

# 华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金

## 【2014】半年度报告摘要

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,只在少数情况下“存在显著的倾向性”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究,发现,交易价差方向没有规律性,即没有明确的利益输送方向。同时潜在利益输送金额比较小(全部低于基金规模的0.5%),因此不构成利益输送。造成少量显著交易价差的原因来自两方面:一是报告期内股票市场的波动幅度较大,为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件;二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异,对证券买卖时点的把握也不同,导致股票买卖存在价差。

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控和管理。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。

本报告期内公司旗下基金所管理的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 管理人报告期内本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  
上半年,债券市场整体表现良好。1月份,银行间市场资金面较为宽松,债券收益率稳中有降;2月份,央行继续维持市场宽松的流动性局面,买盘积极相对1月有所上涨,债券收益率高位回落;而4月份央行实施了“定向降准”的措施,使得各机构对于后续资金面的预期产生了积极的变化;即:资金面并非短时间的宽松,而可能在较长时间内保持宽松。市场多头情绪因此得到了提振,各品种收益率不断走低,尤其长端品种下行迅速。

投资策略上,基金以配置超长期品种为主,并保持了较高的杠杆水平,并以较低仓位进行了长久期品种的交易。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现  
截至本报告期末,本基金A类和C类份额净值分别为1.059元和1.066元,分别上涨4.75%和4.56%,同期本基金业绩比较基准上涨1.96%。

4.5 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望  
下半年,受国务院提提经济多种措施的影响,预计经济数据将略有好转,但当前中国经济所面临的多方面问题难以在短时间内得到实质性改观,仍需要货币政策给与连续的配合。预计债券收益率在货币政策与经济数据的博弈中,仍将进一步下行的空间。

操作上,基金将继续在获取较高票息收入的基础上,灵活把握较长久期品种的交易性机会。

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,本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及估值程序均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明  
本基金本报告期末进行利润分配。

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  
本报告期内,本基金托管人在对华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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  
本报告期内,华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金的托管人——华泰柏瑞基金管理有限公司在华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各理方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见  
本托管人依法对华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金的华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

5.4 半年度财务会计报告(未经审计)  
6.1 资产负债表  
会计主体:华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金  
报告截止日:2014年6月30日

资产	附注号	本期 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款		340,792,022.80	20,079,696.36
结算备付金		11,376,639.50	512,380.95
存出保证金		19,98.93	-
买入返售金融资产		827,616,800.00	123,359,000.00
应收款项融资		-	-
预付款项		-	-
应收利息		827,616,800.00	123,359,000.00
应收股利		-	-
其他应收款		25,279,654.65	1,738,554.45
其他流动资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,205,084,715.88	150,910,141.85
负债和所有者权益	附注号	本期 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
应付金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		449,490,984.11	19,949,850.07
应付证券清算款		24,101.58	19,210,008.68
应付赎回款		52,539.31	624,196.46
应付管理人报酬		434,148.84	73,147.32
应付托管费		12,042.53	20,899.25
应付销售服务费		6,096.41	16,171.00
应付交易费		12,676.76	787.43
应交税费		624,000.00	600
应付利息		144,363.48	2,951.06
递延所得税负债		-	-
其他负债		148,800.96	180,256.26
负债合计		451,061,959.98	40,078,259.55
所有者权益:			
实收基金		712,024,650.18	109,672,329.18
未分配利润		41,998,105.72	1,139,553.12
所有者权益合计		754,022,755.90	110,813,882.30
负债和所有者权益总计		1,205,084,715.88	150,910,141.85

注:报告截止日2014年6月30日,华泰柏瑞丰盛纯债债券A份额净值1.069元,份额总额696,758,019.51份;华泰柏瑞丰盛纯债债券C份额净值1.066元,份额总额155,266,630.67份。

6.2 利润表  
会计主体:华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金  
会计期间:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入		41,109,357.83	-
1.利息收入		22,723,136.21	-
其中:存款利息收入		8,396,140.24	-
债券利息收入		14,319,886.07	-
买入返售金融资产收入		13,189.92	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,601,311.23	-
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,601,311.23	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		16,777,464.76	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		7,445.61	-
减:二、费用		7,248,292.64	-
1.运营费用		579,671.16	-
2.销售服务费		51,983.82	-
3.交易费用		9,588.34	-
4.利息支出		4,403,302.44	-
其中:卖出回购金融资产支出		4,403,302.44	-
6.其他费用		175,097.76	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		33,661,065.19	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		33,661,065.19	-

注:本基金基金合同生效日为2013年9月2日,无上年可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)		109,672,329.18	1,159,553.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益)		-	33,861,065.19
三、本期基金份额交易产生的基金份额净变动数(本期交易净收益+基金申购赎回净收益)		602,352,321.00	697,497,481
其中:1.基金申购款		661,745,459.18	8,333,969.47
2.基金赎回款		-59,393,138.18	-1,358,482.06
四、本期基金份额持有人分配股利和利润产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)		-	-60,081,428.65
五、期末所有者权益(基金净值)		712,024,650.18	1,159,553.12

注:本基金基金合同生效日为2013年9月2日,无上年可比期间数据。

6.4 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
一、收入		41,109,357.83	-
1.利息收入		22,723,136.21	-
其中:存款利息收入		8,396,140.24	-
债券利息收入		14,319,886.07	-
买入返售金融资产收入		13,189.92	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,601,311.23	-
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,601,311.23	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		16,777,464.76	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		7,445.61	-
减:二、费用		7,248,292.64	-
1.运营费用		579,671.16	-
2.销售服务费		51,983.82	-
3.交易费用		9,588.34	-
4.利息支出		4,403,302.44	-
其中:卖出回购金融资产支出		4,403,302.44	-
6.其他费用		175,097.76	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		33,661,065.19	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		33,661,065.19	-

注:本基金基金合同生效日为2013年9月2日,无上年可比期间数据。

6.5 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)		109,672,329.18	1,159,553.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益)		-	33,861,065.19
三、本期基金份额交易产生的基金份额净变动数(本期交易净收益+基金申购赎回净收益)		602,352,321.00	697,497,481
其中:1.基金申购款		661,745,459.18	8,333,969.47
2.基金赎回款		-59,393,138.18	-1,358,482.06
四、本期基金份额持有人分配股利和利润产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)		-	-60,081,428.65
五、期末所有者权益(基金净值)		712,024,650.18	1,159,553.12

注:本基金基金合同生效日为2013年9月2日,无上年可比期间数据。

6.6 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)		109,672,329.18	1,159,553.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益)		-	33,861,065.19
三、本期基金份额交易产生的基金份额净变动数(本期交易净收益+基金申购赎回净收益)		602,352,321.00	697,497,481
其中:1.基金申购款		661,745,459.18	8,333,969.47
2.基金赎回款		-59,393,138.18	-1,358,482.06
四、本期基金份额持有人分配股利和利润产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)		-	-60,081,428.65
五、期末所有者权益(基金净值)		712,024,650.18	1,159,553.12

注:本基金基金合同生效日为2013年9月2日,无上年可比期间数据。

6.7 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)		109,672,329.18	1,159,553.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益)		-	33,861,065.19
三、本期基金份额交易产生的基金份额净变动数(本期交易净收益+基金申购赎回净收益)		602,352,321.00	697,497,481
其中:1.基金申购款		661,745,459.18	8,333,969.47
2.基金赎回款		-59,393,138.18	-1,358,482.06
四、本期基金份额持有人分配股利和利润产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)		-	-60,081,428.65
五、期末所有者权益(基金净值)		712,024,650.18	1,159,553.12

注:本基金基金合同生效日为2013年9月2日,无上年可比期间数据。

6.8 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)		109,672,329.18	1,159,553.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益)		-	33,861,065.19
三、本期基金份额交易产生的基金份额净变动数(本期交易净收益+基金申购赎回净收益)		602,352,321.00	697,497,481
其中:1.基金申购款		661,745,459.18	8,333,969.47
2.基金赎回款		-59,393,138.18	-1,358,482.06
四、本期基金份额持有人分配股利和利润产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)		-	-60,081,428.65
五、期末所有者权益(基金净值)		712,024,650.18	1,159,553.12

注:本基金基金合同生效日为2013年9月2日,无上年可比期间数据。

6.9 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)		109,672,329.18	1,159,553.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益)		-	33,861,065.19
三、本期基金份额交易产生的基金份额净变动数(本期交易净收益+基金申购赎回净收益)		602,352,321.00	697,497,481
其中:1.基金申购款		661,745,459.18	8,333,969.47
2.基金赎回款		-59,393,138.18	-1,358,482.06
四、本期基金份额持有人分配股利和利润产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)		-	-60,081,428.65
五、期末所有者权益(基金净值)		712,024,650.18	1,159,553.12

注:本基金基金合同生效日为2013年9月2日,无上年可比期间数据。

6.10 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)		109,672,329.18	1,159,553.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益)		-	33,861,065.19
三、本期基金份额交易产生的基金份额净变动数(本期交易净收益+基金申购赎回净收益)		602,352,321.00	697,497,481
其中:1.基金申购款		661,745,459.18	8,333,969.47
2.基金赎回款		-59,393,138.18	-1,358,482.06
四、本期基金份额持有人分配股利和利润产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)		-	-60,081,428.65
五、期末所有者权益(基金净值)		712,024,650.18	1,159,553.12

注:本基金基金合同生效日为2013年9月2日,无上年可比期间数据。

6.11 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)		109,672,329.18	1,159,553.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益)		-	33,861,065.19
三、本期基金份额交易产生的基金份额净变动数(本期交易净收益+基金申购赎回净收益)		602,352,321.00	697,497,481
其中:1.基金申购款		661,745,459.18	8,333,969.47
2.基金赎回款		-59,393,138.18	-1,358,482.06
四、本期基金份额持有人分配股利和利润产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)		-	-60,081,428.65
五、期末所有者权益(基金净值)		712,024,650.18	1,159,553.12

注:本基金基金合同生效日为2013年9月2日,无上年可比期间数据。

6.12 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)		109,672,329.18	1,159,553.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益)		-	33,861,065.19
三、本期基金份额交易产生的基金份额净变动数(本期交易净收益+基金申购赎回净收益)		602,352,321.00	697,497,481
其中:1.基金申购款		661,745,459.18	8,333,969.47
2.基金赎回款		-59,393,138.18	-1,358,482.06
四、本期基金份额持有人分配股利和利润产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)		-	-60,081,428.65
五、期末所有者权益(基金净值)		712,024,650.18	1,159,553.12

注:本基金基金合同生效日为2013年9月2日,无上年可比期间数据。

6.13 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)		109,672,329.18	1,159,553.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益)		-	33,861,065.19
三、本期基金份额交易产生的基金份额净变动数(本期交易净收益+基金申购赎回净收益)		602,352,321.00	697,497,481
其中:1.基金申购款			