

华泰柏瑞安盛一年持有期债券型证券投资  
基金  
2023 年第 2 季度报告

2023 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2023 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 4 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞安盛一年持有期债券
基金主代码	016983
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 1 月 17 日
报告期末基金份额总额	300,864,042.79 份
投资目标	在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 本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资收益。 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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞安盛一年持有期债券 A	华泰柏瑞安盛一年持有期债券 C
下属分级基金的交易代码	016983	016984
报告期末下属分级基金的份额总额	107,567,549.23 份	193,296,493.56 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（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）	
	华泰柏瑞安盛一年持有期债券 A	华泰柏瑞安盛一年持有期债券 C
1. 本期已实现收益	1,064,909.15	1,779,611.85
2. 本期利润	1,218,382.01	2,059,050.46
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0114	0.0107
4. 期末基金资产净值	109,687,889.20	196,841,216.49
5. 期末基金份额净值	1.0197	1.0183

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

华泰柏瑞安盛一年持有期债券 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	1.13%	0.08%	0.32%	0.08%	0.81%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.97%	0.07%	0.55%	0.08%	1.42%	-0.01%

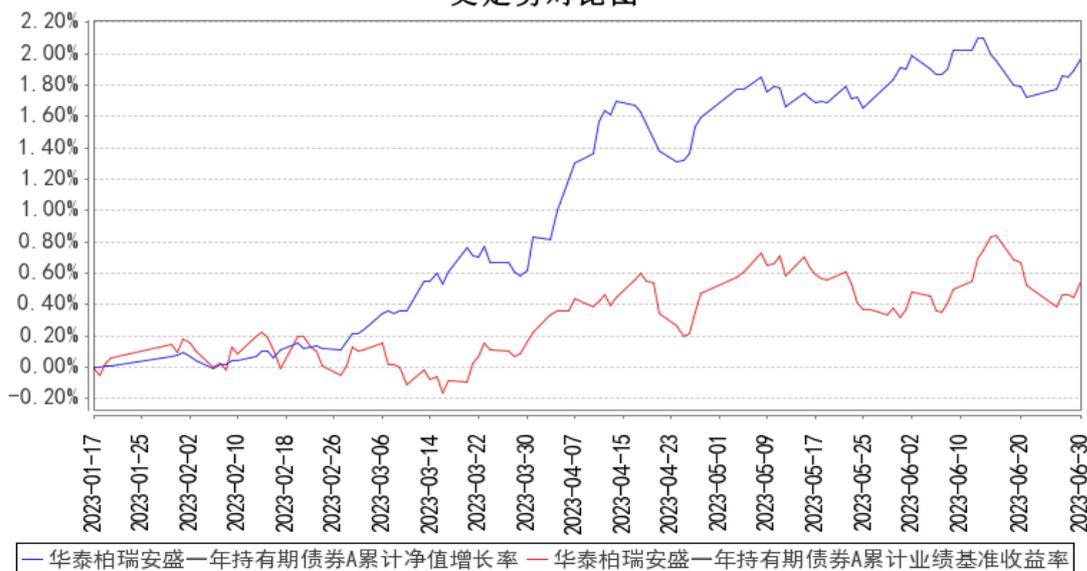
华泰柏瑞安盛一年持有期债券 C

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	1.13%	0.08%	0.32%	0.08%	0.81%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.97%	0.07%	0.55%	0.08%	1.42%	-0.01%

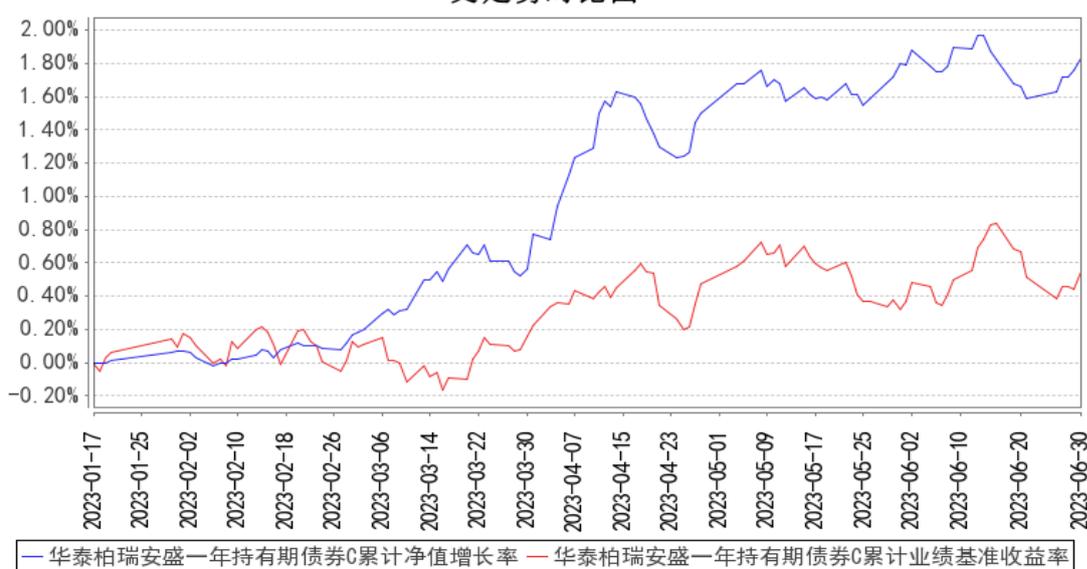
过去三个月	1.05%	0.08%	0.32%	0.08%	0.73%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.83%	0.07%	0.55%	0.08%	1.28%	-0.01%

### 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

华泰柏瑞安盛一年持有期债券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



华泰柏瑞安盛一年持有期债券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、图示日期为 2023 年 1 月 17 日至 2023 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处于建仓期。

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		
罗远航	固定收益部联席总监、本基金的基金经理	2023年1月17日	-	12年	清华大学应用经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司交易员、研究员、基金经理。2017年1月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。2017年3月至2018年4月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月至2018年11月任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月至2019年3月任华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金的基金经理。2017年3月至2020年7月任华泰柏瑞新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。2019年2月至2021年4月任华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金的基金经理。2019年11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的基金经理。2020年1月起任华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2020年7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。2020年10月起任华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金的基金经理。2021年11月起任华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金的基金经理。2022年11月起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。2023年1月起任华泰柏瑞安盛一年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：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

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《证券投资基金管理人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 5 次，其中 1 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，其余 4 次为指数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

2023 年二季度，美国通胀有所下行但仍维持在较高水平，美联储加息一次，比一季度减少一次。其货币政策进入观察期，但仍然维持了年内继续加息的展望预期。国内方面，经济复苏的势头有所减弱，数据表现大都低于预期，受到去年低基数的影响，二季度同比增速较高，但环比一季度表现趋弱。PMI 在 4 月和 5 月连续回落且低于季节性，6 月也仅仅是小幅反弹，且处于 50 以下。二季度信贷增量显著低于一季度水平，信用扩张速度下降。货币政策方面，二季度央行降低 OMO、MLF 和 LPR 等政策利率 10bp，且引导银行降低了存款挂牌利率，货币政策仍然处于宽松周期中。

市场方面，二季度资金利率相比一季度降低，R001 和 R007 季度均值分别下降了约 20bp。

各类债券在二季度表现良好，收益率整体下行。

报告期内，本基金仍处于建仓阶段，主要投资于高等级的信用债和利率债，维持了适当的久期和杠杆水平，同时也优选了权益基金进行配置。

展望 2023 年三季度，美国通胀和经济的韧性仍在，不排除下半年美联储还有继续加息的空间。国内方面，受到地产和消费的拖累，经济增长仍然面临一定的挑战，不过库存周期可能已经接近底部，经济增长预期也并不悲观。政策上，上半年财政发力慢于预期，下半年有可能财政加快投放节奏，这对于经济增长有一定支撑。整体上债券市场的有利因素不会发生大的改变，但边际上继续推动利率下行的力量也并不显著，预计利率将在较长的时间内低位震荡。

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安盛一年持有期债券 A 的基金份额净值为 1.0197 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.13%，同期业绩比较基准收益率为 0.32%，截至本报告期末华泰柏瑞安盛一年持有期债券 C 的基金份额净值为 1.0183 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.05%，同期业绩比较基准收益率为 0.32%。

#### 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	28,141,243.50	7.19
3	固定收益投资	362,027,575.69	92.52
	其中：债券	362,027,575.69	92.52
	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	1,075,572.43	0.27

8	其他资产	34,959.13	0.01
9	合计	391,279,350.75	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	217,696,270.08	71.02
	其中：政策性金融债	40,798,520.55	13.31
4	企业债券	61,609,427.95	20.10
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	82,721,877.66	26.99
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	362,027,575.69	118.11

## 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	2028041	20 工商银行二级 01	200,000	21,247,506.85	6.93
2	1928031	19 广发银行永续 债	200,000	21,114,410.96	6.89
3	1920076	19 徽商银行永续 债	200,000	21,013,068.49	6.86
4	2128038	21 农业银行永续 债 01	200,000	20,872,145.75	6.81
5	155505	19 北汽 03	200,000	20,819,152.88	6.79

## 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国债期货交易情况说明

#### 5.9.1 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。

#### 5.9.2 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。

#### 5.9.3 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。

### 5.10 投资组合报告附注

#### 5.10.1 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

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。

#### 5.10.2 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。

#### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,009.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,987.21
6	其他应收款	13,962.16
7	其他	-

8	合计	34,959.13
---	----	-----------

#### 5.10.4 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。

#### 5.10.5 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。

#### 5.10.6 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	004475	华泰柏瑞富利混合 A	契约型开放式	11,265,010.40	22,327,250.61	7.28	是
2	014597	华泰柏瑞富利混合 C	契约型开放式	2,968,746.37	5,813,992.89	1.90	是

#### 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023 年 4 月 1 日至 2023 年 6 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)	7,620.14	7,620.14
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	12,519.35	12,519.35
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	106,529.16	106,529.16
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	17,754.91	17,754.91

#### 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	华泰柏瑞安盛一年持有期 债券 A	华泰柏瑞安盛一年持有期 债券 C
报告期期初基金份额总额	106,530,358.33	193,040,126.73
报告期期间基金总申购份额	1,037,190.90	256,366.83
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	107,567,549.23	193,296,493.56

## §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：无。

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## §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。

### 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

### 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2023 年 7 月 21 日