

恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：恒生前海基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 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 2021 年 01 月 01 日起至 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	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.....	7
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16

6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	38
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	38
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	39
§8 基金份额持有人信息.....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
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.....	40
§10 重大事件揭示.....	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
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.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	42
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	43
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.....	43

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	43
§12 备查文件目录.....	43
12.1 备查文件目录.....	43
12.2 存放地点.....	44
12.3 查阅方式.....	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	恒生前海恒颐五年定开债券	
基金主代码	009303	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 2 日	
基金管理人	恒生前海基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,600,018,163.71 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	恒生前海恒颐五年定开债券 A	恒生前海恒颐五年定开债券 C
下属分级基金的交易代码:	009303	009304
报告期末下属分级基金的份额总额	2,600,006,386.14 份	11,777.57 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金利用定期开放、定期封闭的运作特性，在有效保持资产流动性和控制投资风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>(1) 封闭期配置策略</p> <p>本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资资产到期日或回售日不得晚于封闭期到期日。本基金投资含回售权的债券时，如果债券到期日晚于封闭期到期日，基金管理人应当以回售日作为持有到期日，并在回售日行使回售权。特殊情况下，在不违反会计准则的前提下，基金管理人可以基于基金份额持有人利益优先原则，对尚未到期的固定收益品种进行处置。</p> <p>(2) 放大策略</p> <p>本基金将在考虑债券投资的风险收益情况，以及回购成本等因素的情况下，在风险可控以及法律法规允许的范围内，通过债券回购，放大杠杆进行投资操作。杠杆放大部分仍投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，并采取买入并持有到期的策略。</p> <p>(3) 封闭期现金管理策略</p> <p>封闭期间，如本基金收到债券付息或持有的债券到期兑付本息等，会增加本基金的现金头寸，本基金将根据市场环境和封闭期剩余期限，选择到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的债券、回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等进行投资。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p> <p>3、受禁证券</p> <p>本基金管理人为汇丰集团成员，按照有关汇丰集团有关政策，本基金将不会投</p>

	<p>资于直接或间接使用、开发、制造、储存、运输或买卖集束炸弹或反步兵地雷的公司发行的证券。</p> <p>今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>
业绩比较基准	每个封闭期起始日中国人民银行公布并执行的金融机构三年期定期存款利率（税后）+0.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	恒生前海基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅宇
	联系电话	0755-88982199
	电子邮箱	fuyu@hsqhfunds.com
客户服务电话	400-620-6608	95528
传真	0755-88982169	021-63602540
注册地址	深圳市前海深港合作区桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 209	上海市中山东一路 12 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第三座 9 楼 903-904 室	上海市北京东路 689 号
邮政编码	518048	200001
法定代表人	刘宇	郑杨

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.hsqhfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	恒生前海基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第三座 9 楼 903-904 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

基金级别	恒生前海恒颐五年定开债券 A	恒生前海恒颐五年定开债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	47,003,648.61	207.31
本期利润	47,003,648.61	207.31
加权平均基金份额本期利润	0.0181	0.0176

本期加权平均净值利润率	1.80%	1.75%
本期基金份额净值增长率	1.82%	1.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	5,467,150.96	24.56
期末可供分配基金份额利润	0.0021	0.0021
期末基金资产净值	2,605,473,537.10	11,802.13
期末基金份额净值	1.0021	1.0021
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.32%	2.26%

注：①上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。

②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。

③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。

④本基金合同生效为2020年11月2日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

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

恒生前海恒颐五年定开债券 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	0.30%	0.01%	0.26%	0.01%	0.04%	0.00%
过去三个月	0.94%	0.01%	0.80%	0.01%	0.14%	0.00%
过去六个月	1.82%	0.01%	1.60%	0.01%	0.22%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.32%	0.01%	2.15%	0.01%	0.17%	0.00%

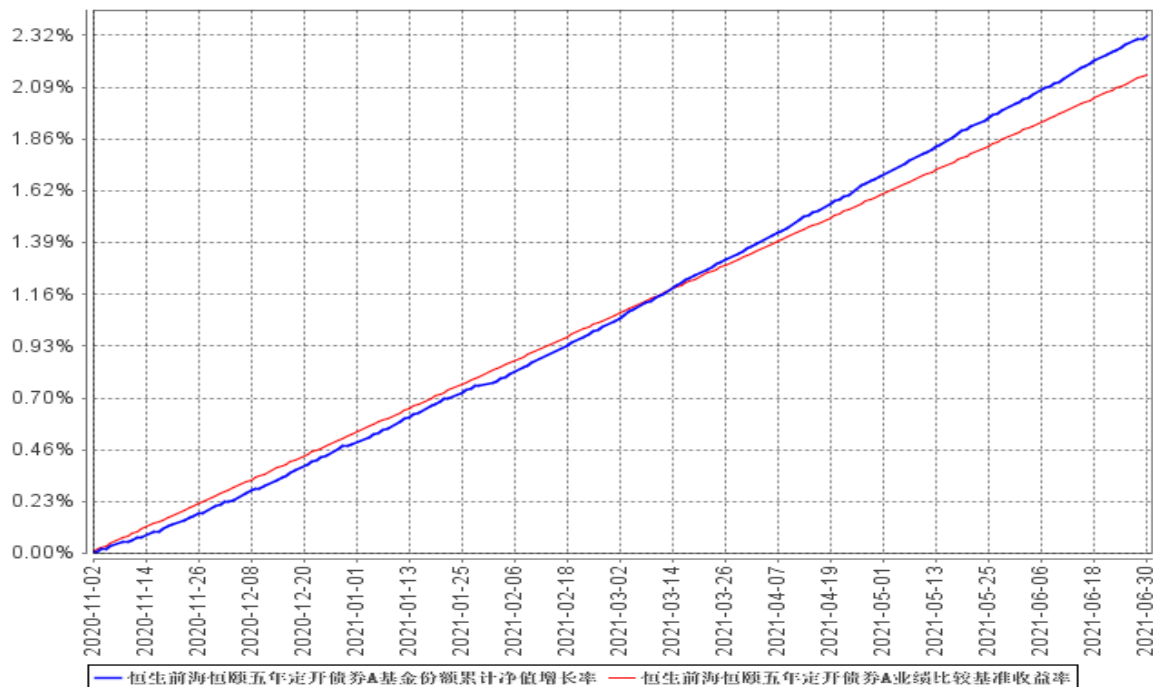
恒生前海恒颐五年定开债券 C

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	0.29%	0.01%	0.26%	0.01%	0.03%	0.00%
过去三个月	0.92%	0.01%	0.80%	0.01%	0.12%	0.00%
过去六个月	1.77%	0.01%	1.60%	0.01%	0.17%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.26%	0.01%	2.15%	0.01%	0.11%	0.00%

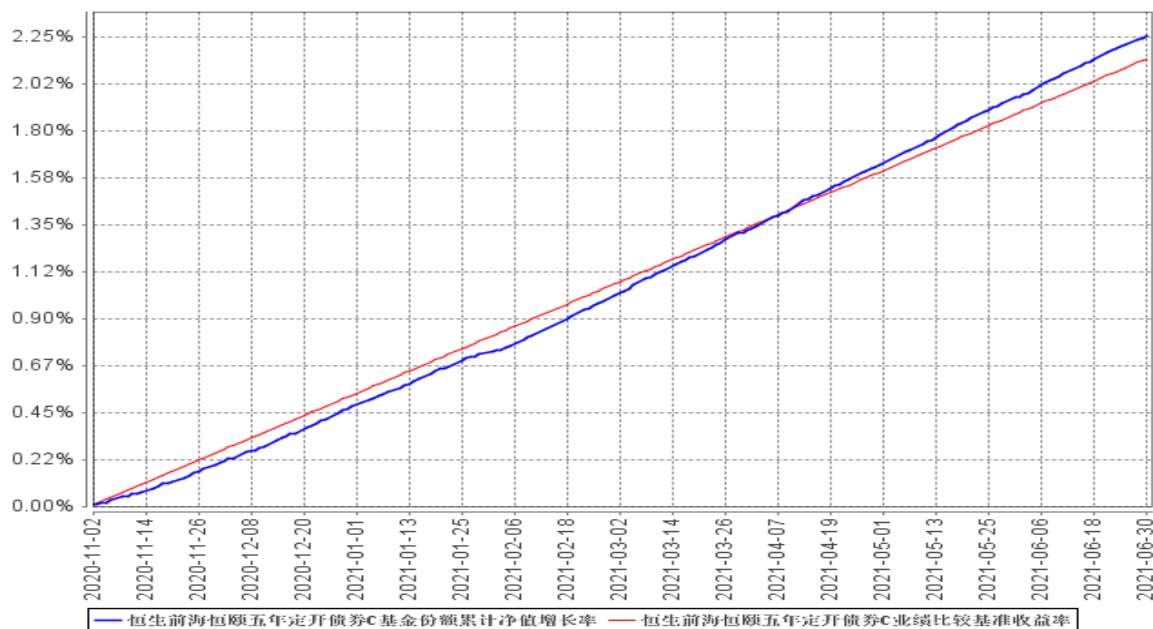
注：本基金的业绩比较基准为：每个封闭期起始日中国人民银行公布并执行的金融机构三年定期存款利率（税后）+0.5%。

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

恒生前海恒颐五年定开债券A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



恒生前海恒颐五年定开债券C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：1、本基金的基金合同于 2020 年 11 月 2 日生效，截至 2021 年 6 月 30 日止，本基金成立未满 1 年。

2、根据基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§ 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

本基金管理人恒生前海基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证券监督管理委员会证监许可字[2016]1297号文批准设立的证券投资基金管理公司，由恒生银行有限公司与前海金融控股有限公司共同发起设立，出资比例分别为70%和30%，注册资本为人民币5亿元。公司注册地为深圳前海，作为CEPA10框架下国内首家外资控股公募基金公司，是深化深港合作、实现前海国家战略定位的重要成果。

截至2021年6月30日，恒生前海基金管理有限公司旗下管理恒生前海沪港深新兴产业精选混合型证券投资基金、恒生前海港股通高股息低波动指数证券投资基金、恒生前海恒锦裕利混合型证券投资基金、恒生前海中证质量成长低波动指数证券投资基金、恒生前海港股通精选混合型证券投资基金、恒生前海恒扬纯债债券型证券投资基金、恒生前海消费升级混合型证券投资基金、恒生前海恒生沪深港通细分行业龙头指数证券投资基金、恒生前海短债债券型发起式证券投资基金、恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金等10只公募基金。

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		
李维康	基金经理	2020年11月2日	-	9	金融学硕士。曾任恒生前海基金管理有限公司固定收益部投资经理，世纪证券有限责任公司资产管理部投资主办人、固定收益部研究员、交易员，富仁投资管理有限公司宏观研究员。现任恒生前海恒锦裕利混合型证券投资基金、恒生前海恒扬纯债债券型证券投资基金、恒生前海短债债券型发起式证券投资基金以及恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金基金经理。
綦鹏	基金经理	2020年11月6日	-	12	曾任南方资本管理有限公司投资管理部副总监，信达澳银基金管理公司基金经理，浦银安盛基金管理公司投资经理，广发银行总行金融市场部（原资金部）债券交易员等。现任恒生前海短债债券型发起式证券投资基金以及恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注：①此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《恒生前海消费升级混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人的利益。

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

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按照投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止同一投资组合在同一交易日内进行反向交易（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外），不同的投资组合之间限制当日反向交易。如不同的投资组合确因流动性需求或投资策略的原因需要进行当日反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况。报告期内基金管理人管理的所有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5%的情况，不存在利益输送行为。

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

上半年，房地产销售表现强韧性，房地产开发投资（主要为土地购置费）同比增速和新开工面积累计同比增速皆放缓，显示地产融资监管政策的加压影响，房企或将保持低库存常态；进出口增速超预期强于疫情之前，但先行指标 PMI 新出口订单出现回落；地方专项债额度略有缩减，发行节奏滞后，基建未有明显发力；总体来看经济动能边际放缓。狭义流动性方面，银行超储率偏低不改流动性充裕局面，货币市场回购成交利率中枢下移；受地方平台隐性债务风险防范化解监管措施、地产融资“三条红线”和“双集中”控制等结构性紧信用影响，广义流动性指标如社

融增速和 M2 回落。1 年期同业存单市场利率低于 MLF 政策利率，显示央行货币政策较为友好，无意引导中长期利率上行，在此背景下，债券市场收益率整体下行。

组合操作在一季度“永煤”事件前后，提升债券仓位至较高杠杆水平，在流动性平稳的环境下，实行套取息差收益策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末恒生前海恒颐五年定开债券 A 基金份额净值为 1.0021 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.82%；截至本报告期末恒生前海恒颐五年定开债券 C 基金份额净值为 1.0021 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.77%；同期业绩比较基准收益率为 1.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，地产和出口的领先指标预示有走弱迹象，而基建在财政后置影响下相应有所扩张需求；新冠疫情对社会生活呈“长尾”影响，国内经济恢复不均衡、不稳固，预计货币政策将保持流动性合理充裕较长一段时期；地产和城投两大债务融资主体去杠杆影响下，融资需求下降，利率债、中高等级信用债收益率难以大幅上升，整体交易空间收窄。下半年关注美联储量宽减码时点、央行对较大 MLF 到期量的对冲操作、地方专项债发行影响。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由督察长、研究部、投资部、运营部、监察稽核部、风险管理部及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值委员会会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同规定，本基金的收益分配原则为：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每

季度至少进行一次收益分配，每年收益分配次数最多为 12 次，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式仅有现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本基金于 2021 年 3 月 29 日进行了收益分配（A 类每 10 份基金份额派发红利 0.085 元，C 类每 10 份基金份额派发红利 0.082 元）；于 2021 年 6 月 21 日进行了收益分配（A 类每 10 份基金份额派发红利 0.085 元，C 类每 10 份基金份额派发红利 0.083 元）

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

本报告期内，本基金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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了两次利润分配，分配金额分别为 22,100,149.52 元、22,100,150.67 元。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由恒生前海基金管理有限公司编制本托管人复核的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）、投资组合报告等内容真实、准确、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：恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,763,157.38	2,795,708.61
结算备付金		107,371,721.51	38,463,525.41
存出保证金		9,296.56	289.50
交易性金融资产	6.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	97,093,270.53	24,295,686.35
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	4,546,427,695.66	3,150,782,954.92
资产总计		4,753,665,141.64	3,216,338,164.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		2,146,998,155.00	613,099,850.00
应付证券清算款		145,956.91	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		322,648.89	331,211.47
应付托管费		107,549.63	110,403.82
应付销售服务费		0.90	0.93
应付交易费用	6.4.7.7	30,707.16	16,517.75
应交税费		-	-

应付利息		461,345.57	78,397.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	113,438.35	20,000.00
负债合计		2,148,179,802.41	613,656,381.29
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,600,018,163.71	2,600,018,163.71
未分配利润	6.4.7.10	5,467,175.52	2,663,619.79
所有者权益合计		2,605,485,339.23	2,602,681,783.50
负债和所有者权益总计		4,753,665,141.64	3,216,338,164.79

注：1、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，恒生前海恒颐五年定开债券 A 基金份额净值 1.0021 元，基金份额总额 2,600,006,386.14 份；恒生前海恒颐五年定开债券 C 基金份额净值 1.0021 元，基金份额总额 11,777.57 份。恒生前海恒颐五年定开债券份额总额合计为 2,600,018,163.71 份。

2、资产负债表中其他资产为分类为持有至到期投资的债券投资和资产支持证券投资。

6.2 利润表

会计主体：恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		69,373,314.52
1.利息收入		69,373,314.52
其中：存款利息收入	6.4.7.11	639,310.79
债券利息收入		68,734,003.73
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-
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	-
资产支持证券投资收益		-
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	-
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	-

减：二、费用		22,369,458.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,943,679.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	647,893.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5.43
4. 交易费用	6.4.7.19	50,500.00
5. 利息支出		19,597,837.24
其中：卖出回购金融资产支出		19,597,837.24
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	129,543.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		47,003,855.92
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		47,003,855.92

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	2,600,018,163.71	2,663,619.79	2,602,681,783.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	47,003,855.92	47,003,855.92
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）	-	-44,200,300.19	-44,200,300.19
五、期末所有者权益（基金净值）	2,600,018,163.71	5,467,175.52	2,605,485,339.23

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：

刘宇

基金管理人负责人

史芳

主管会计工作负责人

赵晶晶

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会《关于准予恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2020]397号)进行募集,由恒生前海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《恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金基金合同》公开募集,于2020年11月02日成立。本基金为契约型开放式,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2,600,018,157.89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(2020)第0924号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2020年11月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,600,018,163.71份基金份额,其中认购资金利息折合5.82份基金份额。本基金的基金管理人为恒生前海基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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》、《恒生前海恒颐五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7.4.4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

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定,真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的编制期间为2021年1月1日至2021年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及可供出售金融资产。

本基金采用买入持有至到期投资策略投资的债券投资。持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且本基金有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。应收款项、持有至到期投资和其他金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。

对于应收款项、持有至到期投资和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。相应的资产减值损失在利润表中列示在其他费用科目下。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。但是，该转回后的账面价值不应当超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

对于单项金额重大的应收款项，单独进行减值测试。当存在客观证据表明本基金将无法按应收款项的原有条款收回款项时，根据其预计未来现金流量现值低于其账面价值的差额，计提坏账准备。

对于单项金额非重大的应收款项，与经单独测试后未减值的应收款项一起按信用风险特征划分为若干组合，根据以前年度与之具有类似信用风险特征的应收账款组合的实际损失率为基础，结合现时情况确定应计提的坏账准备。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

不适用。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。于持有至到期投资处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1)在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(4)由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；(5)基金可供分配利润为正的情况下，方可进行收益分配；(6)投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位开始舍去，舍去部分归基金资产；(7)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

持有至到期投资是否减值在很大程度上依赖于基金管理人的判断。本基金的基金管理人定期审阅持有至到期投资以评估其是否出现减值情况，并在出现减值情况时评估减值损失的具体金额。发生减值的客观证据包括评估日该金融工具可观察的市场价值出现严重下跌，发行方发生严重财务困难使该金融资产无法在活跃市场继续交易、无法履行合同条款(例如，无法按期偿付利息或本金)等。在进行判断的过程中，本基金的基金管理人需评估发生减值的客观证据对该项投资预计未来现金流的影响。

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

本基金本报告期无重大会计差错更正。

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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	2,763,157.38
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：	2,763,157.38

6.4.7.2 交易性金融资产

无余额。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

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**

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,127.18
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	48,317.30
应收债券利息	97,043,821.85
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	4.20
合计	97,093,270.53

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	-
持有至到期投资	4,546,427,695.66
合计	4,546,427,695.66

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的持有至到期投资为债券投资，其中交易所市场债券 1,738,006,388.58 元，银行间市场债券 2,808,421,307.08 元。上述持有至到期投资均无需计提减值准备。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 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	30,707.16
合计	30,707.16

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 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	-
预提费用	113,438.35
合计	113,438.35

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

恒生前海恒颐五年定开债券 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,600,006,386.14	2,600,006,386.14
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,600,006,386.14	2,600,006,386.14

金额单位：人民币元

恒生前海恒颐五年定开债券 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,777.57	11,777.57
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	11,777.57	11,777.57

注：根据《恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及《恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金基金份额发售公告》的相关规定，契约型开放式，本基金以封闭期和开放期相结合的方式运作，每五年开放一次，但基金合同另有约定的除外。

本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起至 5 年后的年度对日的前一日为止。首个封闭期结束之后第一个工作日起进入首个开放期。首个开放期结束之日的次日起进入第二个封闭期，第

二个封闭期为第二个封闭期起始日起至该日 5 年后的年度对日的前一日，以此类推。年度对日不存在的或者年度对日为非工作日的，则顺延至下一个工作日。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

本基金自封闭期结束之日的下一个工作日起或下一个封闭期开始前进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。基金管理人有权对开放期的长度进行调整，并提前公告，而无需召开基金份额持有人大会。若由于不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购或赎回业务的，导致原定开放期起始日或开放期不能办理基金的申购与赎回，则开放期起始日或开放期相应顺延。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

恒生前海恒颐五年定开债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,663,608.37	-	2,663,608.37
本期利润	47,003,648.61	-	47,003,648.61
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-44,200,106.02	-	-44,200,106.02
本期末	5,467,150.96	-	5,467,150.96

单位：人民币元

恒生前海恒颐五年定开债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11.42	-	11.42
本期利润	207.31	-	207.31
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-194.17	-	-194.17
本期末	24.56	-	24.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	37,899.34
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	601,370.59
其他	40.86
合计	639,310.79

6.4.7.12 股票投资收益

无发生额。

6.4.7.13 债券投资收益

无发生额。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无发生额。

6.4.7.15 衍生工具收益

无发生额。

6.4.7.16 股利收益

无发生额。

6.4.7.17 公允价值变动收益

无发生额。

6.4.7.18 其他收入

无发生额。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	50,500.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	50,500.00

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,704.93
账户维护费	21,700.00
合计	129,543.28

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，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要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

本基金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
恒生前海基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人
恒生银行有限公司	基金管理人的股东
前海金融控股有限公司	基金管理人的股东

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

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 权证交易

无。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

无。

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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,943,679.46
其中：支付销售机构的客户维护费	5.43

注：支付基金管理人恒生前海的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%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×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	647,893.19

注：支付基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司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：日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内未发生应支付关联方的销售服务费。

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

无。

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**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

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

无。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	2,763,157.38	37,899.34

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

恒生前海恒颐五年定开债券 A

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	2021 年 6 月 21 日	-	2021 年 6 月 21 日	0.0850	22,100,053.01	-	22,100,053.01	
2	2021 年 3 月 29 日	-	2021 年 3 月 29 日	0.0850	22,100,053.01	-	22,100,053.01	
合计	-	-	-	0.1700	44,200,106.02	-	44,200,106.02	

恒生前海恒颐五年定开债券 C

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	2021 年 6 月 21 日	-	2021 年 6 月 21 日	0.0830	97.66	-	97.66	
2	2021 年 3 月 29 日	-	2021 年 3 月 29 日	0.0820	96.51	-	96.51	
合计	-	-	-	0.1650	194.17	-	194.17	

6.4.12 期末（2021 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
200315	20 进出 15	2021 年 7 月 7 日	100.11	2,632,000	263,499,084.75
200315	20 进出 15	2021 年 7 月 1 日	100.11	1,053,000	105,419,656.63
200315	20 进出 15	2021 年 7 月 13 日	100.11	1,053,000	105,419,656.63
200315	20 进出 15	2021 年 7 月 1 日	100.11	1,053,000	105,419,656.63
200315	20 进出 15	2021 年 7 月 6 日	100.11	1,076,000	107,722,270.21
200315	20 进出 15	2021 年 7 月 1 日	100.11	1,053,000	105,419,656.63
合计				7,920,000	792,899,981.48

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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人民币 1,397,000,000.00 元，截至 2021 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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，根据基金管理的业务特点设置内部机构和部门，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部和监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运行风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了《基金流动性风险管理办法》、《交易对手风险管理办法》、《投资风险管理办法》、《压力测试管理办法》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阈值及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续实时监控上述各类风险。

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上海浦东发展银行股份有限公司，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

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	4,546,427,695.66	3,150,782,954.92
合计	4,546,427,695.66	3,150,782,954.92

注：未评级的债券投资为国债和政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有人民币 2,146,998,155.00 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同约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性

风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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上市公司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 2021 年 6 月 30 日，本基金无流动性受限资产。

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。

本基金对投资组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。因此固定利率类金融工具的利率变动对本基金的基金资产净值无重大影响，浮动利率类金融工具使本基金面临现金流量利率风险。本基金的基金管理人主要通过合理配置债券组合的到期期限，管理利率波动带来的再投资风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,763,157.38	-	-	-	2,763,157.38
结算备付金	107,371,721.51	-	-	-	107,371,721.51
存出保证金	9,296.56	-	-	-	9,296.56
交易性金融资产	-	4,546,427,695.66	-	-	4,546,427,695.66
应收利息	-	-	-	97,093,270.53	97,093,270.53
资产总计	110,144,175.45	4,546,427,695.66	-	97,093,270.53	4,753,665,141.64
负债					
卖出回购金融资产款	2,146,998,155.00	-	-	-	2,146,998,155.00
应付证券清算款	-	-	-	145,956.91	145,956.91
应付管理人报酬	-	-	-	322,648.89	322,648.89
应付托管费	-	-	-	107,549.63	107,549.63
应付销售服务费	-	-	-	0.90	0.90
应付交易费用	-	-	-	30,707.16	30,707.16
应付利息	-	-	-	461,345.57	461,345.57
其他负债	-	-	-	113,438.35	113,438.35
负债总计	2,146,998,155.00	-	-	1,181,647.41	2,148,179,802.41
利率敏感度缺口	-2,036,853,979.55	4,546,427,695.66	-	95,911,623.12	2,605,485,339.23
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,795,708.61	-	-	-	2,795,708.61
结算备付金	38,463,525.41	-	-	-	38,463,525.41
存出保证金	289.50	-	-	-	289.50
交易性金融资产	-	3,150,782,954.92	-	-	3,150,782,954.92
应收利息	-	-	-	24,295,686.35	24,295,686.35
资产总计	41,259,523.52	3,150,782,954.92	-	24,295,686.35	3,216,338,164.79
负债					
卖出回购金融资产款	613,099,850.00	-	-	-	613,099,850.00
应付管理人报酬	-	-	-	331,211.47	331,211.47
应付托管费	-	-	-	110,403.82	110,403.82

应付销售服务费	-	-	-	0.93	0.93
应付交易费用	-	-	-	16,517.75	16,517.75
应付利息	-	-	-	78,397.32	78,397.32
其他负债	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	613,099,850.00	-	-	556,531.29	613,656,381.29
利率敏感度缺口	-571,840,326.48	3,150,782,954.92	-	23,739,155.06	2,602,681,783.50

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.14 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

(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。

(3) 持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具（2020 年 12 月 31 日：同）。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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（2020 年 12 月 31

日：同)。

(4) 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、持有至到期投资和其他金融负债等。

除持有至到期投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的持有至到期投资的账面价值为 4,546,427,695.66 元，公允价值为 4,571,872,625.40 元(2020 年 12 月 31 日：持有至到期投资的账面价值为 3,150,782,954.92 元，公允价值为 3,176,142,165.20 元)。

持有至到期投资按如下原则确定公允价值：(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。(ii) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。(iii) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值；本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次(2020 年 12 月 31 日：同)。

2. 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	4,546,427,695.66	95.64
	其中：债券	4,546,427,695.66	95.64
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	110,134,878.89	2.32
8	其他各项资产	97,102,567.09	2.04
9	合计	4,753,665,141.64	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

本基金本报告期内无买入股票。

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

本基金本报告期内无卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无股票投资变动。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	---------

			比例 (%)
1	国家债券	1,387,923,720.72	53.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,158,503,974.94	121.23
	其中：政策性金融债	3,158,503,974.94	121.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,546,427,695.66	174.49

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	200315	20 进出 15	19,300,000	1,932,193,136.68	74.16
2	019643	20 国债 13	6,300,000	628,158,083.96	24.11
3	019631	20 国债 05	5,331,000	513,436,913.87	19.71
4	150218	15 国开 18	4,500,000	456,725,264.33	17.53
5	018083	农发 2001	3,000,000	299,083,484.26	11.48

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	9,296.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	97,093,270.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	97,102,567.09

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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	持有人数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	数 (户)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
恒生前海恒颐五年定开债券 A	243	10,699,614.76	2,599,997,000.00	100.00%	9,386.14	0.00%
恒生前海恒颐五年定开债券 C	24	490.73	-	-	11,777.57	100.00%
合计	267	9,737,895.74	2,599,997,000.00	100.00%	21,163.71	0.00%

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

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	恒生前海恒颐五年定开债券 A	3,259.00	0.0001%
	恒生前海恒颐五年定开债券 C	110.00	0.9340%
	合计	3,369.00	0.0001%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	恒生前海恒颐五年定开债券 A	0~10
	恒生前海恒颐五年定开债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	恒生前海恒颐五年定开债券 A	0~10
	恒生前海恒颐五年定开债券 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	恒生前海恒颐五年定开债券 A	恒生前海恒颐五年定开债券 C
基金合同生效日（2020 年 11 月 2 日）基金份额总额	2,600,006,386.14	11,777.57
本报告期期初基金份额总额	2,600,006,386.14	11,777.57
本报告期基金总申购份额	-	-

减:本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,600,006,386.14	11,777.57

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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,基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内,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

本报告期内,无涉及本基金管理人、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,基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

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、基金托管人及其高级管理人员未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	
瑞信方正	1	-	-	-	-	-

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)的有关规定,我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序:

(1) 选择标准

- 1、公司经营行为规范,财务状况和经营状况良好;
- 2、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;
- 3、公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;
- 4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

(2) 选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择席位:

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

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
瑞信方正	429,214,100.00	100.00%	111,642,600,000.00	100.00%	-	-

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	恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金分红公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年3月26日
2	恒生前海基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年3月30日
3	恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定网站	2021年3月31日
4	恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）2021 年第 1 期	中国证监会规定网站	2021年3月31日
5	恒生前海基金管理有限公司关于旗下基金招募说明书（更新）及基金产品资料概要更新提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年3月31日
6	恒生前海基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年3月31日
7	恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金托管协议	中国证监会规定网站	2021年3月31日
8	恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金基金合同	中国证监会规定网站	2021年3月31日
9	恒生前海基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年4月22日
10	恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定网站	2021年4月22日
11	恒生前海基金管理有限公司关于旗下基金新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务的公告	基金管理人网站	2021年5月14日

12	恒生前海基金管理有限公司关于旗下部分基金参加泛华普益基金销售有限公司基金认购、申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 5 月 14 日
13	恒生前海基金管理有限公司关于旗下基金新增北京汇成基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务的公告	基金管理人网站	2021 年 6 月 4 日
14	恒生前海基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京汇成基金销售有限公司基金认购、申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 6 月 4 日
15	恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金分红公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 6 月 17 日

注：前述所有公告事项均同时在中国证监会基金电子披露网站或基金管理人网站进行披露

§ 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	20210101-20210630	999,999,000.00	-	-	999,999,000.00	38.46%
	2	20210101-20210630	1,099,999,000.00	-	-	1,099,999,000.00	42.31%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金本报告期内有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况发生。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，确认利息收入并评估减值准备。本报告中投资组合报告公允价值部分均以摊余成本列示。
- 2、本基金本报告期内未计提减值准备。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金设立的文件
- (2) 恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金基金合同

- (3) 恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金托管协议
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (5) 恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金 2021 年中期报告正文
- (6) 报告期内恒生前海恒颐五年定期开放债券型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人恒生前海基金管理有限公司客户服务电话：400-620-6608，或可登录基金管理人网站 www.hsqhfund.com 查阅详情。

恒生前海基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日