

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  
送出日期:2015年3月31日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之一以上独立董事签字同意,并向董事长签章。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,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及其摘要。

本年度报告所涉资料已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本年度报告摘要节录自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

本报告期自2014年1月1日起至2014年12月31日止。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金
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年11月13日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金总资产	53,640,935.73元

2.2 基金产品说明

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,力争实现净值年化收益率10%左右。
投资策略	本基金将根据对宏观经济形势、利率变化趋势、收益曲线形态变化和变化趋势的判断,综合运用久期调整、期限配置、息差匹配等投资策略,选择合适的时机和品种构建投资组合。
业绩比较基准	年平均收益率+预期收益率(10%)±1%
风险收益特征	本基金属于债券型基金中的中低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
住所	上海市	北京市
法定代表人	陈振	田奇
信息披露负责人	顾晓东	010-67595096
电子邮箱	ce4008880001@huatai-ph.com	tianqi@cboc.com
客户服务电话	400-888-0001	010-67595096
传真	021-38601799	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的法定披露媒体: http://www.huatai-ph.com

基金份额持有人查询网站: 上海市浦东新区民生路1199号证大五矿广场1号楼17层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

1.1 期间数据和指标	2014年	2013年11月13日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	10,842,854.98	2,291,003.24
本期利润	12,885,970.20	2,280,238.59
加权平均基金份额本期利润	0.1013	0.0960
期末基金份额净值增长率为	10.34%	6.60%

1.2 期末数据和指标

2014年末 2013年末

期末可供分配基金份额利润 0.0930 0.0960

期末基金资产净值 57,019,534.93 344,978,776.01

期末基金份额净值 1.063 1.006

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将低于所示数字。

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. 基金合同生效日为2013年11月13日, 2013年的主要财务指标根据当年的实际情况确定。

3.2 基金价值表现

3.2.1 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	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	2.00%	0.38%	0.99%	0.01%	1.01%	0.37%
过去六个月	4.48%	0.27%	2.02%	0.01%	2.46%	0.26%
过去一年	10.34%	0.20%	4.03%	0.01%	6.31%	0.19%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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. 首次定期报告显示:2013年11月13日至2014年12月31日, 2014年期间净值增长率为10.34%。

2. 按基金合同规定, 本基金合同生效日起六个月为建仓期, 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; 投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%, 其中对信用债券的投资比例不低于债券资产的90%; 现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的5%; 权证的投资比例不超过基金资产净值的3%。

3.2.3 基金合同生效以来基金份额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. 首次定期报告显示:2013年11月13日至2014年12月31日, 2014年期间净值增长率为10.34%。

2. 按基金合同规定, 本基金合同生效日起六个月为建仓期, 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; 投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%, 其中对信用债券的投资比例不低于债券资产的90%; 现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的5%; 权证的投资比例不超过基金资产净值的3%。

3.2.4 基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:基金合同生效日为2013年11月13日, 2013年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

1.1 期间数据和指标	2014年	2013年11月13日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	10,842,854.98	2,291,003.24
本期利润	12,885,970.20	2,280,238.59
加权平均基金份额本期利润	0.1013	0.0960
期末基金份额净值增长率为	10.34%	6.60%

3.4 管理人报告

5.1 报告期内基金运作揭示

报告期内, 中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金管理法》、基金合同以及其他有关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人的义务。

5.2 托管人报告

报告期内, 托管人严格按照国家有关法律法规、部门规章和规范性文件的要求, 履行了基金托管人的职责, 在基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金管理法》、基金合同以及其他有关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人的义务。

5.3 本报告期未有诉讼、仲裁事项。

5.4 本报告期未有影响经营业绩的重大事项。

5.5 本报告期未有涉及基金的重大关联交易。

5.6 本报告期未有内幕交易、不公平交易等损害基金份额持有人利益的其他行为。

5.7 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.8 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.9 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.10 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.11 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.12 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.13 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.14 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.15 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.16 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.17 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.18 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.19 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.20 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.21 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.22 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.23 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.24 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.25 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.26 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.27 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.28 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.29 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.30 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.31 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.32 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.33 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.34 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.35 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.36 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.37 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.38 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.39 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.40 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.41 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.42 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.43 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.44 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.45 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.46 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.47 本报告期未有涉及基金的关联交易。

5.48 本报告期未有涉及基金的关联交易。