

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
送出日期：2017年3月29日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管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的法律责任。
本基金托管人经复核确认。以上披露的内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金公告经中国银监会有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月29日复核了报告中对财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

本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当阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告财务数据已经审计，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。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告，投资人欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 华泰柏瑞稳健收益债券基金

基金主代码 460000

基金的运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2012年12月4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

报告期基金份额总额 6,801,133,769.46份

基金合同存续期间 不定期

下属分级基金的基金简称：华泰柏瑞稳健收益债券A 华泰柏瑞稳健收益债券C

下属分级基金的代码：460000 460108

报告期下一级基金的份额总额 6,615,918,111.24份 189,215,683.21份

2.2 基金产品说明

在合理的谨慎的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，力争超越业绩比较基准。

投资策略 对于宏观经济走势、货币政策变化和利率走势、资金供求变化和市场主体资金偏好的分析，综合判断市场趋势，适时调整组合结构和投资品种的组合。

业绩比较基准 一年定期存款利率（税后）+1%

风险收益特征 本基金属债券型证券投资基金，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 中国银行股份有限公司

姓名 陈继海 王军民

信息披露负责人 联系电话 021-39901777 电子邮箱 cs@008800.com.cn@huatai-ph.com

客户服务电话 400-888-0001

传真 021-39901779

基金年度报告备置地点 基金管理人住所或办公场所

§ 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

3.1.1 利润数据和利润指标

项目 2016年 2016年 2014年末

华泰柏瑞稳健收益债券A 华泰柏瑞稳健收益债券C

本期已实现收益 62,600, 67,177 113,460, 17,624 6,768, 8,068, 28,850 49,006, 75,700

本期利润 -218,236, -6,174, 247,418, 125,662, 47,363, 9,913, 77,027 939,811 695,654

加权平均利润率 -0.610% -0.0041 0.1760 0.1757 0.1403 0.1103

本期份额净增减额 -0.0610 -0.0041 0.1760 0.1757 0.1403 0.1103

本期份额净增率 -0.70% -1.11% 11.68% 11.25% 13.23% 12.90%

3.1.2 利润数据和利润指标

项目 2016年末 2015年末 2014年末

华泰柏瑞稳健收益债券A 华泰柏瑞稳健收益债券C

本期利润 0.2389 0.2136 0.1810 0.1650 0.1068 0.0967

加权平均利润率 0.2389 0.2136 0.1810 0.1650 0.1068 0.0967

本期份额净增减额 -0.0610 -0.0041 0.1760 0.1757 0.1403 0.1103

本期份额净增率 -0.70% -1.11% 11.68% 11.25% 13.23% 12.90%

3.2.1 利润数据和利润指标

项目 2016年 2015年 2014年

华泰柏瑞稳健收益债券A 华泰柏瑞稳健收益债券C

本期利润 212,144, 67,177 65,700, 17,624 10,768, 8,068, 28,850 49,006, 75,700

加权平均利润率 0.21% 0.17% 1.13% 0.01% -2.37% 0.16%

本期份额净增减额 -0.0610 -0.0041 0.1760 0.1757 0.1403 0.1103

本期份额净增率 -0.70% -1.11% 11.68% 11.25% 13.23% 12.90%

3.2.2 利润数据和利润指标

项目 2016年末 2015年末 2014年末

华泰柏瑞稳健收益债券A 华泰柏瑞稳健收益债券C

本期利润 0.2389 0.2136 0.1810 0.1650 0.1068 0.0967

加权平均利润率 0.2389 0.2136 0.1810 0.1650 0.1068 0.0967

本期份额净增减额 -0.0610 -0.0041 0.1760 0.1757 0.1403 0.1103

本期份额净增率 -0.70% -1.11% 11.68% 11.25% 13.23% 12.90%

3.2.3 利润数据和利润指标

项目 2016年 2015年 2014年

华泰柏瑞稳健收益债券A 华泰柏瑞稳健收益债券C

本期利润 212,144, 67,177 65,700, 17,624 10,768, 8,068, 28,850 49,006, 75,700

加权平均利润率 0.21% 0.17% 1.13% 0.01% -2.35% 0.16%

本期份额净增减额 -0.0610 -0.0041 0.1760 0.1757 0.1403 0.1103

本期份额净增率 -0.70% -1.11% 11.68% 11.25% 13.23% 12.90%

3.2.4 利润数据和利润指标

项目 2016年 2015年 2014年

华泰柏瑞稳健收益债券A 华泰柏瑞稳健收益债券C

本期利润 212,144, 67,177 65,700, 17,624 10,768, 8,068, 28,850 49,006, 75,700

加权平均利润率 0.21% 0.17% 1.13% 0.01% -2.35% 0.16%

本期份额净增减额 -0.0610 -0.0041 0.1760 0.1757 0.1403 0.1103

本期份额净增率 -0.70% -1.11% 11.68% 11.25% 13.23% 12.90%

3.2.5 利润数据和利润指标

项目 2016年 2015年 2014年

华泰柏瑞稳健收益债券A 华泰柏瑞稳健收益债券C

本期利润 212,144, 67,177 65,700, 17,624 10,768, 8,068, 28,850 49,006, 75,700

加权平均利润率 0.21% 0.17% 1.13% 0.01% -2.35% 0.16%

本期份额净增减额 -0.0610 -0.0041 0.1760 0.1757 0.1403 0.1103

本期份额净增率 -0.70% -1.11% 11.68% 11.25% 13.23% 12.90%

3.2.6 利润数据和利润指标

项目 2016年 2015年 2014年

华泰柏瑞稳健收益债券A 华泰柏瑞稳健收益债券C

本期利润 212,144, 67,177 65,700, 17,624 10,768, 8,068, 28,850 49,006, 75,700

加权平均利润率 0.21% 0.17% 1.13% 0.01% -2.35% 0.16%

本期份额净增减额 -0.0610 -0.0041 0.1760 0.1757 0.1403 0.1103

本期份额净增率 -0.70% -1.11% 11.68% 11.25% 13.23% 12.90%

3.2.7 利润数据和利润指标

项目 2016年 2015年 2014年

华泰柏瑞稳健收益债券A 华泰柏瑞稳健收益债券C

本期利润 212,144, 67,177 65,700, 17,624 10,768, 8,068, 28,850 49,006, 75,700

加权平均利润率 0.21% 0.17% 1.13% 0.01% -2.35% 0.16%

本期份额净增减额 -0.0610 -0.0041 0.1760 0.1757 0.1403 0.1103

本期份额净增率 -0.70% -1.11% 11.68% 11.25% 13.23% 12.90%

3.2.8 利润数据和利润指标

项目 2016年 2015年 2014年

华泰柏瑞稳健收益债券A 华泰柏瑞稳健收益债券C

本期利润 212,144, 67,177 65,700, 17,624 10,768, 8,068, 28,850 49,006, 75,700

加权平均利润率 0.21% 0.17% 1.13% 0.01% -2.35% 0.16%

本期份额净增减额 -0.0610 -0.0041 0.1760 0.1757 0.1403 0.1103

本期份额净增率 -0.70% -1.11% 11.68% 11.25% 13.23% 12.90%

3.2.9 利润数据和利润指标

项目 2016年 2015年 2014年

华泰柏瑞稳健收益债券A 华泰柏瑞稳健收益债券C

本期利润 212,144, 67,177 65,700, 17,624 10,768, 8,068, 28,850 49,006, 75,700

加权平均利润率 0.21% 0.17% 1.13% 0.01% -2.35% 0.16%

本期份额净增减额 -0.0610 -0.0041 0.1760 0.1757 0.1403 0.1103

本期份额净增率 -0.70% -1.11% 11.68% 11.25% 13.23% 12.90%

3.2.10 利润数据和利润指标

项目 2016年 2015年 2014年

华泰柏瑞稳健收益债券A 华泰柏瑞稳健收益债券C

本期利润 212,144, 67,177 65,700, 17,624 10,768, 8,068, 28,850 49,006, 75,700