

# 华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资 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 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
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.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	48
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>48</b>
11.1 备查文件目录.....	48
11.2 存放地点.....	49
11.3 查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞量化优选混合
基金主代码	000877
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 17 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	481,623,583.64 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金投资策略如下：1、股票投资策略</p> <p>本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。但在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可降至 0%。</p> <p>2、固定收益资产投资策略</p> <p>本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>3、资产支持证券投资策略：在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>4、权证投资策略：权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时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。</p> <p>5、其他金融衍生工具投资策略：在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生</p>

	品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。
业绩比较基准	95%*沪深 300 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

### 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 层	北京市西城区金融大街 25 号
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	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
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 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	364, 226, 294. 72
本期利润	406, 410, 331. 03
加权平均基金份额本期利润	0. 4200
本期加权平均净值利润率	37. 19%
本期基金份额净值增长率	47. 17%
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	227, 027, 651. 47
期末可供分配基金份额利润	0. 4714
期末基金资产净值	708, 651, 235. 11
期末基金份额净值	1. 4714
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	47. 14%

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

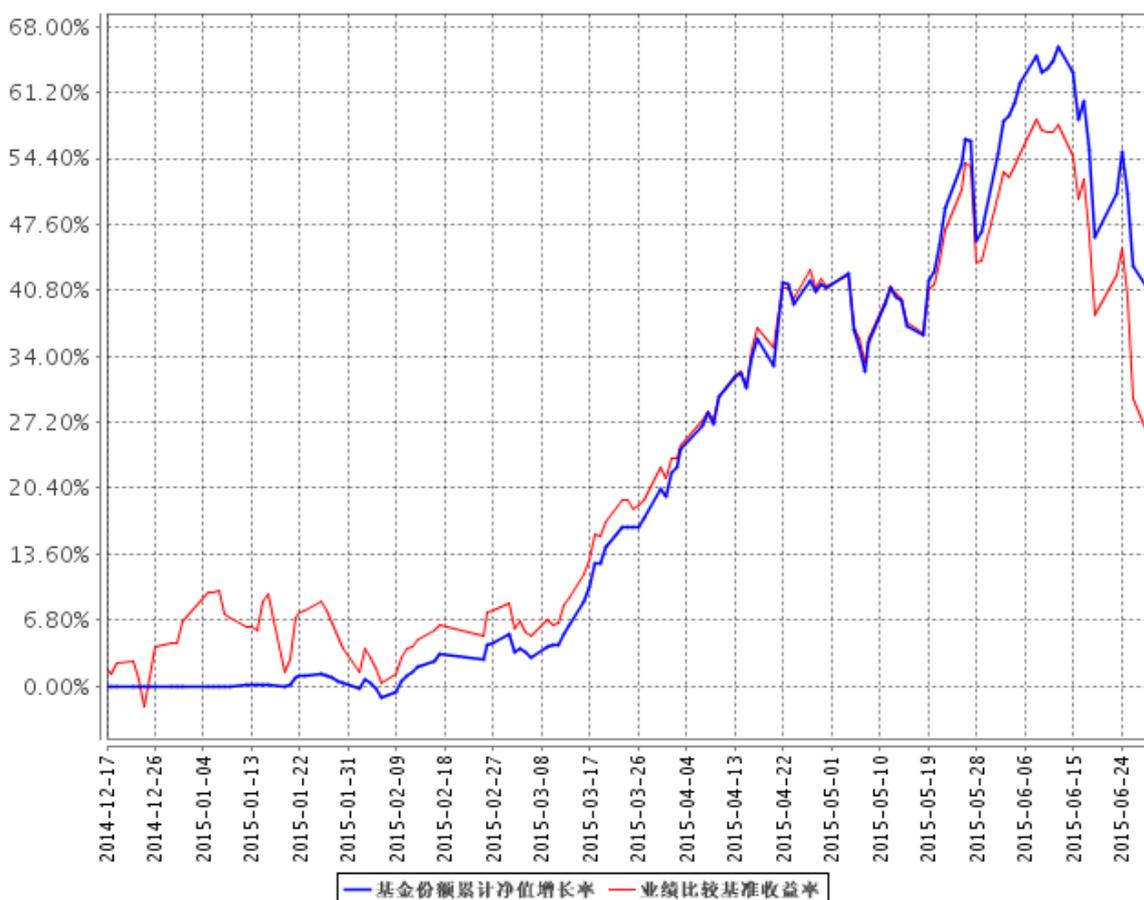
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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. 22%	2. 94%	-7. 18%	3. 32%	7. 40%	-0. 38%
过去三个月	23. 00%	2. 40%	9. 98%	2. 48%	13. 02%	-0. 08%
过去六个月	47. 17%	1. 82%	25. 29%	2. 15%	21. 88%	-0. 33%
自基金合同生效起至今	47. 14%	1. 74%	33. 59%	2. 12%	13. 55%	-0. 38%

注：本基金的业绩基准由沪深 300 指数和活期存款利率按照 95%与 5%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 2014 年 12 月 17 日至 2015 年 6 月 30 日。 1、本基金基金合同生效日为 2014 年 12 月 17 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，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（十二）之 4、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 0%-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%。

## § 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		
田汉卿	副总经理、本基金的基金经理	2014 年 12 月 17 日	-	11	副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI）担任投资经理，2012 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，

					<p>2013 年 8 月起任华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金的基金经理，2013 年 10 月起任公司副总经理，2014 年 12 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理和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的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA 毕业于美国加州</p>
--	--	--	--	--	--

					大学伯克利分校哈斯商学院。
--	--	--	--	--	---------------

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期指基金管理公司作出决定之日。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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《华泰柏瑞量化指数增强股票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

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

股票市场在经历了 2014 年最后两个月主板市场的大幅上涨和 2015 年前 5 个月创业板和中小盘的急速上涨之后，在本报告期最后两周出现大幅回调。我们之前认为创业板和中小盘有泡沫，适当降低了权重配置，减少了这次调整的损失。

### 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 1.4714 元， 上涨 47.17%，同期本基金的业绩比较

基准上涨 25.29%。风险方面，相对于沪深 300 总收益指数的年化跟踪误差严格控制在目标范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票市场在经历了 2014 年最后两个月主板市场的大幅上涨和 2015 年前 5 个月创业板和中小盘的急速上涨之后，于 6 月中旬开始大幅回调，直到 7 月 8 日政府救市取得显著成效。这轮牛市是中国 A 股市场首个杠杆牛，全市场低估了去杠杆给股市造成的下行风险。

随着政府各项救市政策出台、救市力度不断加大，同时由于股市深度调整，风险已得到一定程度的释放，我们认为不少股票有了投资价值。由于政府救市政策的深入，影响市场的因素增多，未来市场的运行轨迹更加难以估计。但这次股市调整，市场风险并未得到完全释放，未来市场可能会出现一定的震荡。中长期相对而言，我们更看好估值较低的中盘和大盘股票。

本基金还是会一贯坚持利用基本面信息选股的策略，紧密关注市场的变化，在有效控制主动投资风险的前提下，力求继续获得超越市场的超额收益。

#### 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

本报告期内基金未实施收益分配。

#### 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：华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金

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	6.4.7.1	221,404,091.34	82,383,947.63
结算备付金		15,192,386.57	-
存出保证金		567,650.82	-
交易性金融资产	6.4.7.2	500,608,212.60	-
其中：股票投资		500,608,212.60	-
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	-	1,538,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	36,594.57	541,819.73
应收股利		-	-
应收申购款		804,178.95	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		738,613,114.85	1,620,925,767.36
<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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		27,611,158.82	-
应付管理人报酬		672,921.96	932,050.44
应付托管费		112,153.66	155,341.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,309,469.25	-
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	256,176.05	-
负债合计		29,961,879.74	1,087,392.13
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	481,623,583.64	1,620,221,925.44
未分配利润	6.4.7.10	227,027,651.47	-383,550.21
所有者权益合计		708,651,235.11	1,619,838,375.23
负债和所有者权益总计		738,613,114.85	1,620,925,767.36

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4714 元，基金份额总额 481,623,583.64 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金

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
一、收入		421,956,453.32

1.利息收入		4,881,956.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,045,780.29
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		3,836,176.36
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		368,598,499.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	364,735,621.35
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	3,862,877.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	42,184,036.31
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	6,291,961.29
<b>减：二、费用</b>		15,546,122.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,287,595.73
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,381,265.98
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,687,893.95
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	189,366.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		406,410,331.03
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		406,410,331.03

注：本基金合同生效日为 2014 年 12 月 17 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金

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）	1,620,221,925.44	-383,550.21	1,619,838,375.23
二、本期经营活动产生	-	406,410,331.03	406,410,331.03

的基金净值变动数（本期利润）			
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）	-1,138,598,341.80	-178,999,129.35	-1,317,597,471.15
其中：1.基金申购款	494,218,228.91	194,048,821.54	688,267,050.45
2.基金赎回款	-1,632,816,570.71	-373,047,950.89	-2,005,864,521.60
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）	481,623,583.64	227,027,651.47	708,651,235.11

注：本基金合同生效日为 2014 年 12 月 17 日，无上年度可比期间数据。

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：

<u>          韩勇          </u>	<u>          房伟力          </u>	<u>          赵景云          </u>
基金管理人负责人	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

华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金(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[2014]第 1132 号《关于准予华泰柏瑞量化优选灵活配置混合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《华泰柏瑞量化优选灵活配置混合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 1,619,915,951.10 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(2014)第 768 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 12 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,619,915,951.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 305,974.34 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《华泰柏瑞量化优选灵活配置混合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 0-95%;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 95%\*沪深 300 指数收益率+5%\*银行活期存款利率(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。

## 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 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

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

本基金本报告期无会计政策变更。

### 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

本基金本报告期无重大会计差错

## 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% 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 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	221,404,091.34
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	221,404,091.34

### 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	458,424,176.29	500,608,212.60	42,184,036.31
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	458,424,176.29	500,608,212.60	42,184,036.31

### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券

### 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	32,743.26
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	3,595.91
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	255.40
合计	36,594.57

### 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	1,309,469.25
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,309,469.25

### 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	82,613.34
预提费用	173,562.71
合计	256,176.05

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,620,221,925.44	1,620,221,925.44
本期申购	494,218,228.91	494,218,228.91
本期赎回(以“-”号填列)	-1,632,816,570.71	-1,632,816,570.71
- 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	481,623,583.64	481,623,583.64

#### 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
上年度末	-383,550.21	0.00	-383,550.21
本期利润	364,226,294.72	42,184,036.31	406,410,331.03
本期基金份额交易产生的变动数	-50,600,160.83	-128,398,968.52	-178,999,129.35
其中：基金申购款	198,744,863.78	-4,696,042.24	194,048,821.54
基金赎回款	-249,345,024.61	-123,702,926.28	-373,047,950.89
本期已分配利润	0.00	0.00	0.00
本期末	313,242,583.68	-86,214,932.21	227,027,651.47

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	980,020.39
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	62,059.92
其他	3,699.98
合计	1,045,780.29

#### 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1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	1,848,729,552.54

减：卖出股票成本总额	1,483,993,931.19
买卖股票差价收入	364,735,621.35

### 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项目。

#### 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项目。

#### 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项目。

#### 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项目。

#### 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项目。

### 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 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,862,877.72
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,862,877.72

#### 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 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	42,184,036.31
——股票投资	42,184,036.31
——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	42,184,036.31

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,165,265.36
转换费收入	126,695.93
合计	6,291,961.29

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 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	5,687,893.95
银行间市场交易费用	-

合计	5,687,893.95
----	--------------

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	54,547.97
信息披露费	119,014.74
银行划款手续费	15,803.92
合计	189,366.63

### 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

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：1、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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1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	3,483,459,665.75	91.89%

注：本基金基金合同生效日为 2014 年 12 月 17 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 2014 年 12 月 17 日，无上年可比期间数据。

### 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1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	2,257,800,000.00	79.28%

注：本基金基金合同生效日为 2014 年 12 月 17 日，无上年可比期间数据。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内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 2014 年 12 月 17 日，无上年可比期间数据。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1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	3,129,741.53	91.90%	1,309,469.25	100%

注：1. 上述佣金按股票交易量的千分之一计算，以扣除证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

关联方的佣金比率和计算方式与非关联方一致；2. 本基金基金合同生效日为 2014 年 12 月 17 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

金额单位：人民币元

项目	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管理费	8,287,595.73
其中：支付销售机构的客户维护费	287,774.60

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 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。

本基金基金合同生效日为 2014 年 12 月 17 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1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,381,265.98

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 2014 年 12 月 17 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：本基金本报告期与关联方未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 2014 年 12 月 17 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 2014 年 12 月 17 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：报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

本基金基金合同生效日为 2014 年 12 月 17 日，无上年可比期间数据。

#### 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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行股份有限公司	221,404,091.34	980,020.39

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 2014 年 12 月 17 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 2014 年 12 月 17 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 2014 年 12 月 17 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	股票	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量（股）	期末	期末估值总	备注
----	----	----	----	----	----	----	-------	----	-------	----

代码	名称	日期	原因	估值单 价	日期	开盘单 价		成本总额	额	
002367	康力 电梯	2015 年6月 2日	重大 事项 停牌	28.49	-	-	362,803	4,820,098.92	10,336,257.47	-
002320	海峡 股份	2015 年6月 25日	重大 事项 停牌	27.43	-	-	131,600	2,468,798.20	3,609,788.00	-
601633	长城 汽车	2015 年6月 19日	重大 事项 停牌	42.76	2015 年7月 13日	38.5	67,900	3,227,765.22	2,903,404.00	-
300056	三维 丝	2015 年6月 5日	重大 事项 停牌	46.55	-	-	46,800	2,186,506.12	2,178,540.00	-
000708	大冶 特钢	2015 年5月 13日	重大 事项 停牌	13.92	-	-	154,900	2,320,502.50	2,156,208.00	-
002191	劲嘉 股份	2015 年6月 18日	重大 事项 停牌	19.22	-	-	40,900	755,699.00	786,098.00	-
002557	洽洽 食品	2015 年6月 29日	重大 事项 停牌	16.38	2015 年8月 24日	14.74	39,815	544,594.48	652,169.70	-
600461	洪城 水业	2015 年2月 26日	重大 事项 停牌	20.65	2015 年8月 26日	11.66	468,046	5,300,984.78	9,665,149.90	-
600900	长江 电力	2015 年6月 15日	重大 事项 停牌	14.35			391,006	4,892,174.09	5,610,936.10	-
300113	顺网 科技	2015 年5月 5日	重大 事项 停牌	53.60	2015 年8月 6日	51.93	2000	109,333.00	107,200.00	-

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

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，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。

### 6.4.13.2 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。本公司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，因而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，因此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。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2014

年 12 月 31 日：同)。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### **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主要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。针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市，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。此外，由于本基金的申购赎回采用股票交付方式进行，申购赎回对本基金的流动性风险影响小。本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为三个月以内且不计息，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，适用于本基金的市场风险包括利率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。

### 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	221,404,091.34	-	-	-	-	-	221,404,091.34
结算备付金	15,192,386.57	-	-	-	-	-	15,192,386.57
存出保证金	567,650.82	-	-	-	-	-	567,650.82
交易性金融资产	-	-	-	-	-	500,608,212.60	500,608,212.60
应收利息	-	-	-	-	-	36,594.57	36,594.57
应收申购款	-	-	-	-	-	804,178.95	804,178.95
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	237,164,128.73	-	-	-	-	501,448,986.12	738,613,114.85
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	27,611,158.82	27,611,158.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	672,921.96	672,921.96
应付托管费	-	-	-	-	-	112,153.66	112,153.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,309,469.25	1,309,469.25
其他负债	-	-	-	-	-	256,176.05	256,176.05
负债总计	-	-	-	-	-	29,961,879.74	29,961,879.74
利率敏感度缺口	237,164,128.73	-	-	-	-	-471,487,106.38	708,651,235.11
上年度末 2014年12月31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	82,383,947.63	-	-	-	-	-	82,383,947.63
买入返售金融资产	1,538,000,000.00	-	-	-	-	-	1,538,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	541,819.73	541,819.73
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,620,383,947.63	-	-	-	-	541,819.73	1,620,925,767.36
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	932,050.44	932,050.44
应付托管费	-	-	-	-	-	155,341.69	155,341.69
负债总计	-	-	-	-	-	1,087,392.13	1,087,392.13
利率敏感度缺口	1,620,383,947.63	-	-	-	-	-545,572.40	1,619,838,375.23

注：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。

### 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（2014 年 12 月 31 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（2014 年 12 月 31 日：同）。

### 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。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，包括跟踪误差等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。本基金投资组合中股票投资比例为不低于基金资产的 95%。于 2014 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 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		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	500,608,212.60	70.64	-	-
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	500,608,212.60	70.64	-	-

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

#### 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）	上年度末（2014年12月31日）
	沪深 300 指数上涨 5%	上升约 3092 万元	上升约 76 万元
	沪深 300 指数下跌 5%	下降约 3092 万元	下降约 76 万元

## § 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	500,608,212.60	67.78
	其中：股票	500,608,212.60	67.78
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	236,596,477.91	32.03
7	其他各项资产	1,408,424.34	0.19
8	合计	738,613,114.85	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	6,679,607.76	0.94
B	采矿业	2,948,841.62	0.42
C	制造业	210,871,555.97	29.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,000,304.53	3.95
E	建筑业	23,619,479.81	3.33
F	批发和零售业	8,591,738.82	1.21
G	交通运输、仓储和邮政业	22,411,541.76	3.16

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,523,060.83	0.50
J	金融业	176,219,353.86	24.87
K	房地产业	14,640,650.64	2.07
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,498,380.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	386,529.00	0.05
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	1,217,168.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	500,608,212.60	70.64

### 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	601318	中国平安	271,797	22,271,046.18	3.14
2	601009	南京银行	902,631	20,579,986.80	2.90
3	600005	武钢股份	2,496,573	17,550,908.19	2.48
4	600036	招商银行	905,834	16,957,212.48	2.39
5	000933	神火股份	1,482,548	13,965,602.16	1.97
6	600999	招商证券	497,029	13,151,387.34	1.86
7	000418	小天鹅A	547,791	13,092,204.90	1.85
8	600000	浦发银行	770,549	13,068,511.04	1.84
9	000333	美的集团	324,047	12,080,472.16	1.70
10	600369	西南证券	569,180	11,184,387.00	1.58
11	002179	中航光电	330,816	10,916,928.00	1.54
12	002367	康力电梯	362,803	10,336,257.47	1.46
13	600004	白云机场	590,621	9,981,494.90	1.41
14	600461	洪城水业	468,046	9,665,149.90	1.36
15	601555	东吴证券	461,198	9,440,723.06	1.33
16	601377	兴业证券	679,255	9,299,000.95	1.31
17	601166	兴业银行	470,900	8,123,025.00	1.15

18	600016	民生银行	816,300	8,114,022.00	1.14
19	000651	格力电器	125,678	8,030,824.20	1.13
20	601668	中国建筑	952,027	7,911,344.37	1.12
21	603001	奥康国际	247,788	7,735,941.36	1.09
22	600029	南方航空	524,209	7,621,998.86	1.08
23	600837	海通证券	338,042	7,369,315.60	1.04
24	002321	华英农业	543,942	6,679,607.76	0.94
25	601186	中国铁建	427,001	6,674,025.63	0.94
26	600015	华夏银行	434,504	6,608,805.84	0.93
27	600827	百联股份	312,306	6,499,087.86	0.92
28	601788	光大证券	208,292	5,613,469.40	0.79
29	000625	长安汽车	265,300	5,611,095.00	0.79
30	600900	长江电力	391,006	5,610,936.10	0.79
31	002202	金风科技	284,800	5,545,056.00	0.78
32	601818	光大银行	1,013,297	5,431,271.92	0.77
33	600048	保利地产	472,900	5,400,518.00	0.76
34	002267	陕天然气	343,913	5,327,212.37	0.75
35	600068	葛洲坝	454,674	5,315,139.06	0.75
36	000039	中集集团	151,500	4,893,450.00	0.69
37	600027	华电国际	431,844	4,802,105.28	0.68
38	000423	东阿阿胶	86,325	4,704,712.50	0.66
39	601233	桐昆股份	227,329	4,537,486.84	0.64
40	000001	平安银行	298,519	4,340,466.26	0.61
41	600276	恒瑞医药	91,200	4,062,048.00	0.57
42	601677	明泰铝业	242,481	3,969,413.97	0.56
43	600079	人福医药	105,872	3,922,557.60	0.55
44	002415	海康威视	86,203	3,861,894.40	0.54
45	600584	长电科技	197,200	3,768,492.00	0.53
46	600741	华域汽车	175,547	3,747,928.45	0.53
47	600030	中信证券	134,400	3,616,704.00	0.51
48	002320	海峡股份	131,600	3,609,788.00	0.51
49	000703	恒逸石化	273,100	3,484,756.00	0.49
50	600305	恒顺醋业	108,830	3,285,577.70	0.46
51	600064	南京高科	163,500	3,188,250.00	0.45
52	000776	广发证券	133,115	3,015,054.75	0.43
53	600376	首开股份	155,800	3,005,382.00	0.42
54	300152	燃控科技	64,200	2,937,150.00	0.41
55	601633	长城汽车	67,900	2,903,404.00	0.41
56	600582	天地科技	168,800	2,884,792.00	0.41

57	600823	世茂股份	220,888	2,878,170.64	0.41
58	600597	光明乳业	124,700	2,868,100.00	0.40
59	600019	宝钢股份	307,700	2,689,298.00	0.38
60	002025	航天电器	99,867	2,616,515.40	0.37
61	601398	工商银行	495,508	2,616,282.24	0.37
62	600236	桂冠电力	232,518	2,594,900.88	0.37
63	600572	康恩贝	114,157	2,591,363.90	0.37
64	000550	江铃汽车	69,643	2,555,898.10	0.36
65	002519	银河电子	116,000	2,354,800.00	0.33
66	000928	中钢国际	94,152	2,335,911.12	0.33
67	300056	三维丝	46,800	2,178,540.00	0.31
68	000708	大冶特钢	154,900	2,156,208.00	0.30
69	000603	盛达矿业	86,023	2,145,413.62	0.30
70	300059	东方财富	31,587	1,992,823.83	0.28
71	002249	大洋电机	149,896	1,921,666.72	0.27
72	002294	信立泰	66,983	1,915,713.80	0.27
73	600686	金龙汽车	70,700	1,819,818.00	0.26
74	002142	宁波银行	83,400	1,763,910.00	0.25
75	601028	玉龙股份	145,640	1,750,592.80	0.25
76	601169	北京银行	130,900	1,743,588.00	0.25
77	600970	中材国际	118,001	1,725,174.62	0.24
78	002563	森马服饰	70,874	1,712,315.84	0.24
79	600177	雅戈尔	84,400	1,541,144.00	0.22
80	002469	三维工程	67,800	1,498,380.00	0.21
81	300033	同花顺	16,300	1,401,637.00	0.20
82	002588	史丹利	48,700	1,400,125.00	0.20
83	601390	中国中铁	101,027	1,383,059.63	0.20
84	600873	梅花生物	130,400	1,361,376.00	0.19
85	002736	国信证券	54,100	1,357,369.00	0.19
86	002501	利源精制	80,700	1,289,586.00	0.18
87	601607	上海医药	56,600	1,260,482.00	0.18
88	600801	华新水泥	117,500	1,241,975.00	0.18
89	600373	中文传媒	50,800	1,217,168.00	0.17
90	600009	上海机场	37,800	1,198,260.00	0.17
91	601313	江南嘉捷	54,740	1,024,185.40	0.14
92	600398	海澜之家	55,800	1,011,654.00	0.14
93	002394	联发股份	60,100	930,348.00	0.13
94	300219	鸿利光电	23,700	900,126.00	0.13
95	600519	贵州茅台	3,400	876,010.00	0.12

96	002640	跨境通	11,984	832,168.96	0.12
97	600028	中国石化	113,800	803,428.00	0.11
98	002191	劲嘉股份	40,900	786,098.00	0.11
99	600282	南钢股份	123,000	773,670.00	0.11
100	002538	司尔特	57,000	758,670.00	0.11
101	002601	佰利联	16,500	750,750.00	0.11
102	300101	振芯科技	13,300	739,480.00	0.10
103	600176	中国巨石	26,000	703,560.00	0.10
104	002557	洽洽食品	39,815	652,169.70	0.09
105	000572	海马汽车	72,300	606,597.00	0.09
106	600271	航天信息	9,200	595,332.00	0.08
107	000869	张裕A	11,500	561,085.00	0.08
108	000783	长江证券	39,700	553,815.00	0.08
109	600391	成发科技	7,600	444,904.00	0.06
110	002701	奥瑞金	16,500	429,495.00	0.06
111	002152	广电运通	12,200	394,548.00	0.06
112	002573	清新环境	18,700	386,529.00	0.05
113	600066	宇通客车	18,605	382,332.75	0.05
114	000902	新洋丰	12,700	344,805.00	0.05
115	600521	华海药业	10,900	340,625.00	0.05
116	600518	康美药业	18,600	329,778.00	0.05
117	600458	时代新材	10,900	273,590.00	0.04
118	002190	成飞集成	5,296	270,043.04	0.04
119	002509	天广消防	14,000	246,120.00	0.03
120	002111	威海广泰	5,600	181,104.00	0.03
121	600325	华发股份	9,300	168,330.00	0.02
122	300113	顺网科技	2,000	107,200.00	0.02
123	600418	江淮汽车	1,900	26,752.00	0.00
124	002279	久其软件	400	21,400.00	0.00
125	600426	华鲁恒升	1,000	18,560.00	0.00

## 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	000651	格力电器	42,530,778.65	2.63

2	601318	中国平安	35,139,162.68	2.17
3	000776	广发证券	33,540,375.20	2.07
4	600837	海通证券	31,719,986.51	1.96
5	600000	浦发银行	31,291,100.81	1.93
6	600036	招商银行	30,780,143.80	1.90
7	600999	招商证券	28,927,726.76	1.79
8	600015	华夏银行	27,945,494.75	1.73
9	600742	一汽富维	27,850,839.78	1.72
10	600585	海螺水泥	27,051,314.35	1.67
11	601668	中国建筑	26,929,598.86	1.66
12	601818	光大银行	26,708,151.00	1.65
13	000418	小天鹅A	25,443,415.09	1.57
14	600873	梅花生物	24,669,295.92	1.52
15	002267	陕天然气	24,606,543.08	1.52
16	600823	世茂股份	24,504,449.58	1.51
17	601398	工商银行	24,414,186.00	1.51
18	000550	江铃汽车	22,240,563.01	1.37
19	601377	兴业证券	21,877,348.09	1.35
20	002179	中航光电	21,643,640.22	1.34

注：不考虑相关交易费用。

#### 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	000651	格力电器	43,487,237.26	2.68
2	000776	广发证券	38,245,635.58	2.36
3	600742	一汽富维	31,934,786.83	1.97
4	600823	世茂股份	30,567,270.29	1.89
5	600837	海通证券	30,126,679.25	1.86
6	600585	海螺水泥	29,206,326.01	1.80
7	600694	大商股份	29,023,161.93	1.79
8	600015	华夏银行	28,877,460.04	1.78
9	002249	大洋电机	27,495,987.28	1.70
10	601818	光大银行	27,203,138.42	1.68
11	600873	梅花生物	26,484,326.71	1.63
12	601398	工商银行	24,401,706.63	1.51

13	600987	航民股份	24,155,299.26	1.49
14	300150	世纪瑞尔	24,096,182.94	1.49
15	000671	阳光城	24,016,659.44	1.48
16	000686	东北证券	23,652,203.93	1.46
17	000002	万科A	23,380,430.86	1.44
18	600000	浦发银行	23,315,237.55	1.44
19	601328	交通银行	23,238,910.51	1.43
20	000001	平安银行	23,190,891.74	1.43

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	1,942,418,107.48
卖出股票收入（成交）总额	1,848,729,552.54

注：不考虑相关交易费用。

### 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	567,650.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	36,594.57
5	应收申购款	804,178.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,408,424.34

#### 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
4,601	104,678.02	219,611,086.91	45.60%	262,012,496.73	54.40%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	9,547.83	0.0020%

### 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

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（2014 年 12 月 17 日）基金份额总额	1,620,221,925.44
本报告期期初基金份额总额	1,620,221,925.44
本报告期基金总申购份额	494,218,228.91
减：本报告期基金总赎回份额	1,632,816,570.71
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

本报告期末基金份额总额	481,623,583.64
-------------	----------------

## § 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
宏信证券	2	307,581,239.27	8.11%	275,985.97	8.10%	-
华泰证券	2	3,483,459,665.75	91.89%	3,129,741.53	91.90%	-

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为，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、本基金在本报告期内未增加交易单元。

### 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	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
宏信证券	-	-	590,000,000.00	20.72%	-	-
华泰证券	-	-	2,257,800,000.00	79.28%	-	-

## 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	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
2	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
3	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
4	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
5	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
6	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
7	华泰柏瑞量化优选灵活配置混合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	2015-03-04

## § 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司  
2015 年 8 月 29 日