

华泰柏瑞安盛一年持有期债券型证券投资
基金
2025 年第 3 季度报告

2025 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 10 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 10 月 27 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 2025 年 7 月 1 日起至 2025 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 华泰柏瑞安盛一年持有期债券 |
| 基金主代码 | 016983 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 1 月 17 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 128,957,197.10 份 |
| 投资目标 | 在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：本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资收益。 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 | 中国建设银行股份有限公司 |

| | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 下属分级基金的基金简称 | 华泰柏瑞安盛一年持有期债券 A | 华泰柏瑞安盛一年持有期债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 016983 | 016984 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 96,838,148.91 份 | 32,119,048.19 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（2025 年 7 月 1 日-2025 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|-----------------|
| | 华泰柏瑞安盛一年持有期债券 A | 华泰柏瑞安盛一年持有期债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 745,555.90 | 251,653.93 |
| 2. 本期利润 | 393,295.13 | 126,300.71 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0042 | 0.0038 |
| 4. 期末基金资产净值 | 106,499,014.29 | 35,040,672.43 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0998 | 1.0910 |

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

华泰柏瑞安盛一年持有期债券 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 |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.43% | 0.16% | 0.48% | 0.09% | -0.05% | 0.07% |
| 过去六个月 | 1.74% | 0.12% | 1.61% | 0.09% | 0.13% | 0.03% |
| 过去一年 | 2.79% | 0.13% | 2.45% | 0.13% | 0.34% | 0.00% |
| 自基金合同 生效起至今 | 9.98% | 0.10% | 6.72% | 0.11% | 3.26% | -0.01% |

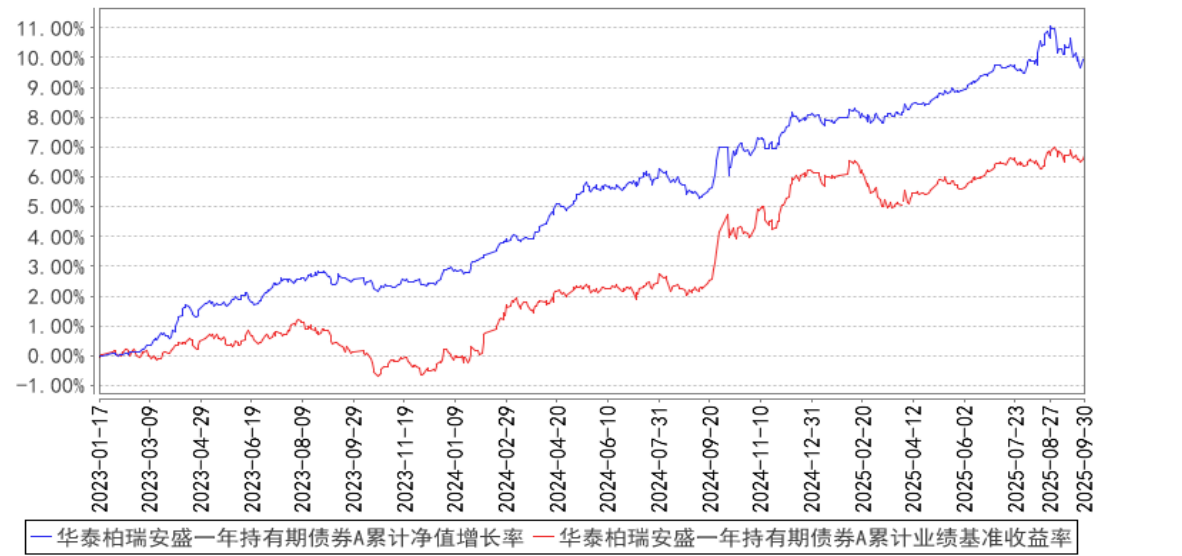
华泰柏瑞安盛一年持有期债券 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 | 业绩比较基 | 业绩比较基 | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|-------|-------|-------|-----|-----|
|----|--------|-------|-------|-------|-----|-----|

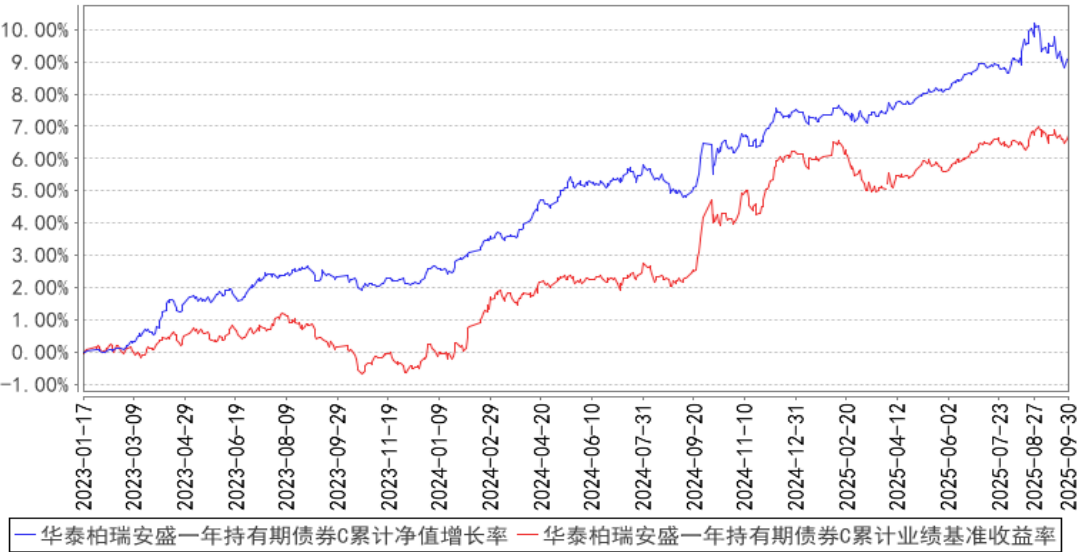
| | | 标准差② | 准收益率③ | 准收益率标准差④ | | |
|------------|-------|-------|-------|----------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.35% | 0.16% | 0.48% | 0.09% | -0.13% | 0.07% |
| 过去六个月 | 1.59% | 0.12% | 1.61% | 0.09% | -0.02% | 0.03% |
| 过去一年 | 2.48% | 0.13% | 2.45% | 0.13% | 0.03% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.10% | 0.10% | 6.72% | 0.11% | 2.38% | -0.01% |

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

华泰柏瑞安盛一年持有期债券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



华泰柏瑞安盛一年持有期债券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：A 类图示日期为 2023 年 1 月 17 日至 2025 年 9 月 30 日。C 类图示日期为 2023 年 1 月 17 日至 2025 年 9 月 30 日。

§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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--------------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 叶丰 | 本基金的基金经理 | 2025 年 7 月 9 日 | - | 11 年 | 博士毕业于中国社会科学院投资系，曾任中国国际工程咨询公司主任科员、国家发改委投资司借调员、华泰柏瑞基金管理有限公司专户投资经理、鼎峰资本管理有限公司投资经理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞致远混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 6 月起任华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金的基金经理。2025 年 3 月起任华泰柏瑞锦华债券型证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月起任华泰柏瑞安盛一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 罗远航 | 固定收益部联席总监、本基金的基金经理 | 2023 年 1 月 17 日 | - | 14 年 | 清华大学应用经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司交易员、研究员、基金经理。2017 年 1 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。现任固定收益部联席总监。2017 年 3 月至 2018 年 4 月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2019 年 3 月任华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月起任华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2020 年 1 月起任华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月至 2025 年 9 月任华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 10 月起任华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 11 月起任华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞益安三个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 1 月起任华泰柏瑞安盛一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月起任华泰柏瑞锦合债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞锦悦债券型证券投资基金的基金经理。2025 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。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

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

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值（元） | 任职时间 |
|----|----------|---------|------------------|-----------------|
| 叶丰 | 公募基金 | 4 | 1,728,246,705.59 | 2023 年 6 月 12 日 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 2,070,315,889.28 | 2025 年 7 月 8 日 |
| | 其他组合 | - | - | - |

| | | | | |
|--|----|---|------------------|---|
| | 合计 | 5 | 3,798,562,594.87 | - |
|--|----|---|------------------|---|

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《证券投资基金管理公司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 1 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

2025 年三季度，沪深 300 指数上涨 17.9%，本基金 A 类上涨 0.43%，C 类上涨 0.35%。

权益方面，三季度以来，市场风险偏好维系在高位，结构性行情特征明显。本基金三季度末本基金产品权益仓位为 7.6%。从结构上看，本基金产品持仓为黄金股和科技股两个方向。

展望四季度，我们将关注中美贸易战后续进展，持续关注中美关系变化；同时关注美联储货币政策变化或将带来的影响；国内则关注稳增长政策的择机出台落地。

投资方向上，我们继续看好黄金股新周期，认为黄金股正进入比黄金更优的发展阶段。部分优质金矿龙头企业在“十五五”期间，随着内部资源整合和外延开拓，资源量和年产金量都将稳步爬升，规模效应带来单位成本下行和净利率提升，进入新一轮快速成长阶段和业绩释放周期。同时，部分景气度向上、估值相对合理的科技股，也具备一定投资价值。

投资如山岳般古老，我们将一如既往回归投资本源，契合当前时代特征，顺应产业发展的内

在趋势，平衡企业盈利和景气成长，力争为投资人创造优秀可持续的业绩。

债券方面，海外方面，伴随着美国经济增长和通胀的回落，美联储在 9 月份进行了降息，美联储或正式进入了降息周期，年内海外利率还有回落空间。国内方面，三季度经济增速相比上半年有所放缓，从 7、8 月份的月度经济数据来看，物价水平仍维持在较低的水平，但是受到“反内卷”政策的影响，价格预期出现了明显的改善，大宗商品价格在三季度有所上涨，PPI 的同比降幅开始收缩。央行保持货币政策适度宽松不变，公开市场投放较为充足，市场资金利率基本围绕政策利率波动，仅在部分时点资金利率波动性加大。不过在三季度央行依然没有恢复国债买入的操作。

市场方面，受到通缩预期改善、股票市场上涨带来风险偏好回升的影响，债券利率在三季度震荡上行，相比 6 月末，10 年国债利率在 9 月末达到了 1.86% 的水平，及时排除掉税收因素也有超过 10bp 的上行幅度，整体来看，三季度债券市场的表现一般。

报告期内，本基金主要投资于高等级的信用债和利率债，维持了适当的久期和杠杆水平，同时也配置了适当的可转债和股票仓位。

展望 2025 年四季度，美联储或已经正式进入降息周期，年内还有进一步降息的空间和可能。国内方面，上半年经济增长取得了良好的开局，全年完成 5% 的增长目标难度不大，但三季度经济增长有所走弱，仍有稳增长的必要。反内卷政策在一定程度上削弱了通缩预期，但是由于缺乏需求侧的显著配合，实际效果和可持续性有待继续观察。货币政策方面，年内都或将维持宽松，主要关注央行能否在四季度重启购买国债。风险偏好上，中美会谈对于贸易谈判的预期影响较大，可能会引起风险情绪的波动，是四季度需要重点考虑的因素之一。

未来本基金将在控制好信用风险和流动性风险的前提下，维持适度的久期和杠杆水平，积极把握大类资产配置的机会，优化组合配置，规避信用风险，力争获取较好的收益。

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盛一年持有期债券 A 的基金份额净值为 1.0998 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.43%，同期业绩比较基准收益率为 0.48%，截至本报告期末华泰柏瑞安盛一年持有期债券 C 的基金份额净值为 1.0910 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.35%，同期业绩比较基准收益率为 0.48%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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 | 10,866,000.00 | 7.05 |
| | 其中：股票 | 10,866,000.00 | 7.05 |
| 2 | 基金投资 | — | — |
| 3 | 固定收益投资 | 140,899,489.20 | 91.48 |
| | 其中：债券 | 140,899,489.20 | 91.48 |
| | 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 | 2,158,746.50 | 1.40 |
| 8 | 其他资产 | 97,130.01 | 0.06 |
| 9 | 合计 | 154,021,365.71 | 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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | — | — |
| B | 采矿业 | 4,719,600.00 | 3.33 |
| C | 制造业 | — | — |
| 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 | — | — |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | — | — |
| H | 住宿和餐饮业 | — | — |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,942,000.00 | 3.49 |
| J | 金融业 | 1,204,400.00 | 0.85 |
| K | 房地产业 | — | — |
| 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 | 10,866,000.00 | 7.68 |

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

| 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 | 600547 | 山东黄金 | 120,000 | 4,719,600.00 | 3.33 |
| 2 | 688318 | 财富趋势 | 20,000 | 3,229,600.00 | 2.28 |
| 3 | 301299 | 卓创资讯 | 30,000 | 1,712,400.00 | 1.21 |
| 4 | 601519 | 大智慧 | 50,000 | 809,000.00 | 0.57 |
| 5 | 600095 | 湘财股份 | 30,000 | 395,400.00 | 0.28 |

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 | 26,632,535.36 | 18.82 |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 10,474,194.52 | 7.40 |
| | 其中：政策性金融债 | — | — |
| 4 | 企业债券 | 20,431,975.89 | 14.44 |
| 5 | 企业短期融资券 | — | — |
| 6 | 中期票据 | 81,916,934.24 | 57.88 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,443,849.19 | 1.02 |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 140,899,489.20 | 99.55 |

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 | 2500002 | 25 超长特别国债 02 | 200,000 | 19,039,344.26 | 13.45 |
| 2 | 2128051 | 21 工商银行二级 02 | 100,000 | 10,474,194.52 | 7.40 |
| 3 | 241598 | 24 中化 K1 | 100,000 | 10,445,301.37 | 7.38 |
| 4 | 102382614 | 23 华阳新材 | 100,000 | 10,437,252.05 | 7.37 |

| | | | | | |
|---|-----------|-------------------|---------|---------------|------|
| | | MTN013 | | | |
| 5 | 102400590 | 24 晋能煤业 MTN002 | 100,000 | 10,342,906.85 | 7.31 |

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，财富趋势（688318）在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，湘财股份（600095）在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，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

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情形。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 10,321.87 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | — |
| 5 | 应收申购款 | 68,630.89 |
| 6 | 其他应收款 | 18,177.25 |
| 7 | 其他 | — |
| 8 | 合计 | 97,130.01 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|-----------|--------------|
| 1 | 113628 | 晨丰转债 | 44,221.98 | 0.03 |
| 2 | 113030 | 东风转债 | 44,070.15 | 0.03 |
| 3 | 111016 | 神通转债 | 37,478.32 | 0.03 |
| 4 | 123147 | 中辰转债 | 37,204.10 | 0.03 |
| 5 | 123146 | 中环转 2 | 36,455.64 | 0.03 |
| 6 | 127040 | 国泰转债 | 36,115.28 | 0.03 |
| 7 | 111010 | 立昂转债 | 35,975.40 | 0.03 |
| 8 | 123246 | 远信转债 | 35,489.91 | 0.03 |
| 9 | 127089 | 晶澳转债 | 34,853.66 | 0.02 |
| 10 | 110081 | 闻泰转债 | 34,807.44 | 0.02 |
| 11 | 110086 | 精工转债 | 34,681.85 | 0.02 |
| 12 | 123235 | 亿田转债 | 34,619.03 | 0.02 |
| 13 | 123085 | 万顺转 2 | 34,574.97 | 0.02 |
| 14 | 113632 | 鹤 21 转债 | 34,511.37 | 0.02 |
| 15 | 127030 | 盛虹转债 | 34,250.28 | 0.02 |
| 16 | 127020 | 中金转债 | 34,125.00 | 0.02 |

| | | | | |
|----|--------|---------|-----------|------|
| 17 | 118031 | 天 23 转债 | 34,121.01 | 0.02 |
| 18 | 127022 | 恒逸转债 | 34,110.51 | 0.02 |
| 19 | 111009 | 盛泰转债 | 33,921.69 | 0.02 |
| 20 | 127049 | 希望转 2 | 33,879.95 | 0.02 |
| 21 | 110062 | 烽火转债 | 33,877.54 | 0.02 |
| 22 | 127107 | 领益转债 | 33,595.79 | 0.02 |
| 23 | 127055 | 精装转债 | 33,584.13 | 0.02 |
| 24 | 113657 | 再 22 转债 | 33,171.98 | 0.02 |
| 25 | 123049 | 维尔转债 | 33,054.58 | 0.02 |
| 26 | 127081 | 中旗转债 | 32,464.85 | 0.02 |
| 27 | 123251 | 华医转债 | 31,824.17 | 0.02 |
| 28 | 113569 | 科达转债 | 31,548.63 | 0.02 |
| 29 | 123166 | 蒙泰转债 | 29,399.96 | 0.02 |
| 30 | 123241 | 欧通转债 | 26,766.14 | 0.02 |
| 31 | 118048 | 利扬转债 | 20,683.78 | 0.01 |
| 32 | 118049 | 汇成转债 | 20,451.86 | 0.01 |
| 33 | 110096 | 豫光转债 | 18,366.63 | 0.01 |
| 34 | 118030 | 睿创转债 | 17,760.59 | 0.01 |
| 35 | 118051 | 皓元转债 | 17,025.97 | 0.01 |
| 36 | 113663 | 新化转债 | 16,103.06 | 0.01 |
| 37 | 123239 | 锋工转债 | 14,836.46 | 0.01 |
| 38 | 118013 | 道通转债 | 14,794.46 | 0.01 |
| 39 | 118012 | 微芯转债 | 14,784.95 | 0.01 |
| 40 | 118039 | 煜邦转债 | 14,766.40 | 0.01 |
| 41 | 123222 | 博俊转债 | 14,743.43 | 0.01 |
| 42 | 118007 | 山石转债 | 14,279.14 | 0.01 |
| 43 | 123245 | 集智转债 | 14,088.19 | 0.01 |
| 44 | 113667 | 春 23 转债 | 14,034.06 | 0.01 |
| 45 | 118029 | 富淼转债 | 13,983.14 | 0.01 |
| 46 | 110077 | 洪城转债 | 13,880.69 | 0.01 |
| 47 | 123173 | 恒锋转债 | 13,880.07 | 0.01 |
| 48 | 123217 | 富仕转债 | 13,840.07 | 0.01 |
| 49 | 113615 | 金诚转债 | 13,717.25 | 0.01 |
| 50 | 110097 | 天润转债 | 13,702.04 | 0.01 |
| 51 | 123059 | 银信转债 | 13,635.03 | 0.01 |
| 52 | 123189 | 晓鸣转债 | 13,610.72 | 0.01 |
| 53 | 123187 | 超达转债 | 13,587.12 | 0.01 |
| 54 | 127084 | 柳工转 2 | 12,822.80 | 0.01 |
| 55 | 128144 | 利民转债 | 11,725.23 | 0.01 |

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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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 基金中基金

6.1 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基金投资明细

无。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2025 年 7 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----------------------|--------------------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | - | - |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 1,756.14 | 1,690.18 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 301.52 | 288.34 |
| 当期交易基金产生的交易费用（元） | 89.06 | 65.09 |

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金持有的基金未发生重大影响事项。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华泰柏瑞安盛一年持有期 债券 A | 华泰柏瑞安盛一年持有期 债券 C |
|----|---------------------|---------------------|
|----|---------------------|---------------------|

| | | |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 93,089,859.88 | 35,313,635.28 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 12,775,338.07 | 1,670,195.24 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 9,027,049.04 | 4,864,782.33 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 96,838,148.91 | 32,119,048.19 |

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§10 备查文件目录

10.1 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

10.2 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

10.3 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

2025 年 10 月 28 日