华泰柏瑞安诚 6 个月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	63,344,170.43 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	17,997,137.87 份	45,347,032.56 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 7 月 1 日-2026 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	426,607.67	757,299.83
2.本期利润	453,967.27	810,412.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0233	0.0221
4.期末基金资产净值	19,819,116.50	49,607,116.75
5.期末基金份额净值	1.1012	1.0939

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

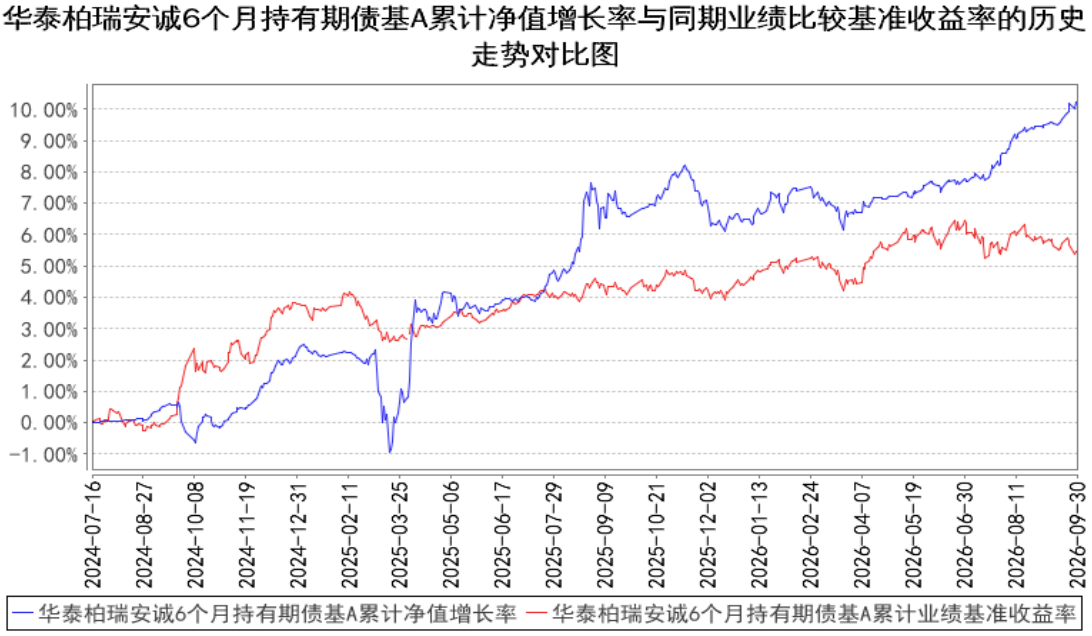
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.18%	0.09%	-0.97%	0.15%	3.15%	-0.06%
过去六个月	3.25%	0.08%	0.92%	0.15%	2.33%	-0.07%
过去一年	3.26%	0.11%	1.05%	0.13%	2.21%	-0.02%
自基金合同生效起至今	10.12%	0.18%	5.41%	0.13%	4.71%	0.05%

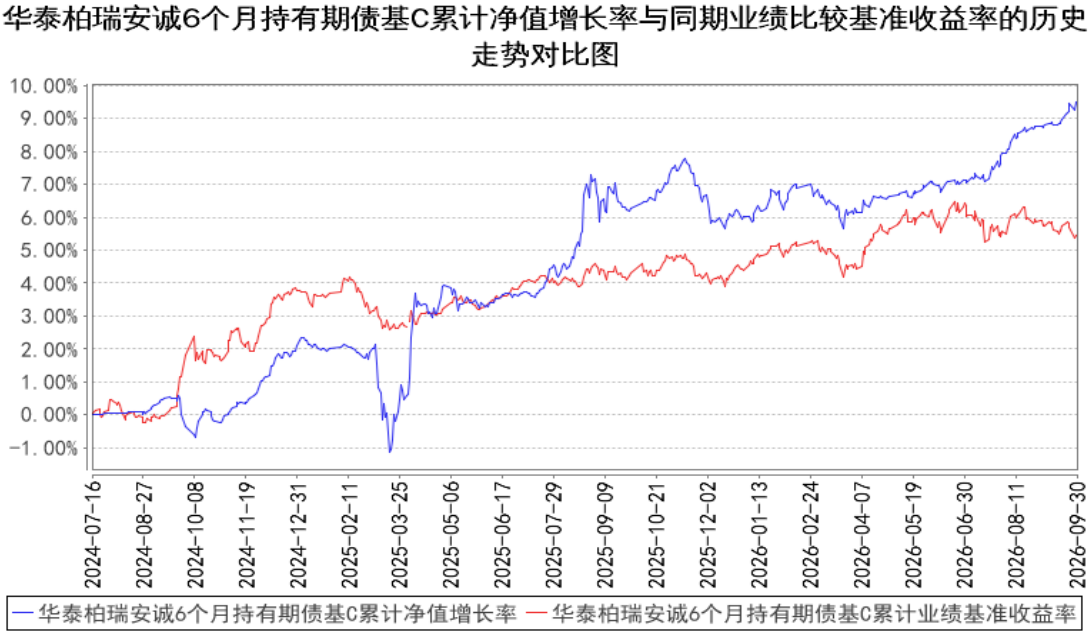
华泰柏瑞安诚 6 个月持有期债基 C

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
过去三个月	2.11%	0.09%	-0.97%	0.15%	3.08%	-0.06%
过去六个月	3.09%	0.08%	0.92%	0.15%	2.17%	-0.07%

过去一年	2.95%	0.11%	1.05%	0.13%	1.90%	-0.02%
自基金合同生效起至今	9.39%	0.18%	5.41%	0.13%	3.98%	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





注：A 类图示日期为 2024 年 7 月 16 日至 2026 年 9 月 30 日。C 类图示日期为 2024 年 7 月 16 日至 2026 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		
姬青	本基金的基金经理	2026 年 4 月 22 日	-	10 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 月起任华泰柏瑞享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。2026 年 7 月起任华泰柏瑞货币市场证券投资基金和华泰柏瑞交易型货币市场基金的基金经理。
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	2026 年 7 月 21 日	12 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 月至 2026 年 8 月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 月至 2026 年 7 月任华泰柏瑞安诚 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。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 9 月起任华泰柏瑞中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 9 月起任华泰柏瑞新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

2026 年三季度，内需磨底、外需与新动能仍是基本面的主要支撑。二季度 GDP 增速回落至 4.3%后，三季度受外需高增与低基数支撑。制造业 PMI 前低后高、逐月修复：7 月 49.2%跌破荣枯线、8 月 49.8%连续第二个月收缩、9 月回升至 50.1%重回扩张区间。7-8 月消费低位震荡，投资 8 月边际企稳但仍在深度负增，生产端 7 月回落、8 月修复，主要来自于上游能化链的补库需求，中下游部分传统行业生产也有边际改善，出口整体维持高位。物价方面，CPI 同比维持低位，PPI 同比先回落后回升，三季度 GDP 平减指数大概率延续正增长。

货币政策方面，央行延续"适度宽松"基调，三季度中长期流动性投放较二季度有所增加。除此之外，央行自 8 月开始增加了隔夜逆回购的中旬投放，9 月下旬将隔夜逆回购单日上限提升至 1 万亿以精准呵护跨季。9 月末央行进一步下调 PSL 利率 0.25 个百分点、扩大 PSL 支持领域并增加科技创新和技术改造再贷款额度和支农支小再贷款额度。

财政政策方面，三季度发债与支出节奏整体呈现"前低后扬、提速发力"的特征， 9 月末国常会部署加快债券发行使用、加大逆周期调节，政策重心由"发债"转向"资金落地形成实物工作量"。

市场方面，以 DR001 为代表的资金利率整体在 1.35%-1.45%区间运行。三季度债券市场演绎牛平行情，短端受资金成本约束基本持平，10 年国债下行约 5bp，30 年国债下行约 14bp， 30 年国债-10 年国债期限利差由 50bp 压缩至约 41bp。信用债方面，受资金宽松、负债端净流入、摊余债基抢跑预期等因素影响，信用利差整体压缩至历史极低分位，信用曲线大幅走平。

展望四季度，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，但随着 9 月末一系列稳增长政策落地，短期内总量货币政策落地的预期有所降温。本基金将积极参与债券交易，维持灵活的久期与适中的杠杆水平，争取规避信用风险。权益方面，随着风险偏好的变化，对主动权益基金和 ETF 维持偏均衡的配置思路。

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 1.1012 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.18%，同期业绩比较基准收益率为-0.97%，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 1.0939 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.11%，同期业绩比较基准收益率为-0.97%。

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	7,737.00	0.01
	其中：股票	7,737.00	0.01
2	基金投资	2,110,764.17	2.85
3	固定收益投资	64,522,443.87	87.23

	其中：债券	64,522,443.87	87.23
	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	5,000,290.98	6.76
	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	2,262,023.25	3.06
8	其他资产	66,721.27	0.09
9	合计	73,969,980.54	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	-	-
C	制造业	7,737.00	0.01
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	7,737.00	0.01

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	920196	南方乳业	300	4,263.00	0.01
2	920162	莫森泰克	200	3,474.00	0.01

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	37,231,334.78	53.63
	其中：政策性金融债	27,180,292.86	39.15
4	企业债券	5,058,280.82	7.29
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	22,232,828.27	32.02
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	64,522,443.87	92.94

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	220203	22 国开 03	120,000	12,255,600.00	17.65
2	250213	25 国开 13	100,000	10,050,929.35	14.48
3	102401042	24 榆林城投 MTN002	50,000	5,243,086.30	7.55
4	244851	26 长电 K2	50,000	5,058,280.82	7.29
5	524780	26 申证 K2	50,000	5,045,886.30	7.27

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，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；江苏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

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	11,760.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	54,961.14
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	66,721.27

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	920196	南方乳业	4,263.00	0.01	新股未上市
2	920162	莫森泰克	3,474.00	0.01	新股未上市

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

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	017606	华泰柏瑞轮动精选混合 A	契约型开放式	660,214.35	884,819.27	1.27	是
2	004475	华泰柏瑞富利灵活配置混合 A	契约型开放式	216,811.11	557,724.90	0.80	是
3	159915	易方达创业板 ETF	交易型开放式	75,000.00	236,550.00	0.34	否
4	588090	华泰柏瑞上证科创板 50 成份 ETF	交易型开放式	110,000.00	173,470.00	0.25	是
5	159259	易方达国证成长 100ETF	交易型开放式	110,000.00	138,600.00	0.20	否
6	512890	华泰柏瑞中证红利低波动 ETF	交易型开放式	100,000.00	119,600.00	0.17	是

6.1.1 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公开募集不动产投资信托基金投资明细

无。

6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

无。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2026 年 7 月 1 日至 2026 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）	4,256.10	4,256.10
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）	4,614.23	4,390.29
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	840.79	775.82
当期交易基金产生的交易费用（元）	416.93	246.02

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
报告期期初基金份额总额	28,247,944.20	52,146,664.07
报告期期间基金总申购份额	3,849,691.03	19,279,142.18
减:报告期期间基金总赎回份额	14,100,497.36	26,078,773.69
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	17,997,137.87	45,347,032.56

§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

2026 年 10 月 27 日