

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：2017年10月25日

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会及监事会对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责任。  
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2017年10月24日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。

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。

本报告中财务数据未经审计。

本基金报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞汇丰债券
交易代码	000421
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月11日
报告期末基金资产净值	46,763,722,000
基金份额持有人户数	在合理预期的范围内，追求基金资产的长期稳健增值
投资目标	本基金主要投资于固定收益类资产，同时在严格控制风险的前提下，通过资产配置，追求超越业绩基准的收益。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类资产，同时在严格控制风险的前提下，通过资产配置，追求超越业绩基准的收益。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期平均风险和预期收益率低于货币市场基金，高于债券型基金。
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
下属基金份额的基金简称	华泰柏瑞汇丰债券A
下属基金份额的交易代码	000421
报告期末下属基金份额的总额	46,763,722,000
报告期末下属基金份额的净值	1.025

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)			
1.本期应计利息	719,225.76			
2.本期利润	763,307.72			
3.加权平均基金份额本期利润	0.0154			
4.期末基金份额净值	1.018,617.36			
5.期末基金资产净值	1,102			

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要低于所列数字。

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。

3.2.基金净值表现

3.2.1.本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

华泰柏瑞汇丰债券A

阶段

净值增长 率

净利率

业绩比较基 准收益率

风险收益特征

过去三个月 1.21% 0.10% 0.08% 0.03% 0.10% 0.00%

华泰柏瑞汇丰债券C

阶段

净值增长 率

净利率

业绩比较基 准收益率

过去三个月 1.21% 0.10% 0.08% 0.03% 0.10% 0.00%

3.2.2.自基金合同生效以来基金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

本基金报告期内的财务数据经审计。

注2: 本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要低于所列数字。

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。

3.2.3.基金净值表现

3.2.1.本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

华泰柏瑞汇丰债券A

阶段

净值增长 率

净利率

业绩比较基 准收益率

过去三个月 1.07% 0.09% -0.16% 0.04% 0.10% 0.00%

华泰柏瑞汇丰债券C

阶段

净值增长 率

净利率

业绩比较基 准收益率

过去三个月 1.07% 0.09% -0.16% 0.04% 0.10% 0.00%

3.2.2.自基金合同生效以来基金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

本基金报告期内的财务数据经审计。

注3: 本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要低于所列数字。

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。

3.2.3.基金净值表现

3.2.1.本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

华泰柏瑞汇丰债券A

阶段

净值增长 率

净利率

业绩比较基 准收益率

过去三个月 1.07% 0.09% -0.16% 0.04% 0.10% 0.00%

华泰柏瑞汇丰债券C

阶段

净值增长 率

净利率

业绩比较基 准收益率

过去三个月 1.07% 0.09% -0.16% 0.04% 0.10% 0.00%

3.2.2.自基金合同生效以来基金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

本基金报告期内的财务数据经审计。

注4: 本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要低于所列数字。

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。

3.2.3.基金净值表现

3.2.1.本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

华泰柏瑞汇丰债券A

阶段

净值增长 率

净利率

业绩比较基 准收益率

过去三个月 1.07% 0.09% -0.16% 0.04% 0.10% 0.00%

华泰柏瑞汇丰债券C

阶段

净值增长 率

净利率

业绩比较基 准收益率

过去三个月 1.07% 0.09% -0.16% 0.04% 0.10% 0.00%

3.2.2.自基金合同生效以来基金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

本基金报告期内的财务数据经审计。

注5: 本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要低于所列数字。

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。

3.2.3.基金净值表现

3.2.1.本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

华泰柏瑞汇丰债券A

阶段

净值增长 率

净利率

业绩比较基 准收益率

过去三个月 1.07% 0.09% -0.16% 0.04% 0.10% 0.00%

华泰柏瑞汇丰债券C

阶段

净值增长 率

净利率

业绩比较基 准收益率

过去三个月 1.07% 0.09% -0.16% 0.04% 0.10% 0.00%

3.2.2.自基金合同生效以来基金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

本基金报告期内的财务数据经审计。

注6: 本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要低于所列数字。

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。

3.2.3.基金净值表现

3.2.1.本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

华泰柏瑞汇丰债券A

阶段

净值增长 率

净利率

业绩比较基 准收益率

过去三个月 1.07% 0.09% -0.16% 0.04% 0.10% 0.00%

华泰柏瑞汇丰债券C

阶段

净值增长 率

净利率

业绩比较基 准收益率

过去三个月 1.07% 0.09% -0.16% 0.04% 0.10% 0.00%

3.2.2.自基金合同生效以来基金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

本基金报告期内的财务数据经审计。

注7: 本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要低于所列数字。

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。

3.2.3.基金净值表现

3.2.1.本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

华泰柏瑞汇丰债券A

阶段

净值增长 率

净利率

业绩比较基 准收益率

过去三个月 1.07% 0.09% -0.16% 0.04% 0.10% 0.00%

华泰柏瑞汇丰债券C

阶段

净值增长 率

净利率