

华泰柏瑞盛纯债债券型证券投资基金

2017年度报告摘要

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
送出日期：2018年3月28日

\$1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金份额持有人及基金销售机构在本基金合同中的任何表述均不构成对投资收益的承诺。本基金合同中关于基金的任何表述均不构成对投资收益的承诺，不构成对基金未来收益的预测。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更新、基金产品资料概要、基金合同、基金定期报告和最新的基金净值公告。

1.2 基金管理人
华泰柏瑞基金管理有限公司与本公司根据本基金合同规定，于2018年3月27日复核了本报告期内公告的财务指标、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，本基金内容不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏。

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（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

本年度报告摘要幅度报告正文，投资人欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

§ 2 基金简介

2.1 基金的基本情况

基金名称 华泰柏瑞盛纯债债券基金

基金代码 000197

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年9月21日

基金管理人 华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

报告期末基金的份额总额 50,000,562.79份

基金简称 不定期

基金募集期间 2013年9月10日至2013年9月11日

基金存续期间 2013年9月12日至不定期

基金管理人对本基金的说明 在基金合同的约定基础上，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

基金目标 在严格控制风险的前提下，通过久期配置和类属资产配置，追求绝对收益。

投资策略 在严格控制风险的前提下，通过久期配置和类属资产配置，追求绝对收益。

业绩比较基准 中证综合债指数(2013年1月1日至2016年10月10日)。

风险特征 属于低风险品种，适合追求绝对收益的投资者。

注：2016年10月1日起，本基金的基金经理由“一年期银行定期存款收益率（税后）”变更为“综合收益法（总值+折数）”。

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 中国工商银行股份有限公司

姓名 谭丽 赵晓东

信息披露负责人 021-36090777 010-66067699

电子邮箱 c000197@fund.hxbp.com.cn c000197@icbc.com.cn

客户服务电话 400-888-0001 966938

传真 021-36090777 010-66067699

2.4 会计信息披露

基金季度报告公告的管理人互联网网址 http://www.hxbp.com

基金年度报告公告的管理人互联网网址 上海浦东新区陆家嘴环路1399号太平金融广场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

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 财务指标表 2017年末 2016年末 2015年末

华泰柏瑞盛纯债债券 A 华泰柏瑞盛纯债债券 C 华泰柏瑞盛纯债债券 A 华泰柏瑞盛纯债债券 C

本期末 2,076,048.18 461,11058 38,954,152.80 1,067 61,018,520.39 4,670,730.43 175.47

年初至报告期初基金已实现收益 3,076,048.18 461,11058 38,954,152.80 1,067 61,018,520.39 4,670,730.43 175.47

报告期损益 0.0240 0.0000 0.0188 0.0022 0.0972 0.0094

本报告期金额 3.20% 2.96% 0.18% -0.39% 9.61% 9.77%

3.1.2 基金期末净资产增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞盛纯债债券 A 华泰柏瑞盛纯债债券 C

报告期净值增长率 1.331% 0.00% -1.75% 0.00% 15.30% 0.00%

同期业绩比较基准收益率 1.20% 0.00% -1.75% 0.00% 15.30% 0.00%

报告期净值增长率相对业绩比较基准收益率的差异 0.13% -0.75% 0.00% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞盛纯债债券 A 华泰柏瑞盛纯债债券 C

报告期净值增长率 1.331% 0.00% -1.75% 0.00% 15.30% 0.00%

同期业绩比较基准收益率 1.20% 0.00% -1.75% 0.00% 15.30% 0.00%

报告期净值增长率相对业绩比较基准收益率的差异 0.13% -0.75% 0.00% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰柏瑞盛纯债债券 A 华泰柏瑞盛纯债债券 C

报告期净值增长率 223.4% 0.00% 3.34% 0.00% 10.30% 0.04%

同期业绩比较基准收益率 22.2% 0.00% 3.34% 0.00% 10.30% 0.04%

注：1.显示日期为2013年9月21日至2017年12月31日。
2.本基金的规则：本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例均符合基金合同第十二部分（二）投资范围的规定的各项比例，但投资于债券等固定收益类资产占基金总资产的比例低于5%，因此报告期在一年以内（含）的政府债券占基金资产的比例不高于5%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞盛纯债债券 A 华泰柏瑞盛纯债债券 C

报告期净值增长率 223.4% 0.00% 3.34% 0.00% 10.30% 0.04%

同期业绩比较基准收益率 22.2% 0.00% 3.34% 0.00% 10.30% 0.04%

注：1.显示日期为2013年9月21日至2017年12月31日。
2.本基金的规则：本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例均符合基金合同第十二部分（二）投资范围的规定的各项比例，但投资于债券等固定收益类资产占基金总资产的比例低于5%，因此报告期在一年以内（含）的政府债券占基金资产的比例不高于5%。

3.2.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

华泰柏瑞盛纯债债券 A 每10份基金分红金额 分红形式 反向回购 收益率 年度 利润分配合计 备注

2017 -0.02% 0.00% -1.15% 0.00% 107% 0.00%

2016 0.7330 72,406,083.10 241,015.94 72,737,000.44 -

2015 -0.02% 0.00% -1.15% 0.00% 107% 0.00%

合计 0.7330 72,406,083.10 241,015.94 72,737,000.44 -

华泰柏瑞盛纯债债券 C 每10份基金分红金额 分红形式 反向回购 收益率 年度 利润分配合计 备注

2017 -0.02% 0.00% -1.15% 0.00% 107% 0.00%

2016 0.7330 10,410,540.06 100,006.09 10,606,625.06 -

2015 -0.02% 0.00% -1.15% 0.00% 107% 0.00%

合计 0.7330 10,410,540.06 100,006.09 10,606,625.06 -

注：1.显示日期为2013年9月21日至2017年12月31日。
2.本基金的规则：华泰柏瑞盛纯债债券 A 华泰柏瑞盛纯债债券 C

报告期利润总额 10,410,540.06 100,006.09 10,606,625.06 -

报告期现金分红 10,410,540.06 100,006.09 10,606,625.06 -

报告期利润总额减去报告期现金分红 0.00 0.00 0.00 -

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

华泰柏瑞盛纯债债券 A 每10份基金分红金额 分红形式 反向回购 收益率 年度 利润分配合计 备注

2017 -0.02% 0.00% -1.15% 0.00% 107% 0.00%

2016 0.7330 72,406,083.10 241,015.94 72,737,000.44 -

2015 -0.02% 0.00% -1.15% 0.00% 107% 0.00%

合计 0.7330 72,406,083.10 241,015.94 72,737,000.44 -

华泰柏瑞盛纯债债券 C 每10份基金分红金额 分红形式 反向回购 收益率 年度 利润分配合计 备注

2017 -0.02% 0.00% -1.15% 0.00% 107% 0.00%

2016 0.7330 10,410,540.06 100,006.09 10,606,625.06 -

2015 -0.02% 0.00% -1.15% 0.00% 107% 0.00%

合计 0.7330 10,410,540.06 100,006.09 10,606,625.06 -

注：1.显示日期为2013年9月21日至2017年12月31日。
2.本基金的规则：华泰柏瑞盛纯债债券 A 华泰柏瑞盛纯债债券 C

报告期利润总额 10,410,540.06 100,006.09 10,606,625.06 -

报告期现金分红 10,410,540.06 100,006.09 10,606,625.06 -

报告期利润总额减去报告期现金分红 0.00 0.00 0.00 -

3.4 基金管理人报告

4.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金的管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于2004年11月10日成立的合资基金管理公司，其股东为华泰证券（控股）有限公司和苏州高新区新嘉技术有限公司，目前的股东构成

为华泰柏瑞基金管理有限公司、华泰证券（控股）有限公司和苏州高新区新嘉技术有限公司。

华泰柏瑞基金管理有限公司是中国证监会批准的合格境内机构投资者，华泰证券（控股）有限公司和苏州高新区新嘉技术有限公司是经中国证监会批准的合格境内机构投资者。

华泰柏瑞基金管理有限公司的经营范围为：基金募集、基金销售、资产管理、基金相关业务咨询、基金投资顾问业务、基金代销、基金研究分析、基金估值、基金评级、基金评价、基金宣传、基金信息披露、基金服务、基金清算、基金核算、基金估值、基金登记、基金过户、基金转换、基金申购赎回、基金赎回、基金赎回确认、基金转换确认、基金定期报告、基金临时报告、基金上市交易、基金非上市交易、基金上市交易的清算、基金非上市交易的清算、基金上市交易的登记、基金非上市交易的登记、基金上市交易的过户、基金非上市交易的过户、基金上市交易的非公开募集、基金非上市交易的非公开募集、基金上市交易的非公开募集的清算、基金非上市交易的非公开募集的清算、基金上市交易的非公开募集的登记、基金非上市交易的非公开募集的登记、基金上市交易的非公开募集的过户、基金非上市交易的非公开募集的过户、基金上市交易的非公开募集的非公开募集、基金非上市交易的非公开募集的非公开募集的清算、基金上市交易的非公开募集的非公开募集的清算、基金上市交易的非公开募集的非公开募集的登记、基金非上市交易的非公开募集的非公开募集的登记、基金上市交易的非公开募集的非公开募集的过户、基金非上市交易的非公开募集的非公开募集的过户、基金上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集、基金非上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的清算、基金上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的清算、基金上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的登记、基金非上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的登记、基金上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的过户、基金非上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的过户、基金上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的非公开募集、基金非上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的非公开募集的清算、基金上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的非公开募集的清算、基金上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的非公开募集的登记、基金非上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的登记、基金上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的非公开募集的过户、基金非上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的过户、基金上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的非公开募集、基金非上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的非公开募集的清算、基金上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的非公开募集的清算、基金上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的非公开募集的登记、基金非上市交易的非公开募集的非公开募集的非公开募集的登记、基金上市交易的非公开募集的非公开