

# 华泰柏瑞量化指数增强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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

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>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
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遵规守信情况的说明.....	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.....	12
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.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>44</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	47
<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.....	48
11.3 查阅方式.....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞量化增强股票
基金主代码	000172
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 8 月 2 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,803,350,753.77 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票投资基金，在力求有效控制投资风险的前提下，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 本基金力争将对业绩比较基准的年化跟踪误差控制在 8% 以内。
投资策略	本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 指数。以增强指数投资收益为目的的股票投资策略如下：利用定量投资模型（如：多因子 alpha、风险估测、交易成本等模型），选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在严格控制组合预期跟踪误差的基础上，力求超越标的指数投资回报。一般情况下，本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 85%。债券投资策略：将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。同时运用金融衍生工具投资策略和融资融券和转融资转融券。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+2.5%(指年收益率，评价时按期间折算)
风险收益特征	本基金是一只指数增强型股票投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
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	北京市复兴门内大街 1 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	北京市复兴门内大街 1 号
邮政编码		200135	100818
法定代表人		齐亮	田国立

## 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 弄证大五道口广场 1 号楼 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	1,328,092,599.95
本期利润	1,174,469,359.07
加权平均基金份额本期利润	0.5689
本期加权平均净值利润率	32.80%

本期基金份额净值增长率	38.24%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2015年6月30日)</b>
期末可供分配利润	1,156,093,001.59
期末可供分配基金份额利润	0.6411
期末基金资产净值	3,516,715,881.97
期末基金份额净值	1.950
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2015年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	142.89%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

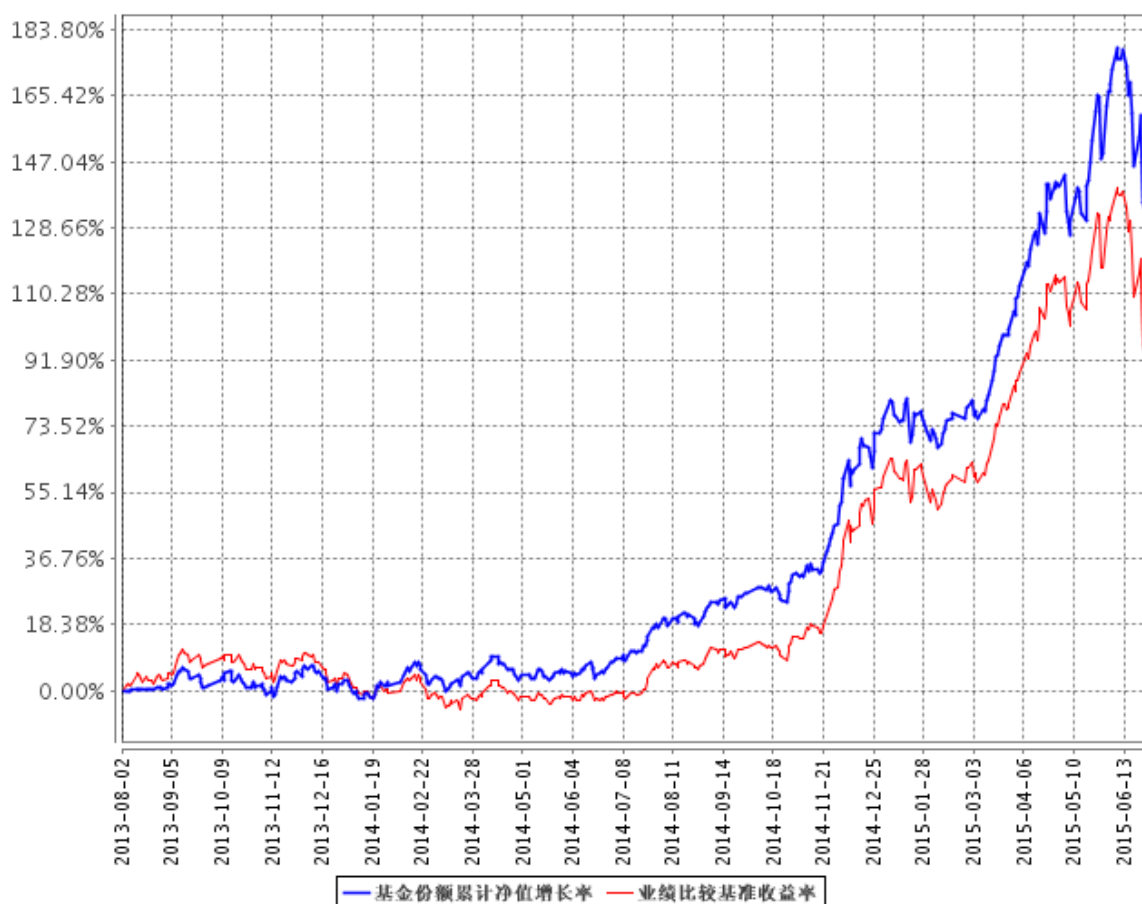
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.55%	3.16%	-6.97%	3.33%	4.42%	-0.17%
过去三个月	18.76%	2.49%	10.67%	2.48%	8.09%	0.01%
过去六个月	38.24%	2.07%	26.86%	2.15%	11.38%	-0.08%
过去一年	125.53%	1.68%	104.74%	1.75%	20.79%	-0.07%
自合同生效日至今	142.89%	1.40%	102.53%	1.46%	40.36%	-0.06%

### 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 2013 年 8 月 2 日至 2015 年 6 月 30 日。

## § 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	2013 年 8 月 2 日	-	12	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，2013 年 8 月起任华

					<p>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 2 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股票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</p>
--	--	--	--	--	---

					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 毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。
--	--	--	--	--	--

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《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

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平，只在少数情况下“存在显著的倾向性”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究表明，交易价差方向没有规律性，即没有明确的利益输送方向。造成少量显著交易价差的原因来自两方面：一是报告期内股票市场的波动幅度较大，为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件；二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异，对证券买卖时点的把握也不

同，导致股票买卖存在价差。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。本报告期公司旗下基金所管理的投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

#### 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。

同时，根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。在本报告期最后两周极端的市场行情下，股市流动性不足。在卖出股票现货冲击成本较大的情况下，我们使用了一定量的股指期货进行套保，对冲了一小部分市场风险。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金的总收益为 38.24%。基金相对于沪深 300 全收益指数（收益为 27.42%）的超额收益为 10.82%，相对于比较基准（95%沪深 300 价格指数收益 + 年化 2.5%）的超额收益为 11.38%。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。本轮牛市是中国 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、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 25%；基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，收益分配基准日可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。本基金于 2015 年 1 月 27 日进行利润分配，每 10 份基金份额派发现金红利 3.5 元，利润分配合计 1,058,971,971.81 元，其中现金形式发放总额为 1,058,971,971.81 元。截止本报告期末，本基金可分配收益为 1,156,093,001.59 元。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞量化指数增强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	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	113,222,468.27	91,346,442.17
结算备付金		14,387,290.60	7,141,111.71
存出保证金		70,004,649.14	751,539.46
交易性金融资产	6.4.7.2	3,312,462,169.55	2,492,446,513.22
其中：股票投资		3,272,270,169.55	2,412,422,513.22
基金投资		-	-
债券投资		40,192,000.00	80,024,000.00
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		71,329,093.20	9,995,163.02
应收利息	6.4.7.5	916,518.28	2,387,825.26
应收股利		-	-
应收申购款		24,078,348.47	23,251,685.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,606,400,537.51	2,627,320,280.13
<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		-	2,319,544.16
应付赎回款		80,017,955.21	62,144,821.69
应付管理人报酬		3,195,252.77	1,815,635.51

应付托管费		798,813.21	453,908.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,192,552.88	3,216,795.44
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	480,081.47	444,213.30
负债合计		89,684,655.54	70,394,918.98
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,803,350,753.77	1,455,066,003.59
未分配利润	6.4.7.10	1,713,365,128.20	1,101,859,357.56
所有者权益合计		3,516,715,881.97	2,556,925,361.15
负债和所有者权益总计		3,606,400,537.51	2,627,320,280.13

注：1. 报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.95 元，基金份额总额 1,803,350,753.77 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金

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	上年度可比期间
		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		1,215,372,820.54	19,032,369.76
1.利息收入		2,829,906.06	94,503.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,278,004.70	94,503.41
债券利息收入		1,551,901.36	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,357,668,213.36	14,656,228.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,329,698,277.91	10,625,358.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	100,960.00	-
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	27,868,975.45	4,030,869.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-153,623,240.88	3,924,762.73
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	8,497,942.00	356,875.27
<b>减：二、费用</b>		40,903,461.47	3,341,250.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	17,645,524.21	1,316,450.23
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,411,381.09	329,112.54
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	18,638,224.14	1,580,418.38
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	208,332.03	115,269.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,174,469,359.07	15,691,119.05
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,174,469,359.07	15,691,119.05

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金

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）	1,455,066,003.59	1,101,859,357.56	2,556,925,361.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,174,469,359.07	1,174,469,359.07
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）	348,284,750.18	496,008,383.38	844,293,133.56
其中：1.基金申购款	4,499,216,827.99	3,181,505,411.82	7,680,722,239.81
2.基金赎回款	-4,150,932,077.81	-2,685,497,028.44	-6,836,429,106.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,058,971,971.81	-1,058,971,971.81
五、期末所有者权益（基金净值）	1,803,350,753.77	1,713,365,128.20	3,516,715,881.97



项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	231,382,764.42	7,096,678.30	238,479,442.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,691,119.05	15,691,119.05
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)	100,837,437.76	2,894,106.06	103,731,543.82
其中：1.基金申购款	373,705,072.38	15,525,602.39	389,230,674.77
2.基金赎回款	-272,867,634.62	-12,631,496.33	-285,499,130.95
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)	332,220,202.18	25,681,903.41	357,902,105.59

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

华泰柏瑞量化指数增强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[2013]610 号《关于核准华泰柏瑞量化指数增强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《华泰柏瑞量化指数增强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 333,108,260.81 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(2013)第 441 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 8 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 333,186,365.72 份基金份额,其中认购资金利息

折合 78,104.91 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化指数增强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，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货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(须符合中国证监会相关规定)。本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%；现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比率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+2.5%。

本财务报表由本基金的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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 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

除 6.4.5.2 会计估计变更的说明外，其他会计政策和会计估计与上年度相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起, 对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(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	113,222,468.27
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	113,222,468.27

### 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	2,917,602,636.33	3,272,270,169.55	354,667,533.22	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	39,986,440.00	40,192,000.00	205,560.00
	合计	39,986,440.00	40,192,000.00	205,560.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,957,589,076.33	3,312,462,169.55	354,873,093.22	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日			备注
	合同/名义金 额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-51,017,520.00	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-51,017,520.00	

#### 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：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

注：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	29,698.69
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	27,299.58
应收债券利息	858,904.11
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	615.90
合计	916,518.28

#### 6.4.7.6 其他资产

注：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	5,192,102.88
银行间市场应付交易费用	450.00
合计	5,192,552.88

#### 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	301,562.98

预提费用	178,518.49
合计	480,081.47

### 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	1,455,066,003.59	1,455,066,003.59
本期申购	4,499,216,827.99	4,499,216,827.99
本期赎回(以“-”号填列)	-4,150,932,077.81	-4,150,932,077.81
- 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	1,803,350,753.77	1,803,350,753.77

### 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	479,154,737.91	622,704,619.65	1,101,859,357.56
本期利润	1,328,092,599.95	-153,623,240.88	1,174,469,359.07
本期基金份额交易产生的变动数	407,817,635.54	88,190,747.84	496,008,383.38
其中：基金申购款	1,274,437,802.12	1,907,067,609.70	3,181,505,411.82
基金赎回款	-866,620,166.58	-1,818,876,861.86	-2,685,497,028.44
本期已分配利润	-1,058,971,971.81	-	-1,058,971,971.81
本期末	1,156,093,001.59	557,272,126.61	1,713,365,128.20

### 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
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	237,632.99
其他	78,230.90
合计	1,278,004.70

### 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	6,269,118,652.87
减：卖出股票成本总额	4,939,420,374.96
买卖股票差价收入	1,329,698,277.91

### 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

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	100,960.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	100,960.00

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	83,456,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	79,899,040.00
减：应收利息总额	3,456,000.00
买卖债券差价收入	100,960.00

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

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

注：本基金本报告期末无衍生工具收益。

#### 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	27,868,975.45
基金投资产生的股利收益	-
合计	27,868,975.45

#### 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	-128,114,480.88
——股票投资	-128,195,080.88
——债券投资	80,600.00
——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	-25,508,760.00
合计	-153,623,240.88

#### 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	8,303,450.00
转换费收入	194,492.00
合计	8,497,942.00

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、本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用的 25% 的部分归入基金资产。



### 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	18,637,974.14
银行间市场交易费用	250.00
合计	18,638,224.14

### 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	29,752.78
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	29,813.54
合计	208,332.03

## 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

截止资产负债表日，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

本基金名称自 2015 年 8 月 6 日起，由“华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞量化增强混合”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司 2015 年 8 月 6 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》。

## 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
中国银行股份有限公司	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：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

注：无。

#### 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		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
华泰证券股份	719,974,286.00	5.96%	227,760,039.44	21.18%

#### 债券交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券交易。

#### 债券回购交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券回购交易。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的权证交易。

##### 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	654,205.69	5.96%	573,716.39	11.05%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	207,309.91	21.47%	207,309.91	40.41%

## 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1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,645,524.21	1,316,450.23
其中：支付销售机构的客户维护费	218,466.66	223,837.73

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1% / 当年天数。

### 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	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,411,381.09	329,112.54

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

### 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：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

## 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：本报告期及 2014 年度，基金管理人未投资本基金。

### 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

份额单位：份

关联方名	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
------	-------------------	---------------------

称	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	21,551,005.75	1.2000%	-	-

#### 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		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	113,222,468.27	962,140.81	19,001,935.69	74,862.71

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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：本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2015年1月27日	2015年1月27日	3.5000	906,962,754.69	152,009,217.12	1,058,971,971.81	
合计	-	-	3.5000	906,962,754.69	152,009,217.12	1,058,971,971.81	

#### 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：无。

### 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
002367	康力电梯	2015年6月24日	临时停牌	28.49	-	-	2,232,935	29,296,317.04	63,616,318.15	-
601633	长城汽车	2015年6月19日	临时停牌	42.76	2015年7月13日	38.50	744,687	35,510,852.64	31,842,816.12	-
002320	海峡股份	2015年6月26日	临时停牌	27.43	-	-	926,985	16,326,342.29	25,427,198.55	-
000708	大冶特钢	2015年5月13日	临时停牌	13.92	-	-	1,572,774	17,843,292.42	21,893,014.08	-
002191	劲嘉股份	2015年6月18日	临时停牌	19.22	-	-	517,200	7,289,563.95	9,940,584.00	-
600886	国投电力	2015年6月24日	临时停牌	14.87	-	-	253,300	2,903,507.37	3,766,571.00	-

注：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：本基金本报告期内无银行间市场债券正回购。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期内无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

本基金属主动管理的股票型证券投资基金，为证券投资基金中的较高风险较高收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资、股指期货投资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投资（须符合中国证监会相关规定）。本基金力求有效控制

投资风险的前提下，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。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投资组合的风险、管理风险、投资合规性风险和其它风险。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

控制在限定的范围之内。

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。除此之外，量化投资团队还有使用量化模型来控制投资组合的风险的流程，从量化的角度把市场风险控制在目标范围内。

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。量化投资团队利用风险估测模型和适当的控制措施，加强了定量分析的方法，有效控制投资组合的预期投资风险，并力求将投资组合的实现风险（用跟踪误差衡量）控制在目标范围内。

#### 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中国银行，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；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，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。

### 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，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。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

### 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。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、存出保证金和结算备付金，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

##### 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	113,222,468.27	-	-	-	-	-	113,222,468.27
结算备付金	14,387,290.60	-	-	-	-	-	14,387,290.60
存出保证金	1,368,510.14	-	-	-	-	68,636,139.00	70,004,649.14
交易性金融资产	-	-	40,192,000.00	-	-	3,272,270,169.55	3,312,462,169.55
应收证券清算款	-	-	-	-	-	96,837,853.20	96,837,853.20
应收利息	-	-	-	-	-	916,518.28	916,518.28
应收申购款	-	-	-	-	-	24,078,348.47	24,078,348.47
其他资产	-	-	-	-	-	-25,508,760.00	-25,508,760.00
资产总计	128,978,269.01	-	40,192,000.00	-	-	3,437,230,268.50	3,606,400,537.51
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	80,017,955.21	80,017,955.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,195,252.77	3,195,252.77
应付托管费	-	-	-	-	-	798,813.21	798,813.21
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,192,552.88	5,192,552.88
其他负债	-	-	-	-	-	480,081.47	480,081.47
负债总计	-	-	-	-	-	89,684,655.54	89,684,655.54
利率敏感度	128,978,269.01	-	40,192,000.00	-	-	3,347,545,612.96	3,516,715,881.97



缺口							
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	91,346,442.17	-	-	-	-	-	91,346,442.17
结算备付金	7,141,111.71	-	-	-	-	-	7,141,111.71
存出保证金	751,539.46	-	-	-	-	-	751,539.46
交易性金融 资产	-	40,024,000.00	40,000,000.00	-	-	-2,412,422,513.22	2,492,446,513.22
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	9,995,163.02	9,995,163.02
应收利息	-	-	-	-	-	2,387,825.26	2,387,825.26
应收申购款	-	-	-	-	-	23,251,685.29	23,251,685.29
资产总计	99,239,093.34	40,024,000.00	40,000,000.00	-	-	-2,448,057,186.79	2,627,320,280.13
负债							
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	2,319,544.16	2,319,544.16
应付赎回款	-	-	-	-	-	62,144,821.69	62,144,821.69
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	1,815,635.51	1,815,635.51
应付托管费	-	-	-	-	-	453,908.88	453,908.88
应付交易费 用	-	-	-	-	-	3,216,795.44	3,216,795.44
其他负债	-	-	-	-	-	444,213.30	444,213.30
负债总计	-	-	-	-	-	70,394,918.98	70,394,918.98
利率敏感度 缺口	99,239,093.34	40,024,000.00	40,000,000.00	-	-	-2,377,662,267.81	2,556,925,361.15

#### 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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.14% (2014 年 12 月 31 日：3.13%)，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

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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交易的股票，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，运用量化投资策略，实现增强指数收益的目标。本基金利用定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在严格控制组合预期跟踪误差的基础上，力求超越标的指数投资回报。一般情况下，本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 85%。

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。

#### 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	3,272,270,169.55	93.05	2,412,422,513.22	94.35
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	40,192,000.00	1.14	80,024,000.00	3.13
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	3,312,462,169.55	94.19	2,492,446,513.22	97.48

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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）
	业绩比较基准上升 5%	增加约 15818 万元	增加约 11424 万元
	业绩比较基准下降 5%	减少约 15818 万元	减少约 11424 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	3,272,270,169.55	90.74
	其中：股票	3,272,270,169.55	90.74
2	固定收益投资	40,192,000.00	1.11
	其中：债券	40,192,000.00	1.11
	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	127,609,758.87	3.54
7	其他各项资产	166,328,609.09	4.61
8	合计	3,606,400,537.51	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	21,699,681.00	0.62
B	采矿业	37,579,801.52	1.07
C	制造业	1,292,757,384.06	36.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	222,571,704.22	6.33
E	建筑业	154,713,825.17	4.40
F	批发和零售业	55,618,349.31	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	144,011,293.02	4.10
H	住宿和餐饮业	336,740.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,279,606.00	0.09
J	金融业	1,201,764,297.87	34.17
K	房地产业	111,129,132.18	3.16
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	10,686,390.00	0.30
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	16,121,965.20	0.46
S	综合	-	-
	合计	3,272,270,169.55	93.05

### 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	1,845,515	151,221,499.10	4.30
2	601009	南京银行	4,861,736	110,847,580.80	3.15
3	600005	武钢股份	13,676,353	96,144,761.59	2.73
4	600036	招商银行	5,005,948	93,711,346.56	2.66
5	000333	美的集团	2,302,957	85,854,236.96	2.44
6	600999	招商证券	2,837,167	75,071,438.82	2.13
7	000651	格力电器	1,172,498	74,922,622.20	2.13
8	600000	浦发银行	4,407,587	74,752,675.52	2.13
9	600900	长江电力	4,973,738	71,373,140.30	2.03
10	601668	中国建筑	8,447,328	70,197,295.68	2.00
11	002367	康力电梯	2,232,935	63,616,318.15	1.81
12	600837	海通证券	2,789,907	60,819,972.60	1.73
13	601377	兴业证券	4,393,478	60,146,713.82	1.71
14	600016	民生银行	5,769,891	57,352,716.54	1.63
15	600369	西南证券	2,870,438	56,404,106.70	1.60
16	002179	中航光电	1,670,128	55,114,224.00	1.57
17	600015	华夏银行	3,616,187	55,002,204.27	1.56
18	601166	兴业银行	3,173,652	54,745,497.00	1.56
19	600029	南方航空	3,721,400	54,109,156.00	1.54
20	600004	白云机场	3,068,002	51,849,233.80	1.47
21	600030	中信证券	1,889,614	50,849,512.74	1.45
22	000933	神火股份	5,357,598	50,468,573.16	1.44
23	600048	保利地产	4,262,257	48,674,974.94	1.38
24	002415	海康威视	1,073,740	48,103,552.00	1.37
25	601555	东吴证券	2,335,284	47,803,263.48	1.36

26	601818	光大银行	8,888,205	47,640,778.80	1.35
27	600027	华电国际	4,208,221	46,795,417.52	1.33
28	600276	恒瑞医药	996,426	44,380,814.04	1.26
29	600068	葛洲坝	3,645,212	42,612,528.28	1.21
30	601788	光大证券	1,482,843	39,962,618.85	1.14
31	000039	中集集团	1,210,362	39,094,692.60	1.11
32	000625	长安汽车	1,842,101	38,960,436.15	1.11
33	002202	金风科技	1,931,312	37,602,644.64	1.07
34	000001	平安银行	2,453,559	35,674,747.86	1.01
35	600827	百联股份	1,621,429	33,741,937.49	0.96
36	600019	宝钢股份	3,770,639	32,955,384.86	0.94
37	002249	大洋电机	2,546,192	32,642,181.44	0.93
38	601633	长城汽车	744,687	31,842,816.12	0.91
39	000776	广发证券	1,372,913	31,096,479.45	0.88
40	601398	工商银行	5,882,162	31,057,815.36	0.88
41	600011	华能国际	2,204,565	30,930,046.95	0.88
42	000002	万科A	2,115,533	30,717,539.16	0.87
43	000418	小天鹅A	1,182,521	28,262,251.90	0.80
44	002267	陕天然气	1,817,143	28,147,545.07	0.80
45	600271	航天信息	406,800	26,324,028.00	0.75
46	600741	华域汽车	1,208,822	25,808,349.70	0.73
47	002320	海峡股份	926,985	25,427,198.55	0.72
48	603001	奥康国际	809,172	25,262,349.84	0.72
49	600236	桂冠电力	2,185,798	24,393,505.68	0.69
50	002025	航天电器	901,896	23,629,675.20	0.67
51	600519	贵州茅台	85,707	22,082,408.55	0.63
52	000708	大冶特钢	1,572,774	21,893,014.08	0.62
53	002321	华英农业	1,767,075	21,699,681.00	0.62
54	002294	信立泰	754,145	21,568,547.00	0.61
55	600887	伊利股份	1,120,616	21,179,642.40	0.60
56	000423	东阿阿胶	372,704	20,312,368.00	0.58
57	600079	人福医药	537,017	19,896,479.85	0.57
58	601677	明泰铝业	1,107,030	18,122,081.10	0.52
59	000858	五粮液	567,100	17,977,070.00	0.51
60	600028	中国石化	2,540,600	17,936,636.00	0.51
61	000603	盛达矿业	708,908	17,680,165.52	0.50
62	601328	交通银行	2,142,499	17,654,191.76	0.50
63	601186	中国铁建	1,128,057	17,631,530.91	0.50
64	601607	上海医药	786,666	17,519,051.82	0.50

65	600461	洪城水业	831,258	17,165,477.70	0.49
66	600873	梅花生物	1,611,951	16,828,768.44	0.48
67	600582	天地科技	952,352	16,275,695.68	0.46
68	600518	康美药业	909,326	16,122,349.98	0.46
69	600373	中文传媒	672,870	16,121,965.20	0.46
70	601233	桐昆股份	797,066	15,909,437.36	0.45
71	601169	北京银行	1,161,710	15,473,977.20	0.44
72	601390	中国中铁	1,104,241	15,117,059.29	0.43
73	600970	中材国际	1,022,314	14,946,230.68	0.43
74	600398	海澜之家	808,544	14,658,902.72	0.42
75	002563	森马服饰	558,466	13,492,538.56	0.38
76	600823	世茂股份	1,028,145	13,396,729.35	0.38
77	600584	长电科技	630,353	12,046,045.83	0.34
78	600064	南京高科	555,004	10,822,578.00	0.31
79	600458	时代新材	428,246	10,748,974.60	0.31
80	600176	中国巨石	395,000	10,688,700.00	0.30
81	002573	清新环境	517,000	10,686,390.00	0.30
82	600685	广船国际	186,502	10,022,617.48	0.28
83	002142	宁波银行	471,765	9,977,829.75	0.28
84	002191	劲嘉股份	517,200	9,940,584.00	0.28
85	000928	中钢国际	369,021	9,155,411.01	0.26
86	000703	恒逸石化	703,600	8,977,936.00	0.26
87	601939	建设银行	1,249,576	8,909,476.88	0.25
88	000783	长江证券	634,936	8,857,357.20	0.25
89	002588	史丹利	303,900	8,737,125.00	0.25
90	601313	江南嘉捷	450,485	8,428,574.35	0.24
91	600305	恒顺醋业	267,264	8,068,700.16	0.23
92	600376	首开股份	374,312	7,220,478.48	0.21
93	000550	江铃汽车	190,408	6,987,973.60	0.20
94	600009	上海机场	219,800	6,967,660.00	0.20
95	002190	成飞集成	123,300	6,287,067.00	0.18
96	600177	雅戈尔	335,551	6,127,161.26	0.17
97	600066	宇通客车	276,969	5,691,712.95	0.16
98	600221	海南航空	885,453	5,658,044.67	0.16
99	000902	新洋丰	188,400	5,115,060.00	0.15
100	002736	国信证券	203,301	5,100,822.09	0.15
101	600597	光明乳业	205,296	4,721,808.00	0.13
102	002640	跨境通	62,750	4,357,360.00	0.12
103	002152	广电运通	126,683	4,096,928.22	0.12

104	600886	国投电力	253,300	3,766,571.00	0.11
105	002501	利源精制	216,100	3,453,278.00	0.10
106	600572	康恩贝	148,766	3,376,988.20	0.10
107	600686	金龙汽车	124,700	3,209,778.00	0.09
108	601028	玉龙股份	260,170	3,127,243.40	0.09
109	002519	银河电子	140,998	2,862,259.40	0.08
110	600038	中直股份	45,887	2,842,699.65	0.08
111	600426	华鲁恒升	126,350	2,345,056.00	0.07
112	600391	成发科技	34,300	2,007,922.00	0.06
113	000758	中色股份	100,000	1,963,000.00	0.06
114	601989	中国重工	125,735	1,860,878.00	0.05
115	600660	福耀玻璃	124,500	1,777,860.00	0.05
116	002601	佰利联	36,105	1,642,777.50	0.05
117	600446	金证股份	12,600	1,555,596.00	0.04
118	000728	国元证券	39,404	1,496,563.92	0.04
119	000100	TCL 集团	246,000	1,389,900.00	0.04
120	002195	二三四五	29,500	1,226,020.00	0.03
121	002465	海格通信	36,244	1,166,694.36	0.03
122	600118	中国卫星	16,600	945,536.00	0.03
123	600690	青岛海尔	21,400	649,062.00	0.02
124	002293	罗莱家纺	26,625	481,646.25	0.01
125	600801	华新水泥	39,200	414,344.00	0.01
126	600754	锦江股份	11,300	336,740.00	0.01
127	002280	联络互动	5,900	314,470.00	0.01
128	600383	金地集团	23,465	296,832.25	0.01
129	000725	京东方 A	47,610	247,095.90	0.01
130	600588	用友网络	4,000	183,520.00	0.01
131	601336	新华保险	2,180	133,110.80	0.00
132	601968	宝钢包装	1,000	13,950.00	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	601318	中国平安	129,812,579.65	5.08
2	600011	华能国际	109,561,624.80	4.28

3	600873	梅花生物	86,403,552.64	3.38
4	000333	美的集团	86,369,755.00	3.38
5	600900	长江电力	84,278,363.30	3.30
6	600016	民生银行	79,725,599.42	3.12
7	002202	金风科技	79,328,119.87	3.10
8	601377	兴业证券	79,219,841.89	3.10
9	600585	海螺水泥	75,888,370.32	2.97
10	601166	兴业银行	75,032,130.66	2.93
11	601555	东吴证券	74,583,390.59	2.92
12	000776	广发证券	74,540,183.74	2.92
13	000933	神火股份	74,114,491.73	2.90
14	600019	宝钢股份	73,890,162.12	2.89
15	600036	招商银行	70,298,003.03	2.75
16	600369	西南证券	69,713,497.83	2.73
17	000686	东北证券	69,614,100.19	2.72
18	600005	武钢股份	68,086,965.52	2.66
19	601677	明泰铝业	65,562,501.26	2.56
20	600030	中信证券	65,087,854.35	2.55
21	600048	保利地产	64,907,939.04	2.54
22	600000	浦发银行	64,781,960.05	2.53
23	000002	万科A	63,474,993.65	2.48
24	000651	格力电器	61,205,579.03	2.39
25	601006	大秦铁路	60,252,896.03	2.36
26	601009	南京银行	55,793,173.31	2.18
27	600177	雅戈尔	55,543,260.15	2.17
28	600999	招商证券	54,419,256.98	2.13
29	002267	陕天然气	51,645,636.56	2.02

#### 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	000671	阳光城	104,891,212.40	4.10
2	000651	格力电器	91,946,496.11	3.60
3	601318	中国平安	90,322,410.87	3.53



4	600011	华能国际	88,884,024.91	3.48
5	000686	东北证券	87,938,141.51	3.44
6	600742	一汽富维	82,925,498.67	3.24
7	000776	广发证券	82,114,230.34	3.21
8	600873	梅花生物	81,069,232.23	3.17
9	000418	小天鹅A	80,839,376.61	3.16
10	600585	海螺水泥	78,462,589.77	3.07
11	002508	老板电器	73,997,110.00	2.89
12	600823	世茂股份	73,505,430.05	2.87
13	000002	万科A	73,260,535.96	2.87
14	601006	大秦铁路	68,888,198.39	2.69
15	600694	大商股份	68,813,702.60	2.69
16	002521	齐峰新材	67,589,082.74	2.64
17	601336	新华保险	66,041,515.90	2.58
18	002327	富安娜	65,743,785.66	2.57
19	600177	雅戈尔	64,187,009.97	2.51
20	600015	华夏银行	63,787,601.50	2.49
21	600837	海通证券	63,448,415.44	2.48
22	002567	唐人神	63,273,523.75	2.47
23	600987	航民股份	62,487,242.07	2.44
24	601328	交通银行	60,450,310.04	2.36
25	000550	江铃汽车	59,469,700.28	2.33
26	601398	工商银行	59,408,615.76	2.32
27	002595	豪迈科技	58,930,953.30	2.30
28	601818	光大银行	58,715,425.60	2.30
29	601677	明泰铝业	58,302,233.92	2.28
30	002415	海康威视	57,707,735.97	2.26
31	002427	尤夫股份	56,761,203.35	2.22
32	002554	惠博普	56,539,113.91	2.21
33	601766	中国南车	56,371,941.45	2.20
34	600000	浦发银行	55,043,224.91	2.15
35	600252	中恒集团	53,744,476.93	2.10
36	600019	宝钢股份	52,911,028.33	2.07
37	002050	三花股份	52,654,458.05	2.06
38	000540	中天城投	51,440,665.97	2.01

### 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	5,927,463,112.17
卖出股票收入（成交）总额	6,269,118,652.87

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,192,000.00	1.14
	其中：政策性金融债	40,192,000.00	1.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	40,192,000.00	1.14

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140230	14 国开 30	400,000	40,192,000.00	1.14

### 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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1512	IF1512	-403	-527,970,300.00	-25,508,760.00	-
公允价值变动总额合计（元）				-25,508,760.00	-
股指期货投资本期收益（元）				0.00	-
股指期货投资本期公允价值变动（元）				-25,508,760.00	-

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在本报告期最后两周极端的市场行情下，股市流动性不足。在卖出股票现货冲击成本较大的情况下，我们使用了一定量的股指期货进行套保，对冲了一小部分市场风险。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 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情形。

### 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	70,004,649.14
2	应收证券清算款	71,329,093.20
3	应收股利	-
4	应收利息	916,518.28
5	应收申购款	24,078,348.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	166,328,609.09

### 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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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
20,177	89,376.56	1,257,896,419.54	69.75%	545,454,334.23	30.25%

### 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
基金管理人所有从业人员 持有本基金	2,325,054.66	0.1300%

### 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	100 万份以上
本基金基金经理持有本开放式基金	10 至 50 万份

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 8 月 2 日）基金份额总额	333,186,365.72
本报告期期初基金份额总额	1,455,066,003.59

本报告期基金总申购份额	4,499,216,827.99
减:本报告期基金总赎回份额	4,150,932,077.81
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,803,350,753.77

## § 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

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。

2015年4月,李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,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为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	
国信证券	1	1,377,350,492.58	11.24%	1,218,821.33	11.03%	-
西南证券	1	1,241,274,078.03	10.13%	1,130,058.04	10.23%	-
申银万国	1	1,182,305,727.82	9.65%	1,076,383.18	9.75%	-
浙商证券	1	1,153,167,875.77	9.41%	1,020,444.58	9.24%	-
长城证券	1	907,517,190.66	7.41%	826,208.55	7.48%	-
中金公司	1	894,575,307.60	7.30%	814,415.46	7.37%	-
广发证券	1	740,830,352.38	6.05%	674,452.70	6.11%	-
海通证券	1	739,899,607.05	6.04%	654,739.22	5.93%	-
华泰证券	2	719,974,286.00	5.88%	654,205.69	5.92%	-
中原证券	1	570,923,980.72	4.66%	519,766.66	4.71%	-
国泰君安	1	558,692,470.17	4.56%	494,387.34	4.48%	-
方正证券	1	433,462,885.41	3.54%	383,573.86	3.47%	-
国金证券	1	391,535,768.52	3.20%	346,470.19	3.14%	-
德邦证券	1	357,043,397.44	2.91%	325,057.23	2.94%	-
东方证券	1	354,185,955.42	2.89%	322,451.79	2.92%	-
招商证券	1	323,593,528.30	2.64%	286,348.46	2.59%	-
中信证券	1	137,559,369.15	1.12%	125,232.93	1.13%	-
银河证券	1	112,543,197.02	0.92%	102,459.76	0.93%	-

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。

### 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

注：无。

### 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年6月30日
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年6月5日
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年6月1日
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年5月28日
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年5月25日
6	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年4月3日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月1日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司参加恒丰银行股份有限公司开放式基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年2月17日

9	华泰柏瑞基金管理有限公司参加国都证券有限责任公司开放式基金网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 2 月 4 日
10	华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 1 月 22 日

## § 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 弄上海证大五道口广场 1 号 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