

重要提示

基金管理人及基金托管人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。
本报告自2019年1月1日起至2019年3月31日止。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes 基金名称 (华泰柏瑞季季红债券), 基金代码 (000186), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2013-11-13), 报告期末基金份额总额 (1,334,428,936.73), 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 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).

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 报告期 (2019-01-01至2019-03-31), 单位: 人民币元. Includes 本期已实现收益 (15,464,013.81), 本期利润 (14,309,433.11), 加权平均基金份额本期利润 (0.0105), 期末基金资产净值 (1,386,434,010.06), 期末基金份额净值 (1.0396).

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可能低于所列数字。
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。

基金净值表现

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

Table with columns: 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. Data for 过去三个月: 1.17%, 0.05%, 0.63%, 0.01%, 0.54%, 0.04%.

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



注: 1、图示日期为2013年11月13日至2019年3月31日。

其他指标

Table with columns: 其他指标, 报告期 (2019-01-01至2019-03-31), 单位: 人民币元. Includes 其他指标 (空).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Includes 罗远航 (基金经理), 任职日期: 2017-03-16, 离任日期: -, 从业年限: 8年. 说明: 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, 2017年3月至2018年4月任华泰柏瑞瑞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、华泰柏瑞利沃灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞利沃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月任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金的基金经理, 2017年3月至2019年3月任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金的基金经理, 2017年3月至2019年3月任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金的基金经理, 2017年3月至2019年3月任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金的基金经理, 2019年2月起任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金的基金经理。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金运作符合法律法规及基金合同的约定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为。

公平交易专项说明

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和流程, 从事前、事中和事后各环节严格控制不同基金之间的利益输送, 首先投资部和研究部通过规范的决策流程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, 确保公平交易的实现, 同时, 风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和风险分析。
本报告期内, 上述公平交易制度总体执行情况良好。

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%。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年一季度, 美国联储加息, 货币政策表现出一定的宽松倾向, 国内方面, 人民银行在3月再次降低了存款准备金率1个百分点, 在置换一季度到期的中期票据(MRF)的同时也释放了流动性, 历来来看, 一季度信贷投放的力度都较强, 今年一季度也是如此, 在贷款大力投放的推动下, 社融增长出现了企稳的迹象。另一方面, 2019年地方政府债的发行提前到一季度, 也为社会融资提供了支撑。一季度宽松的货币信贷环境, 使得国内经济保持温和复苏态势有所修正。
在货币市场流动性充裕的态势下, 短端利率明显下行, 而长端利率在年初先有所下行; 但随后由于经济复苏预期的修正和信贷结构偏紧, 风险偏好恢复, 大幅上翘。长端利率又震荡上行, 收益率曲线趋平坦化, 期限利差扩大, 同时信用利差压缩, 一季度信用债的表现明显好于利率债。
报告期内, 本基金主要投资于高等级的信用债和利率债, 维持了中性的久期配置水平。
展望2019年二季度, 国内经济将长期在信贷和社融的推动下继续好转; 由于联储加息的影响, 通胀上翘对CPI造成了一定压力, CPI通胀的上行限制了国内货币政策进一步宽松的空间, 另一方面, 基金面的反转推升了风险偏好, 资金流入股票市, 债券市场对资金的吸引力有所降低, 债券市场短期内难以出现超预期的行情, 但是随着收益率上行到相对高位, 债券的配置价值也将得到提升。
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, 优化组合配置, 规避信用风险, 以获取较好的收益。

报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末, 本基金份额净值为1.0396元, 上涨1.17%, 同期基金的业绩比较基准上涨0.63%。

报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

无。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额 (元), 占基金总资产的比例 (%). Includes 权益类投资 (0.00%), 其中: 股票 (0.00%), 固定收益投资 (1,574,112,000.00, 98.49%), 其中: 债券 (1,574,112,000.00, 98.49%), 资产支持证券 (0.00%), 贵金属投资 (0.00%), 金融衍生品投资 (0.00%), 买入返售金融资产 (0.00%), 其中: 买断式回购的买入返售金融资产 (0.00%), 银行存款和结算备付金合计 (1,071,201.97, 0.07%), 其他资产 (23,027,983.04, 1.44%), 合计 (1,588,211,185.01, 100.00%).

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Lists various industry categories such as 农、林、牧、渔业, 采矿业, 制造业, 电力、热力、燃气及水生产和供应业, 建筑业, 批发和零售业, 交通运输、仓储和邮政业, 住宿和餐饮业, 信息传输、软件和信息技术服务业, 金融业, 房地产业, 租赁和商务服务业, 科学研究和技术服务业, 水利、环境和公共设施管理业, 居民服务、修理和其他服务业, 教育, 卫生和社会工作, 文化、体育和娱乐业, 综合, 合计.

注: 本基金本报告期末未持有股票。

Table with columns: 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Lists various industry categories such as A 基础材料, B 消费者非必需品, C 消费者必需品, D 能源, E 金融, F 医疗保健, G 工业, H 信息技术, I 电信服务, J 公用事业, K 房地产.

注: 本基金本报告期末未持有股权投资股票。

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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量 (股), 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). All values are 0.

注: 本基金本报告期末未持有股票。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 国家债券 (79,988,000.00, 5.77%), 央行票据 (0.00, 0.00%), 金融债券 (447,159,000.00, 32.25%), 其中: 政策性金融债 (447,159,000.00, 32.25%), 企业债券 (49,640,000.00, 3.58%), 企业短期融资券 (401,769,000.00, 28.98%), 中期票据 (595,576,000.00, 42.96%), 可转债 (可交换债) (0.00, 0.00%), 同业存单 (0.00, 0.00%), 其他 (0.00, 0.00%), 合计 (1,574,112,000.00, 113.54%).

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

Table with columns: 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 (%). Includes 150204 (15国开04, 800,000, 81,424,000.00, 5.87%), 190001 (19附息国债01, 800,000, 79,988,000.00, 5.77%), 180406 (18农收06, 700,000, 74,165,000.00, 5.33%), 190401 (19农收01, 700,000, 69,587,000.00, 5.62%), 170206 (17国开06, 600,000, 61,374,000.00, 4.43%).

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。

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

Table with columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量 (份), 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). All values are 0.

注: 本基金本报告期末未持有贵金属。

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。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约市值 (元), 公允价值变动 (元), 风险说明. All values are 0.

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) -

本基金股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 适度运用国债期货, 以控制债券投资的系统性风险, 提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时, 本基金将首先分析国债期货合约价格与国债可交割券的关系, 选择定价合理的国债期货合约, 其次, 考虑国债期货各合约的流动性情况, 最终确定与现货组合的合适匹配, 以达到风险管理的目的。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 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. All values are 0.

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: 本基金本报告期末未持有国债期货。

本期国债期货投资评价

注: 无。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

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。

申明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

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。

其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额 (元), 单位: 人民币元. Includes 1 存出保证金 (9,268.82), 2 应收证券清算款 (0.00), 3 应收股利 (0.00), 4 应收利息 (19,591,428.52), 5 应收申购款 (3,427,285.70), 6 其他应收款 (0.00), 7 其他 (0.00), 8 其他 (0.00), 9 合计 (23,027,983.04).

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。

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。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 数量. Includes 报告期末基金份额总额 (933,135,258.47), 报告期期间基金总申购份额 (903,449,740.26), 报告期期间基金总赎回份额 (502,193,062.00), 报告期期间基金净申购份额 (份额减少以“-”填列) (1,334,428,936.73), 报告期末基金份额总额 (1,334,428,936.73).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 项目, 基金份额, 单位: 份. Includes 报告期末基金管理人持有的本基金份额, 报告期期间买入/申购总份额, 报告期期间卖出/赎回总份额, 报告期末基金管理人持有的本基金份额, 报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%).

注: 无。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易份额 (份), 交易金额 (元), 适用费率. Includes 合计.

注: 无。

报告期末发起式基金及发起资金持有份额情况

Table with columns: 项目, 持有份额总数, 持有份额占基金总份额比例, 发起份额总数, 发起份额占基金总份额比例, 发起份额承诺持有期限. Includes 基金管理人自有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人, 基金管理人, 基金管理人, 合计.

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

Table with columns: 投资者类别, 报告期内持有基金份额变化情况 (持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间, 期初份额, 申购份额, 赎回份额), 报告期末持有基金份额 (持有份额, 份额占比). Includes 机构, 个人.

注: 本基金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。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- 1. 本基金的中国证监会注册募集文件
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

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

查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅, 也可工本费购买复印件。
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