

上证红利交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告 摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞上证红利 ETF
基金主代码	510880
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	227,175,703.00 份
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2007-01-18

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	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。
业绩比较基准	上证红利指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证红利指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	张燕
	联系电话	021-38601777	0755-83199084
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95555
传真		021-38601799	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	425,369,434.80	150,000,347.95	-1,370,007.17
本期利润	193,762,220.19	513,729,038.89	-84,610,894.79
加权平均基金份额本期利润	0.6185	0.8316	-0.1187
本期加权平均净值利润率	21.24%	46.79%	-6.37%
本期基金份额净值增长率	11.54%	56.60%	-8.85%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	297,675,443.77	257,036,166.62	146,082,567.65
期末可供分配基金份额利润	1.3103	0.5254	0.2148
期末基金资产净值	644,360,845.79	1,285,338,347.74	1,184,076,436.98
期末基金份额净值	2.836	2.628	1.741
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	116.07%	93.71%	23.70%

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

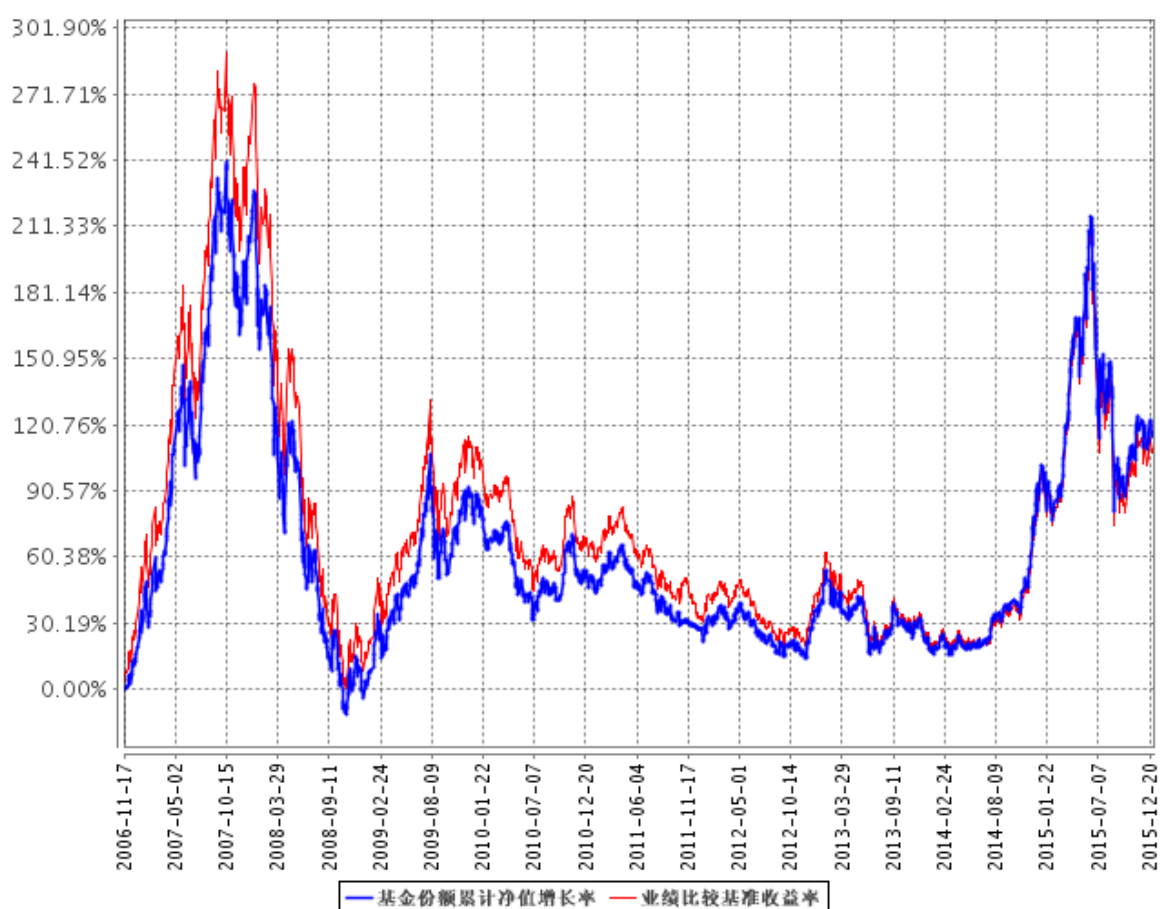
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	14.08%	1.56%	14.32%	1.56%	-0.24%	0.00%

过去六个月	-19.86%	2.79%	-20.62%	2.80%	0.76%	-0.01%
过去一年	11.54%	2.61%	9.31%	2.63%	2.23%	-0.02%
过去三年	59.21%	1.87%	46.11%	1.88%	13.10%	-0.01%
过去五年	45.17%	1.62%	27.54%	1.63%	17.63%	-0.01%
自基金合同生效起至今	116.07%	2.03%	108.68%	2.05%	7.39%	-0.02%

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

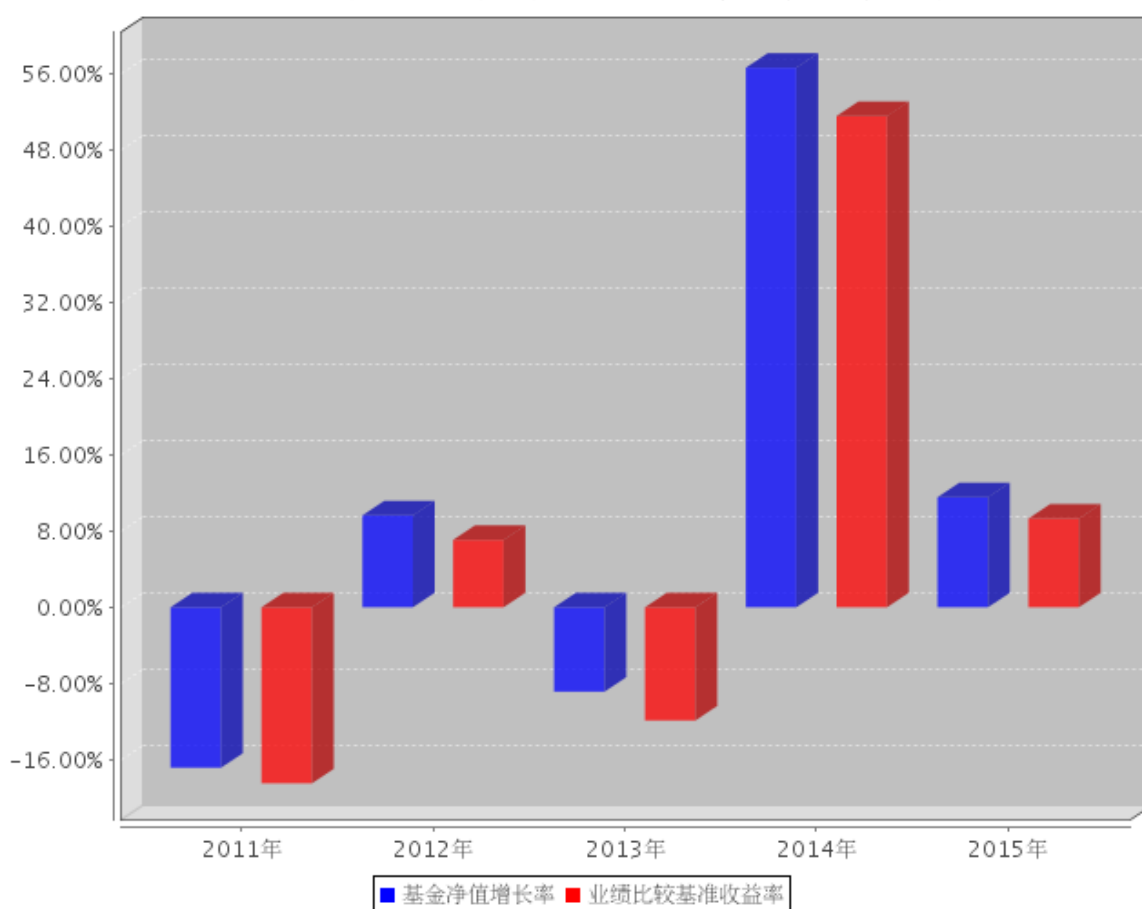


注：图示日期为2006年11月17日至2015年12月31日。

按基金合同规定，本基金自基金合同生效起3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十六条（二）投资范围及投资比例中规定的比例，即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合 计	备注
2015	0.80	40,734,056.24	—	40,734,056.24	
2014	0.59	40,189,367.96	—	40,189,367.96	
2013	—	—	—	—	
合计	1.39	80,923,424.20	—	80,923,424.20	

§ 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。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混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、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 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型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证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金。截至 2015 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 1299.23 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		
柳军	本基金的基金经理、指数投资部总监	2009 年 6 月 4 日	—	14	柳军，14 年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士，2000 年至 2001

					年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作，2001年至2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年7月起加入本公司，历任基金事务部总监、基金经理助理。2009年6月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010年10月1日起任华泰柏瑞指数投资部副总监。2011年1月起担任华泰柏瑞上证中小盘ETF及华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

					2012 年 5 月起担任华泰柏瑞沪深 300ETF 及华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金基金经理。 2015 年 2 月起任指数投资部总监。 2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 ETF 及华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金的基金经理。
龚丽丽	本基金的基金经理	2015 年 6 月 3 日	-	4 年	上海交通大学数学系硕士。 2011 年 5 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部研究员、基金经理助理。 2015 年 6 月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经

					理。
--	--	--	--	--	----

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。任职日期和离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《上证红利交易型开放式指数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 公平交易制度和控制方法

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，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。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，对于场内交易启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 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。同时潜在利益输送金额比较小，因此不构成利益输送。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。

4.3.3 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

2015 年之于 A 股市场波澜壮阔的一年。2014 年底到 2015 年 6 月市场经历快速上涨，其核心驱动力是对于中国经济改革转型乐观预期带来的市场风险偏好提升。期间小盘股票大幅走强于大盘股，15 年初至 6 月 10 日，创业板累计涨幅超过 160%。而 6 月中下旬，在清理场外配资的背景下，强平导致的踩踏致使 A 股出现急速回撤，其速度和深度均让市场始料未及。受到 8 月份人民币贬值影响，国际市场出现大幅波动，A 股进一步受挫。9 月后，在全球股市上行大背景下，A 股暂别颓势出现反弹并持续至年底。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的累计跟踪偏离为 2.226%，日均绝对跟踪偏离度为 0.025%，期间日跟踪误差为 0.0535%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 2.836 元，还原后基金份额累计净值为 2.057 元，本报告期内基金份额净值上涨 11.54%，本基金的业绩比较基准上涨 9.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经历跌宕起伏的 2015 年后，投资者情绪急剧下降。随着改革进入深水区，“供给侧改革”的推进将可能导致宏观经济的阶段性恶化（去产能、去库存、去杠杆等措施都会阶段性地削弱经济增长动力），在“稳增长”的目标基调下政策将出现两难，政策的不确定性，使得市场风险偏好难以提升。展望 2016，我们认为市场将进入相对收益者“存量博弈”的环境。

在全球经济萎缩的大背景下，市场投资兴趣整体悲观，加之对于汇率以及政策不确定性担忧，中期看弱势格局难以打破。鉴于此，我们认为估值将成为 2016 年重要投资逻辑。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

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，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。根据基金合同约定，本基金已于 2015 年 1 月对 2014 年度可分配利润实施了分红，每 10 份基金份额派发现金红利 0.80 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

普华永道会计师事务所对本基金的年度报告出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2016)第 21934 号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：上证红利交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	4,351,715.55	1,729,014.85
结算备付金		103,082.07	481,554.92
存出保证金		101,875.78	8,912.50
交易性金融资产	7.4.7.2	641,069,295.96	1,281,663,604.93
其中：股票投资		641,069,295.96	1,281,663,604.93
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,067.01	3,314,919.84
应收利息	7.4.7.5	1,015.81	877.45
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		645,628,052.18	1,287,198,884.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		274,154.72	521,420.95
应付托管费		54,830.92	104,284.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	320,617.75	613,729.14
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	617,603.00	621,102.44
负债合计		1,267,206.39	1,860,536.75
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	346,685,402.02	746,515,023.28
未分配利润	7.4.7.10	297,675,443.77	538,823,324.46
所有者权益合计		644,360,845.79	1,285,338,347.74
负债和所有者权益总计		645,628,052.18	1,287,198,884.49

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.836 元，基金份额总额 227,175,703.00 份。

7.2 利润表

会计主体：上证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		200,864,061.30	522,087,226.65
1.利息收入		101,406.81	142,939.65
其中：存款利息收入	7.4.7.11	86,545.69	70,462.01
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		14,861.12	72,477.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		437,787,642.21	158,089,845.18
其中：股票投资收益	7.4.7.12	412,273,311.26	110,472,795.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	25,514,330.95	47,617,049.73
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-231,607,214.61	363,728,690.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-5,417,773.11	125,750.88
减：二、费用		7,101,841.11	8,358,187.76
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,575,109.52	5,489,333.89
2. 托管费	7.4.10.2.2	915,021.91	1,097,866.90
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,024,068.23	1,173,837.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	587,641.45	597,149.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		193,762,220.19	513,729,038.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		193,762,220.19	513,729,038.89

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	746,515,023.28	538,823,324.46	1,285,338,347.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	193,762,220.19	193,762,220.19
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）	-399,829,621.26	-394,176,044.64	-794,005,665.90
其中：1.基金申购款	10,358,944,543.76	11,614,539,865.75	21,973,484,409.51
2.基金赎回款	-10,758,774,165.02	-12,008,715,910.39	-22,767,490,075.41
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）	-	-40,734,056.24	-40,734,056.24
五、期末所有者权益（基金净值）	346,685,402.02	297,675,443.77	644,360,845.79
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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）	1,037,993,869.33	146,082,567.65	1,184,076,436.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	513,729,038.89	513,729,038.89
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）	-291,478,846.05	-80,798,914.12	-372,277,760.17
其中：1.基金申购款	221,279,752.33	86,567,414.51	307,847,166.84
2.基金赎回款	-512,758,598.38	-167,366,328.63	-680,124,927.01
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）	-	-40,189,367.96	-40,189,367.96
五、期末所有者权益（基金净值）	746,515,023.28	538,823,324.46	1,285,338,347.74

金净值)			
------	--	--	--

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 韩勇	_____ 房伟力	_____ 赵景云
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上证红利交易型开放式指数证券投资基金(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”)证监基金字[2006]第 196 号《关于同意上证红利交易型开放式指数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《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，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 2,222,962,819.00 元(含募集股票市值)，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(2006)第 170 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2006 年 11 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,222,985,094.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 22,275.00 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。根据《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于 2007 年 1 月 10 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.65527799，并于 2007 年 1 月 11 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2007]第 4 号文审核同意，本基金 1,456,675,703 份基金份额于 2007 年 1 月 18 日在上交所挂牌交易。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的主要投资范围为标的指数成份股和备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。本基金的业绩基准为上证红利指数。

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 2016 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 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》、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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》、财税[2015]101 号《关于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。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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。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。

7.4.7 关联方关系

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
招商银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、一级交易商
柏瑞投资有限责任公司	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

注：无。

7.4.8.1.2 权证交易

注：无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,575,109.52	5,489,333.89
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.50% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ 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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	915,021.91	1,097,866.90

注：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 0.10% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ 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。

7.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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

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

	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	-	-	1,982,475.00	0.4100%

7.4.8.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	4,351,715.55	61,773.94	1,729,014.85	58,864.47

注：本报告期，基金托管人招商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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.9.2 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
600578	京能电 力	2015 年 11 月 5 日	临时停牌	6.07	2016 年 2 月 24 日	5.49	1,430,987	8,442,902.39	8,686,091.09	-

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2015 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 21,973,484,409.51 元(2014 年度：307,847,166.84 元)，其中包括以股票支付的申购款 20,561,405,524.11 元和以现金支付的申购款 1,412,078,885.40 元(2014 年度：以股票支付的申购款 303,775,591.00 元和以现金支付的申购款 4,071,575.84 元)。

(2) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 632,383,204.87 元，属于第二层次的余额为 8,686,091.09，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 1,281,663,604.93 元，无属于第二层次和第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易

不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(3) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	641,069,295.96	99.29
	其中:股票	641,069,295.96	99.29
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	4,454,797.62	0.69
7	其他各项资产	103,958.60	0.02

8	合计	645,628,052.18	100.00
---	----	----------------	--------

8.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	43,779,540.45	6.79
C	制造业	165,210,523.87	25.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	109,486,241.69	16.99
E	建筑业	18,612,326.03	2.89
F	批发和零售业	20,967,333.91	3.25
G	交通运输、仓储和邮政业	67,678,543.87	10.50
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	174,815,941.02	27.13
K	房地产业	40,460,045.12	6.28
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	58,800.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	641,069,295.96	99.49

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600507	方大特钢	3,649,426	22,261,498.60	3.45
2	600104	上汽集团	982,864	20,856,374.08	3.24
3	601566	九牧王	875,707	20,018,662.02	3.11
4	601398	工商银行	4,095,185	18,755,947.30	2.91
5	601288	农业银行	5,648,374	18,244,248.02	2.83
6	601939	建设银行	3,136,053	18,126,386.34	2.81
7	601988	中国银行	4,302,060	17,251,260.60	2.68
8	600660	福耀玻璃	1,095,413	16,639,323.47	2.58
9	600000	浦发银行	903,186	16,501,208.22	2.56
10	600863	内蒙华电	3,539,769	15,822,767.43	2.46

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.Huatai-pb.com 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600507	方大特钢	37,131,394.28	2.89
2	600481	双良节能	17,919,703.54	1.39
3	601566	九牧王	16,585,509.80	1.29
4	600397	安源煤业	15,187,646.00	1.18
5	600027	华电国际	14,587,452.28	1.13
6	600500	中化国际	14,325,527.00	1.11
7	600028	中国石化	13,798,907.33	1.07
8	600395	盘江股份	11,870,430.97	0.92
9	600183	生益科技	11,692,484.46	0.91
10	601799	星宇股份	11,587,074.80	0.90
11	600350	山东高速	11,569,857.95	0.90
12	600012	皖通高速	11,214,636.56	0.87
13	600863	内蒙华电	10,311,736.75	0.80
14	601010	文峰股份	10,280,929.05	0.80
15	601668	中国建筑	10,232,846.00	0.80
16	600694	大商股份	10,187,107.48	0.79
17	600104	上汽集团	10,164,870.75	0.79
18	600011	华能国际	10,105,769.17	0.79

19	601088	中国神华	9,882,736.83	0.77
20	601398	工商银行	9,466,786.00	0.74

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	600507	方大特钢	23,528,869.39	1.83
2	601799	星宇股份	19,748,035.09	1.54
3	600397	安源煤业	16,825,357.83	1.31
4	601800	中国交建	16,199,466.01	1.26
5	601010	文峰股份	14,256,453.31	1.11
6	601998	中信银行	12,803,322.29	1.00
7	601158	重庆水务	11,755,307.23	0.91
8	600317	营口港	10,808,226.39	0.84
9	600098	广州发展	10,307,027.90	0.80
10	601088	中国神华	10,057,142.29	0.78
11	600563	法拉电子	9,994,571.94	0.78
12	600009	上海机场	9,764,967.58	0.76
13	601333	广深铁路	9,094,356.47	0.71
14	600018	上港集团	8,427,579.03	0.66
15	600481	双良节能	8,072,779.81	0.63
16	600177	雅戈尔	8,025,569.36	0.62
17	600500	中化国际	7,650,073.72	0.60
18	600016	民生银行	6,525,115.75	0.51
19	601009	南京银行	5,494,702.72	0.43
20	600004	白云机场	5,340,361.30	0.42

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	431,678,194.36
卖出股票收入（成交）总额	287,109,333.09

注：不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	101,875.78
2	应收证券清算款	1,067.01
3	应收股利	—
4	应收利息	1,015.81
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	103,958.60

8.12.4 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。

8.12.5 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未存在流通受限的情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的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
20,641	11,006.04	23,069,834.00	10.16%	204,105,869.00	89.84%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	海南洋浦海悦药业有限公司	4,301,100.00	1.89%
2	紫金矿业集团股份有限公司	3,300,000.00	1.45%
3	申银万国证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	2,525,600.00	1.11%
4	上海奇宇建筑工程设计咨询有限公司	2,400,000.00	1.06%
5	方弥纯	2,114,400.00	0.93%
6	国泰君安证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	1,306,300.00	0.58%
7	国信证券股份有限公司融券专用证券账户	1,218,700.00	0.54%
8	曾甲囡	1,045,499.00	0.46%
9	魏乔英	990,000.00	0.44%
10	贺婷	946,676.00	0.42%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006 年 11 月 17 日）基金份额总额	2, 222, 985, 094. 00
本报告期期初基金份额总额	489, 175, 703. 00
本报告期基金总申购份额	6, 788, 000, 000. 00
减:本报告期基金总赎回份额	7, 050, 000, 000. 00
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	227, 175, 703. 00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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, 经公司股东会批准杨智雅女士为公司董事, 2015 年 10 月 19 日, 经公司股东会批准童辉先生为公司监事。

2015 年 12 月 4 日, 公司任命董元星先生为公司副总经理, 董元星先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试, 其任命已在中国证券投资基金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2015 年 12 月 11 日, 公司任命程安至先生为公司副总经理, 程安至先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试, 其任命已在中国证券投资基金业协会备案。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无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 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。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 100,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 8 年的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
光大证券	1	718,690,667.45	100.00%	662,094.98	100.00%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

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。

11.7.2 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
光大证券	-	-	20,000,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

华泰柏瑞基金管理有限公司
2015 年 3 月 29 日