

# 华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

2019年6月30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

送出日期：2019年8月29日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月28日复核了本报告中的财务指标、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，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞季季红债券
基金主代码	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
报告期末基金份额总额	1,078,019,505.05份
基金合同存续期	不定期

### 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，力争实现超越业绩比较基准的投资收益
投资策略	本基金将在对宏观经济走势、利率变化趋势、收益率曲线形态变化和发债主体基本面分析的基础上，综合运用久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略等主动投资策略，选择合适的时机和品种构建债券组合。
业绩比较基准	一年期银行定期存款收益率（税后）+1%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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
信息披露负责人	姓名	陈晖	田青
	联系电话	021-38601777	010-67595096
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tianqingl.zh@ccb.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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	18,534,514.21
本期利润	18,246,124.06
加权平均基金份额本期利润	0.0145
本期基金份额净值增长率	1.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0105
期末基金资产净值	1,116,053,255.56
期末基金份额净值	1.0353

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

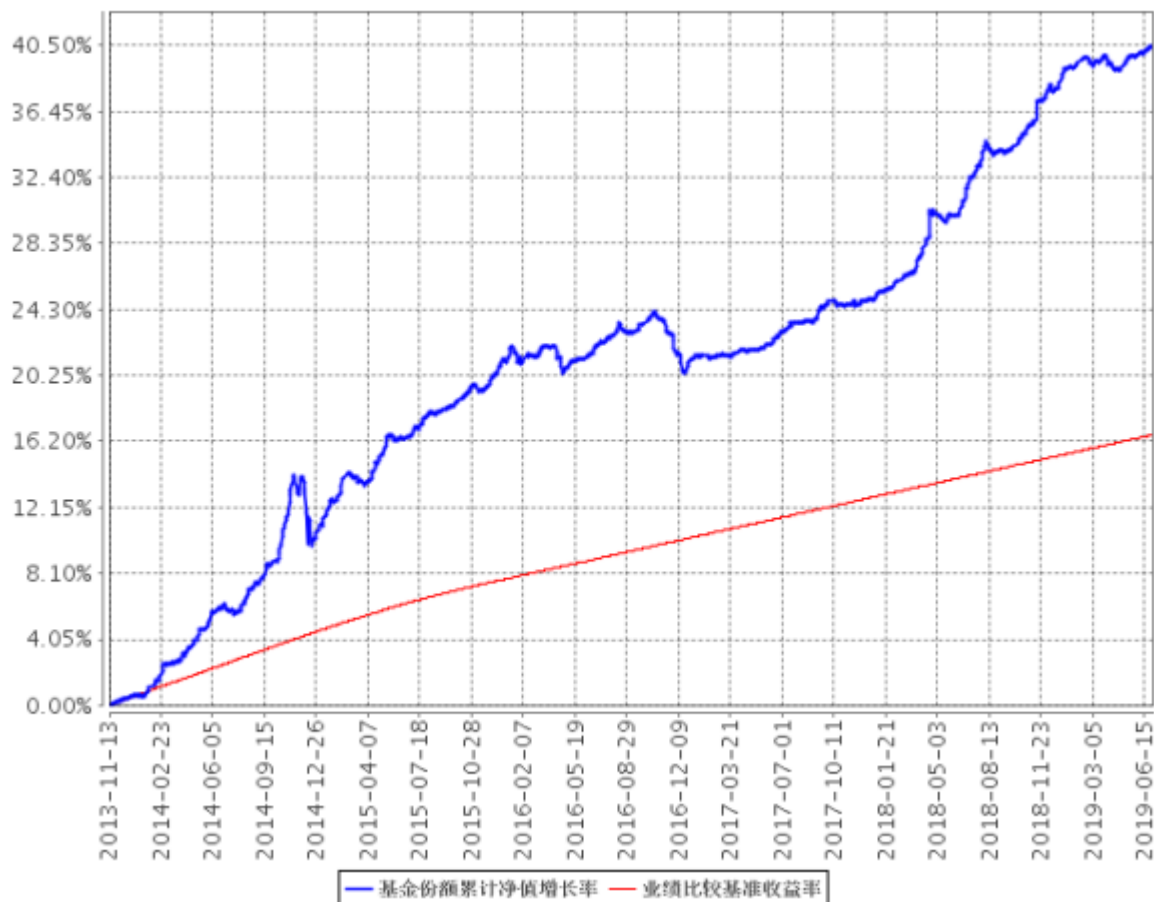
#### 3.2 基金净值表现

##### 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①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.43%	0.03%	0.21%	0.01%	0.22%	0.02%
过去三个月	0.41%	0.05%	0.63%	0.01%	-0.22%	0.04%
过去六个月	1.59%	0.05%	1.26%	0.01%	0.33%	0.04%
过去一年	6.67%	0.07%	2.53%	0.01%	4.14%	0.06%
过去三年	15.15%	0.08%	7.60%	0.01%	7.55%	0.07%
自基金合同生效起至今	40.50%	0.12%	16.60%	0.01%	23.90%	0.11%

##### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为2013年11月13日至2019年6月30日。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金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18日成立的合资基金管理公司，注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为49%、49%和2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选30灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活

配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞现代服务业混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞核心优势混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金。截至2019年6月30日，公司基金管理规模为1030.82亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗远航	本基金的基金经理	2017年3月16日	-	8年	清华大学应用经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司交易员、研究员、基金经理。2017年1月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2017年3月至2018年4月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月至2018年11月任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月至2019年3月任华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019年2月起任华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金的基金经理。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5%的同日反向交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年二季度，美联储继续暂停加息，同时货币政策表述趋于鸽派。在增长担忧情绪加剧的影响下，海外市场的债券收益率普遍下行。国内方面，受到一季度信用扩张超预期和通胀上行的影响，人民银行的货币政策在4月份边际收紧，降准预期落空。5月份以来中美贸易冲突加剧，国内外金融市场大幅震荡，宏观数据也出现了一定的回落，国内货币政策又有所转松。



市场方面，二季度利率大幅震荡。在央行收紧的影响下，4月份债券收益率快速上行超过30bp，5月中美贸易冲突恶化后，收益率又逐渐回落。整体来看，债券市场在二季度的表现弱于一季度，收益率相比一季度的低点有所上行。

报告期内，本基金主要投资于高等级的信用债和利率债，维持了中性的久期和杠杆水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0353元；本报告期基金份额净值增长率为1.59%，业绩比较基准收益率为1.26%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年三季度，经济复苏的预期已经在二季度被证伪。投资增速并没有跟随社融增速的回升而出现明显的改善，消费增速也在进一步下滑。在5月份包商银行被托管后，中小银行的同业存单发行困难，中小银行的资产负债表扩张速度减缓，这不利于未来的信用创造。同时，由于地方政府债今年提前到一季度发行，也使得三季度的地方政府债供给将明显少于去年同期。因此三季度的信用扩张速度可能趋缓，对于经济增长形成负面的压力。另一方面，随着猪肉价格基数影响的减弱，猪肉价格同比上升对于CPI的拉动作用在三季度也将降低，整体通胀压力在三季度将有所缓解。随着通胀压力的减缓和金融风险的加大，货币政策收紧的概率大大降低，预计三季度资金面将维持稳定宽松的局面，债券市场表现也有望好于二季度。

未来本基金将在控制好信用风险和流动性风险的前提下，维持适度的久期和杠杆水平，优化组合配置，规避信用风险，以获取较好的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，每季度末基金份额可供分配利润超过0.01元时，本基金至少进行收益分配1次，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的50%，每年度末收益分配比例不得低于基金该年度末可供分配利润的90%。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。本报告期内，本基金符合分红条件，于2019年1月16日和2019年4月19日进行分配。本基金于2019年1月16日，每10份基金份

额共派发现金红利0.354元，利润分配合计42,221,811.77元，其中现金形式发放总额为29,194,885.24元，再投资形式发放总额为13,026,926.53元；本基金于2019年4月19日，每10份基金份额共派发现金红利0.079元，利润分配合计9,147,575.38元，其中现金形式发放总额为6,047,015.42元，再投资形式发放总额为3,100,559.96元。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

注：无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为51,369,387.15元。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	445,878.44	4,520,339.66
结算备付金	787,719.67	582,883.20
存出保证金	27,926.22	1,915.74
交易性金融资产	1,245,032,907.20	1,134,347,400.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,245,032,907.20	1,134,347,400.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	15,035,142.55
应收证券清算款	20,160,722.74	-
应收利息	16,163,443.37	11,142,400.48
应收股利	-	-
应收申购款	616,147.62	3,392,364.27
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,283,234,745.26	1,169,022,445.90
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	164,391,643.41	175,999,458.00
应付证券清算款	27,399.89	-
应付赎回款	2,061,102.84	1,061,662.63
应付管理人报酬	329,715.44	255,606.25
应付托管费	94,204.42	73,030.35
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	35,335.79	33,923.29
应交税费	79,595.57	55,768.67
应付利息	56,395.86	147,317.28
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	106,096.48	212,841.83

负债合计	167,181,489.70	177,839,608.30
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,078,019,505.05	933,135,258.47
未分配利润	38,033,750.51	58,047,579.13
所有者权益合计	1,116,053,255.56	991,182,837.60
负债和所有者权益总计	1,283,234,745.26	1,169,022,445.90

注：1、报告截止日2019年6月30日，基金份额总额为1,078,019,505.05份，份额净值为1.0353元。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6 月30日
<b>一、收入</b>	22,539,736.16	8,855,347.34
1.利息收入	24,023,337.14	3,486,127.77
其中：存款利息收入	17,977.65	6,915.97
债券利息收入	23,823,227.30	3,476,562.93
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	182,132.19	2,648.87
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-2,057,869.32	4,094,284.50
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,057,869.32	4,107,434.50
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-13,150.00
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-288,390.15	1,228,789.76
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	862,658.49	46,145.31
<b>减：二、费用</b>	4,293,612.10	1,283,371.40
1. 管理人报酬	2,275,709.70	479,928.66
2. 托管费	650,202.80	137,122.48
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	51,144.86	17,378.12
5. 利息支出	1,112,174.04	493,596.29
其中：卖出回购金融资产支出	1,112,174.04	493,596.29
6. 税金及附加	52,390.00	10,268.80

7. 其他费用	151,990.70	145,077.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>18,246,124.06</b>	<b>7,571,975.94</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>18,246,124.06</b>	<b>7,571,975.94</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	933,135,258.47	58,047,579.13	991,182,837.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,246,124.06	18,246,124.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	144,884,246.58	13,109,434.47	157,993,681.05
其中：1.基金申购款	1,160,850,132.24	47,816,220.08	1,208,666,352.32
2.基金赎回款	-1,015,965,885.66	-34,706,785.61	-1,050,672,671.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-51,369,387.15	-51,369,387.15
五、期末所有者权益（基金净值）	1,078,019,505.05	38,033,750.51	1,116,053,255.56
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	141,278,227.94	2,427,941.43	143,706,169.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,571,975.94	7,571,975.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-32,939,569.02	-1,504,316.55	-34,443,885.57
其中：1.基金申购款	99,636,225.60	3,148,986.58	102,785,212.18

2. 基金赎回款	-132,575,794.62	-4,653,303.13	-137,229,097.75
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-3,082,271.72	-3,082,271.72
五、期末所有者权益（基金净值）	108,338,658.92	5,413,329.10	113,751,988.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

          韩勇                                          房伟力                                          赵景云            
 基金管理人负责人              主管会计工作负责人              会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]669号《关于核准华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币386,303,855.54元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第728号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金基金合同》于2013年11月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为386,431,675.29份基金份额,其中认购资金利息折合127,819.75份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市的债券、货币市场工具、资产支持证券、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金主要投资于固定收益类资产,包括国债、中央银行票据、地方政府债、中期票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券、次级债、债券回购、期限在一年期以内的定期存款等。本基金不投资股票,也不直接在二级市场买入可转债和权证,但可以参与一级市场可转债的申购,并可持有因投资分离交易可转债而产生的权证。因上述原因持有的可转债和权证,本基金应在其可交易之日起的30个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行

适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的3%。本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款收益率（税后）+1%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2019年8月29日批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金2019年1月1日至2019年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56



号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(2) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(3) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(5) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司(“华泰柏瑞基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间通过关联方交易单元未进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间通过关联方交易单元未进行债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间通过关联方交易单元未进行债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间通过关联方交易单元未进行权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间通过关联方交易单元无应支付关联方的佣金。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30 日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,275,709.70	479,928.66
其中：支付销售机构的客户维护费	433,826.46	28,396.67

注：1、本基金的管理费率于2018年6月22日起，由原来的0.70%调整为0.35%。

2、修改前：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.7%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.7% / 当年天数；

修改后：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.35% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	650,202.80		137,122.48	

注：1、本基金的托管费率于2018年6月22日起，由原来的0.2%调整为0.1%。

2、修改前：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数};$$

修改后：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

### 6.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期与关联方未进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

#### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	445,878.44	15,966.50	209,777.33	3,455.92

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.1.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额104,391,643.41元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
190401	19农发01	2019年7月1日	99.29	1,000,000	99,290,000.00
190203	19国开03	2019年7月1日	99.36	77,000	7,650,720.00
合计				1,077,000	106,940,720.00

###### 6.4.9.1.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额60,000,000元，一笔于7月1日到期，一笔于7月2日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,245,032,907.20	97.02
	其中：债券	1,245,032,907.20	97.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,233,598.11	0.10
8	其他各项资产	36,968,239.95	2.88
9	合计	1,283,234,745.26	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

注：无。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

注：无。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：无。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	109,183,907.20	9.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	239,134,000.00	21.43
	其中：政策性金融债	239,134,000.00	21.43
4	企业债券	70,148,000.00	6.29
5	企业短期融资券	381,584,000.00	34.19
6	中期票据	444,983,000.00	39.87
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,245,032,907.20	111.56

## 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	190401	19农发01	1,400,000	139,006,000.00	12.46
2	019611	19国债01	988,660	98,786,907.20	8.85
3	190210	19国开10	800,000	80,256,000.00	7.19
4	101900811	19陕煤 化MTN002	600,000	60,198,000.00	5.39
5	011900337	19鲁钢 铁SCP001	600,000	60,174,000.00	5.39

## 7.7 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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，以控制债券投资的系统性风险，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约。其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,926.22
2	应收证券清算款	20,160,722.74
3	应收股利	-
4	应收利息	16,163,443.37
5	应收申购款	616,147.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,968,239.95

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
25,923	41,585.45	577,487,146.39	53.57%	500,532,358.66	46.43%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	49,097.69	0.0046%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0



## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年11月13日）基金份额总额	386,431,675.29
本报告期期初基金份额总额	933,135,258.47
本报告期期间基金总申购份额	1,160,850,132.24
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,015,965,885.66
本报告期末基金份额总额	1,078,019,505.05

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2019年3月11日公司股东批准Anthony Gerard Fasso先生为公司董事。  
2019年4月4日公司股东批准王永筠女士为公司监事。  
2019年4月15日，经公司董事会批准刘万方先生为公司副总经理。

托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华西证券	1	-	-	-	-	-

南京证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华西证券	16,783,470.20	4.73%	30,000,000.00	10.64%	-	-
南京证券	6,023,400.00	1.70%	12,000,000.00	4.26%	-	-
华泰证券	210,390,967.12	59.33%	-	-	-	-
爱建证券	110,110,693.70	31.05%	90,000,000.00	31.91%	-	-
海通证券	11,327,942.20	3.19%	150,000,000.00	53.19%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

1. 具有相应的业务经营资格；
2. 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；

3. 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
  4. 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
  5. 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。
- 2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。
- 3、本基金在本报告期内增加华泰证券交易单元。

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019年8月29日