

# 华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金 2014 年年度报告 摘要

2014 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 月 30 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及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金简称            | 华泰柏瑞稳健收益债券       |                 |
| 基金主代码           | 460008           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2012 年 12 月 4 日  |                 |
| 基金管理人           | 华泰柏瑞基金管理有限公司     |                 |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司       |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 261,913,913.37 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称:    | 华泰柏瑞稳健收益债券 A     | 华泰柏瑞稳健收益债券 C    |
| 下属分级基金的交易代码:    | 460008           | 460108          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 187,034,494.44 份 | 74,879,418.93 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 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，力争实现超越业绩比较基准的投资收益  |
| 投资策略   | 本基金将在对宏观经济走势、利率变化趋势、收益率曲线形态变化和发债主体基本面分析的基础上，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，选择合适的时机和品种构建债券组合。 |
| 业绩比较基准 | 一年期银行定期存款收益率（税后）+1%  |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中的较低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                      | 基金托管人                |
|---------|------|----------------------------|----------------------|
| 名称      |      | 华泰柏瑞基金管理有限公司               | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 陈晖                         | 王永民                  |
|         | 联系电话 | 021-38601777               | 010-66594896         |
|         | 电子邮箱 | cs4008880001@huatai-pb.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-888-0001               | 95566                |
| 传真      |      | 021-38601799               | 010-66594942         |

### 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1                                      |

|  |               |
|--|---------------|
|  | 号楼 17 层及托管人住所 |
|--|---------------|

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2014 年        |              | 2013 年        |              | 2012 年 12 月 4 日(基金合同生效日)-2012 年 12 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 | 华泰柏瑞稳健收益债券 A  | 华泰柏瑞稳健收益债券 C | 华泰柏瑞稳健收益债券 A                              | 华泰柏瑞稳健收益债券 C |
| 本期已实现收益       | 16,788,499.06 | 8,068,757.00 | 31,771,098.10 | 8,320,850.69 | 3,264,996.76                              | 916,120.07   |
| 本期利润          | 47,353,939.81 | 8,913,695.54 | 14,729,624.86 | 3,675,834.15 | 2,948,685.20                              | 700,491.38   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1403        | 0.1103       | 0.0193        | 0.0171       | 0.0019                                    | 0.0014       |
| 本期基金份额净值增长率   | 13.23%        | 12.90%       | 1.10%         | 0.70%        | 0.20%                                     | 0.10%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2014 年末       |              | 2013 年末       |              | 2012 年末                                   |              |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1065        | 0.0957       | 0.0131        | 0.0079       | 0.0021                                    | 0.0014       |

|          |                |               |                |               |                |                |
|----------|----------------|---------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 期末基金资产净值 | 214,523,979.17 | 85,197,181.72 | 575,604,959.00 | 61,592,452.71 | 860,192,286.14 | 449,327,820.25 |
| 期末基金份额净值 | 1.147          | 1.138         | 1.013          | 1.008         | 1.002          | 1.001          |

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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

华泰柏瑞稳健收益债券 A

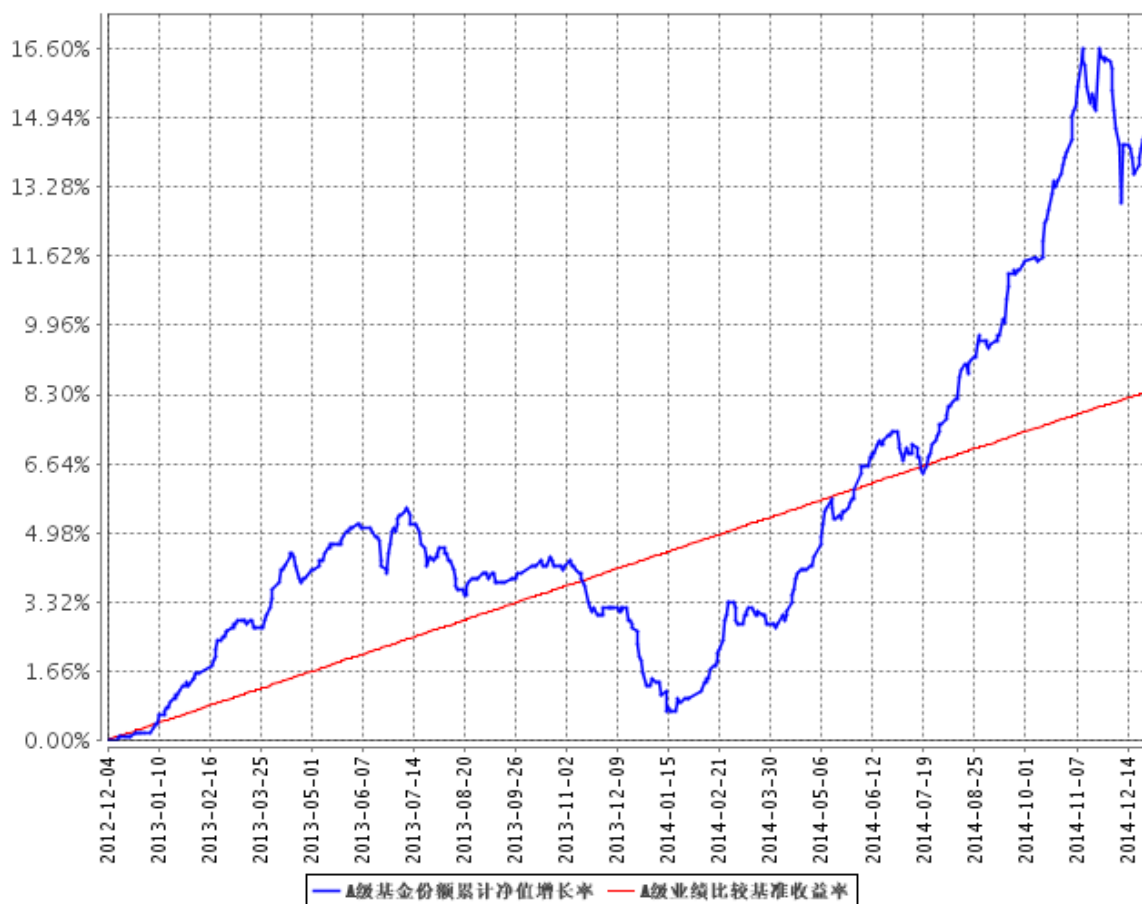
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月      | 2.87%    | 0.35%       | 0.93%      | 0.01%         | 1.94% | 0.34% |
| 过去六个月      | 6.80%    | 0.26%       | 1.90%      | 0.01%         | 4.90% | 0.25% |
| 过去一年       | 13.23%   | 0.21%       | 3.86%      | 0.01%         | 9.37% | 0.20% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.70%   | 0.17%       | 8.39%      | 0.01%         | 6.31% | 0.16% |

华泰柏瑞稳健收益债券 C

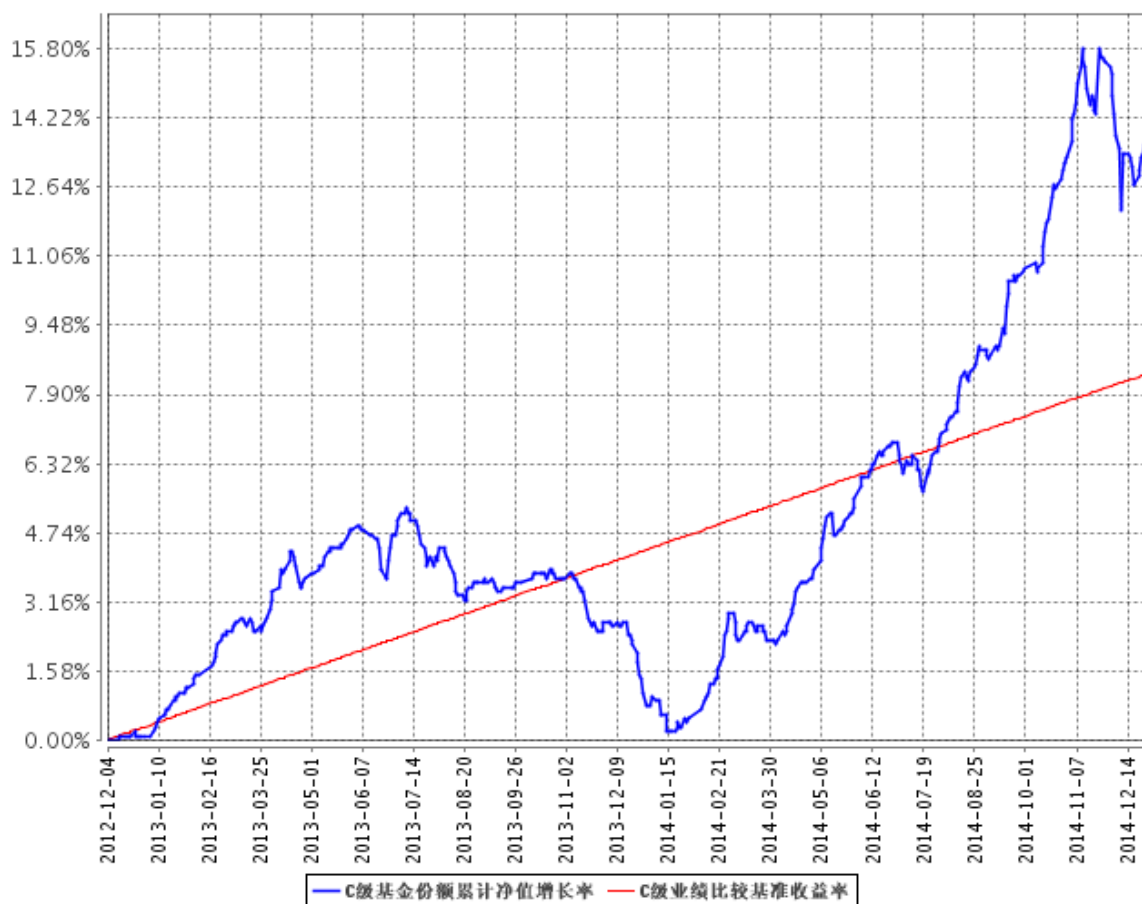
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月      | 2.71%    | 0.34%       | 0.93%      | 0.01%         | 1.78% | 0.33% |
| 过去六个月      | 6.55%    | 0.26%       | 1.90%      | 0.01%         | 4.65% | 0.25% |
| 过去一年       | 12.90%   | 0.21%       | 3.86%      | 0.01%         | 9.04% | 0.20% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.80%   | 0.17%       | 8.39%      | 0.01%         | 5.41% | 0.16% |

#### 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

A级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对比图



C级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对比图

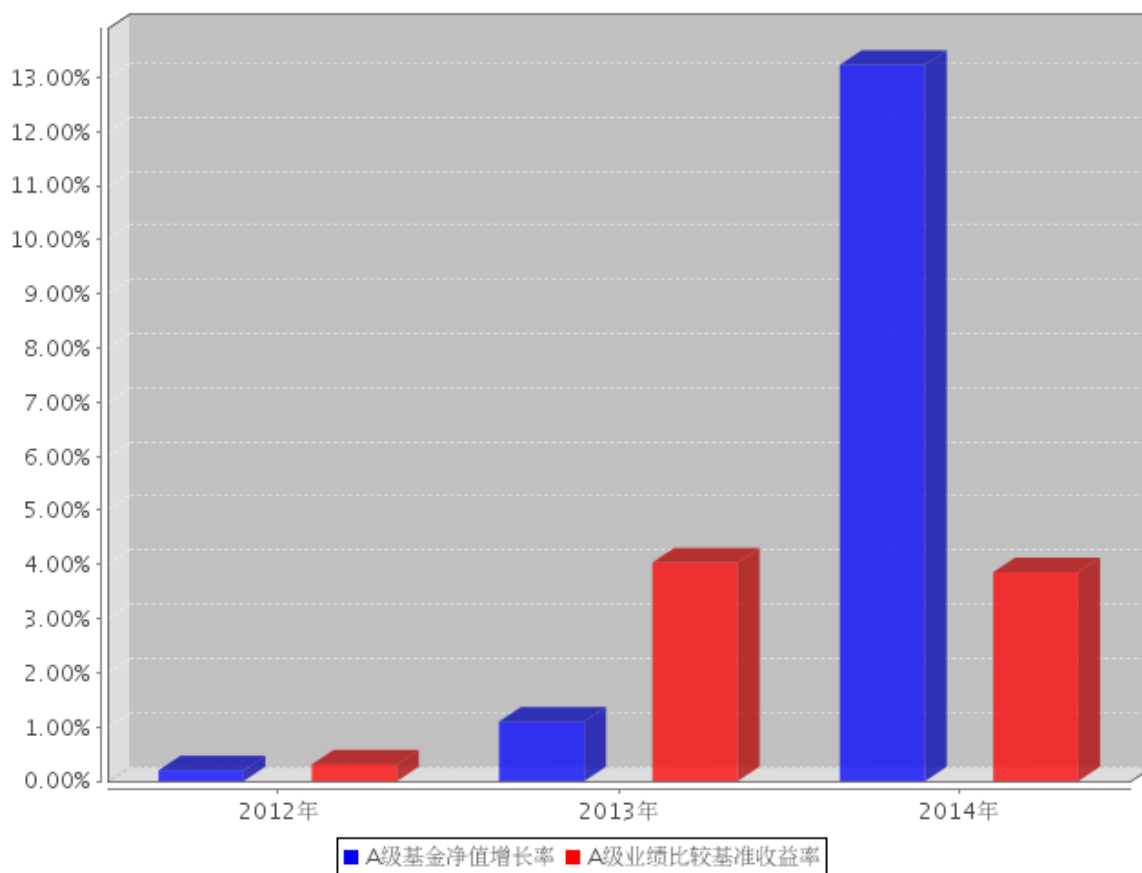


注：1、图示日期为 2012 年 12 月 4 日至 2014 年 12 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 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十四条（二）投资范围中规定的各项比例，投资于债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

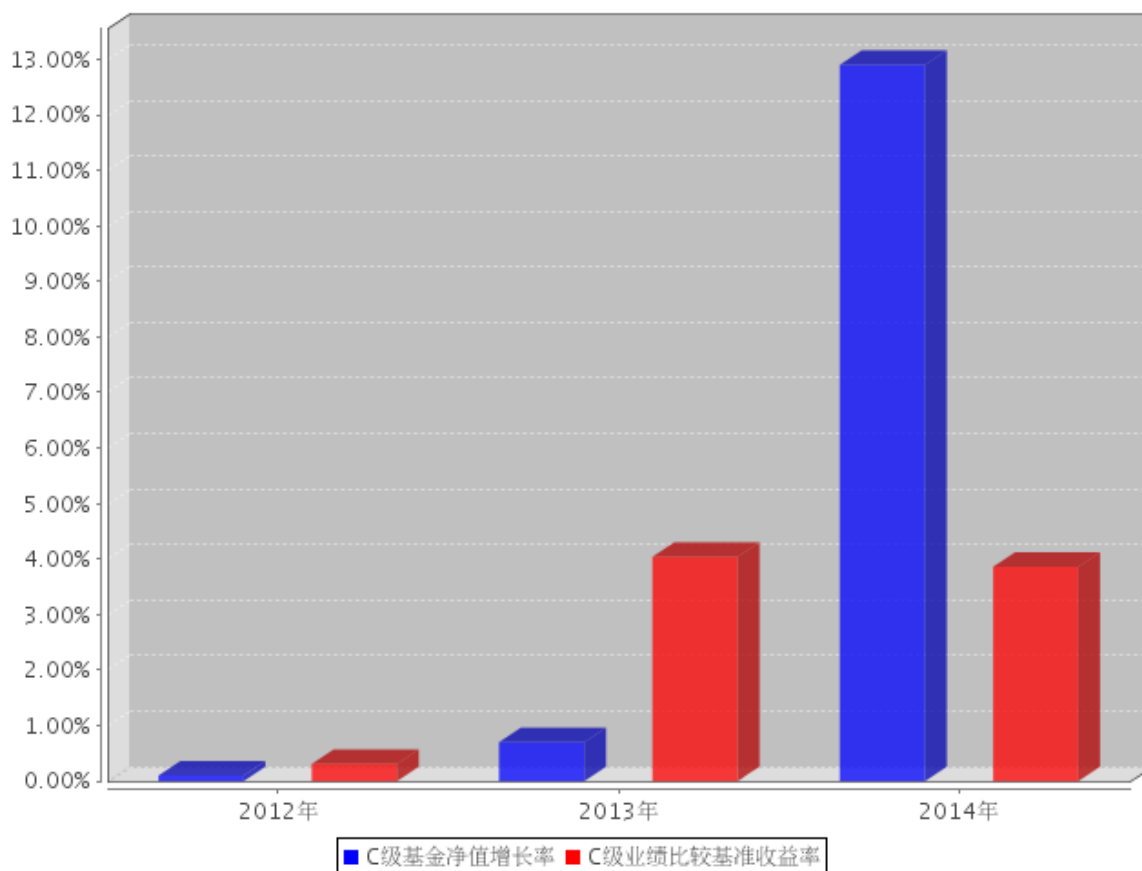
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

### A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图





**C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**



注：基金合同生效日为 2012 年 12 月 4 日，2012 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、

华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金。截至 2014 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 600.75 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务                     | 任本基金的基金经理（助理）期限  |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|------------------------|------------------|------|--------|---|
|     |                        | 任职日期             | 离任日期 |        |   |
| 董元星 | 总经理助理、固定收益部总监、本基金的基金经理 | 2013 年 10 月 16 日 | -    | 9 年    | 本科毕业于北京大学经济学院，博士毕业于纽约大学商学院。曾任巴克莱资本（纽约）债券交易员、华夏基金管理有限公司基金经理。2012 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任固定收益部总监。2013 年 10 月起任华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金的基金经理，2014 年 2 |

|    |                                     |                    |                 |      |  |
|----|-------------------------------------|--------------------|-----------------|------|--|
|    |                                     |                    |                 |      | 月起任总<br>经 理 助<br>理。  |
| 沈涛 | 固定收益<br>部 副 总<br>监、本基<br>金的基金<br>经理 | 2012 年 12 月<br>4 日 | 2014 年 9 月 26 日 | 21 年 | 经济学博<br>士。21 年<br>证券投资<br>从 业 经<br>历。曾任<br>易方达基<br>金管理有<br>限公司月<br>月收益中<br>短期债券<br>投资基金<br>基 金 经<br>理。2007<br>年 11 月加<br>入 本 公<br>司。历任<br>华泰柏瑞<br>金字塔稳<br>本增利债<br>券基金基<br>金经理、<br>华泰柏瑞<br>货币基金<br>基 金 经<br>理、华泰<br>柏瑞信用<br>增利债券<br>基金基金<br>经 理 。<br>2012 年 6<br>月起任华<br>泰柏瑞固<br>定收益部<br>副总监。<br>2012 年 12<br>月起任华<br>泰柏瑞稳<br>健收益债<br>券型证券<br>投资基金<br>基 金 经<br>理，2014 |

|  |  |  |  |  |                       |
|--|--|--|--|--|-----------------------|
|  |  |  |  |  | 年 2 月起<br>任总经理<br>助理。 |
|--|--|--|--|--|-----------------------|

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资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表明，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，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。

### 4.3.3 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督和管理。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 管理人对报告期内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

2014 年是中国债券历史上罕见的牛市，政策性金融债收益率下行 140BP 左右，其间也较少出现大幅的回调。驱动一季度利率下行的主要因素是流动性的改善，随后李克强总理提出“降低社会融资成本”的政策目标成为推动二三季度利率走低的主要原因，年末市场对未来货币政策放松的预期推动收益率水平再下一个台阶。

策略上，基金在市场利率水平大幅下行的环境下，重点投资了长久期利率品种，杠杆水平较高，良好地把握了长久期资产的增值机会。

### 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 1.147 元和 1.138 元，分别上涨 13.23% 和 12.9%，同期本基金的业绩比较基准上涨 3.86%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年，房地产业、制造业等实体部门的增长前景将继续受限，经济增长将继续面临严峻的下滑压力。在实体经济下行、通胀走低的前提下，货币政策预计将保持中性偏松的政策基调。整体经济与政策环境将有利于利率水平的不断下行，全年债券市场的最大风险可能在于财政与货币政策刺激力度较大、经济短期即企稳反弹，否则债券市场仍将存在良好的收益机会。

2015 年，基金将以中短久期信用品种为配置主体，保持中性的杠杆水平；并根据长久期品种

的走势，增加仓位，把握长久期品种的交易性机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2014 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统事先进行合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.7 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，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门负责人，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或定价服务均来自独立第三方。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 70%。本报告期内基金未实施收益分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 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

报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金费用开支等方面进行了认真地复核。本报告期内，基金投资运作不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金

融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

普华永道会计师事务所对本基金的年度报告出具了“无保留意见的审计报告”(普华永道中天审字(2015)第 21326 号),投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体:华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金

报告截止日:2014 年 12 月 31 日

单位:人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2014 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产:</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            |            | 874,976.60                      | 35,106,490.88                    |
| 结算备付金           |            | 14,488,824.18                   | 13,901,765.37                    |
| 存出保证金           |            | 8,258.88                        | 125,519.97                       |
| 交易性金融资产         |            | 326,334,614.00                  | 770,486,000.00                   |
| 其中:股票投资         |            | -                               | -                                |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 326,334,614.00                  | 770,486,000.00                   |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          |            | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        |            | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                               | 19,966,258.01                    |
| 应收利息            |            | 9,746,168.57                    | 17,556,331.75                    |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 10,002,000.00                   | 29,100,784.09                    |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            |            | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 361,454,842.23                  | 886,243,150.07                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2014 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2013 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债:</b>      |            |                                 |                                  |
| 短期借款            |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          |            | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 51,000,000.00                   | 247,090,149.36                   |
| 应付证券清算款         |            | 10,035,519.56                   | -                                |



|               |  |                |                |
|---------------|--|----------------|----------------|
| 应付赎回款         |  | 60,314.10      | 1,008,045.35   |
| 应付管理人报酬       |  | 193,881.54     | 360,220.11     |
| 应付托管费         |  | 55,394.69      | 102,920.01     |
| 应付销售服务费       |  | 33,528.76      | 21,500.40      |
| 应付交易费用        |  | 12,344.37      | 5,392.15       |
| 应交税费          |  | -              | -              |
| 应付利息          |  | 1,940.83       | 116,881.15     |
| 应付利润          |  | -              | -              |
| 递延所得税负债       |  | -              | -              |
| 其他负债          |  | 340,757.49     | 340,629.83     |
| 负债合计          |  | 61,733,681.34  | 249,045,738.36 |
| <b>所有者权益：</b> |  |                |                |
| 实收基金          |  | 261,913,913.37 | 629,253,049.29 |
| 未分配利润         |  | 37,807,247.52  | 7,944,362.42   |
| 所有者权益合计       |  | 299,721,160.89 | 637,197,411.71 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 361,454,842.23 | 886,243,150.07 |

注：1. 报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额总额为 261,913,913.37 份，其中 A 类基金份额净值 1.147 元，A 类基金份额总额 187,034,494.44 份；C 类基金份额净值 1.138 元，C 类基金份额总额 74,879,418.93 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号 | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|------------------|-----|-------------------------------------|-------------------------------------|
|                  |     | 2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 12 月 31 日 | 2013 年 1 月 1 日至 2013<br>年 12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b>      |     | 68,884,888.18                       | 36,807,733.20                       |
| 1.利息收入           |     | 35,044,254.41                       | 58,136,652.68                       |
| 其中：存款利息收入        |     | 296,152.12                          | 1,158,583.95                        |
| 债券利息收入           |     | 34,492,720.31                       | 56,721,064.36                       |
| 资产支持证券利息收入       |     | -                                   | -                                   |
| 买入返售金融资产收入       |     | 255,381.98                          | 257,004.37                          |
| 其他利息收入           |     | -                                   | -                                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |     | 2,131,078.40                        | -347,747.93                         |
| 其中：股票投资收益        |     | -                                   | -                                   |
| 基金投资收益           |     | -                                   | -                                   |
| 债券投资收益           |     | 2,131,078.40                        | -347,747.93                         |
| 资产支持证券投资收益       |     | -                                   | -                                   |
| 贵金属投资收益          |     | -                                   | -                                   |
| 衍生工具收益           |     | -                                   | -                                   |

|                            |  |               |                |
|----------------------------|--|---------------|----------------|
| 股利收益                       |  | -             | -              |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      |  | 31,410,379.29 | -21,686,489.78 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |  | -             | -              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          |  | 299,176.08    | 705,318.23     |
| <b>减：二、费用</b>              |  | 12,617,252.83 | 18,402,274.19  |
| 1. 管理人报酬                   |  | 3,188,404.92  | 7,165,484.52   |
| 2. 托管费                     |  | 910,972.74    | 2,047,281.32   |
| 3. 销售服务费                   |  | 352,506.00    | 894,426.88     |
| 4. 交易费用                    |  | 24,330.63     | 42,724.91      |
| 5. 利息支出                    |  | 7,733,241.48  | 7,850,133.04   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |  | 7,733,241.48  | 7,850,133.04   |
| 6. 其他费用                    |  | 407,797.06    | 402,223.52     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |  | 56,267,635.35 | 18,405,459.01  |
| 减：所得税费用                    |  | -             | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |  | 56,267,635.35 | 18,405,459.01  |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |                 |                   |
|-----------------------------------|--|-----------------|-------------------|
|                                   | 实收基金                                   | 未分配利润           | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                   | 629,253,049.29                         | 7,944,362.42    | 637,197,411.71    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）         | -                                      | 56,267,635.35   | 56,267,635.35     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -367,339,135.92                        | -26,404,750.25  | -393,743,886.17   |
| 其中：1. 基金申购款                       | 1,009,682,786.70                       | 88,199,113.44   | 1,097,881,900.14  |
| 2. 基金赎回款                          | -1,377,021,922.62                      | -114,603,863.69 | -1,491,625,786.31 |

|  |   |                 |                   |
|--|---|-----------------|-------------------|
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -   | -               | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 261,913,913.37                              | 37,807,247.52   | 299,721,160.89    |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |                 |                   |
|  | 实收基金  | 未分配利润           | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,307,076,801.61                            | 2,443,304.78    | 1,309,520,106.39  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -   | 18,405,459.01   | 18,405,459.01     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -677,823,752.32                             | -12,904,401.37  | -690,728,153.69   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 2,794,369,835.66                            | 106,892,222.65  | 2,901,262,058.31  |
| 2. 基金赎回款                               | -3,472,193,587.98                           | -119,796,624.02 | -3,591,990,212.00 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -   | -               | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 629,253,049.29                              | 7,944,362.42    | 637,197,411.71    |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|                               |                                |                               |
|-------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|
| <u>          韩勇          </u> | <u>          房伟力          </u> | <u>          陈培          </u> |
| 基金管理人负责人                      | 主管会计工作负责人                      | 会计机构负责人                       |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]第 1383 号《关于核准华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,

存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,257,883,917.64 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 478 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 12 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,258,996,930.68 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,113,013.04 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国债、地方政府债、金融债、央行票据、中期票据、次级债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、短期融资券、银行存款、债券回购等固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款收益率（税后）+1%。

本财务报表由本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2015 年 3 月 31 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称                | 与本基金的关系              |
|----------------------|----------------------|
| 华泰柏瑞基金管理有限公司         | 基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构 |
| 中国银行股份有限公司           | 基金托管人、基金代销机构         |
| 华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）   | 基金管理人的股东、基金代销机构      |
| 华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合”） | 基金管理人的股东华泰证券的控股子公司   |

|                  |          |
|------------------|----------|
| 证券” )            |          |
| 柏瑞投资有限责任公司       | 基金管理人的股东 |
| 苏州新区高新技术产业股份有限公司 | 基金管理人的股东 |

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

注：无。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

注：无。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注：无。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|-----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,188,404.92                     | 7,165,484.52                     |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 244,347.82                       | 1,497,578.96                     |

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 0.7% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

###### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|----|----------------------------------|----------------------------------|
|    | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |

|                | 月 31 日     | 日            |
|----------------|------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 910,972.74 | 2,047,281.32 |

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日      |                  |            |
|----------------|---|------------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |                  |            |
|                | 华泰柏瑞稳健收益<br>债券 A                            | 华泰柏瑞稳健收益<br>债券 C | 合计         |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司   | -   | 313,664.59       | 313,664.59 |
| 中国银行股份有限公司     | -   | 33,752.58        | 33,752.58  |
| 华泰证券股份有限公司     | -   | 24.84            | 24.84      |
| 合计             | -   | 347,442.01       | 347,442.01 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |                  |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |                  |            |
|                | 华泰柏瑞稳健收益<br>债券 A                            | 华泰柏瑞稳健收益<br>债券 C | 合计         |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司   | -   | 414,915.26       | 414,915.26 |
| 中国银行股份有限公司     | -   | 350,010.03       | 350,010.03 |
| 华泰证券股份有限公司     | -   | 128.74           | 128.74     |
| 合计             | -   | 765,054.03       | 765,054.03 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额支付销售机构销售服务费，按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应支付的销售服务费

E 为前一日的 C 类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各基金销售机构。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日      |               |      |       |      |               |           |
|---|---------------|------|-------|------|---------------|-----------|
| 银行间市场交易的各关联方名称                              | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购         |           |
|   | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额          | 利息支出      |
| 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |               |      |       |      |               |           |
| 银行间市场交易的各关联方名称                              | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购         |           |
|   | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额          | 利息支出      |
| 中国银行  | 39,865,763.54 | -    | -     | -    | 50,388,000.00 | 19,784.55 |

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |            | 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |               |
|-------|--|------------|---|---------------|
|       | 期末余额                                   | 当期利息收入     | 期末余额  | 当期利息收入        |
|       | 中国银行                                   | 874,976.60 | 69,175.36                                   | 35,106,490.88 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

### 7.4.9 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。



#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 51,000,000.00 元，于 2015 年 1 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 234,175,614.00 元，属于第二层次的余额为 92,159,000.00 元，无属于第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层次 182,096,000.00 元，第二层次 588,390,000.00，无第三层次)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -              | -             |
|    | 其中：股票             | -              | -             |
| 2  | 固定收益投资            | 326,334,614.00 | 90.28         |
|    | 其中：债券             | 326,334,614.00 | 90.28         |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 15,363,800.78  | 4.25          |
| 7  | 其他各项资产            | 19,756,427.45  | 5.47          |

|   |    |                |        |
|---|----|----------------|--------|
| 8 | 合计 | 361,454,842.23 | 100.00 |
|---|----|----------------|--------|

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：无。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：无。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：无。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：无。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：无。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -             |
| 2  | 央行票据      | -              | -             |
| 3  | 金融债券      | 83,290,000.00  | 27.79         |
|    | 其中：政策性金融债 | 83,290,000.00  | 27.79         |
| 4  | 企业债券      | 203,139,614.00 | 67.78         |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -             |
| 6  | 中期票据      | 39,905,000.00  | 13.31         |
| 7  | 可转债       | -              | -             |
| 8  | 其他        | -              | -             |
| 9  | 合计        | 326,334,614.00 | 108.88        |

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 (张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------|------|--------|------|---------------|
|----|------|------|--------|------|---------------|

|   |        |          |         |               |       |
|---|--------|----------|---------|---------------|-------|
| 1 | 018001 | 国开 1301  | 400,000 | 41,092,000.00 | 13.71 |
| 2 | 140211 | 14 国开 11 | 200,000 | 22,198,000.00 | 7.41  |
| 3 | 122559 | 12 昆交 02 | 200,000 | 21,600,000.00 | 7.21  |
| 4 | 124505 | 14 嘉市镇   | 200,000 | 21,214,000.00 | 7.08  |
| 5 | 124387 | 13 湛江基投债 | 200,000 | 20,558,000.00 | 6.86  |

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

注：无。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：无。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：无。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**8.11.1 本期国债期货投资政策**

注：无。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：无。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

注：无。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

**8.12.2**

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额       |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | 8,258.88 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 3 | 应收股利  | -             |
| 4 | 应收利息  | 9,746,168.57  |
| 5 | 应收申购款 | 10,002,000.00 |
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 19,756,427.45 |

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别        | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额    | 持有人结构          |        |               |        |
|-------------|----------|--------------|----------------|--------|---------------|--------|
|             |          |              | 机构投资者          |        | 个人投资者         |        |
|             |          |              | 持有份额           | 占总份额比例 | 持有份额          | 占总份额比例 |
| 华泰柏瑞稳健收益债券A | 238      | 785,859.22   | 171,738,722.49 | 91.82% | 15,295,771.95 | 8.18%  |
| 华泰柏瑞稳健收益债券C | 74       | 1,011,884.04 | 72,530,718.83  | 96.86% | 2,348,700.10  | 3.14%  |
| 合计          | 312      | 839,467.67   | 244,269,441.32 | 93.26% | 17,644,472.05 | 6.74%  |

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 华泰柏瑞稳健收益债券 A     | 华泰柏瑞稳健收益债券 C   |
|--------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2012 年 12 月 4 日）基金份额总额 | 1,735,780,960.90 | 523,215,969.78 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 568,141,456.68   | 61,111,592.61  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 700,636,778.91   | 309,046,007.79 |
| 减:本报告期基金总赎回份额                  | 1,081,743,741.15 | 295,278,181.47 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -                | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 187,034,494.44   | 74,879,418.93  |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2014 年 5 月 15 日，公司任命高山先生为公司副总经理，高山先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试，其任命已在中国证券投资基金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2014 年 2 月 14 日中国银行股份有限公司公告，自 2014 年 2 月 13 日起，陈四清先生担任本行行长。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司。报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 100,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 3 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

无。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 债券回购交易            |                | 权证交易 |              |
|------|----------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中金公司 | 343,773,048.48 | 63.05%       | -                 | -              | -    | -            |
| 华泰证券 | 155,202,851.20 | 28.47%       | 27,426,500,000.00 | 93.25%         | -    | -            |
| 方正证券 | 42,166,295.33  | 7.73%        | 1,986,300,000.00  | 6.75%          | -    | -            |
| 招商证券 | 4,054,571.50   | 0.74%        | -                 | -              | -    | -            |

注：

#### 1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度

保密的要求。

4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。

5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

华泰柏瑞基金管理有限公司  
2015年3月31日