

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

报告送出日期：2016年1月21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。

基金托管人对本基金年度报告的内容真实、准确和完整，不负任何责任。

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。

基金管理人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。

本报告期无利润分配。

报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

2.2 基金产品概况

基金简称 华泰柏瑞丰盛纯债债券

交易代码 000187

基金运作方式 货币型开放式

基金合同生效日 2013年9月2日

报告期末基金份额总额 943,319,766.82份

在严格控制风险的基础上，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

本基金将对宏观经济走势、利率变化趋势、收益率曲线形态

变化及发行主体基本面的基本分析，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，结合合适的品种和机构进行资产配置。

业绩比较基准 一年定期存款利率（税后）+130%

风险收益特征 本基金属于货币基金中的较低风险品种，预期收益和预

期风险低于货币市场基金，属于混合型基金和股票型基金。

基金管理人 华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 华泰柏瑞丰盛纯债债券A

华泰柏瑞丰盛纯债债券C

下属分级基金的交易代码 000187 000188

报告期末下属分级基金份额总额 887,264,421.14份 56,066,336.68份

5.3 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10月1日 - 2015年12月31日)

华泰柏瑞丰盛纯债债券A 华泰柏瑞丰盛纯债债券C

1.本期已实现收益 21,247,944.66 2,417,068.69

2.本期利润 19,234,568.97 3,161,422.31

3.加权平均基金份额本期利润 0.0217 0.0290

4.期末基金资产净值 1,002,077,879.46 63,004,365.07

5.期末基金份额净值 1.129 1.124

注：1.所列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。

3.2.1 本基金报告期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 净值增长率(%) 比净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

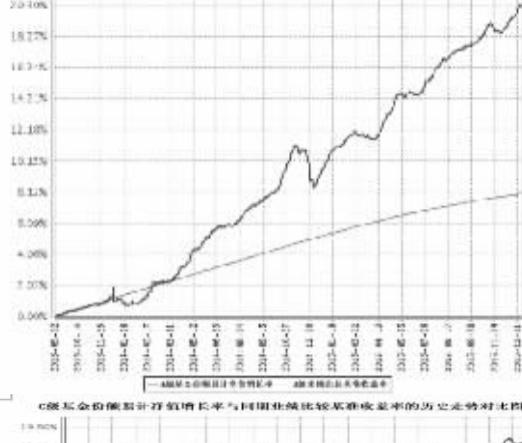
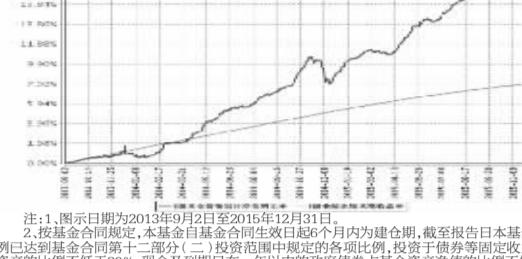
过去三个月 1.9% 0.07% 0.52% 0.01% 14.47% 0.06%

华泰柏瑞丰盛纯债债券C

阶段 净值增长率(%) 比净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.9% 0.08% 0.52% 0.01% 13.8% 0.07%

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

华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金**2015】第四季度报告****A类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图****C类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图****5.4 管理人报告**

报告期内本基金运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

报告期内，本基金未发现存在不公平交易行为。

本基金未发现存在不公平交易行为。

本基金未发现存在