

# 华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金 2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 20 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 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

本基金于 2022 年 11 月 24 日根据收费方式分不同，新增 E 类份额，E 类相关指标从 2022 年 11 月 24 日开始计算。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                      |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 华泰柏瑞锦瑞债券                                                                                                                                                                             |
| 基金主代码      | 008524                                                                                                                                                                               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                               |
| 基金合同生效日    | 2020 年 1 月 20 日                                                                                                                                                                      |
| 报告期末基金份额总额 | 323,915,141.73 份                                                                                                                                                                     |
| 投资目标       | 在合理控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。                                                                                                                                         |
| 投资策略       | 1、类属资产配置策略<br>2、债券投资策略<br>本基金将在对宏观经济走势、利率变化趋势、收益率曲线形态变化和发债主体基本面分析的基础上，综合运用久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略等主动投资策略，选择合适的时机和品种构建债券组合。<br>3、股票投资策略<br>4、资产支持证券投资策略<br>5、国债期货投资策略<br>6、存托凭证投资策略 |
| 业绩比较基准     | 中债综合全价指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%                                                                                                                                |
| 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。                                                                                                                                          |

|                 |                                                                                   |                |                  |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
|                 | 本基金可能投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |                |                  |
| 基金管理人           | 华泰柏瑞基金管理有限公司                                                                      |                |                  |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司                                                                        |                |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 华泰柏瑞锦瑞债券 A                                                                        | 华泰柏瑞锦瑞债券 C     | 华泰柏瑞锦瑞债券 E       |
| 下属分级基金的交易代码     | 008524                                                                            | 008525         | 015529           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 73,234,300.61 份                                                                   | 9,686,500.60 份 | 240,994,340.52 份 |

注：本基金管理人于 2025 年 9 月 29 日至 2025 年 10 月 29 日止以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，审议《关于华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金修改基金投资范围和调整赎回费率有关事项的议案》。根据 2025 年 10 月 30 日的计票结果，审议通过了该议案，修订后的法律文件于 2025 年 10 月 31 日起生效。有关详情请查阅本基金管理人 2025 年 10 月 31 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。故本基金于 2025 年 10 月 31 日起，业绩比较基准由原来的中债综合全价指数收益率×80%+一年期银行定期存款税后收益率×20%，变更为中债综合全价指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率\*5%。

§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（2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日） |               |                |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|----------------|
|                 | 华泰柏瑞锦瑞债券 A                          | 华泰柏瑞锦瑞债券 C    | 华泰柏瑞锦瑞债券 E     |
| 1. 本期已实现收益      | -1,526,731.25                       | -268,961.70   | -6,029,832.68  |
| 2. 本期利润         | -7,354,181.09                       | -1,381,952.52 | -29,407,647.42 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1244                             | -0.0935       | -0.1067        |
| 4. 期末基金资产净值     | 78,289,804.25                       | 10,079,232.42 | 257,634,151.04 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0690                              | 1.0405        | 1.0690         |

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、E 类份额指标的计算期间为 2022 年 11 月 24 日至 2026 年 6 月 30 日。

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             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④   |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | -8.63% | 0.48%         | 1.81%          | 0.23%                 | -10.44% | 0.25% |
| 过去六个月          | -5.72% | 0.64%         | 1.16%          | 0.22%                 | -6.88%  | 0.42% |
| 过去一年           | -3.30% | 0.54%         | -0.41%         | 0.17%                 | -2.89%  | 0.37% |
| 过去三年           | 3.18%  | 0.44%         | 4.75%          | 0.11%                 | -1.57%  | 0.33% |
| 过去五年           | 8.11%  | 0.43%         | 8.08%          | 0.09%                 | 0.03%   | 0.34% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 12.10% | 0.40%         | 8.91%          | 0.09%                 | 3.19%   | 0.31% |

华泰柏瑞锦瑞债券 C

| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④   |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | -8.72% | 0.48%         | 1.81%          | 0.23%                 | -10.53% | 0.25% |
| 过去六个月          | -5.91% | 0.64%         | 1.16%          | 0.22%                 | -7.07%  | 0.42% |
| 过去一年           | -3.70% | 0.54%         | -0.41%         | 0.17%                 | -3.29%  | 0.37% |
| 过去三年           | 1.94%  | 0.44%         | 4.75%          | 0.11%                 | -2.81%  | 0.33% |
| 过去五年           | 5.95%  | 0.43%         | 8.08%          | 0.09%                 | -2.13%  | 0.34% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 9.24%  | 0.40%         | 8.91%          | 0.09%                 | 0.33%   | 0.31% |

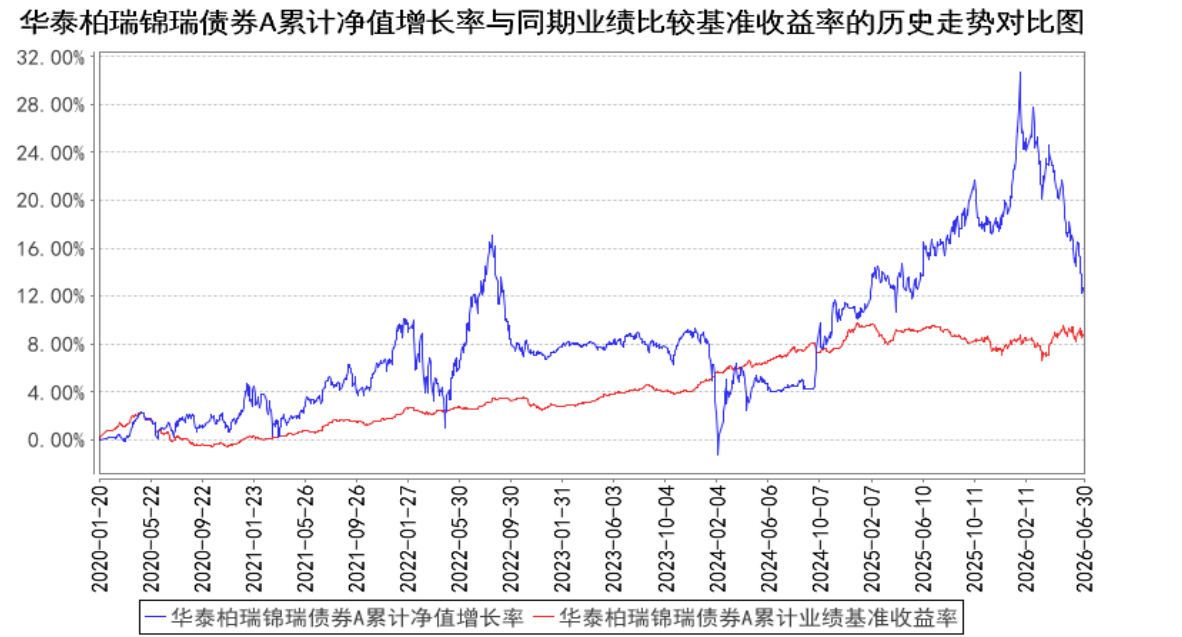
华泰柏瑞锦瑞债券 E

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④   |
|-------|--------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -8.63% | 0.48%         | 1.81%          | 0.23%                 | -10.44% | 0.25% |
| 过去六个月 | -5.72% | 0.64%         | 1.16%          | 0.22%                 | -6.88%  | 0.42% |
| 过去一年  | -3.30% | 0.54%         | -0.41%         | 0.17%                 | -2.89%  | 0.37% |
| 过去三年  | 3.18%  | 0.44%         | 4.75%          | 0.11%                 | -1.57%  | 0.33% |

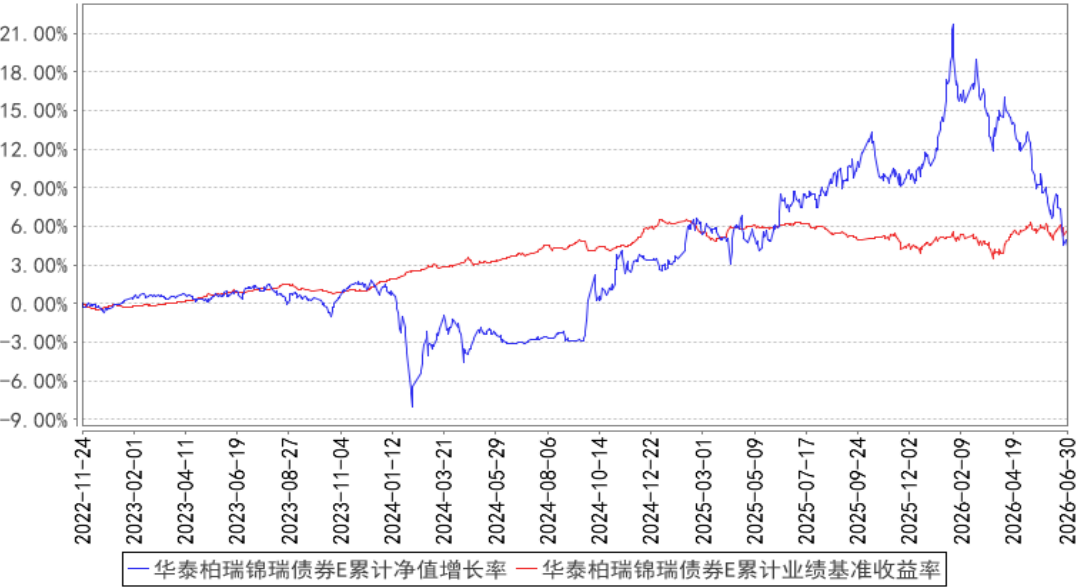
|                |       |       |       |       |        |       |
|----------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 自基金合同<br>生效起至今 | 4.41% | 0.41% | 5.72% | 0.10% | -1.31% | 0.31% |
|----------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|

注：E 类份额业绩计算期间为 2022 年 11 月 24 日至 2026 年 6 月 30 日

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率变动的比较



华泰柏瑞锦瑞债券E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 2020 年 1 月 20 日至 2026 年 6 月 30 日。C 类图示日期为 2020 年 1 月 20 日至 2026 年 6 月 30 日。E 类图示日期为 2022 年 11 月 24 日至 2026 年 6 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 王烨斌 | 本基金的基金经理 | 2022 年 1 月 11 日 | —    | 12 年   | 中国人民大学西方经济学硕士、法国图卢兹经济学院公共发展政策专业硕士。曾任中诚信国际信用评级有限责任公司分析师，2015 年 5 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任固定收益部研究员。2021 年 2 月起任华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月至 2023 年 11 月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月起任华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月至 2026 年 6 月任华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月至 2024 年 12 月任华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月至 2025 年 2 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 6 月至 2026 年 3 月任华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金的基金经理。                                                                                                                                                                           |
| 叶丰 | 本基金的基金经理 | 2024 年 6 月 14 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。 |

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       | 1,585,412,221.00 | 2023 年 6 月 12 日 |
|    | 私募资产管理计划 | 2       | 1,985,342,352.20 | 2025 年 7 月 8 日  |
|    | 其他组合     | -       | -                | -               |
|    | 合计       | 6       | 3,570,754,573.20 | -               |

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、勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，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 4 次，是指数或量化投资组合因投资策略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

权益方面，2026 年二季度沪深 300 指数上涨 11.9%，本基金 A 类下跌 8.63%，C 类下跌 8.72%，E 类下跌 8.63%，跑输指数。

本产品二季度配置结构上延续前期策略，权益部分布局黄金股为主。

3 月份美以伊战争后，市场巨震并走势分化，黄金股中短期进入逆风期。虽然黄金股经历了加息预期和流动性压制，且部分上市公司业绩低于预期，但央行购金支撑金价的长期逻辑未变，未来风险释放后也仍将具备投资价值。

展望未来，我们持续关注美联储货币政策变化，关注中美关系变化，关注国际新秩序的建立。长期来看，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。

债券方面，2026 年二季度债券市场整体呈现“震荡走强、利多共振”的格局，核心驱动力在于宏观经济的结构性偏弱与银行资金外溢导致的“资产荒”。经济基本面方面呈现出典型的“K 型分化”特征。虽然出口表现强劲，但社零、投资、信贷等数据均指向了内需复苏明显放缓。这种内需低迷、上游热下游冷的格局，导致国内物价缺乏大幅上涨的基础，也成为债市做多的重要宏观背景。在机构行为层面，二季度银行体系面临信贷需求不足的结构性资产荒，贷款难以放量，导致银行资金大量外溢至非银机构。这种流动性的充裕直接推动了高息资产荒行情的持续演绎，而由于杠杆率持续下降，使得债市在面临供给放量或央行短期资金回笼扰动时，依然能够保持相对较强的韧性。

本基金维持短久期的债券配置。

展望三季度，对债券市场有利的宏观逻辑不变，预计市场主线将逐步从资金面向基本面切换。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞锦瑞债券 A 的基金份额净值为 1.0690 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.63%，同期业绩比较基准收益率为 1.81%，截至本报告期末华泰柏瑞锦瑞债券 C 的基金

份额净值为 1.0405 元,本报告期基金份额净值增长率为-8.72%,同期业绩比较基准收益率为 1.81%,截至本报告期末华泰柏瑞锦瑞债券 E 的基金份额净值为 1.0690 元,本报告期基金份额净值增长率为-8.63%,同期业绩比较基准收益率为 1.81%。

#### 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              | 55,404,818.69  | 15.99        |
|    | 其中:股票             | 55,404,818.69  | 15.99        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 285,253,894.25 | 82.33        |
|    | 其中:债券             | 285,253,894.25 | 82.33        |
|    | 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      | 5,569,193.75   | 1.61         |
| 8  | 其他资产              | 230,889.63     | 0.07         |
| 9  | 合计                | 346,458,796.32 | 100.00       |

注:通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 23,700,818.69 元,占基金资产净值的比例为 6.85%。

#### 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              | 31,704,000.00 | 9.16         |
| 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 |               | —    |
| J | 金融业             |               | —    |
| 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              | 31,704,000.00 | 9.16 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）     | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|---------------|--------------|
| 10 能源   | —             | —            |
| 15 原材料  | 23,700,818.69 | 6.85         |
| 20 工业   | —             | —            |
| 25 可选消费 | —             | —            |
| 30 主要消费 | —             | —            |
| 35 医药卫生 | —             | —            |
| 40 金融   | —             | —            |
| 45 信息技术 | —             | —            |
| 50 通信服务 | —             | —            |
| 55 公用事业 | —             | —            |
| 60 房地产  | —             | —            |
| 合计      | 23,700,818.69 | 6.85         |

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 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 | 500,000 | 11,545,000.00 | 3.34         |
| 1  | 01787  | 山东黄金 | 600,000 | 8,702,871.00  | 2.52         |
| 2  | 601899 | 紫金矿业 | 400,000 | 10,056,000.00 | 2.91         |
| 3  | 01818  | 招金矿业 | 600,000 | 8,541,320.70  | 2.47         |
| 4  | 600489 | 中金黄金 | 300,000 | 5,415,000.00  | 1.57         |

|   |        |        |         |              |      |
|---|--------|--------|---------|--------------|------|
| 5 | 000506 | 招金黄金   | 400,000 | 4,688,000.00 | 1.35 |
| 6 | 03330  | 灵宝黄金   | 320,000 | 3,415,833.44 | 0.99 |
| 7 | 03939  | 万国黄金集团 | 450,000 | 3,040,793.55 | 0.88 |

#### 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      | 285,253,894.25 | 82.44        |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | —              | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —              | —            |
| 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        | 285,253,894.25 | 82.44        |

#### 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  | 019835 | 26 国债 09 | 1,200,000 | 120,197,490.41 | 34.74        |
| 2  | 019768 | 25 国债 03 | 640,000   | 64,592,061.37  | 18.67        |
| 3  | 019827 | 26 国债 01 | 500,000   | 50,324,095.89  | 14.54        |
| 4  | 019782 | 25 国债 12 | 500,000   | 50,140,246.58  | 14.49        |

#### 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，中金黄金（600489）在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所（中国证券博物馆）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约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约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   | 40,472.69  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | 170,760.00 |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 19,656.94  |
| 6  | 其他应收款   | -          |

|   |    |            |
|---|----|------------|
| 7 | 其他 | —          |
| 8 | 合计 | 230,889.63 |

#### 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 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 华泰柏瑞锦瑞债券 A    | 华泰柏瑞锦瑞债券 C    | 华泰柏瑞锦瑞债券 E     |
|---------------------------|---------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 21,937,692.75 | 18,178,809.39 | 343,011,361.43 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 75,964,636.02 | 2,594,823.75  | 135,670,126.02 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 24,668,028.16 | 11,087,132.54 | 237,687,146.93 |
| 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               | 73,234,300.61 | 9,686,500.60  | 240,994,340.52 |

### §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

单位：份

| 项目                       | 华泰柏瑞锦瑞债券 A | 华泰柏瑞锦瑞债券 C | 华泰柏瑞锦瑞债券 E    |
|--------------------------|------------|------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | —          | —          | 41,003,827.97 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | —          | —          | —             |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | —          | —          | —             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | —          | —          | 41,003,827.97 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | —          | —          | 12.66         |

#### 7.2 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。

§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

| 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              | 20260401-20260518;20260520-20260521; | 97,961,480.34 | -    | 44,589,980.00 | 53,371,500.34 | 16.48   |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 2              | 20260401-20260616;20260623-20260624; | 83,752,855.17 | -    | 83,752,855.17 | -             | -       |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                |                                      |               |      |               |               |         |
| <p>本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。</p> |                |                                      |               |      |               |               |         |

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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2026 年 7 月 21 日