

华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金 2015 年半年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国建设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及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)起至 2015 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41

§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.3 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.....	42
§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	45
§11 备查文件目录	45
11.1 备查文件目录.....	45
11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞积极优选股票
基金主代码	001097
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 月 26 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
报告期末基金份额总额	1,177,357,172.11 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以对经济周期和产业周期的研究判断为基础，优选受益于经济发展、市场改革且处于行业领先地位的上市公司证券，追求基金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；通过适度的大类资产配置来降低组合的系统性风险。 本基金将“自上而下”的趋势投资和“自下而上”的个股选择相结合。投资决策的重点在于寻找具有巨大发展潜力的趋势，发现并投资于有能力把握趋势并在竞争中处于优势的公司。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：80%*沪深 300 指数收益率+20%*中信标普国债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期收益和风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	田青
	联系电话	021-38601777	010-67595096
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	010-67595096
传真		021-38601799	010-66275853
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17	北京市西城区金融大街 25 号

	层	
办公地址	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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200135	100033
法定代表人	齐亮	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	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(2015 年 3 月 26 日 (基金合同生效日)- 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	66,650,766.16
本期利润	-80,032,989.39
加权平均基金份额本期利润	-0.0526
本期加权平均净值利润率	-5.11%
本期基金份额净值增长率	-11.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-132,584,839.20
期末可供分配基金份额利润	-0.1126
期末基金资产净值	1,044,772,332.91
期末基金份额净值	0.887
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-11.30%

注：本基金于 2015 年 3 月 26 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足半年。

3.2 基金净值表现

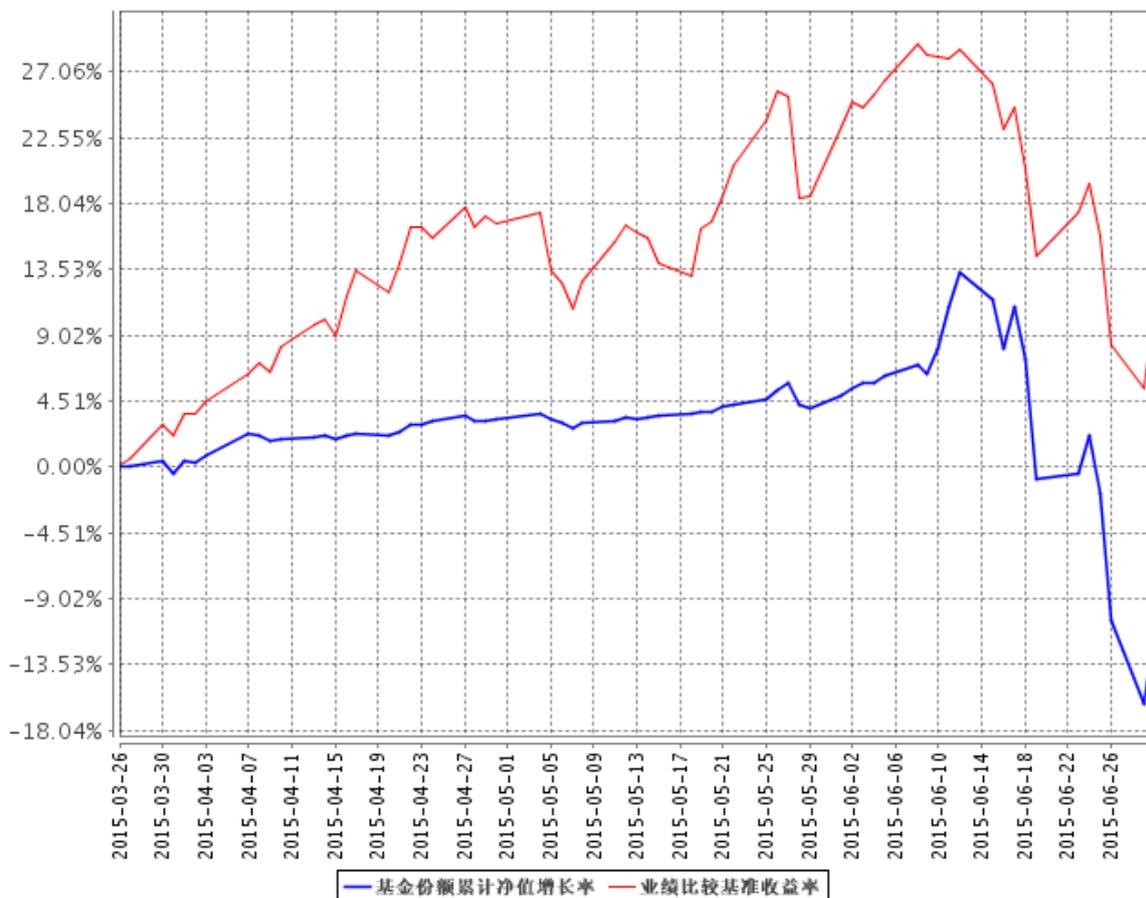
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-14.71%	3.67%	-5.9%	2.80%	-8.81%	0.87%
过去三个月	-10.94%	2.16%	9.04%	2.09%	-19.98%	0.07%
自基金合同生效起至今	-11.30%	2.10%	11.32%	2.05%	-22.62%	0.05%

注：本基金的业绩基准由沪深 300 指数和中信标普国债指数收益率按照 80%与 20%之比构建，并每日进行再平衡。

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

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：图示日期为 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日。1、本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日。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，

截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§ 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 交易性开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易性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		
方伦煜	投资部总监、本基金的基金经理	2015年3月26日	-	15	方伦煜先生，管理学硕士，15年证券从业经历，历任广发证券股份有限公司行业研究员、招商证券股份有限公司投资经历、巨田基金管理有限公司研究员，广发证券股份有限公司投资经历。2008年6月至2010年2月任中国人寿资产管理有限公司投资经历，2010年2月至2012年2月任职于华安基金管理有限公司基金投资部，2012年3月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，

					2012 年 4 月起担任华泰柏瑞基金成长混合型证券投资基金经历。 2015 年 3 月起担任华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金的基金经理。 2015 年 4 月起任投资部副总监。2015 年 6 月起任投资部总监
--	--	--	--	--	---

注：上述表格内基金经理的任职日期为本基金基金合同生效日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 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

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内的公平交易模块，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 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

积极优选发行之后采取了逐步建仓的策略，所料不及的是在高仓位赶上了“股灾”，净值回撤幅度较大。虽然本基金在个股配置方面做好了应对市场出现极端变化的准备，但在高杠杆去化导致的“踩踏”过程中，“泥沙俱下”，我们精选的股票也同样暴跌，基金净值大幅回撤。

报告期内组合配置重点主要集中在国企改革相关的高速公路、化工、零售以及盈利水平出现大幅改善的航运、券商等板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值分别为 0.887 元，下降 11.30%，同期本基金的业绩比较基准上涨 11.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

可以预见，随着各项促进经济增长举措的实施以及改革的稳步推进，中国经济走稳是大概率事件。经过 6 月中下旬以来的大幅下跌，市场总体风险释放较为充分。在以证金公司为代表的“救市国家队”的努力下，市场情绪已经稳定下来。展望后市，下半年流动性宽松的局面不会改变，政策呵护市场的基调不变，尽管经济基本面仍难以出现明显改善，但如果在政策的支持下市场能找到新的、较大的主题性机会，不排除下半年市场出现结构性行情的可能。

在经济转型的大背景下，国企改革、新能源、节能环保和一些业绩出现大幅改善的个股存在较好的投资机会。

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

本基金在报告期内未进行利润分配。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金

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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	147,186,535.75
结算备付金		13,557,649.33

存出保证金		481,750.04
交易性金融资产	6.4.7.2	967,659,000.41
其中：股票投资		967,659,000.41
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	20,877.00
应收股利		-
应收申购款		393,082.96
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,129,298,895.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		63,527,172.21
应付赎回款		16,666,924.87
应付管理人报酬		1,455,761.20
应付托管费		242,626.84
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	2,462,321.53
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	171,755.93
负债合计		84,526,562.58
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	1,177,357,172.11
未分配利润	6.4.7.10	-132,584,839.20
所有者权益合计		1,044,772,332.91
负债和所有者权益总计		1,129,298,895.49

注 1. 报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.887 元，基金份额总额 1,177,357,172.11 份。

注 2. 本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日，无上年可比期间数据。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 3 月 26 日(基金合同生 效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-68,303,828.68
1.利息收入		3,225,305.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,938,643.21
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,286,661.88
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		71,895,978.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	70,236,301.35
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,659,677.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-146,683,755.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,258,643.11
减：二、费用		11,729,160.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,155,582.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,025,930.33
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,401,752.58
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	145,895.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-80,032,989.39
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-80,032,989.39

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 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：华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)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)	1,706,941,661.53	-	1,706,941,661.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-80,032,989.39	-80,032,989.39
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)	-529,584,489.42	-52,551,849.81	-582,136,339.23
其中：1.基金申购款	299,569,979.58	-5,764,026.81	293,805,952.77
2.基金赎回款	-829,154,469.00	-46,787,823.00	-875,942,292.00
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)	1,177,357,172.11	-132,584,839.20	1,044,772,332.91

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 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

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

华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金(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[2015]第 250 号《关于准予华泰柏瑞积极优选股票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《华泰柏瑞积极优选股票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 1,706,729,101.43 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(2015)第 186 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金合同》于 2015 年 3 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,706,729,101.43 份基金份额,其中认购资金利息折合 212,560.10 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞积极优选股票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良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 80-95%;在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为 $80% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20% \times \text{中信标普国债指数收益率}$ (税后)

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。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 3 月 26 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 3 月 36 日(基金合同生效日)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 3 月 26 日(基金合同生效日)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。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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，于交易日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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当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。

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，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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和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。当本基金依法有权抵销债权债务且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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率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，其公允价值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和托管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也可按直线法计算。

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(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)为正数,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(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,不需要进行分部报告的披露。

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股票投资和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)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票,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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定

期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)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。

(4)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)，按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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

注：本基金报告期内无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

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，本基金本报告期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。

6.4.5.3 差错更正的说明

注：本基金报告期内无差错更正。

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收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%

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	147,186,535.75
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	147,186,535.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,114,342,755.96	967,659,000.41	-146,683,755.55
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,114,342,755.96	967,659,000.41	-146,683,755.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末，本基金未持有反售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未持有反售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	14,563.28
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	6,096.92
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	216.80
合计	20,877.00

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,462,321.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,462,321.53

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	33,678.37
预提费用	138,077.56

合计	171,755.93
----	------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,706,941,661.53	1,706,941,661.53
本期申购	299,569,979.58	299,569,979.58
本期赎回(以“-”号填列)	-829,154,469.00	-829,154,469.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,177,357,172.11	1,177,357,172.11

注：本基金合同于 2015 年 3 月 26 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金为人民币 1,706,941,661.53 元，折合 1,706,941,661.53 份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	0.00	0.00	0.00
本期利润	66,650,766.16	-146,683,755.55	-80,032,989.39
本期基金份额交易产生的变动数	-14,165,999.71	-38,385,850.10	-52,551,849.81
其中：基金申购款	11,780,573.30	-17,544,600.11	-5,764,026.81
基金赎回款	-25,946,573.01	-20,841,249.99	-46,787,823.00
本期已分配利润	0.00	0.00	0.00
本期末	52,484,766.45	-185,069,605.65	-132,584,839.20

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	77257.88
其他	3430.09
合计	1,938,643.21

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,105,946,112.52
减：卖出股票成本总额	1,035,709,811.17
买卖股票差价收入	70,236,301.35

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期末未持有债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期末未持有债券投资收益。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期末未持有债券投资收益。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期末未持有债券投资收益。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末未持有债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,659,677.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,659,677.32

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-146,683,755.55
——股票投资	-146,683,755.55
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-146,683,755.55

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年6月30日
基金赎回费收入	3,146,670.24
转换费收入	111,972.87
合计	3,258,643.11

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金财产。

2、本基金的转换费由基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用中的 25% 归入基金财产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,401,752.58
银行间市场交易费用	-
合计	4,401,752.58

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	34,519.39
信息披露费	103,558.17
银行划款手续费	7,818.06
合计	145,895.62

6.4.7.21 分部报告

注：本基金本报告期无分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：关联方与资产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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	3,250,336,936.29	100.00%

注：本基金基金合同生效日为2015年3月26日，无上年可比期间数据。

债券交易

注：本基金本报告期内通过关联方交易单元未进行债券交易。本基金基金合同生效日为2015年3月26日，无上年可比期间数据。

债券回购交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	5,209,200,000.00	100.00%

注：本基金基金合同生效日为2015年3月26日，无上年可比期间数据。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期通过关联方交易单元未进行权证交易。本基金基金合同生效日为2015年3月26日，无上年可比期间数据。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券股份 有限公司	2,927,905.19	100.00%	2,462,321.53	100.00%

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日，无上年可比期间数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,155,582.18
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注 1：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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。

注 2：本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日，无上年可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,025,930.33

注 1：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 0.25% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

注 2：本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日，无上年可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日，无上年可比期间数据。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日，无上年可比期间数据。

6.4.10.4.2 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：本报告期末，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	147,186,535.75	1,857,955.24

注：本报告期，基金托管人建设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

本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日，无上年可比期间数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日，无上年可比期间数据。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日，无上年可比期间数据。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002320	海峡股份	2015年6月25日	重大事项停牌	27.43	-	-	904,800	14,129,150.84	24,818,664.00	-
000778	新兴铸管	2015年6月15日	重大事项停牌	12.96	-	-	1,500,000	12,073,549.50	19,440,000.00	-
600153	建发股份	2015年6月29日	重大事项停牌	17.51	-	-	600,000	13,399,123.86	10,506,000.00	-
000429	粤高速 A	2015年4月8日	重大事项停牌	8.05	2015年7月22日	7.06	1,978,438	11,773,993.64	15,926,425.90	-

注：1、本基金截至2015年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有银行间债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工

具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，通过主动投资追求适度风险水平下的较高收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

-

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	147,186,535.75	-	-	-	-	-	147,186,535.75
结算备付金	13,557,649.33	-	-	-	-	-	13,557,649.33
存出保证金	481,750.04	-	-	-	-	-	481,750.04
交易性金融资产	-	-	-	-	-	967,659,000.41	967,659,000.41
应收利息	-	-	-	-	-	20,877.00	20,877.00
应收申购款	-	-	-	-	-	393,082.96	393,082.96
资产总计	161,225,935.12	-	-	-	-	968,072,960.37	1,129,298,895.49
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	63,527,172.21	63,527,172.21
应付赎回款	-	-	-	-	-	16,666,924.87	16,666,924.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,455,761.20	1,455,761.20
应付托管费	-	-	-	-	-	242,626.84	242,626.84
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,462,321.53	2,462,321.53
其他负债	-	-	-	-	-	171,755.93	171,755.93
负债总计	-	-	-	-	-	84,526,562.58	84,526,562.58
利率敏感度缺口	161,225,935.12	-	-	-	-	-883,546,397.79	1,044,772,332.91

注 1：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

注 2：本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日，无上年可比期间数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：截至 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

注：本基金本报告期末未持有外汇。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 80-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	967,659,000.41	92.62
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	967,659,000.41	92.62

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日，无上年可比期间数据。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数收益率”以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末（2015 年 6 月 30 日）
	沪深 300 指数上涨 5%	上升约 4875 万元
沪深 300 指数下跌 5%	下降约 4875 万元	

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日，无上年可比期间数据。

§ 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	967,659,000.41	85.69
	其中：股票	967,659,000.41	85.69
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	160,744,185.08	14.23
7	其他各项资产	895,710.00	0.08
8	合计	1,129,298,895.49	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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	22,261,666.60	2.13
B	采矿业	11,045,000.00	1.06
C	制造业	341,260,908.86	32.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,521,345.65	1.87
E	建筑业	50,488,935.12	4.83
F	批发和零售业	128,950,869.85	12.34
G	交通运输、仓储和邮政业	192,858,015.41	18.46
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	122,437,756.30	11.72
K	房地产业	15,259,126.08	1.46
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	50,478,028.02	4.83
S	综合	13,097,348.52	1.25
	合计	967,659,000.41	92.62

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600350	山东高速	6,642,809	56,862,445.04	5.44
2	600500	中化国际	2,899,860	50,689,552.80	4.85
3	000498	山东路桥	5,499,884	50,488,935.12	4.83
4	601999	出版传媒	3,549,791	50,478,028.02	4.83
5	603167	渤海轮渡	3,009,169	50,042,480.47	4.79
6	000830	鲁西化工	5,000,000	49,800,000.00	4.77
7	600309	万华化学	2,000,000	48,360,000.00	4.63
8	002648	卫星石化	3,189,929	48,295,525.06	4.62
9	600426	华鲁恒升	2,499,955	46,399,164.80	4.44
10	600858	银座股份	3,222,500	44,212,700.00	4.23
11	000417	合肥百货	3,530,734	43,251,491.50	4.14
12	000488	晨鸣纸业	3,206,009	28,757,900.73	2.75
13	002320	海峡股份	904,800	24,818,664.00	2.38
14	601628	中国人寿	736,450	23,065,614.00	2.21
15	000713	丰乐种业	1,567,723	22,261,666.60	2.13
16	600030	中信证券	820,000	22,066,200.00	2.11
17	600837	海通证券	999,984	21,799,651.20	2.09
18	000783	长江证券	1,500,000	20,925,000.00	2.00
19	000778	新兴铸管	1,500,000	19,440,000.00	1.86
20	601788	光大证券	699,928	18,863,059.60	1.81
21	600511	国药股份	349,930	17,632,972.70	1.69
22	600012	皖通高速	1,300,000	16,874,000.00	1.62
23	600789	鲁抗医药	1,000,000	16,270,000.00	1.56
24	601872	招商轮船	1,334,500	16,014,000.00	1.53
25	000429	粤高速 A	1,978,438	15,926,425.90	1.52

26	600369	西南证券	799,910	15,718,231.50	1.50
27	000002	万科A	1,050,904	15,259,126.08	1.46
28	600783	鲁信创投	349,449	13,097,348.52	1.25
29	000599	青岛双星	1,000,000	13,010,000.00	1.25
30	600115	东方航空	1,000,000	12,320,000.00	1.18
31	600153	建发股份	600,000	10,506,000.00	1.01
32	600969	郴电国际	499,959	10,174,165.65	0.97
33	002202	金风科技	500,000	9,735,000.00	0.93
34	600864	哈投股份	500,000	8,100,000.00	0.78
35	000028	国药一致	98,815	7,362,705.65	0.70
36	600188	兖州煤业	500,000	6,875,000.00	0.66
37	000597	东北制药	499,901	6,233,765.47	0.60
38	000759	中百集团	500,000	5,985,000.00	0.57
39	002510	天汽模	280,000	4,270,000.00	0.41
40	601088	中国神华	200,000	4,170,000.00	0.40
41	600027	华电国际	91,000	1,011,920.00	0.10
42	601985	中国核电	18,000	235,260.00	0.02

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000417	合肥百货	85,399,883.15	8.17
2	600309	万华化学	82,868,589.64	7.93
3	600350	山东高速	77,619,774.39	7.43
4	600115	东方航空	76,780,104.50	7.35
5	002648	卫星石化	76,085,395.88	7.28
6	600029	南方航空	71,250,679.19	6.82
7	601999	出版传媒	66,500,349.72	6.37
8	603167	渤海轮渡	60,952,008.05	5.83
9	601628	中国人寿	60,160,868.75	5.76
10	000498	山东路桥	59,799,339.46	5.72
11	000830	鲁西化工	57,398,840.48	5.49
12	601111	中国国航	57,091,510.68	5.46
13	000713	丰乐种业	53,212,899.56	5.09

14	600858	银座股份	52,982,636.00	5.07
15	600500	中化国际	51,921,003.00	4.97
16	601318	中国平安	49,500,000.00	4.74
17	600426	华鲁恒升	49,290,440.77	4.72
18	002465	海格通信	37,077,226.78	3.55
19	000488	晨鸣纸业	36,640,703.97	3.51
20	600369	西南证券	36,102,968.70	3.46
21	601788	光大证券	35,834,724.90	3.43
22	600011	华能国际	35,425,145.94	3.39
23	600030	中信证券	32,998,129.00	3.16
24	601336	新华保险	32,861,369.84	3.15
25	000002	万科A	31,017,376.54	2.97
26	600012	皖通高速	30,182,968.20	2.89
27	600837	海通证券	27,583,309.54	2.64
28	600153	建发股份	27,573,908.36	2.64
29	000783	长江证券	27,571,026.00	2.64
30	000001	平安银行	27,202,706.26	2.60
31	600900	长江电力	25,201,053.18	2.41
32	002202	金风科技	24,848,852.90	2.38
33	600033	福建高速	24,085,817.49	2.31
34	000916	华北高速	24,033,649.84	2.30
35	600027	华电国际	23,720,019.87	2.27
36	002190	成飞集成	23,131,311.64	2.21
37	000027	深圳能源	21,258,524.34	2.03

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600029	南方航空	84,675,083.71	8.10
2	600115	东方航空	71,847,669.75	6.88
3	601111	中国国航	63,327,616.26	6.06
4	601318	中国平安	47,217,624.67	4.52
5	600011	华能国际	43,968,343.05	4.21

6	002465	海格通信	37,058,929.84	3.55
7	601628	中国人寿	35,070,755.00	3.36
8	000713	丰乐种业	34,850,364.52	3.34
9	000417	合肥百货	32,383,028.61	3.10
10	601336	新华保险	29,109,961.27	2.79
11	000001	平安银行	28,484,161.94	2.73
12	600027	华电国际	26,394,022.00	2.53
13	600309	万华化学	26,221,860.86	2.51
14	000916	华北高速	25,516,134.92	2.44
15	600900	长江电力	24,885,916.48	2.38
16	600033	福建高速	24,687,700.00	2.36
17	002190	成飞集成	23,690,028.85	2.27
18	000027	深圳能源	21,712,577.80	2.08
19	601002	晋亿实业	20,199,174.00	1.93
20	601188	龙江交通	19,377,172.07	1.85

注：不考虑相关交易费用。

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	2,150,052,567.13
卖出股票收入（成交）总额	1,105,946,112.52

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 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。

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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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

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	481,750.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,877.00
5	应收申购款	393,082.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	895,710.00
---	----	------------

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

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
10,513	111,990.60	217,483,327.75	18.47%	959,873,844.36	81.53%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

该只基金的基金经理未持有本基金。

8.3 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、基金投资和研究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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年3月26日）基金份额总额	1,706,941,661.53
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	299,569,979.58
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	829,154,469.00

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	1,177,357,172.11

§ 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

基金管理人的重大人事变动：

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。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	3,250,336,936.29	100%	2,927,905.19	100%	-

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、本基金于 2015 年 3 月 26 日成立，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

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
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	5,209,200,000.00	100%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	参加交通银行网上银行、手机银行基金申购手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015-06-30
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于开通中国工商银行借记卡直销网上交易以及费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015-06-05
3	关于华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金参与深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015-06-01
4	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金参与天天基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015-05-28
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于开展我司网上直销交易认购、申购、转换费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015-05-25
6	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资、费率优惠等业务公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015-05-23
7	关于网上直销平台新增通联支付支持银行业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015-04-03
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015-04-01
9	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015-03-27
10	关于华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015-03-20
11	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金-招募说明书	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015-03-02
12	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金-托管协议	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015-03-02
13	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金-基金合同	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015-03-02
14	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金-发售公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015-03-02

§ 11 备查文件目录

11.1 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

11.2 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

11.3 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
2015 年 8 月 29 日