华泰柏瑞锐势债券发起式证券投资基金2019年第1季度报告

2019-03-31

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 4 月 19 日

§1 重要提示
§2 基金产品概况
§3 主要财务指标和基金净值表现
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 半年度财务报告（未经审计）
§7 投资组合报告
§8 基金份额持有人户数和持有人结构
§9 开放式基金份额变动
§10 重大事件揭示
§11 影响投资者决策的其他重要信息
§12 备查文件目录

重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告书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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月19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，也不保证投资者单次申购基金本金不受损失。

投资有风险，投资者在投资前应认真阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务报告未经审计。

本报告期2019年1月1日至2019年3月31日。

§2 基金产品概况

项目	内容
基金简称	华泰柏瑞锐势债券发起式
基金主代码	008905
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018-07-18
报告期末基金份额总额	225,106,761.91 份
投资目标	本基金通过投资于合理控制的利率风险、本金损失和一定的流动性风险的债券资产，在追求当期收益的同时，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、大类资产配置策略本基金将综合考虑宏观经济运行状况、国家财政政策和货币政策、证券市场资金供求状况、证券市场各种投资品种的预期收益率水平及风险水平等因素，在保持适当流动性的基础上，合理安排基金资产在债券资产和现金资产之间的配置比例，适时调整基金资产在债券资产内部不同类别资产之间的配置比例，在控制投资组合风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。2、债券投资策略本基金将在综合分析宏观经济运行状况变化、债券市场资金供求状况、债券收益率曲线形态变化、债券市场流动性变化等因素的基础上，主动调整组合的平均剩余期限，并结合对债券收益率曲线变动趋势的预测，采取骑乘策略、息差策略、久期策略、凸性策略、信用债策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略等积极投资策略进行债券投资管理。3、资产支持证券投资策略本基金将综合考虑资产支持证券的流动性风险、提前还款风险、信用风险、利率风险、税收特征等因素，并结合对宏观经济运行状况、资产支持证券发行市场和二级市场供求关系的分析，对资产支持证券进行投资。4、国债期货投资策略本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，适度参与国债期货的投资，以提高投资效率，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金与低于股票型基金、混合型基金。本基金为中债综合财富指数的跟踪标的，主要投资于中国境内债券市场。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-01-01 至 2019-03-31）
本期已实现收益	23,365,151.39
本期利润	132,451,146.16
加权平均基金份额本期利润	0.5899
期末基金资产净值	322,921,391.30
期末基金份额净值	1.4345

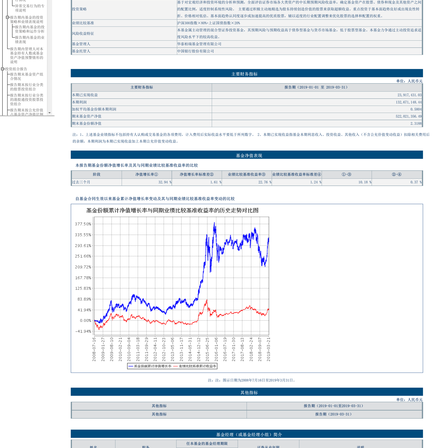
注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。2、本期已实现收益指本基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

§4 管理人报告

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

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	32.39 %	1.40 %	22.39 %	1.59 %	10.10 %	-0.19 %

自基金合同生效日至基金定期开放债券本变动主关与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：自《华泰柏瑞锐势债券型证券投资基金基金合同》生效日起至本报告期末，本基金已经按照合同规定在建仓期内完成了投资组合的构建，截至报告期末本基金各项投资比例符合合同规定。

§5 托管人报告

本报告期内基金托管人遵规守信情况声明

报告期内本基金托管人中国银行股份有限公司在对本基金的投资运作、资产净值计算、利润分配、信息披露、申购赎回价格计算等问题的监督和复核中，未发现本基金管理人存在违反《证券投资基金管理人运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《华泰柏瑞锐势债券型证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞锐势债券型证券投资基金招募说明书》等有关法律法规、基金合同和招募说明书规定的情况。

托管人对本报告期内财务信息真实、准确、完整的说明

报告期内，本基金托管人中国银行股份有限公司根据有关法律法规、基金合同和招募说明书的规定，对本基金管理人编制的本报告期内的财务信息进行了复核，认为：本报告期内，本基金管理人对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金利润的确认和分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的情况。

§6 半年度财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞锐势债券发起式证券投资基金

报告截止日：2019年3月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2019年3月31日	上年度末 2018年12月31日
资产：		
银行存款	4,000,000.00	4,000,000.00
结算备付金	1,000,000.00	1,000,000.00
存出保证金	1,000,000.00	1,000,000.00
交易性金融资产	322,921,391.30	322,921,391.30
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	322,921,391.30	322,921,391.30
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	5,000,000.00	5,000,000.00
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	334,921,391.30	334,921,391.30

负债和所有者权益	本期末 2019年3月31日	上年度末 2018年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	12,000,000.00	12,000,000.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	120,000.00	120,000.00
应付托管费	40,000.00	40,000.00
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,000.00	1,000.00
应交税费	-	-
应付利息	39,000.00	39,000.00
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	-	-
负债合计	12,200,000.00	12,200,000.00
所有者权益：		
实收基金	225,106,761.91	225,106,761.91
未分配利润	97,614,629.39	97,614,629.39
所有者权益合计	322,721,391.30	322,721,391.30
负债和所有者权益总计	334,921,391.30	334,921,391.30

注：报告截止日2019年3月31日，基金份额净值1.4345元，基金份额总额225,106,761.91份，共计所有者权益总额322,721,391.30元。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞锐势债券发起式证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年3月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年3月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年3月31日
一、收入	3,365,151.39	-
1.利息收入	3,365,151.39	-
其中：存款利息收入	3,365,151.39	-
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	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	23,197,402.62	-
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	23,197,402.62	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”填列）	105,888,592.15	-
4.汇兑收益（损失以“-”填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”填列）	-	-
减：二、费用	1,914,005.23	-
1.管理人报酬	360,000.00	-
2.托管费	120,000.00	-
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,000.00	-
5.利息支出	117,000.00	-
其中：卖出回购金融资产支出	117,000.00	-
6.税金及附加	-	-
7.其他费用	1,314,005.23	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	130,537,141.16	-
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	130,537,141.16	-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞锐势债券发起式证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年3月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年3月31日			
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	
一、期初所有者权益（基金净值）	225,106,761.91	97,614,629.39	322,721,391.30	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	130,537,141.16	130,537,141.16	
三、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）	-	-	-	
其中：1.基金申购款	-	-	-	
2.基金赎回款	-	-	-	
四、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）	-	-130,537,141.16	-130,537,141.16	
五、期末所有者权益（基金净值）	225,106,761.91	97,614,629.39	322,721,391.30	

§7 投资组合报告

7.1 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	-	-
2	固定收益投资	322,921,391.30	96.42
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,000,000.00	1.49
7	其他资产	7,000,000.00	2.09
8	合计	334,921,391.30	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	-	-
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	-	-

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	金融债券	-	-
2	企业债券	-	-
3	企业短期融资券	-	-
4	中期票据	-	-
5	可转债（可交换债）	-	-
6	同业存单	-	-
7	其他	-	-
8	合计	322,921,391.30	100.00

7.4 报告期末基金资产组合情况

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	180122	18飞马债	1,000,000	102,450,000.00	31.75
2	180512	18农发02	500,000	51,370,000.00	15.92
3	180202	18进出02	500,000	51,355,000.00	15.91
4	180205	18国开05	300,000	30,825,000.00	9.55
5	180210	18国开10	300,000	30,822,000.00	9.55
6	180402	18农发02	300,000	30,804,000.00	9.54

7.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

序号	债券信用等级	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	302,709.90	0.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	302,709.90	0.09

7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

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	1680157	16国投C1	2,900	302,709.90	0.09

7.7 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

序号	贵金属名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

注：本报告期末基金未投资贵金属。

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权证投资明细

序号	权证名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

注：本报告期末基金未投资权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）				-	
股指期货投资本期收益（元）				-	
股指期货投资本期公允价值变动（元）				-	

注：无。本基金本报告期末未持有股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）				-	
国债期货投资本期收益（元）				-	
国债期货投资本期公允价值变动（元）				-	

注：无。本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况

报告期内基金投资的前一年内没有受到公开谴责或受到监管部门处罚的情况，包括在相关编码行前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

7.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	100,907.10
2	应收证券清算款	13,150.50
3	应收股利	-
4	应收利息	10,377.50
5	应收申购款	161,388.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,481.10

7.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。本基金本报告期末未持有十名股票中存在流通受限情况。

§8 开放式基金份额变动

单位：份

项目	数量
报告期期初基金份额总额	225,106,761.91
报告期期间基金总申购份额	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	0.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	225,106,761.91

§9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

9.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	基金份额
报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

注：无。

9.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率

注：无。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

序号	事项	决议内容
1	基金份额持有人大会的召开情况	无
2	基金份额持有人大会决议内容	无
3	基金管理人在基金份额持有人大会前后公告基金资产净值、基金份额净值及基金份额总数的情况	无
4	基金托管人在基金份额持有人大会召开前后复核基金份额总数的情况	无
5	律师事务所对基金份额持有人大会出具法律意见书的情况	无

10.2 基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动

项目	拟任/离任基金名称	拟任/离任基金托管部门	拟任/离任基金名称	拟任/离任基金托管部门	拟任/离任基金名称	拟任/离任基金托管部门
基金管理人高管变动	-	-	-	-	-	-
基金管理人基金经理变动	-	-	-	-	-	-
基金托管人专门基金托管部门负责人变动	-	-	-	-	-	-
基金托管人基金经理变动	-	-	-	-	-	-

10.3 涉及基金财产诉讼

无。

10.4 基金投资策略改变

无。本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

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，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

交易单元所需证券公司名称	交易单元编号	交易单元数量	交易金额（元）	占当期股票成交总额的比例	佣金（元）	占当期佣金总量的比例	备注
中信证券	1	-	-	-	-	-	新增
中信证券	2	-	-	-	-	-	新增
中信证券	3	-	-	-	-	-	新增
中信证券