华泰柏瑞稳健低息债券型证券投资基金2019年第1季度报告

2019-04-19

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：2019-04-20

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事及其监事人保证投资组合报告中所载资料的真实性、准确性和完整性。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2019-04-15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，但不保证投资一定盈利，基金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。

本报告中财务数据和指标均以人民币列示，数值单位为人民币元，小数点后保留两位小数，特别指出的除外。

本报告期2019年1月1日至2019年3月31日。

§2 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞稳健低息债券
交易代码	000300
基金主代码	000300
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012-12-04
报告期末基金份额总额	1,102,980,325.18份
投资目标	在严格控制信用风险前提下，以获取高于产品风险收益特性、具有长期稳定性的绝对收益为目标。
投资策略	本基金将采用自上而下的宏观经济分析、利率走势分析、信用风险分析、流动性风险分析等方法，在综合考虑宏观经济、利率水平、信用风险、流动性风险、税收因素等因素的基础上，合理安排组合久期、信用风险、流动性风险的配置，在控制风险的前提下，力争实现组合资产的稳定增值。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率+1.75%
风险收益特征	本基金属于债券型基金品种，其风险收益水平一般低于股票型基金、混合型基金和偏债型混合型基金。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属A类基金的基金简称	华泰柏瑞稳健低息债券A
下属A类基金的交易代码	000300
下属B类基金的基金简称	华泰柏瑞稳健低息债券B
下属B类基金的交易代码	000301
下属A类基金份额总额	1,102,202,435.18份
下属B类基金份额总额	777.99份

§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 - 2019-03-31)	华泰柏瑞稳健低息债券A	华泰柏瑞稳健低息债券B
本期已实现收益	31,391,731.93	1,391,731.93	6,395,984.21
本期利润	31,996,384.90	1,396,384.90	6,395,984.21
加权平均基金份额本期利润	0.0290	0.0012	0.0822
期末基金资产净值	1,271,109,302.32	1,107,985,305.25	107,985,305.25
期末基金份额净值	1.0332	1.0052	1.0368

注：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，上述费用计提标准请参考相关法律文件和合同。

2、本报告期内，华泰柏瑞稳健低息债券A份额净值增长率为0.52%，同期业绩比较基准收益率为0.42%，华泰柏瑞稳健低息债券B份额净值增长率为0.52%，同期业绩比较基准收益率为0.42%。

§4 管理人报告

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈文英	固定收益部，本基金的基金经理	2015-10-14		13年	陈文英女士，博士，2006.3-2009.12任巨田证券基金管理有限公司固定收益部研究员；2010.01-2010.04任华泰柏瑞基金管理有限公司，定投定息基金经理；2010.05-至今任华泰柏瑞基金管理有限公司，固定收益部基金经理。2013年10月起担任华泰柏瑞稳健低息债券基金经理；2014年1月起担任华泰柏瑞稳健增利债券基金经理；2015年3月1日起担任华泰柏瑞稳健低息债券基金经理。本基金于2015年3月1日起生效。本基金于2015年3月1日起生效。
姚秀	固定收益部总监，本基金的基金经理	2017-11-22		13年	姚秀女士，CFA证券从业资格，博士后研究员，曾任国泰君安证券股份有限公司固定收益部研究员，国泰君安证券股份有限公司固定收益部投资经理，中国工商银行总行金融市场部人民币投资主管，负责银行间人民币投资业务管理和交易。2013年2月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013年2月至今担任华泰柏瑞基金管理有限公司固定收益部基金经理。2014年1月起担任华泰柏瑞增利债券基金经理；2015年3月1日起担任华泰柏瑞稳健低息债券基金经理；2016年1月1日起担任华泰柏瑞稳健增利债券基金经理；2016年1月1日起担任华泰柏瑞稳健增利债券基金经理；2017年11月22日起担任华泰柏瑞稳健低息债券基金经理。本基金于2015年3月1日起生效。

管理人对报告期内本基金运作遵守有关法律法规的说明

报告期内本基金运作合规守法情况：本报告期内，本基金运作合规守法。

§5 投资组合报告

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资情况		
	其中：股票		
2	固定收益投资	2,991,193,800.00	97.43
	其中：债券	2,991,193,800.00	97.43
	其中：资产支持证券		
3	贵金属投资		
4	金融衍生品投资		
5	买入返售金融资产		
	其中：买断式逆回购		
6	银行存款和结算备付金合计	5,174,431.50	0.169
7	其他资产	58,198,142.40	1.895
8	合计	3,054,566,373.90	100.000

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		

报告期末指数投资按照行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
注：报告期末指数投资按照各行业分类的投资明细。			

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

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（%）
注：报告期末持有的股票明细。					

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有债券投资明细

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国债期货		
2	金融债券	277,402,208.32	25.16
	其中：政策性金融债	277,402,208.32	25.16
3	企业债券	1,455,788,591.68	132.04
4	企业短期融资券	913,103,309.42	82.82
5	中期票据	344,899,690.58	31.28
6	可转债（可交换债）		
7	同业存单		
8	其他		
	合计	2,991,193,800.00	271.30

报告期末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	190202	19国开02	2,900,000	291,406,000.00	26.43
2	190205	19国开05	900,000	90,135,000.00	8.18
3	1580277	15中电投MTN001	800,000	81,208,000.00	7.36
4	101900601	19央企资产管理计划01	800,000	81,128,000.00	7.36
5	2015T206	20海通信托01	600,000	61,128,000.00	5.54

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
注：报告期末持有的资产支持证券明细。					

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贵金属投资明细

序号	名称	数量（盎司）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
注：报告期末持有的贵金属明细。				

报告期末按照风险指标从低到高排列的前五个权证投资明细

代码	名称	持仓量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
注：报告期末持有的权证明细。				

报告期末按照风险指标从低到高排列的前五个股指期货投资明细

代码	名称	持仓量（买方）	持仓量（卖方）	公允价值（元）	风险价值
注：报告期末持有的股指期货明细。					

本基金投资股指期货的投资政策

本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期未参与国债期货投资。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

代码	名称	持仓量（买方）	持仓量（卖方）	公允价值(元)	风险价值
注：报告期末持有的国债期货明细。					

本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期未参与国债期货投资。

报告期末本基金投资的股票数量发生重大变动情况

注：本基金本报告期内股票投资没有发生重大变动情况。

报告期末本基金投资的股票投资组合的行业分类发生重大变动情况

注：本基金本报告期内股票投资没有发生重大变动情况。

报告期末本基金投资的前十名证券发生重大变动情况

序号	重大买入	买入金额（元）	占期初基金资产净值比例（%）	重大卖出	卖出金额（元）	占期初基金资产净值比例（%）
注：报告期内没有发生重大买入证券。						

报告期内利息收入占基金资产净值比例大小排序的所有证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	投资类型	利息收入（元）	占基金资产净值比例（%）
注：报告期内没有发生利息收入证券。					

报告期内股票投资组合的换手率

报告期内股票投资组合的换手率	
报告期内股票投资组合的换手率	0.00%

报告期内基金投资和赎回其他基金的情况

序号	基金代码	基金名称	投资类型	投资份额（份）	占期末基金资产净值比例（%）
注：报告期内没有投资其他基金。					

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股指期货的持仓情况	
报告期末基金投资股指期货的交易保证金情况	
报告期末基金投资股指期货的公允价值变动情况	
股指期货投资的会计政策	

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期末本基金投资国债期货的持仓情况	
报告期末基金投资国债期货的交易保证金情况	
报告期末基金投资国债期货的公允价值变动情况	
国债期货投资的会计政策	

投资组合报告附注

序号	内容
5.11.1	报告期内投资的前五名证券中，未发生投资于发行主体被监管部门立案调查的证券。报告期内，未发生投资于发行主体因涉嫌犯罪被司法机关采取强制措施的证券。报告期内，未发生投资于发行主体因涉嫌违法违规被证监会采取立案调查的证券。报告期内，未发生投资于发行主体因涉嫌违法违纪被纪检部门采取立案调查的证券。报告期内，未发生投资于发行主体因涉嫌违法违纪被其他有关部门采取立案调查的证券。报告期内，未发生投资于发行主体因有违公开承诺而被采取强制措施的证券。报告期内，未发生投资于发行主体因有违公开承诺而被证券交易所纪律委员会公开谴责、认定为不诚信记录的证券。报告期内，未发生投资于发行主体因涉嫌洗钱犯罪被司法机关采取强制措施的证券。2018年2月2日收到国家税务总局深圳市税务局稽查局《税务处理决定书》，因其子公司深圳市前海华侨城投资发展有限公司（以下简称“前海投资”）2015年度未按照规定缴纳增值税等税款，对前海投资作出补缴税款、滞纳金及罚款合计人民币1,000,000.00元的决定。2018年2月2日收到国家税务总局深圳市税务局稽查局《税务处理决定书》，因其子公司深圳市前海华侨城投资发展有限公司（以下简称“前海投资”）2016年度未按照规定缴纳增值税等税款，对前海投资作出补缴税款、滞纳金及罚款合计人民币1,000,000.00元的决定。2018年2月2日收到国家税务总局深圳市税务局稽查局《税务处理决定书》，因其子公司深圳市前海华侨城投资发展有限公司（以下简称“前海投资”）2017年度未按照规定缴纳增值税等税款，对前海投资作出补缴税款、滞纳金及罚款合计人民币1,000,000.00元的决定。2018年2月2日收到国家税务总局深圳市税务局稽查局《税务处理决定书》，因其子公司深圳市前海华侨城投资发展有限公司（以下简称“前海投资”）2018年1月1日至2018年1月31日期间未按照规定缴纳增值税等税款，对前海投资作出补缴税款、滞纳金及罚款合计人民币1,000,000.00元的决定。
5.11.2	报告期末本基金投资的前十名股票中，没有投资于主板以外的非流通股。
5.11.3	报告期末本基金投资的前五名证券中，没有投资于流通受限证券。

§6 开放式基金份额变动

报告期期初基金份额总额	1,102,202,435.18
报告期基金总申购份额	777.99
报告期基金总赎回份额	0.00
报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	1,102,980,325.18

§7 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					

§8 报告期末发行机构公允价值变动情况

发行机构名称	公允价值变动(元)
注：本基金本报告期末未持有发行机构的债券。	

§9 报告期末基金可供投资的股票投资比例情况

报告期末基金可供投资的股票投资比例情况	
报告期末基金可供投资的股票投资比例	0.00%

§10 投资组合报告附注

序号	内容
10.1	报告期内投资的前十名证券中，除浦发银行（600000.SH）、中国石油化工股份有限公司（600028.SH）、中国石油天然气股份有限公司（601857.SH）、中国中铁股份有限公司（601390.SH）、中国铁建股份有限公司（601186.SH）、中国中车股份有限公司（601766.SH）、中国交通建设股份有限公司（601800.SH）、中国建筑股份有限公司（601668.SH）、中国电力建设股份有限公司（601669.SH）、中国核电工程有限公司（601611.SH）、中国化学工程股份有限公司（601117.SH）、中国重汽（香港）有限公司（3808.HK