

# 华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金

## 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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 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。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 华泰柏瑞享利混合                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 基金主代码      | 003591                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 基金合同生效日    | 2016 年 12 月 29 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 报告期末基金份额总额 | 634,379,701.23 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 投资目标       | 前瞻性地把握不同时期股票市场、债券市场和银行间市场的收益率，在有效控制风险的前提下，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 投资策略       | 1、资产配置策略<br>本基金为混合型基金，以获取长期稳定收益为目标。根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行大类资产配置。<br>2、股票投资策略<br>本基金股票投资以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手。根据个股的估值水平优选个股，重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中的股票。<br>在股票初选库中，按照企业生命周期理论将股票划分为突出成长类——A 类、高速稳定成长类——B 类、高速周期性成长类——C 类、成熟类——D 类（D 类又分为成熟/良性转折——D1 类、成熟/周期性——D2 类、成熟/防御性——D3 类）。本基金管理人对股票初选库中的上市 |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                  |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|
|                 | <p>公司深入研究，构建财务模型，进行盈利预测，给出股票评级和目标价，提交详尽的标准研究报告，其中获得 1、2、3 评级的股票构成本基金的股票精选库。</p> <p>3、固定收益资产投资策略</p> <p>本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对固定收益资产的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在固定收益资产投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。</p> <p>5、其他金融衍生工具投资策略</p> <p>在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。</p> |                  |
| 业绩比较基准          | 本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%＋中债综合指数收益率×50%。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                  |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                  |
| 基金管理人           | 华泰柏瑞基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                  |
| 基金托管人           | 平安银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 华泰柏瑞亨利混合 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 华泰柏瑞亨利混合 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 003591                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 003592           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 163,676,146.88 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 470,703,554.35 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（2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日） |            |
|--------|-------------------------------------|------------|
|        | 华泰柏瑞亨利混合 A                          | 华泰柏瑞亨利混合 C |

|                 |                |                |
|-----------------|----------------|----------------|
| 1. 本期已实现收益      | 3,748,876.19   | 10,249,067.35  |
| 2. 本期利润         | 935,865.65     | 2,380,937.05   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0057         | 0.0050         |
| 4. 期末基金资产净值     | 258,494,175.56 | 728,744,711.44 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.5793         | 1.5482         |

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

华泰柏瑞亨利混合 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      | 0.40%  | 0.12%     | 6.23%      | 0.63%         | -5.83% | -0.51% |
| 过去六个月      | 1.19%  | 0.10%     | 4.37%      | 0.57%         | -3.18% | -0.47% |
| 过去一年       | 4.15%  | 0.10%     | 12.52%     | 0.51%         | -8.37% | -0.41% |
| 过去三年       | 14.60% | 0.20%     | 18.09%     | 0.55%         | -3.49% | -0.35% |
| 过去五年       | 29.27% | 0.23%     | 3.69%      | 0.55%         | 25.58% | -0.32% |
| 过去七年       | 58.94% | 0.28%     | 23.44%     | 0.58%         | 35.50% | -0.30% |
| 自基金合同生效起至今 | 84.86% | 0.30%     | 35.53%     | 0.58%         | 49.33% | -0.28% |

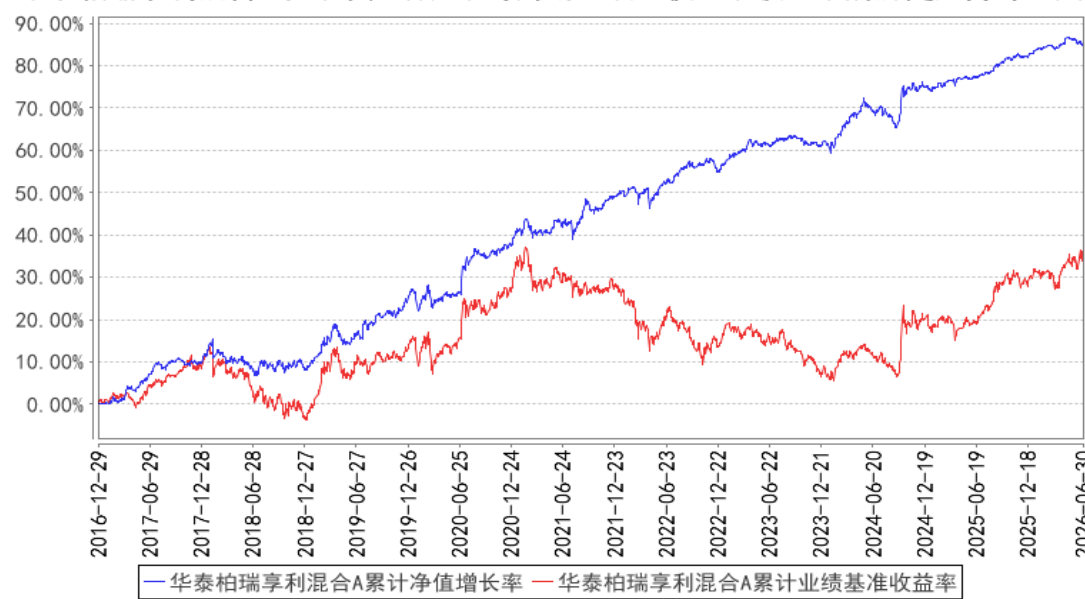
华泰柏瑞亨利混合 C

| 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    |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.34%  | 0.12%     | 6.23%      | 0.63%         | -5.89% | -0.51% |
| 过去六个月 | 1.04%  | 0.10%     | 4.37%      | 0.57%         | -3.33% | -0.47% |
| 过去一年  | 3.84%  | 0.10%     | 12.52%     | 0.51%         | -8.68% | -0.41% |

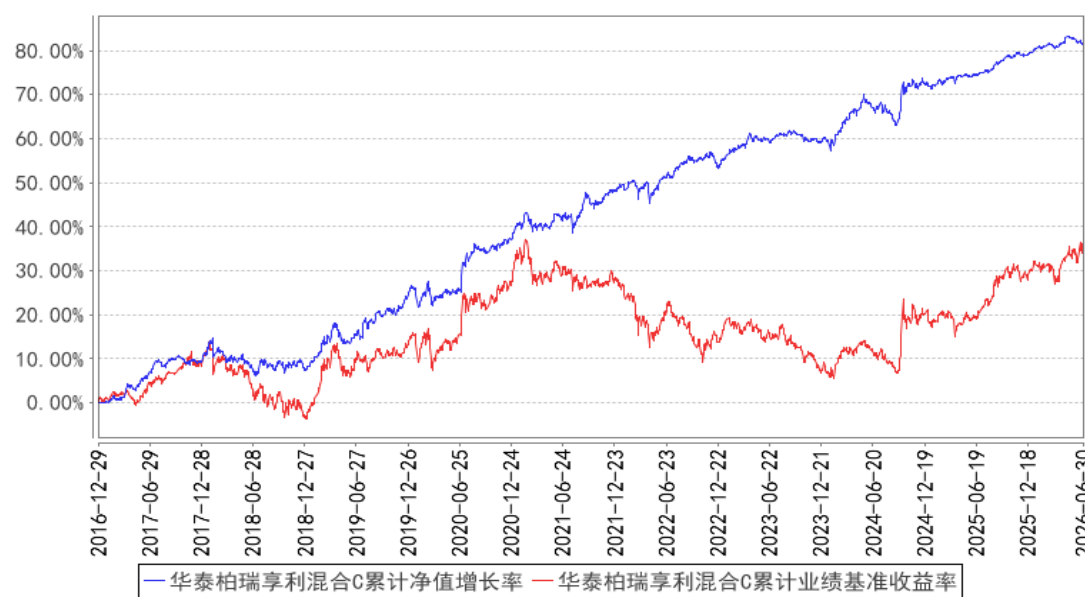
|            |        |       |        |       |        |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三年       | 13.61% | 0.20% | 18.09% | 0.55% | -4.48% | -0.35% |
| 过去五年       | 27.39% | 0.23% | 3.69%  | 0.55% | 23.70% | -0.32% |
| 过去七年       | 57.10% | 0.28% | 23.44% | 0.58% | 33.66% | -0.30% |
| 自基金合同生效起至今 | 81.38% | 0.30% | 35.53% | 0.58% | 45.85% | -0.28% |

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

华泰柏瑞亨利混合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



华泰柏瑞亨利混合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 2016 年 12 月 29 日至 2026 年 6 月 30 日。C 类图示日期为 2016 年 12 月 29

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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 姬青 | 本基金的基金经理                | 2022 年 12 月 5 日  | —    | 9 年    | 北京大学企业管理专业硕士。曾任海通证券股份有限公司管理培训生。2017 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任交易部交易员、固定收益部基金经理助理。2022 年 9 月起任华泰柏瑞天添宝货币市场基金的基金经理。2022 年 12 月起任华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 8 月起任华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理。2026 年 4 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。                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 董辰 | 副总经理、主动权益投资部总监、本基金的基金经理 | 2020 年 12 月 29 日 | —    | 13 年   | 副总经理，硕士，曾任长江证券首席分析师，2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理助理、基金经理、投资二部副总监、投资二部总监、总经理助理。现任副总经理兼主动权益投资部总监。2020 年 7 月起任华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 8 月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎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的基金经理。2021 年 6 月至 2022 年 10 月任华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2025 年 11 月任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月至 2023 年 7 月任华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 2 月起任华泰柏瑞招享 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月起任华泰柏瑞轮动精选混合型证券投资基金的基金经 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                               |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 11 月起任华泰柏瑞集利债券型证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞启臻混合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、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中的公平交易模块，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 2 季度 A 股市场先扬后抑、整体上涨，科技板块延续强势。

2 季度国内宏观经济保持平稳运行，政策面和流动性环境友好。海外方面，美以与伊朗冲突贯穿 2 季度，霍尔木兹海峡航运持续受限，全球能源供应链紧张加剧，原油和天然气价格在 5 月创出年内新高，推升了全球通胀预期，主要央行降息节奏低于年初预判，风险资产估值承压，季末海峡有条件通行，油价随之回落。结构上，以 AI 产业链等为代表的科技板块表现强劲，资源品、

消费和金融板块延续弱势。报告期内，随着非 AI 板块的回调，性价比逐渐提升，本基金适当提高了权益仓位，增加了在资源品方面的配置，并持续关注下半年可能出现机会的内需板块，科技的中长期趋势依然强势，但经历持续上涨，部分个股估值有待消化，本基金减持了部分 AI 科技方向的持仓。

展望接下来的市场，国际地缘动荡推动通胀的中长期上行仍有相当大的概率，由此带来利率环境的变化尚未被市场充分定价，大盘指数层面可能波动放大，宽幅震荡。结构上，时代背景下的科技和资源仍然是中长期相对看好的两大方向。科技领域产业趋势明确，AI 产业链经历上半年的快速上涨，估值有消化压力，关注商业航天、机器人等科技方向的产业催化。资源品方面，地缘冲突和供应链重构带来的供给冲击仍会时有发生，商品价格中枢抬升的趋势概率加大。内需方面，随着压力增大政策可期待性逐渐增强，目前仍在左侧磨底的阶段，需要时刻关注机会。接下来，本基金将继续在公司质量、景气度和成长空间三个维度精选个股，保持灵活仓位应对市场波动，尽力控制回撤，获取超额收益。

债券方面，2026 年二季度，基本面呈现 K 型分化加剧的特征，内需边际承压，外需与新动能仍是主要支撑。一季度 GDP 增速 5.0% 实现开门红后，二季度增速预计回落。制造业 PMI 整体平稳，4 月 50.3%、5 月处于 50.0% 荣枯线、6 月回升至 50.3%。4-5 月消费、投资等内需指标明显回落，5 月社会消费品零售增速转负、房地产投资降幅继续扩大，出口与高技术制造业则成为经济最重要的支撑项。物价方面，CPI 同比稳定在 1.2%，PPI 同比在中东冲突推升大宗与能源成本的带动下回升至 5 月的 3.9%，二季度 GDP 平减指数大概率时隔多时转正。

货币政策方面，央行延续“适度宽松”基调，综合运用多种货币政策工具削峰填谷、维护资金面稳定，央行买断式逆回购在连续多月缩量后于 6 月中旬转为等量续作，MLF 于 6 月加量续作 2000 亿元，6 月末央行创新推出隔夜逆回购工具以精准投放跨季。财政政策方面，发债与支出节奏整体呈现 4-5 月慢、6 月加速的特征。

市场方面，以 DR001 为代表的资金利率从 4 月低点 1.22% 上行至 6 月最高 1.45%，上行幅度达 23bp，6 月中下旬开始逐步回落至 1.35%。受基本面数据走弱及资金利率波动影响，10 年期国债利率整体在 1.70%-1.75% 区间运行。10 年-5 年国债利差走扩、30 年-10 年利差先收窄后再度走扩，信用利差整体低位震荡。

固收操作方面，本基金继续坚持配置打底、交易辅助的策略，在控制风险的基础上，努力提升收益，同时结合各类债券资产的性价比对组合进行调整。

展望三季度，当前基本面仍处在弱修复阶段，内需疲弱决定了利率上行的空间有限，但央行在 10 年国债 1.70% 附近的“底线管理”明确，叠加三季度政府债供给高峰，债券市场大概率维持区

间震荡格局，突破的方向取决于内外需是否进一步下滑、及政治局会议增量政策，10 年期国债利率预计在 1.70%-1.75%区间震荡，密切关注震荡市带来的波段交易机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞亨利混合 A 的基金份额净值为 1.5793 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.40%，同期业绩比较基准收益率为 6.23%，截至本报告期末华泰柏瑞亨利混合 C 的基金份额净值为 1.5482 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.34%，同期业绩比较基准收益率为 6.23%。

#### 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              | 71,197,801.08    | 6.37         |
|    | 其中：股票             | 71,197,801.08    | 6.37         |
| 2  | 基金投资              | —                | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 1,030,723,125.91 | 92.25        |
|    | 其中：债券             | 1,030,723,125.91 | 92.25        |
|    | 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      | 6,837,781.02     | 0.61         |
| 8  | 其他资产              | 8,520,311.79     | 0.76         |
| 9  | 合计                | 1,117,279,019.80 | 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        | 46,361.00     | 0.00         |
| B  | 采矿业             | 12,953,642.50 | 1.31         |
| C  | 制造业             | 50,731,526.00 | 5.14         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应 | 1,864,785.00  | 0.19         |

|   | 业               |               |      |
|---|-----------------|---------------|------|
| E | 建筑业             | 25,668.00     | 0.00 |
| F | 批发和零售业          | -             | -    |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 2,112,275.48  | 0.21 |
| H | 住宿和餐饮业          | -             | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 506,619.10    | 0.05 |
| J | 金融业             | 173,014.00    | 0.02 |
| K | 房地产业            | 2,781,729.00  | 0.28 |
| 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   | 2,181.00      | 0.00 |
| 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              | 71,197,801.08 | 7.21 |

### 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  | 600938 | 中国海油 | 129,000 | 3,502,350.00 | 0.35         |
| 2  | 600426 | 华鲁恒升 | 112,600 | 2,693,392.00 | 0.27         |
| 3  | 601857 | 中国石油 | 309,700 | 2,688,196.00 | 0.27         |
| 4  | 600989 | 宝丰能源 | 129,100 | 2,624,603.00 | 0.27         |
| 5  | 002318 | 久立特材 | 96,100  | 2,296,790.00 | 0.23         |
| 6  | 601233 | 桐昆股份 | 102,500 | 2,219,125.00 | 0.22         |
| 7  | 603162 | 海通发展 | 208,884 | 1,873,689.48 | 0.19         |
| 8  | 605090 | 九丰能源 | 50,100  | 1,862,217.00 | 0.19         |
| 9  | 688375 | 国博电子 | 17,665  | 1,842,459.50 | 0.19         |
| 10 | 600346 | 恒力石化 | 103,800 | 1,838,298.00 | 0.19         |

### 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      | 39,391,337.02  | 3.99         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 377,594,591.35 | 38.25        |
|    | 其中：政策性金融债 | 362,414,192.44 | 36.71        |

|    |           |                  |        |
|----|-----------|------------------|--------|
| 4  | 企业债券      | 30,259,859.19    | 3.07   |
| 5  | 企业短期融资券   | 30,110,807.67    | 3.05   |
| 6  | 中期票据      | 553,366,530.68   | 56.05  |
| 7  | 可转债（可交换债） | —                | —      |
| 8  | 同业存单      | —                | —      |
| 9  | 其他        | —                | —      |
| 10 | 合计        | 1,030,723,125.91 | 104.40 |

#### 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  | 230208    | 23 国开 08       | 1,400,000 | 143,311,632.88 | 14.52        |
| 2  | 102582009 | 25 晋能煤业 MTN004 | 500,000   | 50,652,558.90  | 5.13         |
| 3  | 250431    | 25 农发 31       | 500,000   | 50,634,547.95  | 5.13         |
| 4  | 09250202  | 25 国开清发 02     | 500,000   | 50,335,876.71  | 5.10         |
| 5  | 102681854 | 26 云铜股 MTN001  | 400,000   | 40,108,806.58  | 4.06         |

#### 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，23 国开 08、25 国开清发 02 的发行主体国开行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，25 农发 31 的发行主体农发银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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   | 82,710.74    |
| 2  | 应收证券清算款 | 7,771,400.32 |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | 666,200.73   |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 其他      | —            |
| 8  | 合计      | 8,520,311.79 |

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                        | 华泰柏瑞享利混合 A     | 华泰柏瑞享利混合 C     |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 159,542,975.10 | 472,027,678.90 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 23,050,554.29  | 85,630,784.93  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 18,917,382.51  | 86,954,909.48  |
| 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               | 163,676,146.88 | 470,703,554.35 |

## §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：本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

### 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

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。

### 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