

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：2014年8月25日

§ 1 重要提示

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：中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年8月22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，保证复核结果不存在虚假记载、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。

本半年度报告摘要自半年度报告正文、投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金
基金代码	000087
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2013年9月2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
报告期末基金资产总额	712,024,650.18份
基金合同的期限	不定期

下级基金的基金简称：华泰柏瑞丰盛纯债债券A 华泰柏瑞丰盛纯债债券C

下级基金的基金代码：000087 000188

报告期末下属分级基金的份额总额：696,758,019.51份 15,266,630.67份

2.2 基金产品说明

投资目标 在合理控制风险的前提下，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 本基金在充分把握宏观形势、利率变化趋势、收益率曲线变化和债券个体基本面分析的基础上，综合运用久期调整策略、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进行债券投资。

业绩比较基准 100%×银行定期存款利率(税后)+10%×股票投资比例+10%×债券投资比例

风险收益特征 本基金属于货币市场基金中的较低风险品种，预期收益和预期风险低于货币基金，高于股票基金。

基金经理和基金托管人

项目 基金经理人 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 阮晖 董琴

信息披露负责人 联系电话 021-38601777 010-66105799

电子邮件 cs@000087.com.cn cs@icbc.com.cn

客户服务电话 400-888-0001 95588

传真 021-38601799 010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年报年度报告的管理人互联网网址 http://www.huatai-ph.com

基金半年报年度报告备置地 上海市浦东新区陆家嘴环路1199号华夏五道口广场1号楼17层

§ 3 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金类型 华泰柏瑞丰盛纯债债券A 华泰柏瑞丰盛纯债债券C

3.1 期间数据和指标 报告期(2014年1月1日至2014年6月30日) 报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)

本期已实现收益 16,518,901.23 56,699.20

本期利润 32,819,731.08 1,041,334.11

加权平均基金份额本期利润 0.0596 0.0410

本期基金份额净值增长率 4.75% 4.55%

3.1.2 期末数据和指标 报告期(2014年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 0.0397 0.0365

期末基金份额净值 737,904,885.59 16,117,870.31

期末基金份额总资产 1.059 1.056

注：1.上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将发生列示。

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 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

华泰柏瑞丰盛纯债债券A

阶段 份额净值增长 短期利率差额 业绩比较基准 业绩比较基准差

①-② ③-④

过去一个月 1.05% 0.07% 0.34% 0.01% 0.71% 0.06%

过去三个月 3.43% 0.08% 0.99% 0.01% 2.53% 0.06%

过去六个月 4.55% 0.09% 1.96% 0.01% 2.79% 0.07%

自基金合同生效以来 5.90% 0.11% 3.27% 0.01% 2.63% 0.10%

华泰柏瑞丰盛纯债债券C

阶段 份额净值增长 短期利率差额 业绩比较基准 业绩比较基准差

①-② ③-④

过去一个月 1.05% 0.08% 0.34% 0.01% 0.71% 0.07%

过去三个月 3.43% 0.08% 0.99% 0.01% 2.44% 0.07%

过去六个月 4.55% 0.09% 1.96% 0.01% 2.59% 0.08%

自基金合同生效以来 5.60% 0.10% 3.27% 0.01% 2.38% 0.09%

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

华泰柏瑞丰盛纯债债券A

阶段 份额净值增长 短期利率差额 业绩比较基准 业绩比较基准差

①-② ③-④

过去一个月 1.05% 0.08% 0.34% 0.01% 0.71% 0.07%

过去三个月 3.43% 0.08% 0.99% 0.01% 2.44% 0.07%

过去六个月 4.55% 0.09% 1.96% 0.01% 2.59% 0.08%

自基金合同生效以来 5.90% 0.11% 3.27% 0.01% 2.63% 0.10%

华泰柏瑞丰盛纯债债券C

阶段 份额净值增长 短期利率差额 业绩比较基准 业绩比较基准差

①-② ③-④

过去一个月 1.05% 0.08% 0.34% 0.01% 0.71% 0.07%

过去三个月 3.43% 0.08% 0.99% 0.01% 2.44% 0.07%

过去六个月 4.55% 0.09% 1.96% 0.01% 2.59% 0.08%

自基金合同生效以来 5.60% 0.10% 3.27% 0.01% 2.38% 0.09%

3.2.3 与同期业绩比较基准的差异分析

华泰柏瑞丰盛纯债债券A

阶段 份额净值增长 短期利率差额 业绩比较基准 业绩比较基准差

①-② ③-④

过去一个月 1.05% 0.08% 0.34% 0.01% 0.71% 0.07%

过去三个月 3.43% 0.08% 0.99% 0.01% 2.44% 0.07%

过去六个月 4.55% 0.09% 1.96% 0.01% 2.59% 0.08%

自基金合同生效以来 5.90% 0.11% 3.27% 0.01% 2.63% 0.10%

华泰柏瑞丰盛纯债债券C

阶段 份额净值增长 短期利率差额 业绩比较基准 业绩比较基准差

①-② ③-④

过去一个月 1.05% 0.08% 0.34% 0.01% 0.71% 0.07%

过去三个月 3.43% 0.08% 0.99% 0.01% 2.44% 0.07%

过去六个月 4.55% 0.09% 1.96% 0.01% 2.59% 0.08%

自基金合同生效以来 5.60% 0.10% 3.27% 0.01% 2.38% 0.09%

3.2.4 与同期业绩比较基准的差异分析

华泰柏瑞丰盛纯债债券A

阶段 份额净值增长 短期利率差额 业绩比较基准 业绩比较基准差

①-② ③-④

过去一个月 1.05% 0.08% 0.34% 0.01% 0.71% 0.07%

过去三个月 3.43% 0.08% 0.99% 0.01% 2.44% 0.07%

过去六个月 4.55% 0.09% 1.96% 0.01% 2.59% 0.08%

自基金合同生效以来 5.90% 0.11% 3.27% 0.01% 2.63% 0.10%

华泰柏瑞丰盛纯债债券C

阶段 份额净值增长 短期利率差额 业绩比较基准 业绩比较基准差

①-② ③-④

过去一个月 1.05% 0.08% 0.34% 0.01% 0.71% 0.07%

过去三个月 3.43% 0.08% 0.99% 0.01% 2.44% 0.07%

过去六个月 4.55% 0.09% 1.96% 0.01% 2.59% 0.08%

自基金合同生效以来 5.60% 0.10% 3.27% 0.01% 2.38% 0.09%

3.2.5 与同期业绩比较基准的差异分析

华泰柏瑞丰盛纯债债券A

阶段 份额净值增长 短期利率差额 业绩比较基准 业绩比较基准差

①-② ③-④

过去一个月 1.05% 0.08% 0.34% 0.01% 0.71% 0.07%

过去三个月 3.43% 0.08% 0.99% 0.01% 2.44% 0.07%

过去六个月 4.55% 0.09% 1.96% 0.01% 2.59% 0.08%

自基金合同生效以来 5.90% 0.11% 3.27% 0.01% 2.63% 0.10%

华泰柏瑞丰盛纯债债券C

阶段 份额净值增长 短期利率差额 业绩比较基准 业绩比较基准差

①-② ③-④

过去一个月 1.05% 0.08% 0.34% 0.01% 0.71% 0.07%

过去三个月 3.43% 0.08% 0.99% 0.01% 2.44% 0.07%

过去六个月 4.55% 0.09% 1.96% 0.01% 2.59% 0.08%

自基金合同生效以来 5.60% 0.10% 3.27% 0.01% 2.38% 0.09%

3.2.6 与同期业绩比较基准的差异分析

华泰柏瑞丰盛纯债债券A

阶段 份额净值增长 短期利率差额 业绩比较基准 业绩比较基准差

①-② ③-④

过去一个月