

华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券型证券投资
基金
2024 年第 3 季度报告

2024 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：2024 年 10 月 25 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规定，于 2024 年 10 月 24 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 2024 年 7 月 1 日起至 2024 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	67,612,029.15 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	<p>1、类属资产配置策略</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>（1）久期管理策略</p> <p>（2）期限结构配置策略</p> <p>（3）骑乘策略</p> <p>（4）息差策略</p> <p>3、信用债券及资产支持证券投资策略</p> <p>4、杠杆投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>6、信用衍生品投资策略</p> <p>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。</p>

业绩比较基准	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%	
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	44,381,832.56 份	23,230,196.59 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（2024 年 7 月 1 日-2024 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	122,788.31	201,836.86
2. 本期利润	-17,826.10	79,380.65
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0008	0.0019
4. 期末基金资产净值	45,316,040.08	23,678,994.52
5. 期末基金份额净值	1.0210	1.0193

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	0.13%	0.03%	0.28%	0.08%	-0.15%	-0.05%
过去六个月	0.93%	0.03%	1.21%	0.07%	-0.28%	-0.04%
自基金合同	2.10%	0.03%	3.04%	0.06%	-0.94%	-0.03%

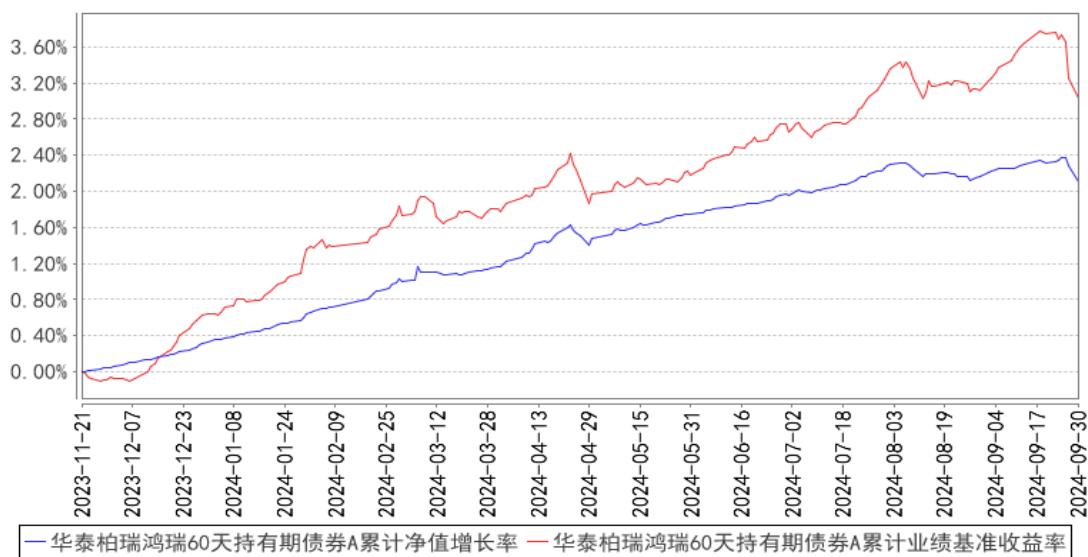
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券 C

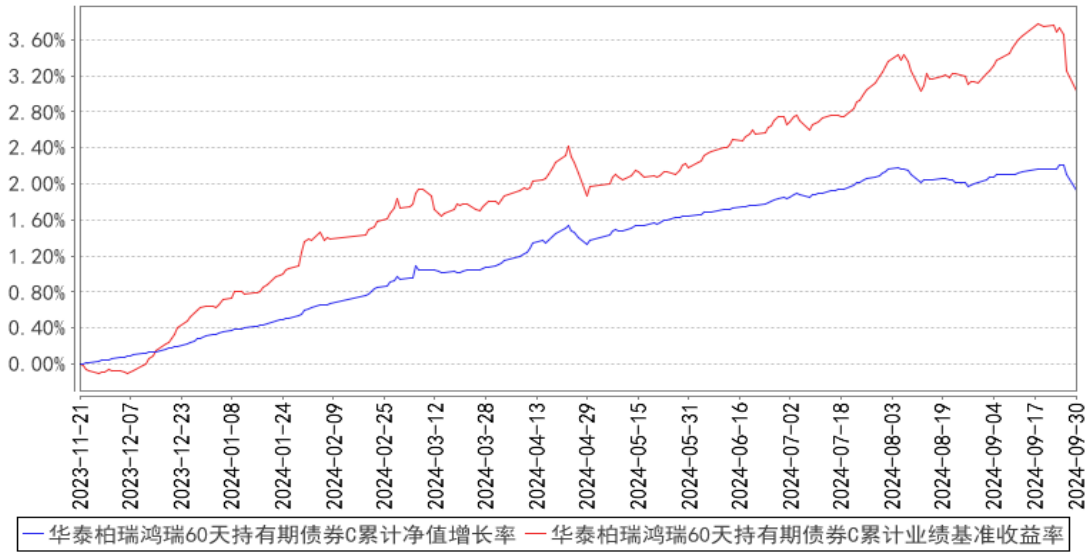
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.08%	0.03%	0.28%	0.08%	-0.20%	-0.05%
过去六个月	0.83%	0.03%	1.21%	0.07%	-0.38%	-0.04%
自基金合同生效起至今	1.93%	0.03%	3.04%	0.06%	-1.11%	-0.03%

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

华泰柏瑞鸿瑞60天持有期债券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



华泰柏瑞鸿瑞60天持有期债券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类图示日期为2023年11月21日至2024年9月30日。C类图示日期为2023年11月21日至2024年9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的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围中规定的比例。

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		
刘礼彬	本基金的基金经理	2024年4月18日	-	11年	德雷克塞尔大学金融学硕士。曾任中诚信国际信用评级有限公司政府与公共融资评级部项目经理、中信保诚基金固定收益部专户投资经理、华夏银行资产管理部投资经理、华夏理财公司固定收益投资部高级经理。2023年8月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2023年10月起任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、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金的基金经理。2023年11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。2024年4月起华泰柏瑞鸿瑞60天持有期债券型证券投资基金基金经理。
郑青	固定收益	2023年11月	-	18年	经济学硕士。曾任职于国信证券股份有限公司。

	部联席总监、本基金的基金经理	21 日		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。
--	----------------	------	--	--

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，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 2 次，都为指数投资组合因跟踪指数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

国内经济方面，2024 年三季度延续了二季度内需偏弱的格局。具体来看，7 月、8 月官方制造业 PMI 分别为 49.4、49.1，9 月回升至 49.8。9 月 26 日政治局会议针对当前经济形势，提出要有效落实存量政策，加力推出增量政策，努力完成全年经济社会发展目标。货币政策方面，三季度央行在 7 月、9 月分别调降 OMO 利率 10BP 和 20BP，并同步调降 MLF 利率；9 月 27 日降准 0.5 个百分点。

市场方面，三季度债券市场收益率波动较大。具体来看，7 月初央行宣布将面向部分一级交易商展开国债借入操作对债券市场有一定扰动外，全月收益率整体下行；8 月受大行卖债影响收益率波动较大；9 月收益率下行，长端表现更好，利率好于信用。9 月 26 日政治局会议后，在对增量政策的预期及风险偏好提升的影响下，债市收益率连续快速上行。

报告期内，本基金主要投资于中高等级的信用债和商业银行债券，维持了适当的久期和杠杆水平。

展望后市，基本面仍然对债市有利，货币政策仍然在降准降息的宽松周期中，债市不具备大幅转向的基础。在 9 月末的大幅调整后，由于风险偏好的提升，四季度债市波动可能加大。重点关注财政的增量政策以及年底的经济工作会议对明年经济形势的预判和定调。

未来本基金将在控制好信用风险和流动性风险的前提下，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，规避信用风险，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 1.0210 元，本报告期基

金份额净值增长率为 0.13%，同期业绩比较基准收益率为 0.28%，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 1.0193 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.08%，同期业绩比较基准收益率为 0.28%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	75,739,691.61	99.82
	其中：债券	75,739,691.61	99.82
	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	139,170.48	0.18
8	其他资产	-	-
9	合计	75,878,862.09	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	19,331,948.67	28.02
	其中：政策性金融债	5,139,433.06	7.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	19,217,859.71	27.85
6	中期票据	27,343,741.64	39.63
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	9,846,141.59	14.27
9	其他	-	-
10	合计	75,739,691.61	109.78

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	112412088	24 北京银行 CD088	100,000	9,846,141.59	14.27
2	102380448	23 鄂联投 MTN001	50,000	5,146,739.73	7.46
3	200203	20 国开 03	50,000	5,139,433.06	7.45
4	042380725	23 淄博城运 CP002	50,000	5,131,166.67	7.44
5	2228015	22 浦发银行 03	50,000	5,095,696.71	7.39

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，24 北京银行 CD088 的发行主体北京银行（601169）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规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

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	10,289,022.27	51,346,099.68
报告期期间基金总申购份额	41,220,023.86	6,021,122.73
减：报告期期间基金总赎回份额	7,127,213.57	34,137,025.82
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	44,381,832.56	23,230,196.59

§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：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§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。

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

2024 年 10 月 25 日