华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9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
报告送出日期:2014年10月24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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

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	2005年4月27日
报告期末基金份额总额	7,076,924,653.20份
投资目标	主要通过股票选择,辅以适度的大类资产配置调整,追求管理资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票类资产为主要投资工具,通过精选个股获取资产的长期增值;以债券类资产作为降低组合风险的策略性投资工具,通过适当的大类资产配置来降低组合的系统性风险。
业绩比较基准	中信标普300指数×70%+中信国债指数×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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	212,637,748.13
2.本期利润	540,100,649.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.0716
4.期末基金资产净值	4,634,544,645.56
5.期末基金份额净值	0.6549

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	12.95%	0.83%	9.41%	0.61%	3.54%	0.22%

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2005年4月27日至2014年9月30日。1.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%,债券投资为基金净资产的0%-40%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
沈雪峰	本基金的基金经理、投资部总监	2014年8月8日	-	20	经济学硕士。历任:安徽省国际信托投资公司投资银行部、股票自营部投资经理;华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员;亚洲证券资产管理总部副总经理兼固定收益证券管理总部副总经理、研究所副所长;华富基金管理公司深圳研究员、基金经理、投研部副总监。后重新加入华安基金管理公司,任基金经理。2012年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,2013年2月起任华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金的基金经理。
张慧	本基金的基金经理	2013年9月16日	-	6	经济学硕士,6年证券从业经历。2007年7月至2010年6月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010年6月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2013年9月起任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金的基金经理。
汪晖	本基金的基金经理、投资部总监	2009年11月18日	2014年8月8日	20	汪晖先生,20年证券投资从业经历,工学硕士、经济学硕士。2004年7月加入本公司,曾任华泰柏瑞(原友邦华泰)稳本增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金、华泰柏瑞(原友邦华泰)价值增长股票型证券投资基金的基金经理。2009年8月起,任华泰柏瑞投资部副总监。2009年11月18日起任华泰柏瑞(原友邦华泰)盛世中国股票型证券投资基金的基金经理。2009年12月起任投资部总监。2011年2月起任投资总监。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、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

4.3.1 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。其次集中交易室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。本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,市场整体非常活跃,热点不断,成长股、价值股、主题股依次上涨。沪深300指数上涨13.20%,创业板综合指数上涨18.31%,中证500指数上涨26.4%。"微刺激"后,7月经济阶段性改善,海外资金持续流入,监管股补涨,8月中下旬以后,经济反弹逐步被证伪,外资流入放缓,改革预期提升市场偏好,市场进入监管搭台,成长和主题唱戏的结构性牛市。

本基金在投资策略上坚持成长风格,在配置上偏重于信息服务、消费电子、军工、医药生物等产业,同时保持高仓位运作,投资期内取得了较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.6549元,累计净值为2.728元,本报告期内基金份额净值上涨12.95%,本基金的业绩比较基准上涨9.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,本基金认为市场存在调整风险,市场的风险偏好有阶段性下降的可能。近期的宏观经济数据大多低于预期,而上市公司也即将进入季报期,三季度业绩的环比趋势和对全年的展望需要重新进行研判,估值和业绩的缺口有可能收窄。流动性方面,AH溢价基本消失导致"沪港通"的影响减弱,融资融券的获利盘存在放大市场波动的可能,美元指数走强使得外资也有流出的压力,但由于央行的定向宽松,以及实体经济偏弱,使得国内流动性总体不会太紧。

本基金认为市场的驱动力来自结构性创新和改革预期,而非经济数据。尽管短期存在调整的风险,但市场上行的逻辑并未被破坏。因此,市场调整之后仍存在上行的机会。在经济减速不可避免的宏观背景下,创新、并购、注入、效率提升是企业抵御盈利放缓的措施,也是本基金筛选标的的思路。

从渗透率的角度,本基金重点关注的创新领域主要有:(移动)互联网应用(包括支付、医疗等),金融信息化(包括银行信息化、供应链金融,互联网金融等),国产化(包括IT国产化和半导体国产化),细胞免疫治疗,新能源汽车,机器人,车联网等。在改革与转型方面,国企改革、体制改革、传统行业向新兴产业转型值得自下而上的挖掘。对于年初以来股价表现较差、但成长逻辑仍在、估值压力已经消化的成长蓝筹,本基金将在四季度关注其估值修复的机会。

针对市场的波动,本基金可能采取一定的择时操作,但行业和个股的选择更为重要。本基金将围绕创新与改革转型布局,择机增持相关标的,力争获得超额收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,161,767,735.05	88.84
	其中:股票	4,161,767,735.05	88.84
2	固定收益投资	80,179,000.00	1.71
	其中:债券	80,179,000.00	1.71
	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	404,022,311.81	8.62
7	其他资产	38,702,283.58	0.83
8	合计	4,684,671,330.44	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11,836,064.76	0.26
B	采矿业	42,935,557.26	0.93
C	制造业	2,432,577,341.87	52.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	66,167,261.57	1.43
E	建筑业	79,835,757.98	1.72
F	批发和零售业	90,471,613.70	1.95
G	交通运输、仓储和邮政业	16,598,738.92	0.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	612,280,604.64	13.21
J	金融业	263,002,676.49	5.67
K	房地产业	38,577,338.92	0.83
L	租赁和商务服务业	54,353,546.72	1.17
M	科学研究和技术服务业	125,194,000.00	2.70
N	水利、环境和公共设施管理业	22,304,948.96	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,856,912.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	301,775,371.26	6.51
S	综合	-	-
	合计	4,161,767,735.05	89.80

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600536	中国软件	7,841,953	223,338,821.44	4.82
2	300133	华策影视	5,836,874	200,263,146.94	4.32
3	002268	卫士通	3,209,818	163,764,914.36	3.53
4	300274	阳光电源	7,498,180	147,714,146.00	3.19
5	000066	长城电脑	19,981,080	118,887,426.00	2.57
6	600580	卧龙电气	10,506,678	103,700,911.86	2.24
7	600872	中炬高新	9,350,000	102,850,000.00	2.22
8	002699	美盛文化	3,921,504	99,135,621.12	2.14
9	300024	机器人	2,766,000	99,022,800.00	2.14
10	000748	长城信息	3,200,906	94,106,636.40	2.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,179,000.00	1.73
	其中:政策性金融债	80,179,000.00	1.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	80,179,000.00	1.73

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140430	14农发30	500,000	50,110,000.00	1.08
2	140207	14国开07	300,000	30,069,000.00	0.65

5.6 报告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:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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、处罚的情形。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,241,326.18
2	应收证券清算款	35,514,065.58
3	应收股利	-
4	应收利息	1,873,037.52
5	应收申购款	73,854.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,702,283.58

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300133	华策影视	200,263,146.94	4.32	停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	7,684,434,081.39
报告期期间基金总申购份额	535,422,557.07
减:报告期期间基金总赎回份额	1,142,931,985.26
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	7,076,924,653.20

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》

4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

8.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问,可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线:400-888-0001(免长途费) 021-3878 4638 公司网址:www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2014年10月24日

华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9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
报告送出日期:2014年10月24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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞价值增长股票
交易代码	460005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月16日
报告期末基金份额总额	187,180,404.52份
投资目标	本基金通过投资于市场估值相对较低、基本面良好、能够为股东持续创造价值的公司,重点关注其中基本面有良性变化、市场认同度逐步提高的优质个股,在充分控制投资组合风险的前提下,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	基于对宏观经济和投资环境的分析和预测,全面评估证券市场各大类资产的中长期预期风险收益率,确定基金资产在股票、债券和现金及其他资产之间的配置比例,适度控制系统性风险。主要通过积极主动地精选为股东持续创造价值的股票来获取超额收益。重点投资于基本面趋势良好或出现良性转折、价格相对低估、基本面趋势认同度逐步或加速提高的优质股票,辅以适度的行业配置调整来优化股票的选择和配置的权重。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×20%
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	13,210,379.86
2.本期利润	25,964,754.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.1306
4.期末基金资产净值	238,814,193.14
5.期末基金份额净值	1.2759

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	11.64%	0.99%	10.72%	0.72%	0.92%	0.27%

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2008年7月16日至2014年9月30日。

1.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、(十)2.2、基金投资组合比例限制中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金资产的60%-95%,现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
沈雪峰	本基金的基金经理、投资部总监	2013年2月7日	-	20	经济学硕士。历任:安徽省国际信托投资公司投资银行部、股票自营部投资经理;华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员;亚洲证券资产管理总部副总经理兼固定收益证券管理总部副总经理、研究所副所长。华富基金管理公司深圳研究员、基金经理、投研部副总监。后重新加入华安基金管理公司,任基金经理。2012年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,2013年2月起任华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金的基金经理,2014年5月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2014年7月起任投资部总监。2014年8月任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金的基金经理。
方纬	本基金的基金经理	2014年8月22日	-	11	经济学硕士。2003年9月至2005年1月任上海金信研究所研究员;2005年1月至2007年2月任万家基金管理有限公司高级研究员;2007年2月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2014年8月任华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、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

4.3.1 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。其次集中交易室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。本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,市场整体非常活跃,热点不断,成长股、价值股、主题股依次上涨。沪深300指数上涨13.20%,创业板综合指数上涨18.31%,中证500指数上涨26.4%。"微刺激"后,7月经济阶段性改善,海外资金持续流入,监管股补涨,8月中下旬以后,经济反弹逐步被证伪,外资流入放缓,改革预期提升市场偏好,市场进入监管搭台,成长和主题唱戏的结构性牛市。

本基金在投资策略上坚持成长风格,在配置上偏重于信息服务、消费电子、军工、医药生物等产业,同时保持高仓位运作,投资期内取得了较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.2759元,本报告期份额净值增长率为11.64%,同期业绩比较基准增长率为10.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去、现在和未来,我们一直处于经济回落、货币政策预期相对宽松的投资环境中。为防范可能出现的金融危机对实体经济的负面影响,货币政策在实体经济企稳回升之前,很难收紧。在这一过程中,传统行业机会在于兼并重组、去产能、去杠杆后盈利复苏驱动的市值增长。新兴产业在创造新的需求、技术和应用后,获得新的市场,产业生命周期相对独立于整体经济环境,其成长性或将穿越经济衰退周期,持续给市场带来投资机会。

本基金关注成长行业和拐点行业中的投资机会,采取自上而下和自下而上相结合的方法构造投资组合。当下,成长股整体估值水平处于历史高位,四季度我们将结合市场短期波动和风格变化适时进行组合调整和仓位控制来降低基金整体风险。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	224,317,938.24	92.78
	其中:股票	224,317,938.24	92.78
2	固定收益投资	10,384,500.00	4.29
	其中:债券	10,384,500.00	4.29
	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	5,911,803.07	2.45
7	其他资产	1,167,926.32	0.48
8	合计	241,782,167.63	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,525,380.00	1.06
B	采矿业	-	-
C	制造业	154,314,112.48	64.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,465,000.00	1.45
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,866,858.60	3.71
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	37,321,308.08	15.63
J	金融业	4,915,000.00	2.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,525,500.00	0.64
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	11,384,779.08	4.77
S	综合	-	-
	合计	224,317,938.24	93.93

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002268	卫士通	300,000	15,306,000.00	6.41
2	600536	中国软件	500,000	14,240,000.00	5.96
3	600580	卧龙电气	1,209,959	11,942,295.33	5.00
4	300133	华策影视	315,788	10,834,686.28	4.54
5	000801	四川九洲	500,000	10,675,000.00	4.47
6	300003	乐普医疗	409,955	9,633,942.50	4.03
7	002353	杰瑞股份	239,858	9,349,664.84	3.92
8	002236	大华股份	300,000	8,271,000.00	3.46
9	300147	香雪制药	350,000	7,941,500.00	3.33
10	600420	现代制药	328,100	7,769,408.00	3.25

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,023,000.00	4.20
	其中:政策性金融债	10,023,000.00	4.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	361,500.00	0.15
8	其他	-	-
9	合计	10,384,500.00	4.35

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140429	14农发29	100,000	10,023,000.00	4.20
2	128008	齐峰转债	3,615	361,500.00	0.15

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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、处罚的情形。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	90,356.07
2	应收证券清算款	781,268.48
3	应收股利	-
4	应收利息	230,612.45
5	应收申购款	65,689.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,167,926.32

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300133	华策影视	10,834,686.28	4.54	停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	205,221,143.27
报告期期间基金总申购份额	5,288,820.93
减:报告期期间基金总赎回份额	23,329,559.68
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	187,180,404.52

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》

4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

8.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问,可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线:400-888-0001(免长途费) 021-3878 4638 公司网址:www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2014年10月24日

华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞季季红债券
交易代码	000186
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月13日
报告期末基金份额总额	98,217,889.08份
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。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	1,232,300.73
2.本期利润	2,320,333.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.0234
4.期末基金资产净值	103,769,474.12
5.期末基金份额净值	1.057

注:1.所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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	2.43%	0.10%	1.02%	0.01%	1.41%	0.09%

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