

## 华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

## [2015] 第二季度报告

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:2015年7月18日

## § 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责任。

基金经理人:中国人寿保险股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月1日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告,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。

报告书中的财务数据未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

## § 2 基本产品概况

基金简称:华泰柏瑞盛世中国股票  
交易代码:460001  
基金运作方式:契约型开放式  
基金合同生效日:2006年7月27日  
报告期末基金份额总额:2,596,969,296.52份

投资目标:主要通过投资于大类资产配置策略,追求管理资产的长期增值,以债券为主要投资对象,通过精选个股获取超额收益,同时适当的大类资产配置策略降低组合的系统性风险。

业绩比较基准:中信标普300指数×70%+中债国债指数×30%

风险收益特征:较高风险,较高收益

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

1.本期已实现收益 1,756,572,229.09

2.本期利润 695,164,836.45

3.加权平均基金份额本期利润 0.1764

4.期末基金份额净值 2,596,699,649.02

5.期末基金份额总额 0.0999

注:1.上表基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用影响收益水平要低于所列数字。  
2.本期已实现收益指基金利息收入、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 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④  
过去三个月 8.38% 2.83% 8.81% 1.18% -0.43% 3.02%

3.2.2 自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

注:图示日期为2006年4月2日至2015年6月30日。

1.按基金合同规定,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已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为净资产的0%-40%。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.3 基金净值表现

3.2.4 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④  
过去三个月 8.38% 2.83% 8.81% 1.18% -0.43% 3.02%

3.2.5 自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

注:图示日期为2006年4月2日至2015年6月30日。

1.按基金合同规定,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已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为净资产的0%-40%。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.6 基金净值表现

3.2.7 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④  
过去三个月 8.38% 2.83% 8.81% 1.18% -0.43% 3.02%

3.2.8 自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

注:图示日期为2006年4月2日至2015年6月30日。

1.按基金合同规定,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已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为净资产的0%-40%。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.9 基金净值表现

3.2.10 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④  
过去三个月 8.38% 2.83% 8.81% 1.18% -0.43% 3.02%

3.2.11 自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

注:图示日期为2006年4月2日至2015年6月30日。

1.按基金合同规定,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已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为净资产的0%-40%。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.12 基金净值表现

3.2.13 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④  
过去三个月 8.38% 2.83% 8.81% 1.18% -0.43% 3.02%

3.2.14 自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

注:图示日期为2006年4月2日至2015年6月30日。

1.按基金合同规定,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已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为净资产的0%-40%。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.15 基金净值表现

3.2.16 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④  
过去三个月 8.38% 2.83% 8.81% 1.18% -0.43% 3.02%

3.2.17 自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

注:图示日期为2006年4月2日至2015年6月30日。

1.按基金合同规定,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已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为净资产的0%-40%。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.18 基金净值表现

3.2.19 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④  
过去三个月 8.38% 2.83% 8.81% 1.18% -0.43% 3.02%

3.2.20 自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

注:图示日期为2006年4月2日至2015年6月30日。

1.按基金合同规定,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已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为净资产的0%-40%。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.21 基金净值表现

3.2.22 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④  
过去三个月 8.38% 2.83% 8.81% 1.18% -0.43% 3.02%

3.2.23 自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

注:图示日期为2006年4月2日至2015年6月30日。

1.按基金合同规定,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已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为净资产的0%-40%。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.24 基金净值表现

3.2.25 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④  
过去三个月 8.38% 2.83% 8.81% 1.18% -0.43% 3.02%

3.2.26 自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

注:图示日期为2006年4月2日至2015年6月30日。

1.按基金合同规定,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已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为净资产的0%-40%。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.27 基金净值表现

3.2.28 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④  
过去三个月 8.38% 2.83% 8.81% 1.18% -0.43% 3.02%

3.2.29 自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

注:图示日期为2006年4月2日至2015年6月30日。

1.按基金合同规定,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已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为净资产的0%-40%。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.30 基金净值表现

3.2.31 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④  
过去三个月 8.38% 2.83% 8.81% 1.18% -0.43% 3.02%

3.2.32 自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

注:图示日期为2006年4月2日至2015年6月30日。

1.按基金合同规定,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已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为净资产的0%-40%。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.33 基金净值表现

3.2.34 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④  
过去三个月 8.38% 2.83% 8.81% 1.18% -0.43% 3.02%

3.2.35 自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

注:图示日期为2006年4月2日至2015年6月30日。

1.按基金合同规定,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已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为净资产的0%-40%。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2.36 基金净值表现