# 华泰柏瑞鸿瑞60天持有期债券型证券投资基金
# 2026年第3季度报告

2026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：2026年10月27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约定，于 2026 年 10 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 2026 年 9 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券 |
| 基金主代码 | 019809 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 11 月 21 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 55,707,872.00 份 |
| 投资目标 | 本基金在控制风险和保持较高流动性的前提下，追求基金资产的稳健增值。 |
| 投资策略 | 1、类属资产配置策略<br>2、债券投资策略<br>（1）久期管理策略<br>（2）期限结构配置策略<br>（3）骑乘策略<br>（4）息差策略<br>3、信用债券及资产支持证券投资策略<br>4、杠杆投资策略<br>杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买具有高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。<br>5、国债期货投资策略<br>本基金根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，投资国债期货。<br>6、信用衍生品投资策略<br>本基金按照风险管理的原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。 |

| | | |
|---|---|---|
| 业绩比较基准 | 中债-综合全价（1-3 年）指数收益率*95%+活期存款基准利率*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。 | |
| 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 | 华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券 A | 华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 019809 | 019810 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 7,521,853.92 份 | 48,186,018.08 份 |

注：自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中债综合全价指数收益率×80%+银行一年期定期存款利率(税后)×20%”调整为“中债-综合全价（1-3 年）指数收益率×95%+活期存款基准利率×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 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日） | |
|---|---|---|
| | 华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券 A | 华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券 C |
| 1.本期已实现收益 | 202,470.05 | 271,711.73 |
| 2.本期利润 | 162,390.34 | 269,331.09 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0075 | 0.0081 |
| 4.期末基金资产净值 | 7,968,134.73 | 50,738,305.95 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0593 | 1.0530 |

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

华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券 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 | 0.76% | 0.02% | 0.41% | 0.02% | 0.35% | 0.00% |

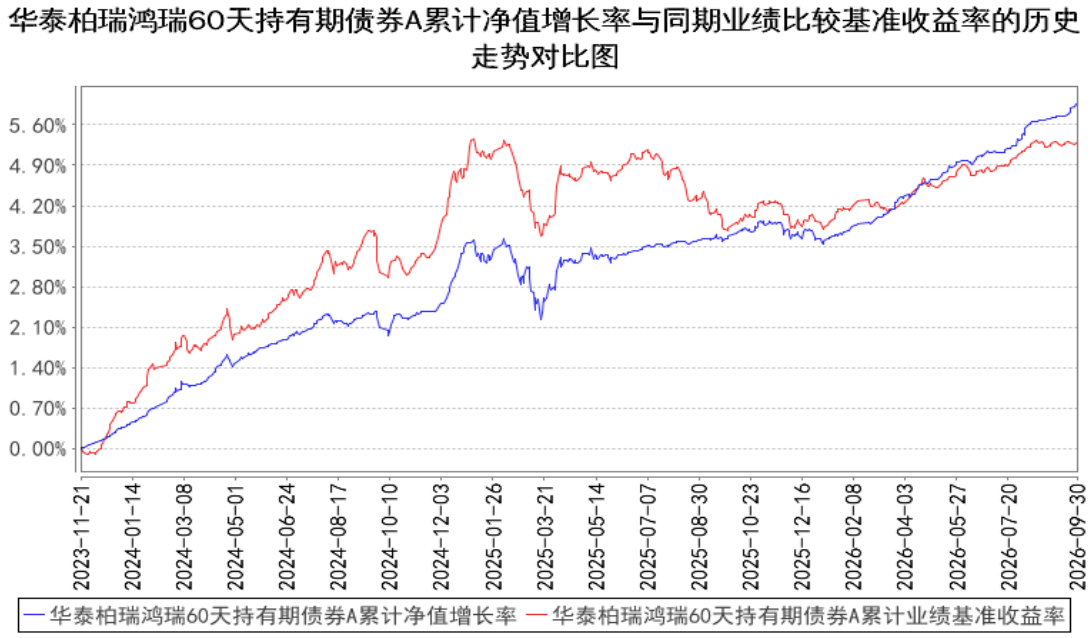
| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去六个月 | 1.51% | 0.02% | 0.99% | 0.03% | 0.52% | -0.01% |
| 过去一年 | 2.17% | 0.03% | 1.41% | 0.03% | 0.76% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.93% | 0.05% | 5.28% | 0.06% | 0.65% | -0.01% |

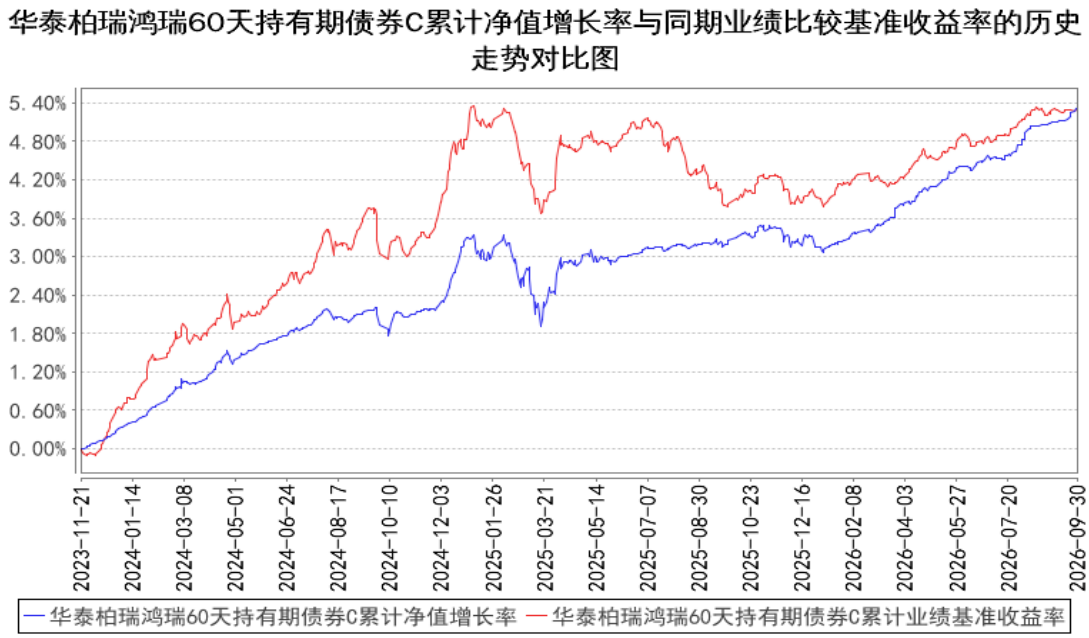
华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券 C

| 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 | 0.72% | 0.02% | 0.41% | 0.02% | 0.31% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.43% | 0.02% | 0.99% | 0.03% | 0.44% | -0.01% |
| 过去一年 | 1.99% | 0.03% | 1.41% | 0.03% | 0.58% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.30% | 0.05% | 5.28% | 0.06% | 0.02% | -0.01% |

注：自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中债综合全价指数收益率×80%+银行一年期定期存款利率(税后)×20%”调整为“中债-综合全价（1-3 年）指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%”，基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

### 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






注：1、A 类图示日期为 2023 年 11 月 21 日至 2026 年 9 月 30 日。C 类图示日期为 2023 年 11 月 21 日至 2026 年 9 月 30 日。

2、自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中债综合全价指数收益率×80%+银行一年期定期存款利率(税后)×20%”调整为“中债-综合全价（1-3 年）指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%”，基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

# §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 | | |
| 闫泽君 | 本基金的基金经理 | 2026 年 2 月 27 日 | - | 10 年 | 复旦大学工商管理硕士。曾任浙江泰隆商业银行投资经理、交银理财有限责任公司投资经理。2023 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任基金经理助理。2024 年 5 月起任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦悦债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 5 月至 2026 年 5 月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。2025 年 3 月起任华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月起任华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金的基金经理。2026 年 2 月起任华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。2026 年 9 月起任华泰柏瑞 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 恒荣债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 郑青 | 固定收益部联席总监、本基金的基金经理 | 2026 年 2 月 27 日 | - | 21 年 | 经济学硕士。曾任职于国信证券股份有限公司、平安资产管理有限责任公司，2008 年 3 月至 2010 年 4 月任中海基金管理有限公司交易员，2010 年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。2012 年 6 月起任华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金经理，2013 年 7 月至 2017 年 11 月任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起任华泰柏瑞交易型货币市场基金的基金经理。2016 年 9 月至 2026 年 7 月任华泰柏瑞天添宝货币市场基金的基金经理。2020 年 6 月起任华泰柏瑞新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。2020 年 6 月至 2022 年 12 月任华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月至 2021 年 12 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。2021 年 1 月起任华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月起任华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月至 2023 年 8 月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。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。2023 年 11 月至 2024 年 12 月任华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券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基金经理。2026 年 2 月起任华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。2026 年 9 月起任华泰柏瑞恒瑞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遵规守信情况的说明

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 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观方面，2026 年三季度主要经济指标走势继续分化，整体经济延续复苏态势。货币政策方面，央行货币政策适度宽松的基调未变、呵护态度明确，资金面总体维持合理充裕状态。

市场方面，2026 年三季度债券市场收益率整体呈现震荡下行走势，尤其是在 7 月和 9 月由于经济指标走势分化、市场流动性充裕、供给高峰接近尾声叠加机构配置需求等多重利多因素共振使得多数期限债券收益率明显下行，而 8 月市场较为平淡呈现横盘震荡走势，总体而言多数期限收益率在三季度震荡下行。

报告期内，本基金主要投资于利率债和信用债，并进行了一定的波段操作。

展望 2026 年四季度，海外方面美联储加息节奏或对金融资产价格造成影响；国内方面，在经济指标延续分化、市场流动性充裕、供给高峰即将过去的条件下债券市场仍然存在做多机会，但在前三个季度债券收益率已明显下行且临近年末的情况下止盈力量也在增加、做多空间有限，把握投资节奏愈发重要。此外，还需要关注突发事件、机构行为、政策预期等因素的影响。

未来本基金将维持适度的久期和杠杆水平，积极把握波段交易机会，优化组合配置，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鸿瑞 60 天持有期债券 A 的基金份额净值为 1.0593 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.76%，同期业绩比较基准收益率为 0.41%，截至本报告期末华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券 C 的基金份额净值为 1.0530 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.72%，同期业绩比较基准收益率为 0.41%。

### 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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 54,174,682.29 | 91.36 |
| | 其中：债券 | 54,174,682.29 | 91.36 |
| | 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 | 2,075,513.65 | 3.50 |
| 8 | 其他资产 | 3,045,362.00 | 5.14 |
| 9 | 合计 | 59,295,557.94 | 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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 38,773,334.24 | 66.05 |
| | 其中：政策性金融债 | 38,773,334.24 | 66.05 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 3,021,220.27 | 5.15 |
| 6 | 中期票据 | 12,380,127.78 | 21.09 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 54,174,682.29 | 92.28 |

## 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 | 260405 | 26 农发 05 | 150,000 | 15,066,661.64 | 25.66 |
| 2 | 230203 | 23 国开 03 | 100,000 | 10,369,709.59 | 17.66 |
| 3 | 230208 | 23 国开 08 | 100,000 | 10,273,063.01 | 17.50 |
| 4 | 102382883 | 23 张家经开 MTN003 | 30,000 | 3,098,887.40 | 5.28 |
| 5 | 102382917 | 23 冀交投 MTN006 | 30,000 | 3,095,535.45 | 5.27 |

## 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，中国农业发展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；国家开发银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

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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,045,362.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 3,045,362.00 |

### 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 | 华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券 A | 华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券 C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 34,382,562.89 | 24,792,663.83 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,816,878.19 | 30,470,089.31 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 30,677,587.16 | 7,076,735.06 |
| 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 | 7,521,853.92 | 48,186,018.08 |

## §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

| 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(%) |
| 个人 | 1 | 20260701-20260723;19,124,988.05 | - | 19,124,988.05 | - | - | |
| | 2 | 20260722-20260724;10,280,936.45 | - | 10,280,936.45 | - | - | |
| 产品特有风险 | | | | | | | |

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。

## 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**

2026 年 10 月 27 日