

华泰柏瑞安诚 6 个月持有期债券型证券投资
基金
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 16 日（基金合同生效日）起至 2024 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞安诚 6 个月持有期债基	
基金主代码	020575	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 7 月 16 日	
报告期末基金份额总额	599,210,162.98 份	
投资目标	严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极灵活的合理资产配置，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。	
投资策略	1、大类资产配置；2、债券组合投资策略；3、股票投资策略；4、基金投资策略；5、存托凭证投资策略；6、国债期货投资策略；7、信用衍生品投资策略	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+中证 800 指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，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。	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞安诚 6 个月持有期债基 A	华泰柏瑞安诚 6 个月持有期债基 C
下属分级基金的交易代码	020575	020576
报告期末下属分级基金的份额总额	547,355,822.48 份	51,854,340.50 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024年7月16日-2024年9月30日）	
	华泰柏瑞安诚6个月持有期债基A	华泰柏瑞安诚6个月持有期债基C
1. 本期已实现收益	1,925,154.16	149,957.68
2. 本期利润	-1,650,299.45	-188,539.59
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0031	-0.0037
4. 期末基金资产净值	545,705,523.03	51,665,800.91
5. 期末基金份额净值	0.9970	0.9964

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞安诚6个月持有期债基A

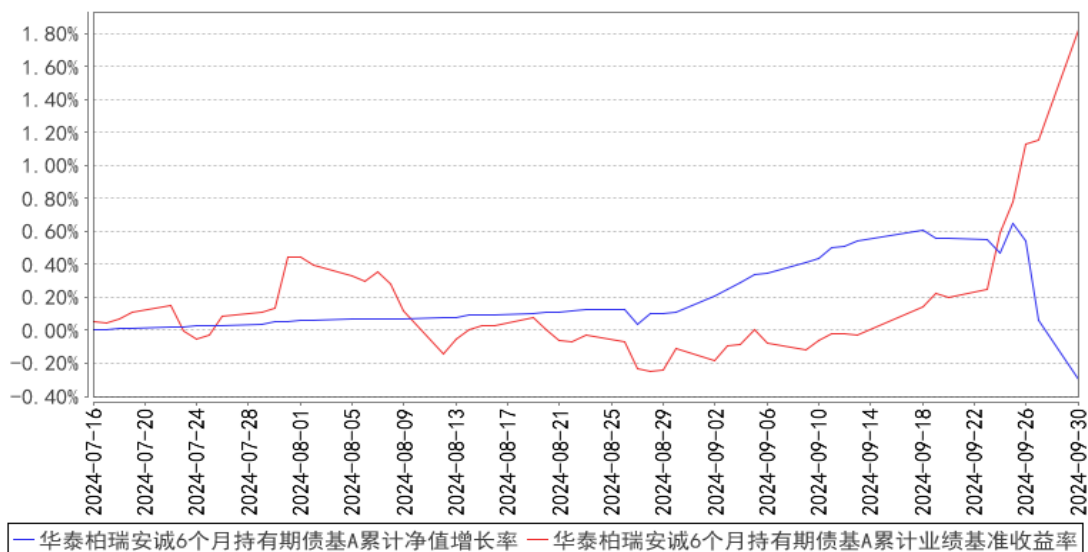
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-0.30%	0.09%	1.82%	0.14%	-2.12%	-0.05%

华泰柏瑞安诚6个月持有期债基C

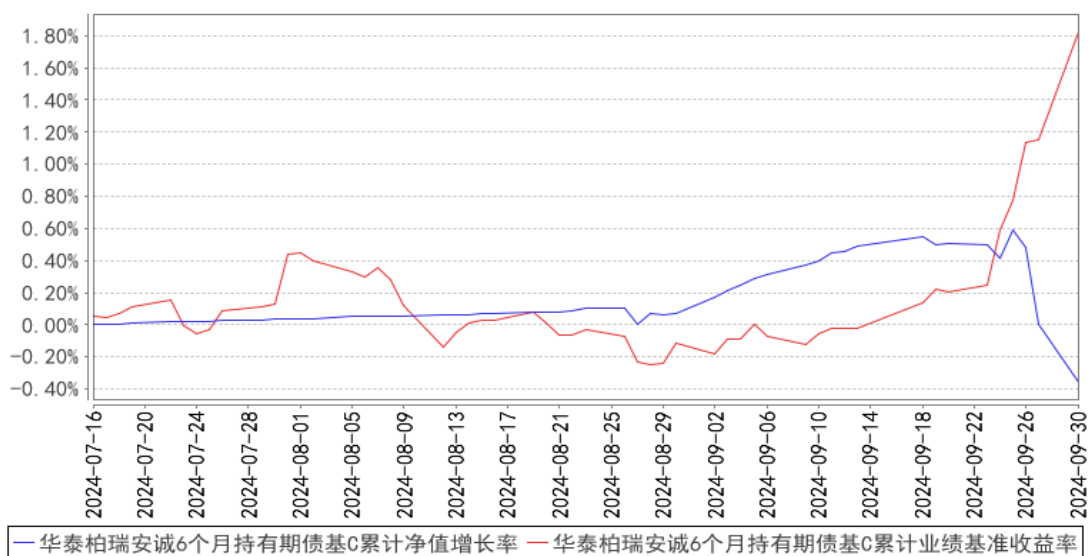
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-0.36%	0.09%	1.82%	0.14%	-2.18%	-0.05%

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

华泰柏瑞安诚6个月持有期债基A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



华泰柏瑞安诚6个月持有期债基C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、A类图示日期为2024年7月16日至2024年9月30日。C类图示日期为2024年7月16日至2024年9月30日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
何子建	固定收益部副总监、本基金的基金经理	2024年7月16日	-	10年	工商管理硕士，经济学学士。2014年5月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任固定收益部助理研究员、基金经理助理。2019年3月起任华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金的基金经理。2020年1月起任华泰柏瑞锦兴39个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020年10月起任华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2021年1月至2022年1月任华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金的基金经理。2021年1月至2023年9月任华泰柏瑞景利混合型证券投资基金的基金经理。2021年9月起任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。2022年5月至2024年6月任华泰柏瑞鸿裕90天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2022年9月起任华泰柏瑞益兴三个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2023年3月起任华泰柏瑞锦汇债券型证券投资基金的基金经理。2023年7月起任华泰柏瑞益享债券型证券投资基金的基金经理。2024年7月起任华泰柏瑞安诚6个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。

4.1.1 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

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在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合规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 2 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年三季度，债市收益率曲线延续震荡走势。整体看银行间体系流动性维持宽松，7 月上旬，央行表态将视情况参与国债买卖交易后，收益率震荡上行。而后央行宣布降低公开市场操作利率，收益率曲线又呈现快速下行。8 月，银行间流动性继续维持宽松，通胀数据有所转暖，二级市场交易量快速下行，收益率曲线上行后呈现震荡。进入 9 月，陆续公布的经济数据并未见经济积极回暖的起色，同时，美联储降息落地，国内收益率曲线震荡下行。临近季末，市场出现了大幅波动。降准、降息、降低存量房贷利率等政策组合拳推出，权益市场出现大幅反弹，风险偏好扭转，收益率快速调整。

展望四季度，我们将重点关注投资者风险偏好的快速变化，以及宽财政政策推出实际情况。市场在预期大幅变化中仍将呈现震荡格局。

策略上，债券方面将维持适当的久期与适中的杠杆水平，有效规避信用风险，同时把握时机博取资本利得，要更加灵活的进行配置与交易。同时权益方面伴随风险偏好提升，将择机积极配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞安诚 6 个月持有期债基 A 的基金份额净值为 0.9970 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.30%，同期业绩比较基准收益率为 1.82%，截至本报告期末华泰柏瑞安诚 6 个月持有期债基 C 的基金份额净值为 0.9964 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.36%，同期业绩比较基准收益率为 1.82%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	683,279,685.87	99.87
	其中：债券	683,279,685.87	99.87
	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	899,754.16	0.13
8	其他资产	1,806.86	0.00
9	合计	684,181,246.89	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	162,894,875.61	27.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	315,800,391.43	52.87
	其中：政策性金融债	85,560,863.01	14.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	204,584,418.83	34.25
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	683,279,685.87	114.38

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	240013	24 附息国债 13	1,000,000	100,909,205.48	16.89
2	200205	20 国开 05	700,000	74,916,972.60	12.54
3	232380017	23 光大二级资本 债 01A	500,000	52,709,150.68	8.82
4	232380021	23 浙商银行二级 资本债 01	500,000	52,330,342.47	8.76
5	102380090	23 华为 MTN001	300,000	31,722,934.43	5.31

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,806.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,806.86

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞安诚 6 个月持有期债基 A	华泰柏瑞安诚 6 个月持有期债基 C
基金合同生效日(2024年7月16日)基金份额总额	547,355,822.48	51,854,340.50
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆	-	-

分变动份额（份额减少以“-”填列）		
报告期期末基金份额总额	547,355,822.48	51,854,340.50

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

9.3 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。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途

费) 021-3878 4638 公司网址: www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024年10月25日