

华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型
证券投资基金
2022 年中期报告

2022 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 3 月 10 日（基金成立日）起至 2022 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 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	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
7.8 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贵金属投资明细	47

7.9 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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	48
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
11.1 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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债	
基金主代码	013827	
基金运作方式	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 10 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	198,961,223.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 A	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 C
下属分级基金的交 易代码	013827	013828
报告期末下属分级 基金的份额总额	48,457,695.25 份	150,503,528.55 份

2.2 基金产品说明

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	<p>1、类属资产配置策略 本基金以宏观经济趋势以及货币政策研究为导向，重点关注 GDP 增速、通货膨胀水平、利率变化趋势以及货币供应量等宏观经济指标，研判宏观经济运行所处的经济周期及其演进趋势；同时，积极关注财政政策、货币政策、汇率政策、产业政策和证券市场政策等的变化，分析其对不同类别资产的市场影响方向与程度，进而比较各大类资产的风险收益特性，综合考虑各证券市场的资金供求状况、流动性水平以及走势的相关性，在基金合同约定比例的范围内，动态调整基金大类资产的配置比例，从而优化资产组合的风险收益水平。</p> <p>2、债券投资策略 本基金主要投资于短期债券，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、信用债券投资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。</p> <p>3、杠杆投资策略 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。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否存在利差套利空间，从而确定是否进行杠杆操作。进行杠杆放大策略时，基金管理人将严格控制信用风险及流动性风险。本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%。</p> <p>4、资产支持证券投资策略 本基金将深入研究资产支持证券的发行条款、市场利率、支持资产的构成及</p>

	<p>质量、支持资产的现金流变动情况以及提前偿还率水平等因素，评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，通过信用分析和流动性管理，辅以量化模型分析，精选那些经风险调整后收益率较高的品种进行投资，力求获得长期稳定的投资收益。</p> <p>5、国债期货投资策略 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。本基金将结合对宏观经济形势和政策趋势的判断，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。</p> <p>6、信用衍生品投资策略 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。在进行信用衍生品投资时，同时投资其挂钩的信用债券，通过信用衍生品将其挂钩的信用债券的信用风险进行转移。收益率方面，将通过分析信用衍生品和挂钩债券的合成收益率，选择具备一定信用利差的信用衍生品及其挂钩债券进行投资，并确定信用衍生品及其挂钩债券的投资金额与期限。本基金仅投资于符合证券交易所或银行间市场相关业务规则的信用衍生工具。</p>
业绩比较基准	中债综合财富（1 年以下）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	李真
	联系电话	021-38601777	021-52629999-212051
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgb_lizhen@cib.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95561
传真		021-38601799	021-62159217
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄 上海证大五道口广场 1 号 17 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄 上海证大五道口广场 1 号 17 层	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码		200135	200120
法定代表人		贾波	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄 上海证大五道口广场 1 号 17 层
--------	--------------	---

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据	2022 年 03 月 10 日（基金合同生效日）-2022 年 06 月 30 日	
和指标	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 A	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 C
本期已实现收益	407,357.62	1,623,362.18
本期利润	488,057.22	1,934,057.10
加权平均基金份额本期利润	0.0115	0.0108
本期加权平均净值利润率	1.15%	1.07%
本期基金份额净值增长率	1.18%	1.12%
3.1.2 期末数据	报告期末 (2022 年 6 月 30 日)	
和指标		
期末可供分配利润	467,493.87	1,361,506.96
期末可供分配基金份额利润	0.0096	0.0090
期末基金资产净值	49,029,614.72	152,189,270.74
期末基金份额净值	1.0118	1.0112
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	1.18%	1.12%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰

低数。

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

华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 A

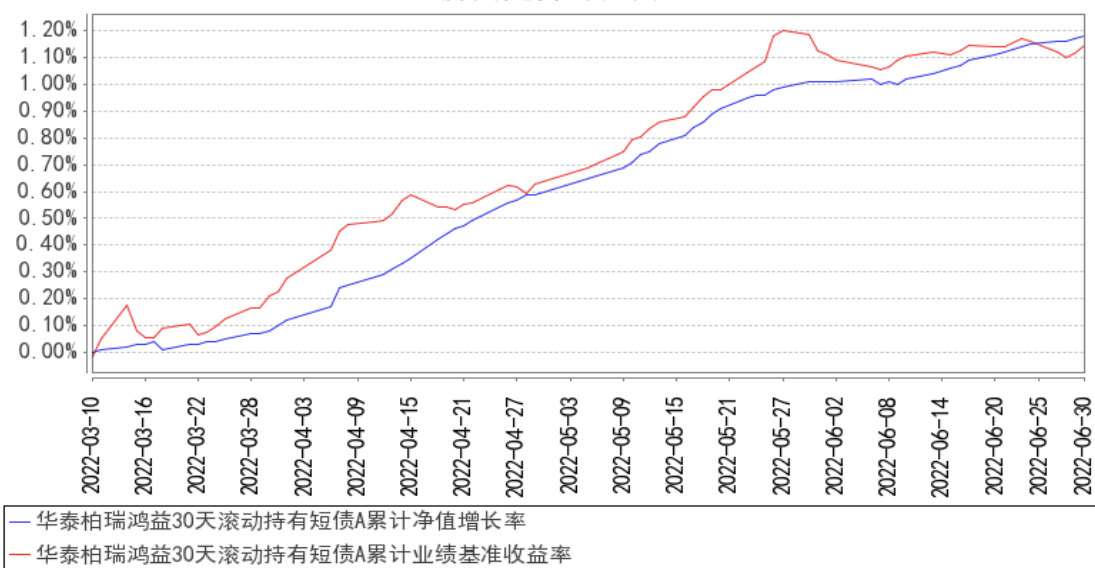
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.17%	0.01%	0.15%	0.01%	0.02%	0.00%
过去三个月	1.08%	0.02%	0.66%	0.01%	0.42%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.18%	0.02%	0.76%	0.01%	0.42%	0.01%

华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 C

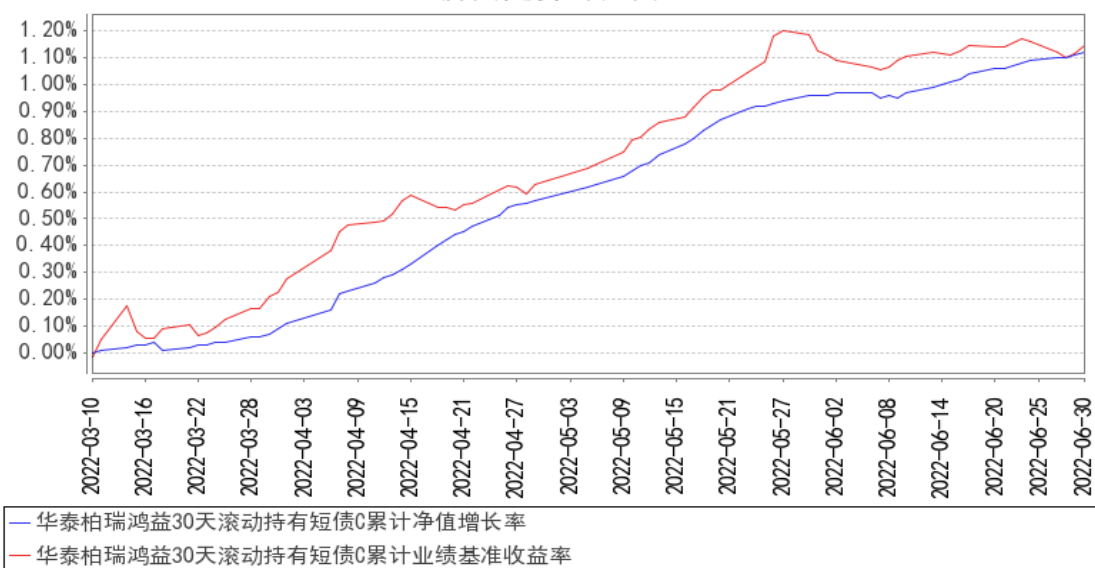
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.16%	0.01%	0.15%	0.01%	0.01%	0.00%
过去三个月	1.03%	0.02%	0.66%	0.01%	0.37%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.12%	0.02%	0.76%	0.01%	0.36%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

华泰柏瑞鸿益30天滚动持有短债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



华泰柏瑞鸿益30天滚动持有短债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：1、A级和C级图示日期均为2022年3月10日至2022年6月30日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至报告期末本基金仍在建仓期内。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深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、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华

泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、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、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式

指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金。截至 2022 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2750.48 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王焯斌	本基金的基金经理	2022 年 3 月 10 日	-	8 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 月起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 4 月起任华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月起任华泰柏瑞鸿裕 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 月起任华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金的基金经理。
郑青	固定收益部副总监、本基金的基金经理	2022 年 3 月 10 日	-	17 年	17 年证券（基金）从业经验，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，任债券研究员。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

					<p>华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 1 月起任固定收益部副总监。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 月起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、华泰柏瑞享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 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。</p>
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离任日期指基金管理人作出决定之日。

4.1.3 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：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差

进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，受内外部双重冲击，国内经济运行的不确定加大。一季度发达经济体开始加息与缩表，逐步退出疫情期间的刺激政策，俄乌冲突冲击全球市场，原油、工业品以及粮食价格上涨，发达国家央行进入加息周期，海外债券与权益市场波动性明显放大。内部来看，一季度稳增长政策不达预期，3 月末上海新冠疫情爆发且很快进入封控状态，二季度疫情持续反复，严重干扰经济修复，5 月末“稳住全国经济大盘电视电话会议”后防疫政策调整，复工复产力度显著增强，6 月上海正式复工复产、北京宣布疫情走向尾声。

国内经济表现上，一季度受疫情影响，PMI 数据转弱，结构上表现为产需两弱，需求回落的幅度更大；二季度各项经济指标表现不差，但有复苏斜率下降的迹象。通胀方面，地缘政治冲突影响原油价格和大宗商品价格，PPI 环比连续为正，CPI 继续受猪肉价格影响，总体维持在温和水平。未来关注焦点是稳增长、宽信用的政策效果。

市场方面，疫情冲击导致二季度经济快速下滑，债券收益率先下后上，总体表现震荡行情，反应疫情与复工复产的经济影响。信用债方面，短期限收益率受资金宽松下行为主，6 月份疫情管控放松后，各期限收益率均有小幅反弹，曲线短端较为平坦，中长端曲线陡峭，体现出市场对久期的谨慎。

华泰柏瑞鸿益 30 天滚动产品目前维持中高等级信用债配置，维持了合适的久期和杠杆水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 A 的基金份额净值为 1.0118 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.18%，同期业绩比较基准收益率为 0.76%，截至本报告期末华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 C 的基金份额净值为 1.0112 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.12%，同期

业绩比较基准收益率为 0.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，债券短期内延续震荡格局的可能性较高，宽松的货币政策环境对债市继续形成支撑。预期上，海外央行加息与缩表的议题落地，国内重归稳经济，三季度财政及基建投资大幅上马的效率或会得以提升，债券将持续关注中短久期、有信用利差的主体。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按照除权除息日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资，红利再投资的基金份额的运作期到期日与原基金份额的运作期到期日保持一致；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；2、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；3、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在

本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	270,466.04
结算备付金		-
存出保证金		437.42
交易性金融资产	6.4.7.2	236,684,887.12
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		236,684,887.12
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		3,110,167.86
递延所得税资产		-

其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		240,065,958.44
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		32,503,920.55
应付清算款		-
应付赎回款		6,172,153.58
应付管理人报酬		38,267.42
应付托管费		9,566.86
应付销售服务费		30,056.87
应付投资顾问费		-
应交税费		16,353.78
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	76,753.92
负债合计		38,847,072.98
净资产:		
实收基金	6.4.7.10	198,961,223.80
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	2,257,661.66
净资产合计		201,218,885.46
负债和净资产总计		240,065,958.44

注：1. 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 198,961,223.80 份，其中华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 A 类基金份额净值 1.0118 元，份额总额 48,457,695.25 份；华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 C 类基金份额净值 1.0112 元，份额总额 150,503,528.55 份。

2. 本基金成立于 2022 年 3 月 10 日，无上年度可比期间数据。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年3月10日（基金合同生效日）至2022年6月30日
一、营业总收入		2,910,951.34
1. 利息收入		391,488.27

其中：存款利息收入	6.4.7.13	164,495.79
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		226,992.48
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,128,068.55
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	2,128,068.55
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	391,394.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-
减：二、营业总支出		488,837.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	137,314.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	34,328.72
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	111,180.42
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		137,696.66
其中：卖出回购金融资产支出		137,696.66
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		6,462.99
8. 其他费用	6.4.7.23	61,853.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,422,114.32
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,422,114.32
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		2,422,114.32

注：本基金成立于 2022 年 3 月 10 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产（基金净值）	236,942,204.93	-	-	236,942,204.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-37,980,981.13	-	2,257,661.66	-35,723,319.47
（一）、综合收益总额	-	-	2,422,114.32	2,422,114.32
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-37,980,981.13	-	-164,452.66	-38,145,433.79
其中：1. 基金申购款	124,892,534.66	-	1,035,977.37	125,928,512.03
2. 基金赎回款	-162,873,515.79	-	-1,200,430.03	-164,073,945.82
（三）、本期向基金份额持有人分配利	-	-	-	-

润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	198,961,223.80	-	2,257,661.66	201,218,885.46

注：本基金成立于 2022 年 3 月 10 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>韩勇</u>	<u>房伟力</u>	<u>赵景云</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]2874 号《关于准予华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金注册的批复》注册，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 236,912,447.81 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0208 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》于 2022 年 3 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 236,912,447.81 份基金份额，其中认购资金利息折合 29,757.12 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费、申购费、销

售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不投资于股票资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中债综合财富（1 年以下）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2022 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日止期间的 财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具, 是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时, 确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为: 以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具, 分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标, 且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致, 即在特定日期产生的现金流量, 仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益:

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具, 以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资, 在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余

成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部

分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开

营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	270,466.04
等于：本金	270,337.66
加：应计利息	128.38
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	270,466.04

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	233,180,005.48	3,113,487.12	236,684,887.12
	合计	233,180,005.48	3,113,487.12	236,684,887.12
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	233,180,005.48	3,113,487.12	236,684,887.12	391,394.52

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：截至本报告期末，本基金未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：截至本报告期末，本基金未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：截至本报告期末，本基金未投资债权。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：截至本报告期末，本基金未投资债权。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：截至本报告期末，本基金未投资其他债权。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：截至本报告期末，本基金未投资其他债权。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：截至本报告期末，本基金未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：截至本报告期末，本基金未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	19,683.27
其中：交易所市场	-
银行间市场	19,683.27
应付利息	-
预提费用	57,070.65
合计	76,753.92

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 A

项目	本期 2022 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
----	---

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	36,846,279.01	36,846,279.01
本期申购	41,970,710.48	41,970,710.48
本期赎回（以“-”号填列）	-30,359,294.24	-30,359,294.24
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	48,457,695.25	48,457,695.25

华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 C

项目	本期 2022 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	200,095,925.92	200,095,925.92
本期申购	82,921,824.18	82,921,824.18
本期赎回（以“-”号填列）	-132,514,221.55	-132,514,221.55
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	150,503,528.55	150,503,528.55

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：截至本报告期末，本基金无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	407,357.62	80,699.60	488,057.22
本期基金份额交易产生的变动数	60,136.25	23,726.00	83,862.25
其中：基金申购款	279,393.14	77,424.76	356,817.90
基金赎回款	-219,256.89	-53,698.76	-272,955.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	467,493.87	104,425.60	571,919.47

华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,623,362.18	310,694.92	1,934,057.10
本期基金份额交易产	-261,855.22	13,540.31	-248,314.91

生的变动数			
其中：基金申购款	490,323.83	188,835.64	679,159.47
基金赎回款	-752,179.05	-175,295.33	-927,474.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,361,506.96	324,235.23	1,685,742.19

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年3月10日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
活期存款利息收入		36,033.18
定期存款利息收入		126,900.00
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		1,560.91
其他		1.70
合计		164,495.79

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内无买卖股票差价收入。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年3月10日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
债券投资收益——利息收入		1,940,120.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		187,948.29
债券投资收益——赎回差价收入		-
债券投资收益——申购差价收入		-
合计		2,128,068.55

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年3月10日（基金合同生效日）至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	214,839,348.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	211,528,499.60
减：应计利息总额	3,113,154.26
减：交易费用	9,746.49
买卖债券差价收入	187,948.29

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	391,394.52
股票投资	-
债券投资	391,394.52
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	391,394.52

6.4.7.21 其他收入

注：本基金不收取赎回费用。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	19,023.55
信息披露费	38,047.10
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,782.81

合计	61,853.46
----	-----------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本期未发生与关联方进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	137,314.77
其中：支付销售机构的客户维护费	62,864.12

注：1. 支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

2. 本基金成立于 2022 年 3 月 10 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	34,328.72

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 A	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 C	合计
兴业银行股份有限公司	0.00	102,396.17	102,396.17
华泰证券股份有限公司	0.00	26.71	26.71
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	30.97	30.97
合计	0.00	102,453.85	102,453.85

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.2% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	270,466.04	36,033.18

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 32,503,920.55 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
042280203	22 华阳新材 CP002	2022 年 7 月 1 日	100.63	100,000	10,063,397.26
101801465	18 天津港 MTN002	2022 年 7 月 1 日	104.32	100,000	10,432,078.90
102000171	20 阳煤 MTN001	2022 年 7 月 1 日	101.91	41,000	4,178,124.66
210306	21 进出 06	2022 年 7 月 1 日	101.87	103,000	10,493,019.18
合计				344,000	35,166,620.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，为证券投资中具有较低风险收益特征的品种。本基金投资的金融工具为具有良好流动性的固定收益类品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人兴业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日
A-1	10,111,746.85
A-1 以下	-
未评级	133,917,561.09

合计	144,029,307.94
----	----------------

注：未评级的债券包括政策性金融债、短期融资券。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日
AAA	72,324,884.94
AAA 以下	20,330,694.24
未评级	-
合计	92,655,579.18

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定持有期后随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于最早约定持有期到期后每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 32,503,920.55 元将在一个月以内到

期且计息(该利息金额不重大)外,本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于最早约定持有期到期后按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日,本基金无流动性受限资产。

于最早约定持有期到期后,本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 2年 6月 30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5 年 以 上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	270,466.04	-	-	-	-	-	270,466.04
存 出 保 证 金	437.42	-	-	-	-	-	437.42
交 易 性 金 融 资 产	30,661,043.29	63,047,114.52	121,881,660.82	21,095,068.49	-	-	236,684,887.12
应 收 申 购 款	-	-	-	-	-	3,110,167.86	3,110,167.86
资	30,931,946.7	63,047,114.5	121,881,660.8	21,095,068.4	-	3,110,167.8	240,065,958.4

产总计	5	2	2	9	6	4
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	6,172,153.58	6,172,153.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	38,267.42	38,267.42
应付托管费	-	-	-	-	9,566.86	9,566.86
卖出回购金融资产款	32,503,920.55	-	-	-	-	32,503,920.55
应付销售服务费	-	-	-	-	30,056.87	30,056.87
应交税费	-	-	-	-	16,353.78	16,353.78
其他负	-	-	-	-	76,753.92	76,753.92

债						
负债总计	32,503,920.55	-	-	-	6,343,152.43	38,847,072.98
利率敏感度缺口	1,571,973.80	-63,047,114.52	121,881,660.82	21,095,068.49	-3,232,984.57	201,218,885.46

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2022年6月30日）
分析	市场利率下降 25 个基点	268,384.75
	市场利率上升 25 个基点	-267,467.30

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金

管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益投资（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	—
第二层次	236,684,887.12
第三层次	—
合计	236,684,887.12

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	236,684,887.12	98.59
	其中：债券	236,684,887.12	98.59
	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	270,466.04	0.11
8	其他各项资产	3,110,605.28	1.30
9	合计	240,065,958.44	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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。

7.2.2 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股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	42,895,473.97	21.32
	其中：政策性金融债	22,390,054.79	11.13
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	121,639,253.15	60.45
6	中期票据	72,150,160.00	35.86
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	236,684,887.12	117.63

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	091900026	19 中国华融债 01(品种一)	200,000	20,505,419.18	10.19
2	210306	21 进出 06	120,000	12,224,876.71	6.08
3	102101487	21 云能投 MTN001	100,000	10,662,989.59	5.30
4	101801465	18 天津港 MTN002	100,000	10,432,078.90	5.18
5	101901017	19 鲁钢铁 MTN003	100,000	10,430,438.36	5.18

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

报告期内基金投资的前十名证券的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。

7.12.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	437.42
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,110,167.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,110,605.28

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 A	461	105,114.31	0.00	0	48,457,695.25	100.00
华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 C	2,244	67,069.31	0.00	0	150,503,528.55	100.00
合计	2,660	74,797.45	0.00	0	198,961,223.80	100.00

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 A	425,456.34	0.8780
	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 C	55,808.78	0.0371
	合计	481,265.12	0.2419

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 A	0
	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 A	0
	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 A	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债 C
基金合同生效日 (2022 年 3 月 10 日) 基金份额总额	36,846,279.01	200,095,925.92
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	41,970,710.48	82,921,824.18
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	30,359,294.24	132,514,221.55
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	48,457,695.25	150,503,528.55

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2022 年 3 月 15 日，公司股东批准 Kirk Chester SWEENEY 先生担任公司董事，Anthony Gerard Fasso 先生不再担任公司董事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需
要，并能为基金提供全面的信息服
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经
济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要
求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、本基金成立于 2022 年 3 月 10 日，上述席位均为本报告期内租用，无变更情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	10,096,238.08	100.00	277,206,000.00	100.00	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金暂停转换转入公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 5 月 30 日
2	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金暂停转换转入公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 26 日
3	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金开放日常赎回业务公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 9 日
4	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金开放日常申购、转换、定期定额投资、费率优惠等业务公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 3 月 30 日
5	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金暂停转换转入公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 3 月 30 日
6	华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 3 月 11 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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：本基金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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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 17 层

托管人住所

12.3 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

2022 年 8 月 30 日