华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金上市交易公告书

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
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2011年12月12日
公告日期：2011年12月7日

一、重要声明与提示

华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》），《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2011年7月21日刊登在《中国证券报》及华泰柏瑞基金管理有限公司网站（www.huatai-pb.com）、2011年7月22日刊登在《上海证券报》、2011年7月25日刊登在《证券时报》上的《华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

1、基金名称：华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金
2、基金类型：债券型
3、基金简称：华泰柏瑞信用增利
4、基金场内简称：信用增利
5、交易代码：164606
6、基金份额总额：211,952,339.56份（截至：2011年12月5日）
7、基金份额净值：1.009元（截至：2011年12月5日）
8、本次上市交易份额：86,540,176.00份（截至：2011年12月5日）
9、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
10、上市交易日期：2011年12月12日
11、跨系统转托管业务开通日期：2011年12月12日
12、基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司
13、基金托管人：中国银行股份有限公司
14、上市推荐人：本基金无上市推荐人
15、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可［2011］526号文。

2、基金运作方式：契约型。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。一旦本基金转为上市开放式基金（LOF）后，本基金将以上市开放式基金的运作方式持续运作，不再每隔三年召开一次基金份额持有人大会决定基金运作方式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：自2011年7月25日至2011年9月9日。

5、发售价格：1.00元人民币。

6、发售方式：场内、场外认购。

7、发售机构：

（1）；场内发售机构

已经具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。

（2）；场外发售机构

1）中国银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：肖钢
传真：（010）66594853
客服电话：95566
公司网址：www.boc.cn

2）中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市复兴门内大街55号
办公地址：北京市复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
传真：（010）66107914
客服电话：95588
公司网址：www.icbc.com.cn

3）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
联系人：曹榕
电话：（021）58781234
传真：（021）58408842
客服电话：95559
公司网址：www.bankcomm.com

4）招商银行股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：傅育宁
联系人：邓炯鹏
电话：（0755）83198888
传真：（0755）83195109
客服电话：95555
公司网址：www.cmbchina.com

5）华泰证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市中山东路90号
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
联系人：万鸣
电话：（025）84457777
传真：（025）84579763
客服电话：95597
公司网址：www.htsc.com.cn

6）华泰联合证券有限责任公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A
办公地址：广东省深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层
法定代表人：马昭明
联系人：盛宗凌
电话：（0755）82492000
传真：（0755）82492962
客服电话：95513
公司网址：www.lhzq.com

7）直销机构：华泰柏瑞基金管理有限公司。

8、验资机构：普华永道中天会计师事务所有限公司。

9、募集资金总额及入账情况：

本次募集净认购额（不含利息）为211,839,238.45元人民币，按照每一基金份额面值人民币1.00元计算，折算成基金份额计211,839,238.45份，有效认购户数为3,580户。认购资金在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计113,465.28元，按照本基金招募说明书等法律文件的约定，折合基金份额113,101.11份，折算差额人民币364.17元计入基金资产（场内有效认购款项在募集期间产生的利息计算结果保留至整数位（最小单位为1元），小数点后部分舍去，舍去部分计入基金财产；场外利息计算结果保留至小数点后两位）。上述募集资金及其利息折算的合计基金份额为211,952,339.56份基金份额。募集资金及利息已于2011年9月21日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户。

10、本基金募集备案情况：根据《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》等相关法律、法规的规定以及《华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2011年9月22日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日：2011年9月22日。

12、基金合同生效日的基金份额总额：211,952,339.56份。

（二）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上［2011］367号

2、上市交易日期：2011年12月12日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称：华泰柏瑞信用增利

基金场内简称：信用增利

5、交易代码：164606

6、本次上市交易份额：86,540,176.00份

7、基金资产净值的披露：基金管理人每个估值日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。本基金上市交易后，基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金份额净值传送给深交所，深交所于次日通过行情系统揭示。根据《基金法》，本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及场内前十名持有人

（一）持有人户数

截至2011年12月5日，本基金份额场内持有人总户数为704户，场外持有人总户数为2877户，平均每户持有的基金份额为59,188.03份。

（二）持有人结构

截至2011年12月5日，本基金份额持有人结构如下：

个人投资者持有的基金份额为119,298,035.73份，占基金总份额的56.29%；机构投资者持有的基金份额为92,654,303.83份，占基金总份额的43.71%。

1、场内部份

场内投资者持有基金份额为86,540,176.00份，其中机构投资者持有基金份额为66,075,882.00份，个人投资者持有基金份额为20,464,294.00份。

2、场外部份

场外投资者持有基金份额为125,412,163.56份，其中机构投资者持有基金份额为26,578,421.83份，个人投资者持有基金份额为98,833,741.73份。

（三）本基金场内份额前十名持有人情况（截至2011年12月5日）

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占场内基金份额的比例（%）
1	华泰证券股份有限公司	30,001,250.00	34.67%
2	华泰柏瑞基金管理有限公司	20,001,944.00	23.11%
3	光大证券-光大-光大阳光基中宝（阳光2号	10,000,416.00	11.56%
4	庄颉	8,000,333.00	9.24%
5	兴业证券股份有限公司	6,000,250.00	6.93%
6	肖晓静	500,152.00	0.58%
7	李秀芝	400,205.00	0.46%
8	张令希	360,110.00	0.42%
9	陈懿	300,129.00	0.35%
10	王翠芸	300,012.00	0.35%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：华泰柏瑞基金管理有限公司
2、注册地址：上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号楼17层
3、法定代表人：齐亮
4、总经理：陈国杰
5、成立日期：2004年11月18日
6、批准设立机关：中国证券监督管理委员会
7、批准设立文号：中国证监会证监基金字［2004］178号
8、工商登记注册的法人营业执照文号：310000400404609
9、经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务
10、组织形式：有限责任公司
11、注册资本：贰亿元人民币
12、存续期间：持续经营
13、信息披露负责人：陈晖
电话：021-38601668
14、股权结构：PineBridge Investments LLC（柏瑞投资有限责任公司）49%、华泰证券股份有限公司49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司2%。
15、内部组织结构及职能：

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。

目前，公司下设22个部门，并在北京、深圳分别设立了分公司。

投资部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票投资。

专户投资部：负责专户的投资管理。

海外投资部：负责公司QDII的投资管理。

指数投资部：负责指数研究、设计和开发工作，以及进行指数产品的投资管理。

研究部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行行业和上市公司研究。

交易部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行交易指令执行与监督。

北京分公司、深圳分公司、第一营销中心、第二营销中心：负责基金销售。

机构理财部：负责机构客户的业务拓展。

营销管理总部：负责对外开拓维护渠道总部，对内管理服务渠道销售人员。

市场部：负责公司品牌、基金产品的市场推广服务。

客户服务部：负责公司的客户服务。

业务发展部：负责基金产品研发等新业务拓展。

基金事务部：负责基金会计核算与估值、开放式基金注册登记等业务。

信息技术部：负责公司信息系统的日常运行与开发。

法律监察部：负责内部法律事务咨询，处理外部法律事务，检查公司管理及基金运作符合国家法律法规规定的情况，负责定期评估公司内部控制体系的完整性、有效性及合规性，检查公司内部控制制度的执行情况，并提出改进意见。

风险管理部：负责投资、交易环节风险提示及控制，研究公司风险管理政策与方针，协调各部门处理公司层面风险事项。

人力资源部：负责公司人力资源管理、薪酬制度、人员培训及人事档案等事务。

行政管理部：负责公司后勤服务、公文档案管理。

公司财务部：负责公司财务事项。

16、人员情况：

截止2011年9月30日，公司员工人数为154人。员工受教育程度分布：大专学历人员占9%，本科学历人员占34%，硕士学历人员占53%，博士以及博士后学历人员占4%。

17、基金管理业务情况简介：

截止2011年9月30日，公司共管理12只基金，包括7只股票型基金，分别是华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金、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、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金；1只混合型基金，华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金；2只债券型基金，华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型基金和华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金；1只货币型基金，华泰柏瑞货币市场证券投资基金和1只QDII基金，华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金。截至2011年9月30日，公司管理的基金资产规模为人民币147.34亿元，总份额规模为203.12亿份。

18、本基金基金经理

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基金基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
变更注册登记日期：2004年8月26日
注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人：肖钢
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字［1998］24号
托管及投资者服务部总经理：李爱华
托管部门信息披露联系人：唐州徽
电话：010-66594855
传真：010-66594942
发展概况：

1912年2月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从1912年至1949年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994年，中国银行改为国有独资商业银行。2003年，中国银行启动股份制改造。2004年8月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006年6月、7月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及31个国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010年度，中国银行被被Global Finance（《环球金融》）评为2010年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被Euromoney（《欧洲货币》）评为2010年度房地产业“中国最佳商业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被Finance Asia（《金融亚洲》）评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行，被《21世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

2、基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工110余人，其中，90%以上的员工具备本科以上学历。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII资产、QDII资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。

3、证券投资基金托管情况

截至2011年6月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成监筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘监筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选或号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、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、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、工银全球股票（QDII）、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）、长盛环球景气行业大盘精选股票型（QDII）、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型（QDII）、信诚金砖四国积极配置（QDII）、海富通大中华精选股票型（QDII）、招商标普金砖四国指数（LOF-QDII）、华宝兴业成熟市场动量优选（QDII）、大成标普500等权重指数（QDII）、长信标普100等权重指数（QDII）、博时抗通胀增强回报（QDII）、华安大中华升级股票型（QDII）等119只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（三）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
联系人：单峰
经办注册会计师：薛竟、单峰
电话：021-23238888
传真：021-23238800

（四）上市推荐人

本基金无上市推荐人

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用从基金认购费用中支付，不由基金资产承担。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金截至2011年12月5日的资产负债表如下：

资　产	本报告期末	负债和所有者权益	本报告期末
资　产：		负债：	
银行存款	59,359,108.44	短期借款	-
结算备付金	-	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	153,866,750.00	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	-	应付证券清算款	1,527,833.80
债券投资	153,866,750.00	应付赎回款	-
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	20,475.74
基金投资	-	应付托管费	5,850.20
衍生金融资产	-	应付销售服务费	-
买入返售金融资产	-	应付交易费用	3,158.80
应收证券清算款	-	应付税费	101,000.00
应收利息	2,362,590.44	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	114,206.75
其他资产	-	负债合计	1,772,525.29
		所有者权益：	
		实收基金	211,952,339.56
		未分配利润	1,863,584.03
		所有者权益合计	213,815,923.59
资产合计：	215,588,448.88	负债与持有人权益总计：	215,588,448.88

注：截至2011年12月5日，基金份额净值1.009元，基金份额总额211,952,339.56份。

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2011年12月5日，本基金的投资组合情况如下：

（一）基金资产组合情况

项目	金额	占基金总资产的比例（%）
权益投资	-	-
其中：股票	-	-
固定收益投资	153,866,750.00	71.37
其中：债券	153,866,750.00	71.37
资产支持证券	-	-
金融衍生品投资	-	-
买入返售金融资产	-	-
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
银行存款和结算备付金合计	59,359,108.44	27.53
其他各项资产	2,362,590.44	1.10
合计	215,588,448.88	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

本报告期末本基金未持有股票。

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

本报告期末本基金未持有股票。

（四）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	1,503,750.00	0.70
2	央行票据	29,978,000.00	14.02
3	金融债券	41,847,000.00	19.57
	其中：政策性金融债券	41,847,000.00	19.57
4	企业债券	50,338,000.00	23.54
5	企业短期融资券	30,200,000.00	14.12
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	153,866,750.00	71.96

（五）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

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	110220	11国开20	200,000	20,782,000.00	9.72
2	1101081	11央票81	200,000	20,306,000.00	9.50
3	110244	11国开44	100,000	10,700,000.00	5.00
4	110226	11国开26	100,000	10,365,000.00	4.85
5	1180147	11铁道03	100,000	10,237,000.00	4.79

（六）投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中无被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

2、本报告期末本基金未持有股票。

3、其他各项资产构成如下：

序号	名称	金额（元）
1	应收利息	2,362,590.44
	合计	2,362,590.44

4、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部资产支持证券投资明细

截止2011年12月5日，本基金未持有资产支持证券。

5、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细

截止2011年12月5日，本基金未持有权证。

自基金合同生效日至2011年12月5日，本基金未投资任何权证。

6、本报告期持有的处于转股期的可转换债券明细

截止2011年12月5日，本基金未持有可转换债券。

7、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

基金管理人就本基金上市交易后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

（一）中国证监会批准华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金募集的文件
（二）《华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金合同》
（三）《华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金托管协议》
（四）注册登记协议
（五）基金管理人业务资格批件、营业执照
（六）基金托管人业务资格批件、营业执照
（七）华泰柏瑞基金管理有限公司募集设立华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的法律意见书。

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

风险提示：本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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

华泰柏瑞基金管理有限公司
二〇一一年十二月七日

附件：华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金管理人的权利

（1）依法募集基金，办理基金备案手续；
（2）依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
（3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
（4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
（5）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
（6）在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
（7）根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
（8）自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
（9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
（10）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；
（11）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
（12）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
（13）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
（14）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
（15）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
（16）法律法规、基金合同规定的其他权利。

（二）基金管理人的义务

（1）依法申请并募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
（2）办理基金备案手续；
（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；
（6）按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
（7）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
（8）进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
（9）依法接受基金托管人的监督；
（10）编制季度、半年度和年度基金报告；
（11）采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
（12）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
（13）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
（14）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
（15）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
（16）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；
（17）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
（18）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
（19）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
（20）因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（21）基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
（22）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

（三）基金托管人的权利

（1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
（2）依照基金合同的约定获得基金托管费；
（3）监督基金管理人对本基金的投资运作；
（4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
（5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
（6）法律法规、基金合同规定的其他权利。

（四）基金托管人的义务

（1）安全保管基金财产；
（2）设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
（3）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
（4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
（5）对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；
（6）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
（7）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
（8）按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；
（9）保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
（10）根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
（11）对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
（12）保存基金份额持有人名册；
（13）复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
（14）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
（15）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
（16）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
（17）按照法律法规监督基金管理人的投资运作；
（18）因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
（19）因基金管理人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿，除法律法规另有规定外，基金托管人不承担连带责任；
（20）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

（五）基金份额持有人的权利

（1）分享基金财产收益；
（2）参与分配清算后的剩余基金财产；
（3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；
（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
（7）监督基金管理人的投资运作；
（8）对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
（9）法律法规、基金合同规定的其他权利。

（六）基金份额持有人的义务

（1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
（2）缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
（3）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责