

# 华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金 2015 年半年度报告 摘要

2015 年 6 月 30 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 8 月 29 日

## § 1 重要提示

### 1.1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 28 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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞丰汇债券	
基金主代码	000421	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 12 月 11 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	225,150,493.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞丰汇债券 A	华泰柏瑞丰汇债券 C
下属分级基金的交易代码:	000421	000422
报告期末下属分级基金的份额总额	164,973,536.43 份	60,176,957.36 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	本基金采用以下投资策略 1、类属资产配置策略：综合考虑各证券市场的资金供求状况、流动性水平以及走势的相关性，在基金合同约定比例的范围内，动态调整基金大类资产的配置比例；2、债券投资策略：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。3、新股认购策略：本基金将深入研究上市公司新股的基本面因素、收益率、中签率以及股票市场整体估值水平，发掘新股的内在价值，综合考虑基金资产的周转率、成本费用
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

### 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

登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华泰柏瑞丰汇债券 A	华泰柏瑞丰汇债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日-2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	24,402,197.95	1,803,739.38
本期利润	30,343,716.65	-2,901,168.35
加权平均基金份额本期利润	0.0559	-0.0453
本期基金份额净值增长率	5.78%	5.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0610	0.0579
期末基金资产净值	175,040,388.93	63,663,265.38
期末基金份额净值	1.061	1.058

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

华泰柏瑞丰汇债券 A

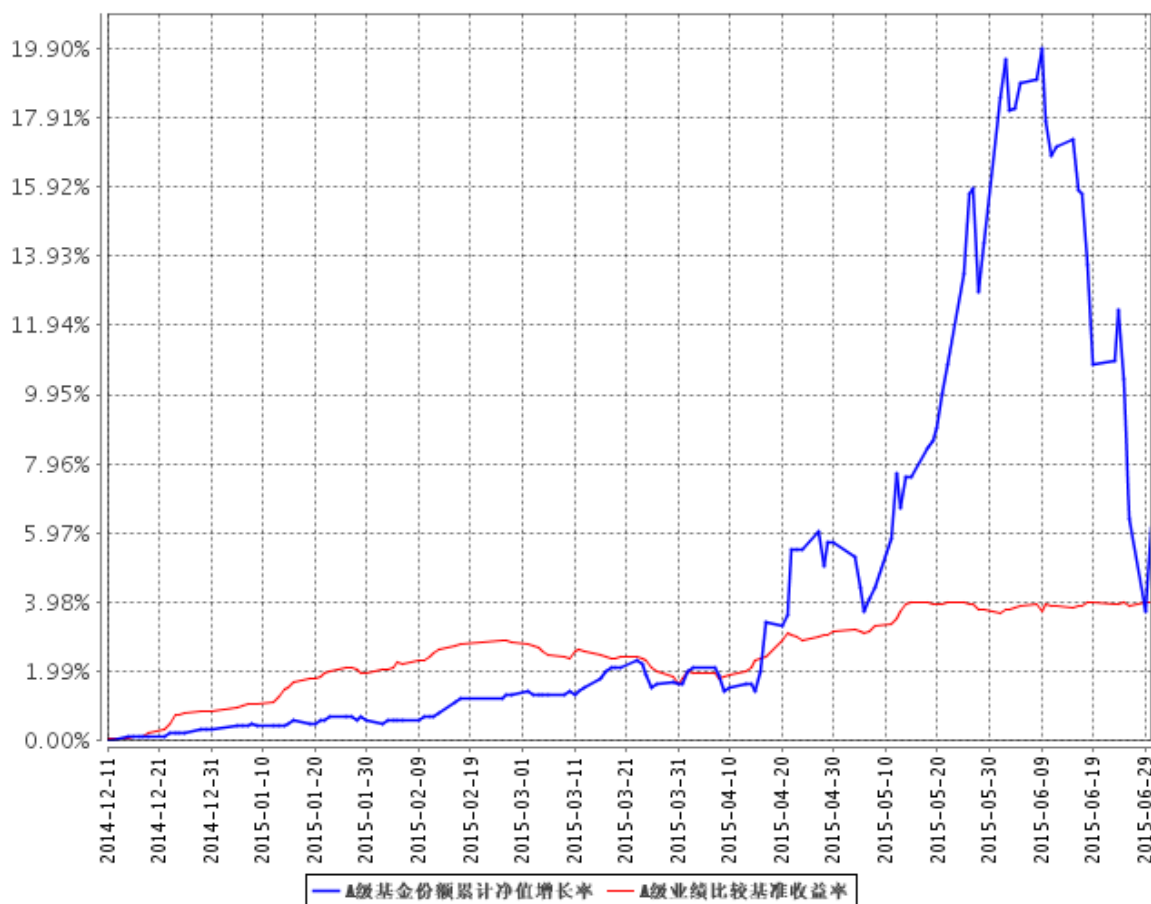
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-7.17%	1.72%	0.28%	0.09%	-7.45%	1.63%
过去三个月	4.43%	1.26%	2.35%	0.10%	2.08%	1.16%
过去六个月	5.78%	0.91%	3.11%	0.09%	2.67%	0.82%
自基金合同生效起至今	6.10%	0.86%	3.99%	0.09%	2.11%	0.77%

华泰柏瑞丰汇债券 C

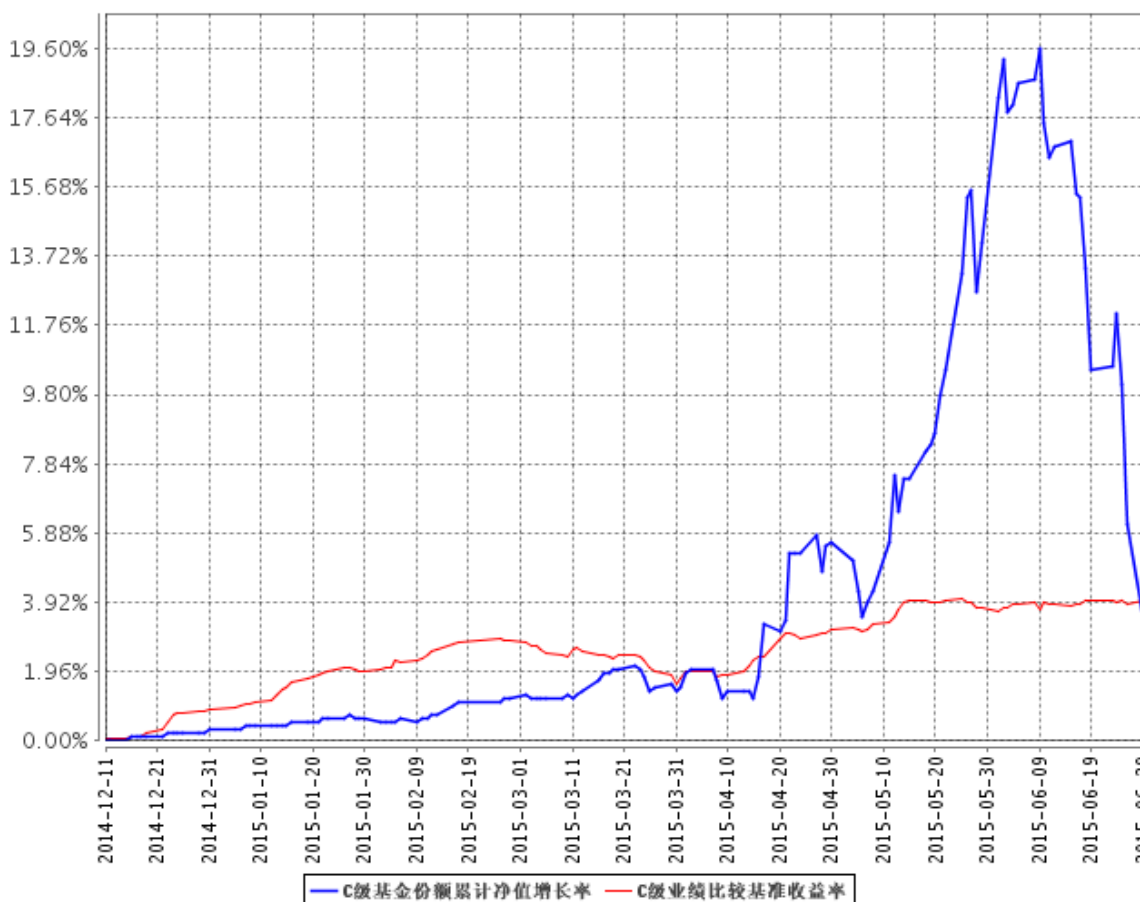
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-7.27%	1.72%	0.28%	0.09%	-7.55%	1.63%
过去三个月	4.34%	1.26%	2.35%	0.10%	1.99%	1.16%
过去六个月	5.48%	0.91%	3.11%	0.09%	2.37%	0.82%
自基金合同生效起至今	5.80%	0.86%	3.99%	0.09%	1.81%	0.77%

### 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 2014 年 12 月 11 日至 2015 年 6 月 30 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十二条（二）投资范围中规定的各项比例，本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

## § 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（原友邦华泰基金管理有限公司）。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、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金和华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金。截至 2015 年 6 月 30 日，公司的公募基金管理规模为 766.62 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		
陈东	固定收益部副总监、本基金的基金经理	2014 年 12 月 11 日	-	8 年	陈东先生，硕士，曾任深圳发展银行（现已更名为平安银行）总行金融市场部固定收益与衍生品交易员，负责本外币理财产品的



					<p>资产管理 工作；中 国工商银 行总行金 融市场部 人民币债 券交易员， 负责银行 账户的自 营债券投 资工作。</p> <p>2012 年 9 月加入 华泰柏瑞 基金管理 有限公司。</p> <p>2012 年 11 月起任 华泰柏瑞 金字塔稳 本增利债 券型证券 投资基金 基金经理，</p> <p>2013 年 9 月起任 华泰柏瑞 丰盛纯债 债券型证 券投资基 金的基金 经理，</p> <p>2013 年 11 月起任 华泰柏瑞 季季红债 券型证券 投资基金 的基金经 理，</p> <p>2014 年 12 月起任 华泰柏瑞 丰汇债券 型证券投</p>
--	--	--	--	--	--

					资基金的 基金经理， 2015 年 1 月起任 固定收益 部副总监。
--	--	--	--	--	---

## 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《信用增利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。

### 4.3.2 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

半年，央行通过定向工具和传统货币政策工具对市场投放流动性并引导社会融资成本下行。随着经济指标的下滑，央行货币政策放松力度开始逐渐加码。前 4 个月，央行主动投放的流动性超过 2 万亿。货币市场利率的下行对中长期债券收益率和贷款利率的传导并不顺畅，中长端利率并没有伴随短融利率下行，5-6 月收益率曲线整体变得比较陡峭，长端收益率上升。权益市场上半年整体表现良好，六月中旬开始，由于场外融资杠杆较大，风险逐渐显现，权益市场迅速下跌进入调整期。

投资策略上，基金以短久期品种为配置主体，并配置一定仓位的转债资产，在控制风险的前提下，博取权益价格波动中的交易机会。

### 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 1.061 元和 1.058 元，分别上涨 5.78% 和 5.48%，同期本基金的业绩比较基准上涨 3.11%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，债券市场预计将呈现整体震荡与短期受政策刺激上涨并存的局面；权益市场随着风险逐渐释放与政策的不断刺激，将逐步筑底反弹。

策略上，债券部分将保持短久期的特征，并把握长久期品种的阶段性机会；权益上，将继续

以一定仓位参与权益市场价格波动的交易机会。

#### 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，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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 70%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 4.8 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞丰汇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、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金

份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		388,671.69	982,040,302.02
结算备付金		3,017,606.11	-
存出保证金		36,342.57	-
交易性金融资产		259,243,688.56	129,243,997.70
其中：股票投资		48,279,817.26	-
基金投资		-	-
债券投资		210,963,871.30	129,243,997.70
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		3,498,943.20	-
应收利息		3,275,762.79	5,572,615.18
应收股利		-	-
应收申购款		20,512.13	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		269,481,527.05	1,116,856,914.90
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 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		27,000,000.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,394,073.17	-
应付管理人报酬		143,352.67	427,473.75
应付托管费		40,957.90	122,135.34
应付销售服务费		13,994.36	35,486.83
应付交易费用		13,507.29	-
应交税费		-	-
应付利息		1,349.93	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		170,637.42	-
负债合计		30,777,872.74	585,095.92
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		225,150,493.79	1,113,048,868.88
未分配利润		13,553,160.52	3,222,950.10
所有者权益合计		238,703,654.31	1,116,271,818.98
负债和所有者权益总计		269,481,527.05	1,116,856,914.90

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，华泰柏瑞丰汇债券 A 份额净值 1.061 元，份额总额 164973536.43 份；华泰柏瑞丰汇债券 C 份额净值 1.058 元，份额总额 60176957.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		31,739,248.65
1.利息收入		13,286,143.45
其中：存款利息收入		1,318,779.17
债券利息收入		10,142,739.86
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,824,624.42
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		16,977,823.25
其中：股票投资收益		2,025,239.00
基金投资收益		-

债券投资收益		14,496,085.54
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		456,498.71
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		1,236,610.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		238,670.98
<b>减：二、费用</b>		<b>4,296,700.35</b>
1. 管理人报酬		2,194,051.15
2. 托管费		626,871.69
3. 销售服务费		130,433.15
4. 交易费用		21,389.38
5. 利息支出		1,128,632.36
其中：卖出回购金融资产支出		1,128,632.36
6. 其他费用		195,322.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>27,442,548.30</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>27,442,548.30</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	1,113,048,868.88	3,222,950.10	1,116,271,818.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	27,442,548.30	27,442,548.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-887,898,375.09	-17,112,337.88	-905,010,712.97

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	185,363,664.55	15,016,962.14	200,380,626.69
2.基金赎回款	-1,073,262,039.64	-32,129,300.02	-1,105,391,339.66
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）	225,150,493.79	13,553,160.52	238,703,654.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_ 韩勇 \_\_\_\_\_

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_ 房伟力 \_\_\_\_\_

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_ 赵景云 \_\_\_\_\_

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞丰汇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《关于核准华泰柏瑞丰汇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《华泰柏瑞丰汇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 1112853885.27 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,《华泰柏瑞丰汇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 1113048868.88 份基金份额,其中认购资金利息折合 194983.61 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《华泰柏瑞丰汇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中债综合指数。

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 8 月 29 日批准报出。

## 6.4.2 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”）、中国证监会公告[2010]5 号《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〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款

项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实

现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

（2）在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 6.4.6 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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

注：本报告期本基金与关联方未进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 权证交易

注：本报告期本基金与关联方未进行权证交易。

#### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注：本报告期本基金无应支付关联方的佣金。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,194,051.15	-
其中：支付销售机构的客户维护费	1,007,126.74	-

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。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	626,871.69	-

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。

### 6.4.8.2.3 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		
	2015年1月1日至2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞丰汇债券 A	华泰柏瑞丰汇债券 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	9,593.04	9,593.04
中国银行股份有限公司	-	118,616.88	118,616.88
合计	-	128,209.92	128,209.92
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞丰汇债券 A	华泰柏瑞丰汇债券 C	合计

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。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.8.4.2 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：本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30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	388,671.69	62,462.76	-	-

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。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.9 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 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 27000000 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 投资组合报告

### 7.1 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	48,279,817.26	17.92
	其中：股票	48,279,817.26	17.92
2	固定收益投资	210,963,871.30	78.29
	其中：债券	210,963,871.30	78.29
	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	3,406,277.80	1.26
7	其他各项资产	6,831,560.69	2.54
8	合计	269,481,527.05	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	14,665,293.60	6.14
C	制造业	22,585,474.94	9.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,029,048.72	4.62
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	48,279,817.26	20.23

### 7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603993	洛阳钼业	1,184,510	14,640,543.60	6.13
2	600023	浙能电力	1,086,766	10,780,718.72	4.52
3	600875	东方电气	416,666	8,529,153.02	3.57
4	002521	齐峰新材	525,911	7,320,681.12	3.07
5	000729	燕京啤酒	638,252	6,637,820.80	2.78
6	601985	中国核电	19,000	248,330.00	0.10
7	603589	口子窖	2,000	50,680.00	0.02
8	300473	德尔股份	500	33,190.00	0.01
9	603979	金诚信	1,000	24,750.00	0.01
10	601968	宝钢包装	1,000	13,950.00	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603993	洛阳钼业	15,410,475.10	1.38
2	600023	浙能电力	12,734,975.68	1.14
3	002521	齐峰新材	10,770,657.28	0.96
4	600875	东方电气	8,283,320.08	0.74
5	000729	燕京啤酒	7,442,038.45	0.67
6	601985	中国核电	64,410.00	0.01
7	603589	口子窖	32,000.00	0.00
8	603979	金诚信	17,190.00	0.00
9	300473	德尔股份	14,380.00	0.00
10	601968	宝钢包装	3,080.00	0.00

### 7.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600023	浙能电力	5,544,439.00	0.50

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	54,772,526.59
卖出股票收入（成交）总额	5,544,439.00

## 7.5 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	14,345,800.00	6.01
	其中：政策性金融债	14,345,800.00	6.01
4	企业债券	55,775,946.80	23.37
5	企业短期融资券	100,658,000.00	42.17
6	中期票据	17,288,000.00	7.24
7	可转债	22,896,124.50	9.59
8	其他	-	-
9	合计	210,963,871.30	88.38

## 7.6 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	113008	电气转债	123,130	22,291,455.20	9.34
2	041554008	15 河钢 CP001	200,000	20,182,000.00	8.45
3	011599040	15 南方水泥 SCP002	200,000	20,164,000.00	8.45
4	011599042	15 沪打捞 SCP001	200,000	20,150,000.00	8.44
5	011599055	15 粤珠江 SCP001	200,000	20,140,000.00	8.44

## 7.7 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：本基金本报告期期末未持有资产支持证券。

## 7.8 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：本基金本报告期期末未持有贵金属。

## 7.9 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：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	36,342.57
2	应收证券清算款	3,498,943.20
3	应收股利	-
4	应收利息	3,275,762.79
5	应收申购款	20,512.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,831,560.69

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
华泰柏瑞丰汇债券 A	743	222,037.06	25,293,997.80	15.33%	139,679,538.63	84.67%
华泰柏瑞丰汇债券 C	194	310,190.50	51,369,863.01	85.36%	8,807,094.35	14.64%
合计	937	240,288.68	76,663,860.81	34.05%	148,486,632.98	65.95%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 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。

### 8.4 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：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞丰汇债券 A	华泰柏瑞丰汇债券 C
基金合同生效日（2014 年 12 月 11 日）基金份额总额	1, 113, 048, 868. 88	-
本报告期期初基金份额总额	951, 334, 388. 43	161, 714, 480. 45
本报告期基金总申购份额	130, 904, 165. 39	54, 459, 499. 16
减：本报告期基金总赎回份额	917, 265, 017. 39	155, 997, 022. 25
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	164, 973, 536. 43	60, 176, 957. 36

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

2015 年 5 月 13 日，公司通过股东会书面决定同意姜治平先生辞去董事一职并任命杨智雅女士为董事。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。



## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

## 10.6 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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	1	5,544,439.00	100.00%	5,047.87	100.00%	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、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。

### 10.7.2 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	287,170,867.97	93.99%	16,629,400,000.00	99.70%	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	18,356,894.78	6.01%	50,300,000.00	0.30%	-	-

华泰柏瑞基金管理有限公司  
2015 年 8 月 29 日