

信息披露 Disclosure

华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金

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
报告送出日期:2018年10月26日

1 重要提示

基金管理人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法律责任。

2 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞稳健收益债券
基金代码	490008
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2012年12月14日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

3 主要财务指标

本期已实现收益	1,008,931.11	1,060,279.69
加权平均基金份额本期利润	0.0041	0.0090
期末基金份额净值	1.501,403.70	209,293.03
期末基金份额净值增长率	1.30%	13.32%

4 基金管理人报告

报告期内,本基金管理人勤勉尽责,严格执行各项法律法规及基金合同约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5 基金经理

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
曹旻	基金经理	2015年9月16日	至今	12年	曹旻先生,2015年9月16日起担任华泰柏瑞稳健收益债券基金经理。曹旻先生拥有12年证券从业经验,2005年12月起担任公募基金经理,曾任华泰证券研究所所长、华泰证券研究所所长助理、华泰证券研究所副所长、华泰证券研究所研究员等职务。

6 基金业绩

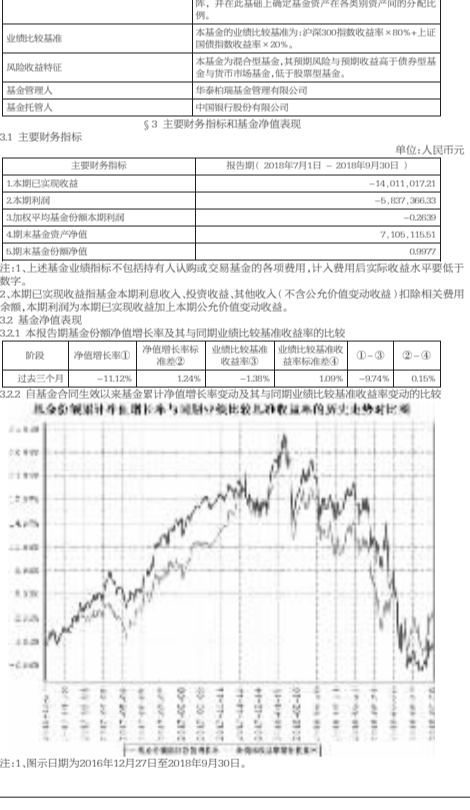
期间	净值增长率	业绩比较基准	超额收益率	①-③	②-③	
过去三个月	1.30%	0.11%	0.64%	0.07%	0.69%	0.10%

7 基金管理人承诺

基金管理人承诺,在基金运作过程中,严格遵守法律法规及基金合同约定,恪尽职守,勤勉尽责,诚实信用,维护基金份额持有人的合法权益。

8 基金托管人报告

中国银行股份有限公司作为华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金的托管人,在报告期内严格执行了基金合同的约定,履行了托管人应尽的职责。

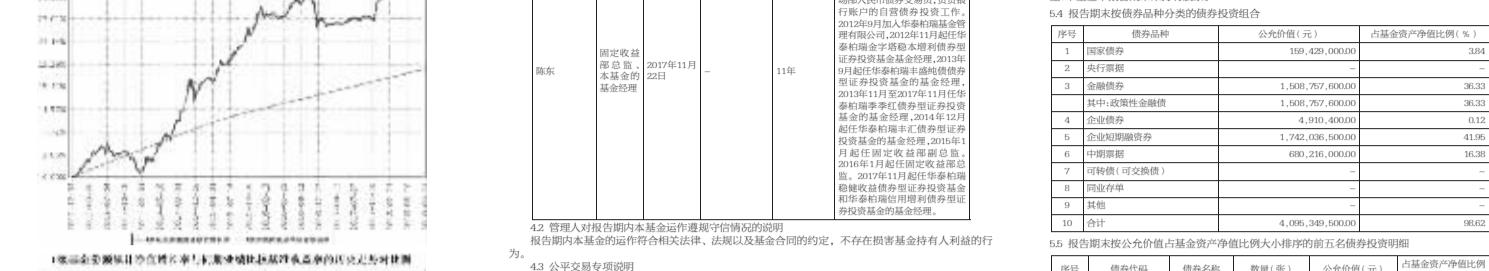


华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

4.2 报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内,本基金管理人严格按照《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、事后各环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资管理研究部门投研流程各环节严格把控,其次交易环节严格执行公平交易制度,确保公平交易实施,同时,风险管理部定期对投资组合的公平交易进行监控,并出具公平交易报告。



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	-	-
2	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	4,096,249,500.00	98.00
4	其中:债券	4,096,249,500.00	98.00
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	2,660,000.00	0.06
7	银行存款和拆出资金	13,088,796.23	0.31
8	其他资产	48,363,493.10	1.16
9	合计	4,157,688,789.33	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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(%)
1	100304	招商银行	5,500,000	606,006,000.00	13.63
2	100303	浦发银行	3,400,000	343,002,000.00	8.27
3	100310	兴业银行	3,000,000	315,006,000.00	7.61
4	100406	招商银行	2,200,000	235,008,000.00	5.41
5	0118034	招商可转债	1,000,000	100,140,000.00	2.62

5.3 报告期末按行业分类的债券投资组合

序号	品种名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	地方政府债	-	-
3	央行票据	-	-
4	中期票据	-	-
5	短期融资券	-	-
6	其他债券	-	-
7	其他	-	-
8	合计	4,096,249,500.00	98.02

5.4 管理人报告

报告期内,本基金管理人严格遵守法律法规及基金合同约定,恪尽职守,勤勉尽责,诚实信用,维护基金份额持有人的合法权益。

5.5 投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格按照《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、事后各环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

4.1 基金经理 (或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
曹旻	基金经理	2015年9月16日	至今	12年	曹旻先生,2015年9月16日起担任华泰柏瑞稳健收益债券基金经理。曹旻先生拥有12年证券从业经验,2005年12月起担任公募基金经理,曾任华泰证券研究所所长、华泰证券研究所所长助理、华泰证券研究所副所长、华泰证券研究所研究员等职务。

华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金

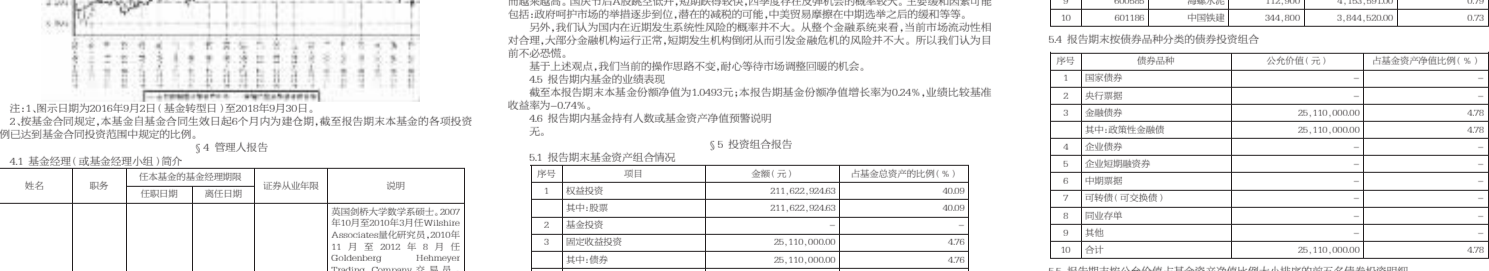
基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26日

华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

4.2 报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内,本基金管理人严格按照《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、事后各环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。



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	4,390,432.14	68.00
2	其中:股票	4,390,432.14	68.00
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和拆出资金	3,083,453.38	49.71
8	其他资产	97,311.26	1.52
9	合计	7,601,196.80	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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(%)
1	601318	中国平安	219,500	18,706,700.00	2.89
2	000006	万科A	1,201,200	7,916,748.00	1.26
3	000038	招商局	563,800	5,076,060.00	0.97
4	002128	海信家电	1,289,200	5,014,088.00	0.89
5	000045	深天马A	130,700	4,662,148.00	0.82
6	000166	申通快递	697,800	4,531,244.00	0.89
7	000104	上汽集团	128,300	4,062,944.00	0.68
8	600741	华联控股	194,400	4,274,200.00	0.83
9	600868	海信电器	112,400	3,161,600.00	0.69
10	601198	招商局	344,800	3,844,320.00	0.72

5.3 报告期末按行业分类的债券投资组合

序号	品种名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	地方政府债	-	-
3	央行票据	-	-
4	中期票据	-	-
5	短期融资券	-	-
6	其他债券	-	-
7	其他	-	-
8	合计	26,110,000.00	4.78

5.4 管理人报告

报告期内,本基金管理人严格遵守法律法规及基金合同约定,恪尽职守,勤勉尽责,诚实信用,维护基金份额持有人的合法权益。

5.5 投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格按照《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、事后各环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

5.6 基金业绩

期间	净值增长率	业绩比较基准	超额收益率	①-③	②-③
过去三个月	0.27%	-0.14%	0.41%	0.02%	0.28%

5.7 基金管理人承诺

基金管理人承诺,在基金运作过程中,严格遵守法律法规及基金合同约定,恪尽职守,勤勉尽责,诚实信用,维护基金份额持有人的合法权益。

5.8 基金托管人报告

中国银行股份有限公司作为华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的托管人,在报告期内严格执行了基金合同的约定,履行了托管人应尽的职责。

5 开放式基金的变动情况

项目	华泰柏瑞稳健收益债券	华泰柏瑞精选回报
报告期期初基金份额总额	69,268,298.76	76,337,238.03
报告期内基金总申购份额	2,111,971,061.13	197,293,161.13
报告期内基金总赎回份额	38,177,175.64	17,547,009.69
报告期内基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	2,947,097,073.25	161,080,048.47

6 基金份额持有人持有基金份额变动情况

项目	期初持有	申购	赎回	期末持有	申购比例	赎回比例
机构投资者	7,620,120.40	0.00	0.00	7,620,120.40	0.00	0.00
个人	7,620,120.40	2,947,097,073.25	7,620,120.40	2,947,097,073.25	100.00	100.00

7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者名称	持有基金份额比例(2017年12月31日)	期初持有	申购	赎回	持有份额	持仓比例
机构 1	20170706-20180101	0.00	200,149,451.38	0.00	200,149,451.38	96.44
2	20170706-20180101	0.00	144,890,677.95	0.00	144,890,677.95	4.81
个人	-	-	-	-	-	-

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

9 备查文件目录

- 基金文件目录
- 本基金的中国证监会批准募集文件
- 本基金的《基金合同》
- 本基金的《招募说明书》
- 本基金的《托管协议》
- 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 基金的公告
- 存放地点

上海市浦东新区民生路1199号正业大厦11楼1号楼17层
投资者可在营业时间内免费查阅,也可在工作时间购买复印件。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(免长话费) 021-3878 4638 公司网址:www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2018年10月26日

5 开放式基金的变动情况

项目	华泰柏瑞精选回报	华泰柏瑞稳健收益
报告期期初基金份额总额	966,371,033.03	11,322,729.00
报告期内基金总申购份额	10,089,831.39	10,089,831.39
报告期内基金总赎回份额	966,371,033.03	11,322,729.00
报告期内基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	7,321,303.96	11,322,729.00

6 基金份额持有人持有基金份额变动情况

项目	期初持有	申购	赎回	期末持有	申购比例	赎回比例
机构投资者	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
个人	0.00	7,321,303.96	0.00	7,321,303.96	100.00	100.00

7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者名称	持有基金份额比例(2017年12月31日)	期初持有	申购	赎回	持有份额	持仓比例
机构 1	20170706-20180101	21,302,389.00	0.00	14,102,389.00	6,999,999.75	96.30
2	20170706-20180101	59,991,100.00	0.00	59,991,100.00	0.00	0.00
3	20170706-20180101	40,100,820.00	0.00	40,100,820.00	0.00	0.00
4	20170706-20180101	47,089,847.43	0.00	47,089,847.43	0.00	0.00
个人	-	-	-	-	-	-

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

9 备查文件目录

- 基金的文件目录
- 本基金的中国证监会批准募集文件
- 本基金的《基金合同》
- 本基金的《招募说明书》
- 本基金的《托管协议》
- 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 基金的公告
- 存放地点

上海市浦东新区民生路1199号正业大厦11楼1号楼17层
投资者可在营业时间内免费查阅,也可在工作时间购买复印件。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(免长话费) 021-3878 4638 公司网址:www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2018年10月26日

5 开放式基金的变动情况

项目	华泰柏瑞精选回报	华泰柏瑞稳健收益
报告期期初基金份额总额	966,683,439.94	129,361.13
报告期内基金总申购份额	13,919,258.11	13,919,258.11
报告期内基金总赎回份额	966,683,439.94	129,361.13
报告期内基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	980,722,788.06	139,000.00

华泰柏瑞基金管理有限公司
2018年10月26日