05	260,169,055.05

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金每个封闭期为上一个开放期结束之日次日(含该日)起至3个月后对应日的前一日(含该日)，如该对应日不存在对应日期或非工作日，则顺延至下一个工作日。本基金每个封闭期结束之日后第一个工作日(含该日)起进入下一个开放期。本基金每个开放期的期限原则上为一至二十个工作日。

#### 6.4.7.8 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	145,827,747.75	-1,001,706.53	144,826,041.22
本期期初	145,827,747.75	-1,001,706.53	144,826,041.22
本期利润	-6,630,825.05	3,589,540.92	-3,041,284.13
本期基金份额交易产生的变动数	-51,152,292.75	-551,570.02	-51,703,862.77
其中：基金申购款	2.44	0.09	2.53
基金赎回款	-51,152,295.19	-551,570.11	-51,703,865.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	88,044,629.95	2,036,264.37	90,080,894.32

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	11,009.15
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	23,597.74
其他	461.01
合计	35,067.90

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	64,568,145.46
减：卖出股票成本总额	78,177,543.63
减：交易费用	106,392.95
买卖股票差价收入	-13,715,791.12

#### 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
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益—利息收入	5,739,079.12
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	2,221,185.87
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	7,960,264.99

#### 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
	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	820,287,083.54
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	811,507,699.44
减：应计利息总额	6,536,811.24
减：交易费用	21,386.99
买卖债券差价收入	2,221,185.87

#### 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

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	707,990.83
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	707,990.83

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1. 交易性金融资产	3,589,540.92
—股票投资	1,907,495.80
—债券投资	1,682,045.12
—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	3,589,540.92



#### 6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 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
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	12,901.15
银行间债券账户维护费	18,600.00
合计	130,955.05

#### 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

截至财务报表批准报出日，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（“华泰保兴基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
华泰保险集团股份有限公司（“华泰保险集团”）	基金管理人的控股股东

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 2024年01月01日至2024年 06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	927,819.20	1,283,450.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	13,822.77	37,906.73
应支付基金管理人的净管理费	913,996.43	1,245,543.42

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 0.40% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	115,977.40	160,431.31

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

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

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 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
华泰保险集团	-	-	36,768,439.37	8.93%

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 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
中国工商银行	4,126,492.95	11,009.15	285,581.58	13,708.91

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

截至本报告期末 2024 年 06 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 10,000,000.00 元，于 2024 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

#### 6.4.12.4 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	68,503,309.95	52,657,793.50
合计	68,503,309.95	52,657,793.50

注：未评级债券为国债、中期票据。

##### 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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	149,010,286.70	311,547,886.56
AAA 以下	8,186,287.39	1,056,591.23
未评级	72,576,165.78	134,122,263.71
合计	229,772,739.87	446,726,741.50

注：未评级债券为国债、政策性金融债、中期票据。

##### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	9,774,000.90
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	9,774,000.90

注：同业存单无债券债项评级，按照发行主体长期评级列示。

### 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。

于 2024 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 10,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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》且于基金开放期内按照《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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的

可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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%。

于开放期内，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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有货币资金、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产和卖出回购金融资产等利率敏感性资产，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 2024 年 06 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						
货币资金	4,126,492.95	-	-	-	-	4,126,492.95
结算备付金	737,565.72	-	-	-	-	737,565.72
存出保证金	47,484.41	-	-	-	-	47,484.41
交易性金融资产	56,539,804.28	70,812,745.23	162,907,485.69	8,016,014.62	54,072,664.13	352,348,713.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	5,500,000.00	-	-	-	-	5,500,000.00
应收清算款	-	-	-	-	2,320.00	2,320.00
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	66,951,347.36	70,812,745.23	162,907,485.69	8,016,014.62	54,074,984.13	362,762,577.03
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	10,000,000.00	-	-	-	-	10,000,000.00
应付清算款	-	-	-	-	1,998,766.35	1,998,766.35
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	133,696.80	133,696.80
应付托管费	-	-	-	-	16,712.11	16,712.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	5,310.76	5,310.76
应付利润	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	358,141.64	358,141.64
负债总计	10,000,000.00	-	-	-	2,512,627.66	12,512,627.66
利率敏感度缺口	56,951,347.36	70,812,745.23	162,907,485.69	8,016,014.62	51,562,356.47	350,249,949.37
上年度末 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	889,057.33	-	-	-	-	889,057.33
结算备付金	1,153,532.90	-	-	-	-	1,153,532.90
存出保证金	70,873.07	-	-	-	-	70,873.07
交易性金融资产	104,553,633.14	135,600,287.78	233,295,915.05	35,708,699.93	102,277,860.60	611,436,396.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	20,997,019.06	-	-	-	-	20,997,019.06
应收清算款	-	-	-	-	927,567.06	927,567.06



应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	127,664,115.50	135,600,287.78	233,295,915.05	35,708,699.93	103,205,427.66	635,474,445.92
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	78,056,278.37	-	-	-	-	78,056,278.37
应付清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	188,343.82	188,343.82
应付托管费	-	-	-	-	23,542.99	23,542.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	9,705.07	9,705.07
应付利润	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	399,325.52	399,325.52
负债总计	78,056,278.37	-	-	-	620,917.40	78,677,195.77
利率敏感度缺口	49,607,837.13	135,600,287.78	233,295,915.05	35,708,699.93	102,584,510.26	556,797,250.15

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	1,250,522.21	2,166,063.54
市场利率上升25个基点	-1,225,534.69	-2,141,312.37	

#### 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

的证券投资品种，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例范围为 0%-30%(但在每次开放期前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，本基金投资不受上述比例限制)。其中，在开放期内，本基金投资于新三板精选层股票的市值不超过基金资产净值的 15%；在封闭期内，本基金投资于新三板精选层股票的市值不超过基金资产净值的 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	54,072,664.13	15.44	102,277,860.60	18.37
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	28,070,855.12	8.01	8,426,561.82	1.51
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	82,143,519.25	23.45	110,704,422.42	19.88

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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）
	业绩比较基准上升 5%	4,192,746.14	—

业绩比较基准下降 5%	-4,192,746.14	-
-------------	---------------	---

注：于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 23.4528%，除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值的影响见上表；于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 19.8824%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	82,143,519.25	109,869,028.47
第二层次	270,205,194.70	501,494,401.13
第三层次	-	72,966.90
合计	352,348,713.95	611,436,396.50

###### 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	54,072,664.13	14.91
	其中：股票	54,072,664.13	14.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	298,276,049.82	82.22
	其中：债券	298,276,049.82	82.22
	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	5,500,000.00	1.52
	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	4,864,058.67	1.34
8	其他各项资产	49,804.41	0.01
9	合计	362,762,577.03	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,419,000.00	3.26
B	采矿业	77,308.00	0.02
C	制造业	37,234,902.73	10.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	25,029.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	79,124.40	0.02
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	5,201,000.00	1.48
K	房地产业	36,300.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

合计	54,072,664.13	15.44
----	---------------	-------

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002567	唐人神	2,460,000	13,185,600.00	3.76
2	002714	牧原股份	150,000	6,540,000.00	1.87
3	600887	伊利股份	240,000	6,201,600.00	1.77
4	600919	江苏银行	700,000	5,201,000.00	1.48
5	600872	中炬高新	225,000	5,105,250.00	1.46
6	603477	巨星农牧	170,000	4,879,000.00	1.39
7	601233	桐昆股份	225,000	3,591,000.00	1.03
8	300408	三环集团	120,000	3,502,800.00	1.00
9	002840	华统股份	200,000	3,318,000.00	0.95
10	688236	春立医疗	110,000	1,559,800.00	0.45
11	688266	泽璟制药	2,300	124,706.00	0.04
12	300213	佳讯飞鸿	18,000	102,600.00	0.03
13	600487	亨通光电	6,000	94,620.00	0.03
14	002384	东山精密	4,500	93,150.00	0.03
15	601899	紫金矿业	4,400	77,308.00	0.02
16	002594	比亚迪	300	75,075.00	0.02
17	002120	韵达股份	9,000	69,660.00	0.02
18	300775	三角防务	2,000	61,200.00	0.02
19	300627	华测导航	2,000	59,700.00	0.02
20	300308	中际旭创	420	57,909.60	0.02
21	300638	广和通	3,000	51,300.00	0.01
22	002244	滨江集团	5,000	36,300.00	0.01
23	000963	华东医药	900	25,029.00	0.01
24	301509	金凯生科	372	13,533.36	0.00
25	301371	敷尔佳	376	11,678.56	0.00
26	601083	锦江航运	990	9,464.40	0.00
27	301518	长华化学	385	6,672.05	0.00
28	688648	中邮科技	303	6,617.52	0.00
29	603107	上海汽配	292	4,639.88	0.00
30	603062	麦加芯彩	126	4,184.46	0.00
31	603273	天元智能	178	3,266.30	0.00

### 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	600872	中炬高新	6,617,236.00	1.19
2	002714	牧原股份	6,148,759.14	1.10
3	002432	九安医疗	4,568,613.56	0.82
4	601233	桐昆股份	3,569,482.00	0.64
5	688236	春立医疗	2,439,275.44	0.44
6	002624	完美世界	283,820.00	0.05
7	000858	五粮液	283,508.00	0.05
8	601899	紫金矿业	184,356.00	0.03
9	600487	亨通光电	163,725.00	0.03
10	002466	天齐锂业	144,751.00	0.03
11	300580	贝斯特	141,691.00	0.03
12	002384	东山精密	124,590.00	0.02
13	300213	佳讯飞鸿	123,000.00	0.02
14	301322	绿通科技	122,211.00	0.02
15	002444	巨星科技	121,260.00	0.02
16	000568	泸州老窖	118,039.00	0.02
17	688266	泽璟制药	116,918.00	0.02
18	000963	华东医药	115,846.00	0.02
19	300442	润泽科技	112,575.00	0.02
20	300896	爱美客	104,561.00	0.02

#### 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	600754	锦江酒店	7,093,513.00	1.27
2	600584	长电科技	6,628,315.00	1.19
3	002472	双环传动	5,372,755.00	0.96
4	000858	五粮液	4,931,722.00	0.89
5	600919	江苏银行	4,362,000.00	0.78
6	002432	九安医疗	4,320,035.00	0.78
7	300408	三环集团	3,602,575.00	0.65
8	601126	四方股份	3,266,637.80	0.59
9	000568	泸州老窖	3,202,238.36	0.58
10	300661	圣邦股份	3,114,877.00	0.56
11	600309	万华化学	2,871,593.00	0.52
12	601601	中国太保	2,496,667.00	0.45
13	002468	申通快递	2,320,547.00	0.42
14	300957	贝泰妮	2,281,411.00	0.41
15	300662	科锐国际	2,177,315.00	0.39

16	688059	华锐精密	1,993,023.38	0.36
17	688308	欧科亿	1,070,078.59	0.19
18	002624	完美世界	284,724.00	0.05
19	301322	绿通科技	152,194.00	0.03
20	300580	贝斯特	149,346.00	0.03

### 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	28,064,851.36
卖出股票收入（成交）总额	64,568,145.46

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	30,628,414.49	8.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	118,786,669.12	33.91
	其中：政策性金融债	35,941,770.49	10.26
4	企业债券	35,797,940.56	10.22
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	84,992,170.53	24.27
7	可转债（可交换债）	28,070,855.12	8.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	298,276,049.82	85.16

### 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	2320019	23 北京银行小微债 02	210,000	21,333,698.63	6.09
2	230207	23 国开 07	200,000	20,603,852.46	5.88
3	2328006	23 交通银行小微债 01	200,000	20,417,375.34	5.83
4	115003	23 海通 03	200,000	20,295,504.66	5.79
5	019706	23 国债 13	153,000	15,379,203.70	4.39

### 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

根据公开市场信息显示，本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到行政处罚，详见《国家金融监督管理总局北京监管局行政处罚信息公开表（京金罚决字（2024）3号）》。海通证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到行政处罚、被采取行政监管措施、被采取自律监管措施、被纪律处分，详见《中国证监会行政处罚决定书（王泽龙、洪浩炜、中信中证、中信证券、海通证券、韩雨辰，（2024）45号）》《中国证券监督管理委员会关于对海通证券股份有限公司以及陈城、景炆采取出具警示函监管措施的决定（2023年11月7日）》《中国证券监督管理委员会广东监管局关于对海通证券股份有限公司采取责令改正监管措施的决定（中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书（2024）36号）》《中国证券监督管理委员会湖北监管局关于对海通证券股份有限公司、朱济赛、陈邦羽采取出具警示函措施的决定（（2023）47号）》《中国证券监督管理委员会上海监管局关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定（沪证监决（2024）17号）》《中国证券监督管理委员会上海监管局关于对海通证券股份有限公司采取责令处分有关人员措施的决定（沪证监决（2024）37号）》《中国证券监督管理委员会上海监管局关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定沪证监决（2024）180号）》《上海证券交易所关于对湖北超卓航空科技股份有限公司持续督导机构及保荐代表人予以监管警示的决定（上海证券交易所监管措施决定书（2023）41号）》《上海证券交易所关于对海通证券股份有限公司及有关责任人采取监管措施的决定（上海证券交易所监管措施决定书（2024）9号）》《上海证券交易所关于对海通证券股份有限公司予以书面警示的决定（上海证券交易所监管措施决定书（2024）29号）》《深

圳证券交易所关于对海通证券股份有限公司的监管函（深证函〔2024〕18号，2024年1月5日）》  
《上海证券交易所关于对海通证券股份有限公司予以通报批评的决定（上海证券交易所纪律处分决定书〔2024〕82号）》。交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到行政处罚，详见《国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字〔2024〕29号）》。本基金投资上述证券的投资决策程序，符合法律法规及公司投资制度有关规定。

### 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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 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	47,484.41
2	应收清算款	2,320.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,804.41

### 7.12.4 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	110059	浦发转债	13,949,834.29	3.98
2	113037	紫银转债	6,625,525.42	1.89
3	113042	上银转债	3,037,356.10	0.87
4	113052	兴业转债	757,523.70	0.22
5	113056	重银转债	640,993.74	0.18
6	128129	青农转债	502,966.17	0.14
7	113065	齐鲁转债	341,992.85	0.10
8	127020	中金转债	168,627.70	0.05
9	127086	恒邦转债	161,442.65	0.05
10	110075	南航转债	161,179.38	0.05
11	113024	核建转债	153,397.92	0.04
12	123158	宙邦转债	151,240.49	0.04
13	123107	温氏转债	150,176.86	0.04
14	127018	本钢转债	118,076.66	0.03

15	113045	环旭转债	106,910.16	0.03
16	123188	水羊转债	103,444.58	0.03
17	111017	蓝天转债	96,756.25	0.03
18	113602	景 20 转债	82,867.48	0.02
19	127067	恒逸转 2	73,889.79	0.02
20	113634	珀莱转债	73,040.03	0.02
21	113584	家悦转债	72,217.75	0.02
22	127022	恒逸转债	71,546.00	0.02
23	127056	中特转债	71,070.06	0.02
24	113641	华友转债	71,026.91	0.02
25	123076	强力转债	67,763.79	0.02
26	113655	欧 22 转债	64,806.99	0.02
27	123113	仙乐转债	36,300.00	0.01
28	113606	荣泰转债	33,426.66	0.01
29	127069	小熊转债	30,271.19	0.01
30	127074	麦米转 2	29,976.51	0.01

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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

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
281	925,868.52	260,113,675.84	99.98%	55,379.21	0.02%

### 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	52,996.41	0.02%

### 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金发起份额承诺的持有期限已于 2022 年 05 月 06 日届满 3 年。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 05 月 06 日）基金份额总额	110,055,000.00
本报告期期初基金份额总额	411,971,208.93
本报告期基金总申购份额	7.41
减：本报告期基金总赎回份额	151,802,161.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	260,169,055.05

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，基金托管人的专门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

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	
长江证券	2	3,869,029.33	4.18%	2,847.34	4.18%	-
东方财富证券	2	68,588,562.48	74.04%	50,474.74	74.04%	-
国金证券	2	3,392,179.00	3.66%	2,496.23	3.66%	-
国泰君安证券	2	16,783,226.01	18.12%	12,350.34	18.12%	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择专用交易单元所属券商的标准如下：

- (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、基金管理人选择专用交易单元所属券商的程序如下：

基金管理人按照上述选择标准，对交易单元所属券商进行综合评估，经评估符合上述标准的，基金管理人按照规定与其签署交易单元租用协议。

3、根据中国证监会 2024 年 4 月 19 日颁布的《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3 号），基金管理人管理的除被动股票型基金之外的基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。市场平均股票交易佣金费率以中国证券业协会及中国证券投资基金业协会定期向行业机构披露的为准，2022 年市场平均股票交易佣金费率为万分之 2.62。报告期内，基金管理人与相关证券公司按照上述监管规定完成了本基金股票交易佣金费率的调整。上述举措有效降低了基金份额持有人对本基金的投资成本，依法维护了基金份额持有人的合法权益。

### 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	回购交易	权证交易	基金
------	------	------	------	----

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	13,156,375.07	3.24%	58,000,000.00	2.97%	-	-	-	-
东方财富证券	165,370,402.98	40.74%	1,003,880,000.00	51.46%	-	-	-	-
国金证券	46,302,241.88	11.41%	652,500,000.00	33.45%	-	-	-	-
国泰君安证券	135,784,902.61	33.45%	236,300,000.00	12.11%	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	45,350,208.48	11.17%	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金 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	华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《证券时报》	2024年02月03日
4	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
5	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
6	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 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
7	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
8	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
9	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	2024年04月13日



		子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	
10	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
11	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 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
12	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
13	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
14	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15日
15	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16日
16	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加蚂蚁（杭州）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17日
17	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加北京雪球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》《证券时报》《证券日报》	2024年05月23日
18	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
19	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
20	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开放日常申购、赎回、转换业务的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《证券时报》	2024年06月07日
21	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

22	华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书更新（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06月21日
23	华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新（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06月21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	20240304-20240620	69,878,133.03	-	31,649,080.10	38,229,052.93	14.69%
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

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、《华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、报告期内本基金在规定媒介披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 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