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:2012年8月28日

华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30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2012年8月27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2012年1月1日起至2012年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞信用增利债券
基金主代码	164606
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2011年9月22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	211,952,339.56份
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011-12-12

2.2 基金产品说明

投资目标	通过系统的信用分析,优化投资组合,在合理控制风险的基础上,追求资金资产的严期稳健增值。
投资策略	1.大类资产配置策略:将深入研究宏观经济趋势以及货币政策导向,重点关注GDP增长率、通货膨胀率、利率水平以及货币供应量等宏观经济指标,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,从而优化资产组合的风险收益水平。2、债券投资策略:将主要投资于固定收益类金融工具,其中信用债又将成为固定收益类金融工具中的重点配置标的。在固定收益类金融工具的投资上,将在对未来利率趋势、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面分析的基础上,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,以获取债券市场的长期稳定收益。3.新股认购策略: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、成本费用率和市场资金的供需关系,从而制定相应的新股申购策略。4.权证投资策略:将对权证标的证券的基本面进行充分研究,综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价,以期获得稳健的当期收益。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的中等风险品种,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	唐州歆
	联系电话	021-38601777	010-66594855
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgcxpl@bank-of-china.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	http://www.huatai-pb.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012年1月1日-2012年6月30日)
本期已实现收益	2,816,908.67
本期利润	4,062,296.33
加权平均基金份额本期利润	0.0192
本期基金份额净值增长率	1.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0123
期末基金资产净值	217,149,015.49
期末基金份额净值	1.025

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。

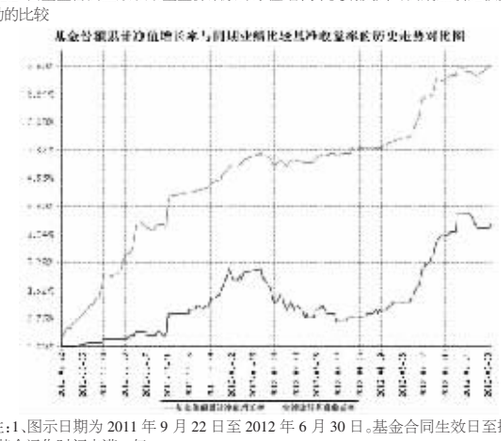
3、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

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	0.29%	0.12%	0.34%	0.07%	-0.05%	0.05%
过去三个月	2.50%	0.10%	2.12%	0.08%	0.38%	0.02%
过去六个月	1.99%	0.11%	3.00%	0.07%	-1.01%	0.04%
自基金合同生效日起至今	3.31%	0.09%	7.61%	0.09%	-4.30%	0.00%

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



注:1、图示日期为2011年9月22日至2012年6月30日。基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。

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十六条(二)投资范围中规定的各项比例,投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%,其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于80%;投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过20%;基金转入开放其后现金或者到期日在一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和华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金。截至2012年6月30日,公司的公募基金管理规模为367.75亿元。

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		
沈涛	本基金的基金经理	2011年9月22日	-	19年	沈涛先生,经济学博士。2005年9月至2007年11月任易方达基金管理有限公司月月收益中短期债券投资基金基金经理。2007年11月加入本公司,2008年3月起任华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型基金基金经理,2009年5月起兼任华泰柏瑞货币市场基金基金经理,2011年9月起兼任华泰柏瑞信用增利债券型基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公司整体公平交易制度的执行情况

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,通过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次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,在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

整个上半年,经济增速继续放缓。在利率市场化以及对经济改善预期乐观的共同作用下,信用债成为市场表现的明星。继一季度出色表现之后,中低等级品种收益率继续大幅度下滑。其中,五年期AA级企业债收益率从四月初的6.2%附近下降到季末的5.3%附近,而尽管降息利率债和高等级信用债的收益率下滑有限。在流动性总体趋缓的前提下,投资者对信用债的流动性要求明显放松,收益率的高低几乎成为阶段性选择唯一的关键要素。由于对通胀的谨慎,利率品种的收益率下降空间预期较小。

基金在二季度将一部分中低评级的信用债获利了结,重新增加了中高级的信用债品种,以期在经济下滑的趋势中规避风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至2012年6月30日,基金单位份额净值增长率为1.99%,同期业绩比较基准的收益率为3%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段,我们仍然对债券市场抱有乐观的信心。一方面,经济增速的下滑的态势没有改变,中期趋缓的态势愈加明朗,随着企业利润的下滑,投资者风险偏好应该会进一步降低;另一方面,六月以来物价形势变化明显,通胀在下半年将有较大回落,这也支持债券整体收益率进一步下降。当投资者对经济增长的乐观预期有所减退后,低评级信用债的流动性风险可能会被市场重新认识。当然,我们也要关注到,尽管政府越来越倾向于不再采用一味以财政货币的高投入来刺激经济的方法,但流动性的收缩仍能够对债券市场的收益率形成阶段性的考验。

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、金融工程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,本基金收益每年最多分配12次,每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的60%;封闭期间本基金每年度收益至少分配1次,分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的90%。本基金已于2011年1月对可分配利润实施了分红,每10份基金份额派发现金红利0.08元。

§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(以下简称"本托管人")在对华泰柏瑞信用增利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:华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金

报告截止日:2012年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资 产:			
银行存款		1,084,100.95	158,956.32
结算备付金		70,746.97	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		300,948,800.00	280,950,100.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		300,948,800.00	280,950,100.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	92,842.78
应收利息		6,884,084.56	4,530,950.99
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		1,467.25	-
资产总计		308,989,199.73	285,732,850.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
负 债:			
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		90,999,480.00	70,499,535.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		124,665.40	127,235.70
应付托管费		35,618.72	36,353.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		11,074.00	6,293.80
应交税费		352,000.00	101,000.00
应付利息		77,396.11	55,754.84
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		239,950.01	124,340.03
负债合计		91,840,184.24	70,950,512.43
所有者权益:			
实收基金		211,952,339.56	211,952,339.56
未分配利润		5,196,675.93	2,829,998.10
所有者权益合计		217,149,015.49	214,782,337.66
负债和所有者权益总计		308,989,199.73	285,732,850.09

注:1. 报告截止日2012年6月30日,基金份额净值1.025元,基金份额总额211,952,339.56份。

2. 本财务报表上年度的实际编制期间为2011年9月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日。

6.2 利润表

会计主体:华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		6,414,680.78
1.利息收入		5,600,656.69
其中:存款利息收入		41,830.21
债券利息收入		5,555,138.96
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,687.52
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-433,321.88
其中:股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益		-433,321.88
资产支持证券投资收益		-
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)		1,245,387.66
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,958.31
减:二、费用		2,352,384.45
1.管理人报酬		744,977.48
2.托管费		212,850.83
3.销售服务费		-
4.交易费用		9,830.04
5.利息支出		1,181,406.21
其中:卖出回购金融资产支出		1,181,406.21
6.其他费用		203,319.89
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		4,062,296.33
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		4,062,296.33

注:本基金的基金合同生效日为2011年9月22日,无上年可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	211,952,339.56	2,829,998.10	214,782,337.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	4,062,296.33	4,062,296.33
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-1,695,618.50	-1,695,618.50
五、期末所有者权益(基金净值)	211,952,339.56	5,196,675.93	217,149,015.49

注:本基金的基金合同生效日为2011年9月22日,无上年可比期间数据。

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_____ _____房伟力_____ _____陈培_____

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞信用增利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[2011]第526号《关于核准华泰柏瑞信用增利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《华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金,本基金合同生效后三年内为封闭期,封闭期间投资者不能申购、赎回和转换本基金份额,但可在本基金上市交易后通过证券交易所转让基金份额。在封闭期届满日前的30个工作日之前,基金管理人将以现场或通讯方式召开基金份额持有人大会,投票决定是否同意本基金继续封闭三年。如果基金份额持有人大会依据有关法律法规和本基金合同的相关规定成功召开并决定继续封闭,经中国证监会核准,则本基金继续封闭,即在上个封闭期届满后的次日起开始下一个三年封闭期;如果基金份额持有人大会未能依据有关法律法规和本基金合同的相关规定召开或在基金份额持有人大会上本基金继续封闭的决议未获得通过,则本基金在上个封闭期届满后的次日起转为上市开放式基金(LOF),投资者可进行基金份额的申购、赎回。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集资本人民币211,839,238.45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(2011)第353号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金合同》于2011年9月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为211,952,339.56份,其中认购资金利息折合113,101.11份。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。

经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上[2011]第367号文审核同意,本基金份额86,540,176.00份于2011年12月12日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具,主要投资于固定收益类资产,包括企业债券、公司债券、短期融资券、地方政府债券、商业银行金融债券、商业银行次级债、可转换公司债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、债券回购、国债、中央银行票据、政策性金融债券、银行存款,以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金也可投资于股票、权证以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他权益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类金融工具,但可以参与一级市场股票首次公开发行或新股增发,并可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于分离交易可转债而产生的权证。本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于80%,其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于80%;投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过20%;基金转入开放期后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的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2012年8月28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》、《华泰柏瑞信用增利债券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

本基金2012年1月1日至2012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2012年6月30日的财务状况以及2012年1月1日至2012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

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。

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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

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

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

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。

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:无。

6.4.8.1.2 权证交易

注:无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注:无。

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 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	744,977.48
其中:支付销售机构的客户维护费	184,639.90

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0.70%的年费率计提,计算方法如下:

H = E × 0.70% ÷ 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 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	212,850.83

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 × 0.2% ÷ 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

注:无。

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

单位:人民币元

本期 2012年1月1日至2012年6月30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	-	-	-	-	189,500,000.00	115,015.08

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

份额单位:份

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金合同生效日(2011年9月22日)持有的基金份额	20,001,944.00
期初持有的基金份额	20,001,944.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减:期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	20,001,944.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.44%

注:基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司在本会计期间认购本基金的交易委托华泰证券办理,投资本基金的费用均参照本基金的基金管理人公布的费率收取。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券	30,001,250.00	14.15%	30,001,250.00	14.15%

注:华泰证券投资本基金的费用均参照本基金的基金管理人公布的费率收取。

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 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,084,100.95	41,549.01

注:本报告期,基金托管人中国银行股份有限公司保管的银行存款按银行间同业存款利率计息。

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:无

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注:无

6.4.9 期末(2012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:无

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:截至本报告期末,本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

截至本报告期末2012年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额79,999,480.00元

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
1282055	12三峡MTN1	2012年7月5日	100.57	100,000	10,057,000.00
1282036	12铁二股MTN1	2012年7月5日	104.40	100,000	10,440,000.00
1182400	11平煤化MTN3	2012年7月5日	103.74	100,000	10,374,000.00
1182402	11盘江MTN1	2012年7月5日	105.72	100,000	10,572,000.00
88065	08中国有色债	2012年7月3日	102.22	100,000	10,222,000.00
1180145	11同煤债01	2012年7月3日	105.76	100,000	10,576,000.00
1180147	11铁道03	2012年7月3日	103.88	100,000	10,388,000.00
1180177	11国网债01	2012年7月3日	102.50	100,000	10,250,000.00
合计				800,000	82,879,000.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,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11,000,000元,于2012年7月2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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	300,948,800.00	97.40
	其中:债券	300,948,800.00	97.40
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,154,847.92	0.37
6	其他各项资产	6,885,551.81	2.23
7	合计	308,989,199.73	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

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

注:本基金本报告期末未持有股票。

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

注:无。

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

注:无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金本报告期未买卖股票。

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	9,417,600.00	4.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	46,722,000.00	21.52
	其中:政策性金融债	46,722,000.00	21.52
4	企业债券	78,224,200.00	36.02
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	166,585,000.00	76.71
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	300,948,800.00	138.59

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	080216	08国开16	200,000	21,030,000.00	9.68
2	1182277	11中铁建MTN1	100,000	10,882,000.00	5.01
3	1182276	11中铁股MTN2	100,000	10,834,000.00	4.99
4	070225	07国开25	100,000	10,602,000.00	4.88
5	1182318	11广百MTN1	100,000	10,594,000.00	4.88

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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。

7.9.2

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。

7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,884,084.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	1,467.25
8	其他	-
9	合计	6,885,551.81

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

§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

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
3,413	62,101.48	105,702,711.83	49.87%	106,249,627.73	50.13%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	华泰证券股份有限公司	30,001,250.00	27.88%
2	华泰柏瑞基金管理有限公司	20,001,944.00	18.59%
3	安信证券-农行-安信理财1号债券型集合资产管理计划	8,307,934.00	7.72%
4	全国社保基金一零零三组合	8,277,376.00	7.69%
5	全国社保基金八零三组合	7,621,864.00	7.08%
6	国联证券股份有限公司	4,802,212.00	4.46%
7	海康人寿保险有限公司	2,297,353.00	2.14%
8	海康人寿保险有限公司	1,652,611.00	1.54%
9	博方湖	1,398,898.00	1.30%
10	中信信托有限责任公司