

华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金

2014] 第一季度报告

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22日

§ 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2014年4月21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。

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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞稳健收益债券
交易代码	460008
基金运作方式	契约型开放式
基金份额总额	2013年8月1日
报告期末基金份额总额	445,466,893.33份
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，力争实现超越业绩基准以上的投资收益。
投资策略	本基金主要在宏观经济、利率、期限结构、信用等宏观因素分析的基础上，综合运用久期调整、期限结构配置、类属资产配置、信用策略、息差策略等主动投资策略，选择合适的时机和品种构建投资组合。
业绩比较基准	一年期定期存款利率(税后)+1%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金及债券型基金。
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	华泰柏瑞稳健收益债券A
下属基金份额的交易代码	460008
报告期末基金份额净值	460108
报告期末基金份额总额	394,763,996.43份
报告期末基金资产净值	50,702,896.90元

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)	
华泰柏瑞稳健收益债券 A	华泰柏瑞稳健收益债券 C	
1.本期已实现收益	-12,656,682.06	
2.本期利润	4,971,518.78	
3.期初平均基金份额利润	0.0116	
4.期末基金份额净值	405,906,174.28	
5.期末基金份额净值	1.028	

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 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞稳健收益债券 A

阶段	净值增长(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.40%	0.15%	0.06%	0.01%	0.52%	0.14%

华泰柏瑞稳健收益债券 C	阶段	净值增长(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.40%	0.14%	0.06%	0.01%	0.53%	0.13%	

3.2.2 本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

华泰柏瑞稳健收益债券 A

阶段	净值增长(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.40%	0.15%	0.06%	0.01%	0.52%	0.14%

华泰柏瑞稳健收益债券 C	阶段	净值增长(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.40%	0.14%	0.06%	0.01%	0.53%	0.13%	

3.2.3 本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

华泰柏瑞稳健收益债券 A

阶段	净值增长(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.40%	0.15%	0.06%	0.01%	0.52%	0.14%

3.2.4 本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

华泰柏瑞稳健收益债券 C

阶段	净值增长(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.40%	0.14%	0.06%	0.01%	0.53%	0.13%

3.2.5 本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

华泰柏瑞稳健收益债券 A

阶段	净值增长(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.40%	0.15%	0.06%	0.01%	0.52%	0.14%

3.2.6 本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

华泰柏瑞稳健收益债券 C

阶段	净值增长(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.40%	0.14%	0.06%	0.01%	0.53%	0.13%

3.2.7 本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

华泰柏瑞稳健收益债券 A

阶段	净值增长(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.40%	0.15%	0.06%	0.01%	0.52%	0.14%

3.2.8 本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

华泰柏瑞稳健收益债券 C

阶段	净值增长(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.40%	0.14%	0.06%	0.01%	0.53%	0.13%

3.2.9 本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

华泰柏瑞稳健收益债券 A

阶段	净值增长(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.40%	0.15%	0.06%	0.01%	0.52%	0.14%

3.2.10 本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

华泰柏瑞稳健收益债券 C

阶段	净值增长(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.40%	0.14%	0.06%	0.01%	0.53%	0.13%

3.2.11 本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

华泰柏瑞稳健收益债券 A

阶段	净值增长(%)</