

华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2016 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 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 2016 年 7 月 1 日起至 2016 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞丰盛纯债债券	
交易代码	000187	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 9 月 2 日	
报告期末基金份额总额	467,177,983.26 份	
投资目标	在合理控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资收益	
投资策略	本基金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、息差策略等主动投资策略，选择合适的时机和品种构建债券组合。	
业绩比较基准	一年期银行定期存款收益率（税后）*130%	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞丰盛纯债债券 A	华泰柏瑞丰盛纯债债券 C
下属分级基金的交易代码	000187	000188
报告期末下属分级基金的份额总额	463,449,573.96 份	3,728,409.30 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（2016年7月1日—2016年9月30日）	
	华泰柏瑞丰盛纯债债券 A	华泰柏瑞丰盛纯债债券 C
1. 本期已实现收益	14,215,499.10	96,273.21
2. 本期利润	12,616,195.16	74,729.35
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0173	0.0153
4. 期末基金资产净值	501,053,454.60	3,992,361.51
5. 期末基金份额净值	1.0810	1.0710

注：1、所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 本报告期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

华泰柏瑞丰盛纯债债券 A

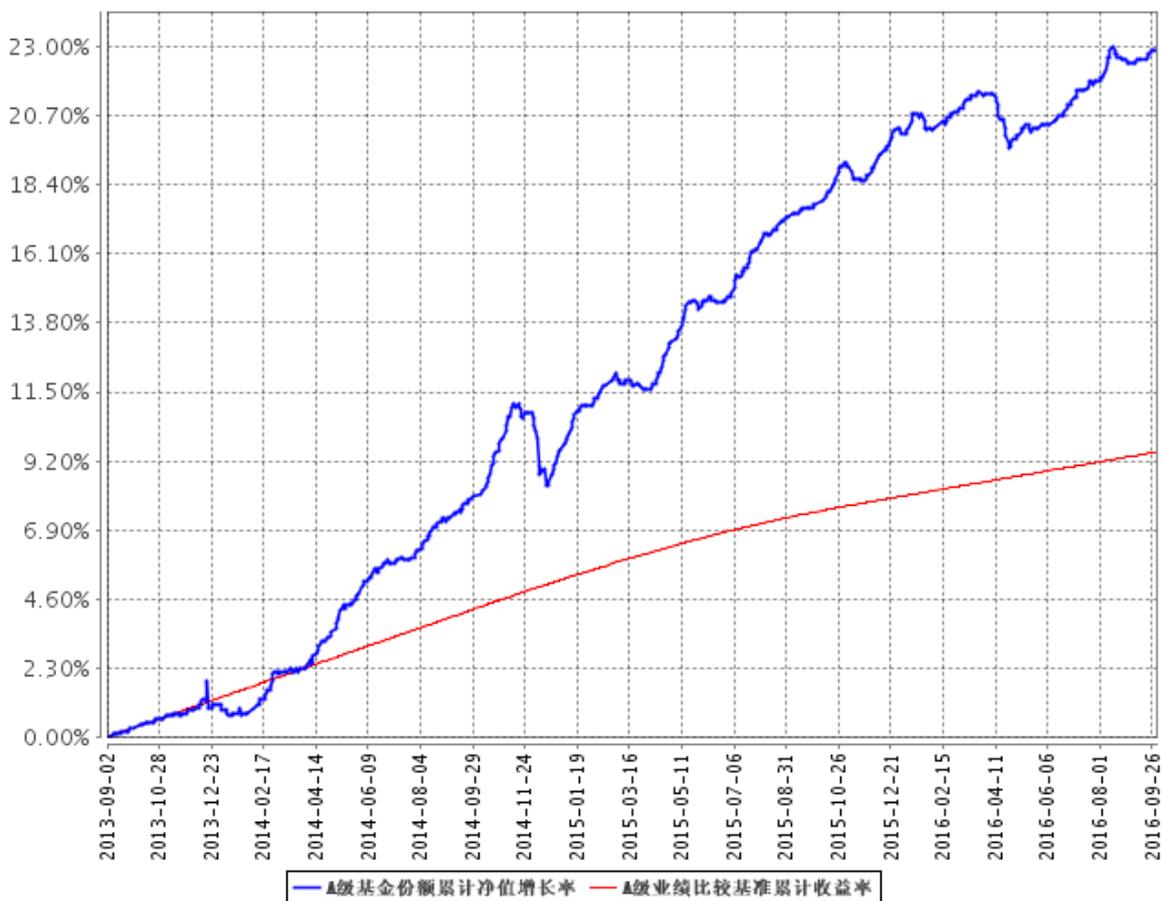
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.50%	0.07%	0.50%	0.00%	1.00%	0.07%

华泰柏瑞丰盛纯债债券 C

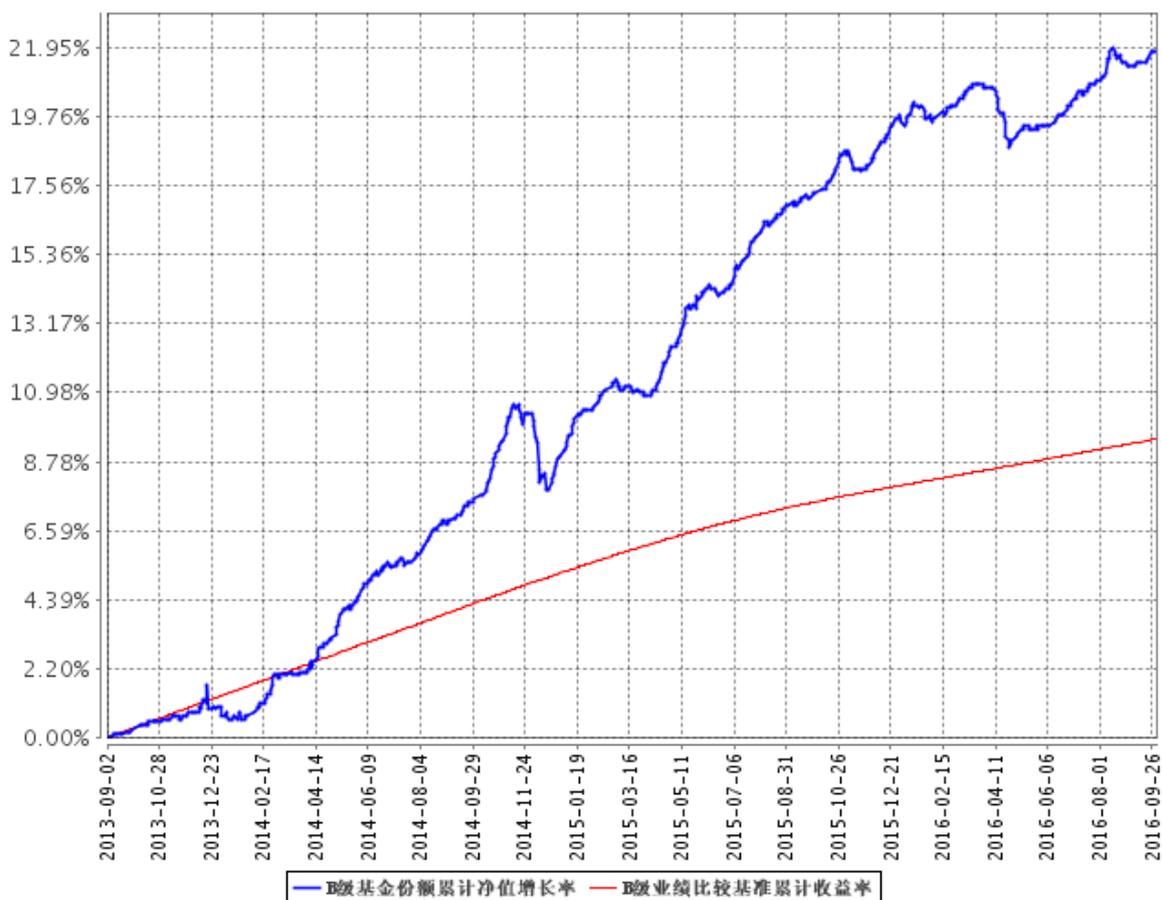
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.42%	0.07%	0.50%	0.00%	0.92%	0.07%

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

A级基金份额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



B级基金份额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 2013 年 9 月 2 日至 2016 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，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围中规定的各项比例，投资于债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

§ 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		
陈东	固定收益部总监、本基金的基金经理	2013 年 9 月 2 日	-	9 年	陈东先生，硕士，曾任深圳发展银行（现已更名为平安银行）总行金融市场部固定收益与衍生品交易员，负责本外币理财产品的资产管理工作；中国工商银行总行

				<p>金融市场部人民币债券交易员，负责银行账户的自营债券投资工作。2007 年 4 月至 2010 年 1 月任深圳发展银行（现已更名为平安银行）总行金融市场部固定收益与衍生品交易员；2010 年 1 月至 2012 年 9 月任中国工商银行总行金融市场部人民币债券交易员；2012 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2012 年 11 月起任华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金经理，2013 年 9 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，2013 年 11 月起任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金的基金经理，2014 年 12 月起任华泰柏瑞丰汇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。2016 年 1 月起任固定收益部总监。</p>
--	--	--	--	---

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。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价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%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来，经济逐步进入去杠杆周期，政府对经济刺激的态度转向调结构。货币政策放松放松节奏相对缓慢。从倚重传统工具转向倚重定向工具。另一方面，人民币从去年以来对一篮子货币出现贬值，但对出口的刺激并不明显。三季度，央行对汇市的干预也并不强烈。

从长期来看，名义经济增长决定资产回报，资产回报引导负债成本。经济仍面临较大下行压力，并且投资机构有较强的配置意愿，收益率曲线整体在震荡中下行。债市投资谨慎中寻找机会。央行放松的制约在于人民币贬值压力和担心市场杠杆上升。在 CPI 回落背景下，如果实际利率升高，而货币增速又开始放缓，那么央行就有必要通过放松利率来引导货币条件放松。

策略上，债券以中短久期品种为基础，并进行了一定长久期品种的交易操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类和 C 类份额净值分别为 1.081 元和 1.071 元，分别上涨 1.50% 和 1.42%，同期本基金的业绩比较基准上涨 0.50%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注：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	628,135,980.80	95.11
	其中：债券	628,135,980.80	95.11
	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	18,871,803.02	2.86
8	其他资产	13,418,201.92	2.03
9	合计	660,425,985.74	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沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

5.3 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	105,131,000.00	20.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,195,000.00	9.94
	其中：政策性金融债	50,195,000.00	9.94
4	企业债券	281,303,780.80	55.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	191,506,200.00	37.92
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	628,135,980.80	124.37

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	160017	16 付息国债 17	600,000	60,078,000.00	11.90
2	160210	16 国开 10	500,000	50,195,000.00	9.94
3	1180050	11 吉城建债	400,000	42,368,000.00	8.39
4	1180104	11 杭高新债	400,000	41,988,000.00	8.31
5	136133	16 国电 01	400,000	40,068,000.00	7.93

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。

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

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中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,521.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,407,251.10
5	应收申购款	2,429.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,418,201.92

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：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞丰盛纯债债券 A	华泰柏瑞丰盛纯债债券 C
报告期期初基金份额总额	883,111,613.94	6,543,218.03
报告期期间基金总申购份额	207,737.29	618,593.66
减：报告期期间基金总赎回份额	419,869,777.27	3,433,402.39
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	463,449,573.96	3,728,409.30

§ 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 备查文件目录

8.1 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

8.2 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

8.3 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

2016 年 10 月 25 日