

# 华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金 [2015]第三季度报告

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期：2015年10月27日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员均声明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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月26日核对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，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至2015年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合		
代码	行业类别	公允价值(元)
A	农、林、牧、渔业	-
B	采矿业	7,963,164.40
C	制造业	14,782,889.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,051,383.60
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	30,787,433.08
	占基金资产净值比例(%)	10.69

5.3 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(%)
1	600993	洛阳钼业	79,510	7,929,284.40	2.75
2	600023	通能电力	1,086,766	7,879,053.00	2.74
3	600675	东方电气	5,208,326.00	1.81	
4	000720	燕京啤酒	438,252	4,879,961.16	1.68
5	002521	齐峰新材	52,911	4,638,538.02	1.61
6	601985	中国银行	19,000	172,330.00	0.06
7	603889	口子窖	2,000	62,280.00	0.02
8	603979	金诚信	1,000	23,889.00	0.01
9	300473	德尔未来	600	23,586.00	0.01
10	601968	宝钢包装	1,000	12,210.00	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	85,466,200.00	29.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	95,827,560.00	32.57
4	企业债券	92,827,360.00	32.57
5	企业中期票据	65,000,098.60	22.67
6	企业短期融资券	32,222,000.00	10.49
7	中期票据	17,780,800.00	6.17
8	可转债	16,788,948.40	5.83
9	其他	309,094,187.90	107.31

5.5 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

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	156210	16国债150	800,000	83,223,000.00	29.69
2	150016	15国开债16	600,000	61,368,000.00	21.30
3	010311	15国开行1	200,000	20,162,000.00	7.00
4	101468007	MTH001(1年期)	160,000	17,780,800.00	6.17
5	113000	电气债	123,130	16,149,499.50	5.61

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本期报告期末未持有资产支持证券。

2. 报告期内合同约定的基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

(一) 投资组合报告期内各时间段，本基金净值增长率与债券回购利率的差额为-0.00%；股票投资收益的差额为-0.00%；债券投资收益的差额为-0.00%；现金类资产投资收益的差额为-0.00%；贵金属投资收益的差额为-0.00%；权证投资收益的差额为-0.00%；商品期货投资收益的差额为-0.00%；其他投资收益的差额为-0.00%。

注：本基金报告期未实现收益为-0.00%。

2.6 基金管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
陈东	固定收益部副总监，本基金的基金经理	2014年12月11日	8年	

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

报告期内未发现本基金存在不公平交易行为。本基金报告期内不存在通过大规模集中申购、巨额赎回、大额申购、大额赎回等影响市场价格的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的绩效考核结果及表现说明

3.2%、股息率从0.15%增长到0.21%，期间收益率从-0.01%增长到0.15%。

4.5 报告期内基金的组合投资情况

本基金在报告期内严格按照基金合同的约定进行投资操作，没有发生违反基金合同关于投资范围、投资比例的有关规定。

4.6 报告期内基金的估值政策

4.7 报告期内基金的利润分配情况

4.8 报告期内基金的费用计提、开支及损益情况

4.9 报告期内基金的税收情况

4.10 报告期内基金的其他重要信息

4.11 报告期内基金的招募说明书、定期报告及其摘要的披露情况

4.12 报告期内基金的临时公告

4.13 报告期内基金的季度报告

4.14 报告期内基金的半年度报告

4.15 报告期内基金的年度报告

4.16 报告期内基金的清算报告

4.17 报告期内基金份额持有人大会决议公告

4.18 报告期内基金的投诉情况

4.19 报告期内基金的诉讼情况

4.20 报告期内基金的仲裁情况

4.21 报告期内基金的执行仲裁裁决的情况

4.22 报告期内基金的说明

4.23 报告期内基金的其他重要信息

4.24 报告期内基金的其他重要信息

4.25 报告期内基金的其他重要信息

4.26 报告期内基金的其他重要信息

4.27 报告期内基金的其他重要信息

4.28 报告期内基金的其他重要信息

4.29 报告期内基金的其他重要信息

4.30 报告期内基金的其他重要信息

4.31 报告期内基金的其他重要信息

4.32 报告期内基金的其他重要信息

4.33 报告期内基金的其他重要信息

4.34 报告期内基金的其他重要信息

4.35 报告期内基金的其他重要信息

4.36 报告期内基金的其他重要信息

4.37 报告期内基金的其他重要信息

4.38 报告期内基金的其他重要信息

4.39 报告期内基金的其他重要信息

4.40 报告期内基金的其他重要信息

4.41 报告期内基金的其他重要信息

4.42 报告期内基金的其他重要信息

4.43 报告期内基金的其他重要信息

4.44 报告期内基金的其他重要信息

4.45 报告期内基金的其他重要信息

4.46 报告期内基金的其他重要信息

4.47 报告期内基金的其他重要信息

4.48 报告期内基金的其他重要信息

4.49 报告期内基金的其他重要信息

4.50 报告期内基金的其他重要信息

4.51 报告期内基金的其他重要信息

4.52 报告期内基金的其他重要信息

4.53 报告期内基金的其他重要信息

4.54 报告期内基金的其他重要信息

4.55 报告期内基金的其他重要信息

4.56 报告期内基金的其他重要信息

4.57 报告期内基金的其他重要信息

4.58 报告期内基金的其他重要信息