

华泰柏瑞中证 500 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 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 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，投资者在做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 5 月 13 日(合同生效日)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	华泰柏瑞中证 500ETF 联接
基金主代码	001214
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 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	386,097,345.38 份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年5月13日
基金管理人名称	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为华泰柏瑞中证 500ETF 的联接基金。华泰柏瑞中证 500ETF 是采用完全复制法实现对中证 500 指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于华泰柏瑞中证 500ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。
业绩比较基准	95%*中证 500 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为华泰柏瑞中证 500ETF 的联接基金，采用主要投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 500 的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
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	中证 500 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

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

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	基金管理人及基金托管人住所

§ 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 5 月 13 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
---------------	---

本期已实现收益	-96,966,244.35
本期利润	-129,033,070.53
加权平均基金份额本期利润	-0.2822
本期基金份额净值增长率	-26.34%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2634
期末基金资产净值	284,391,327.05
期末基金份额净值	0.7366

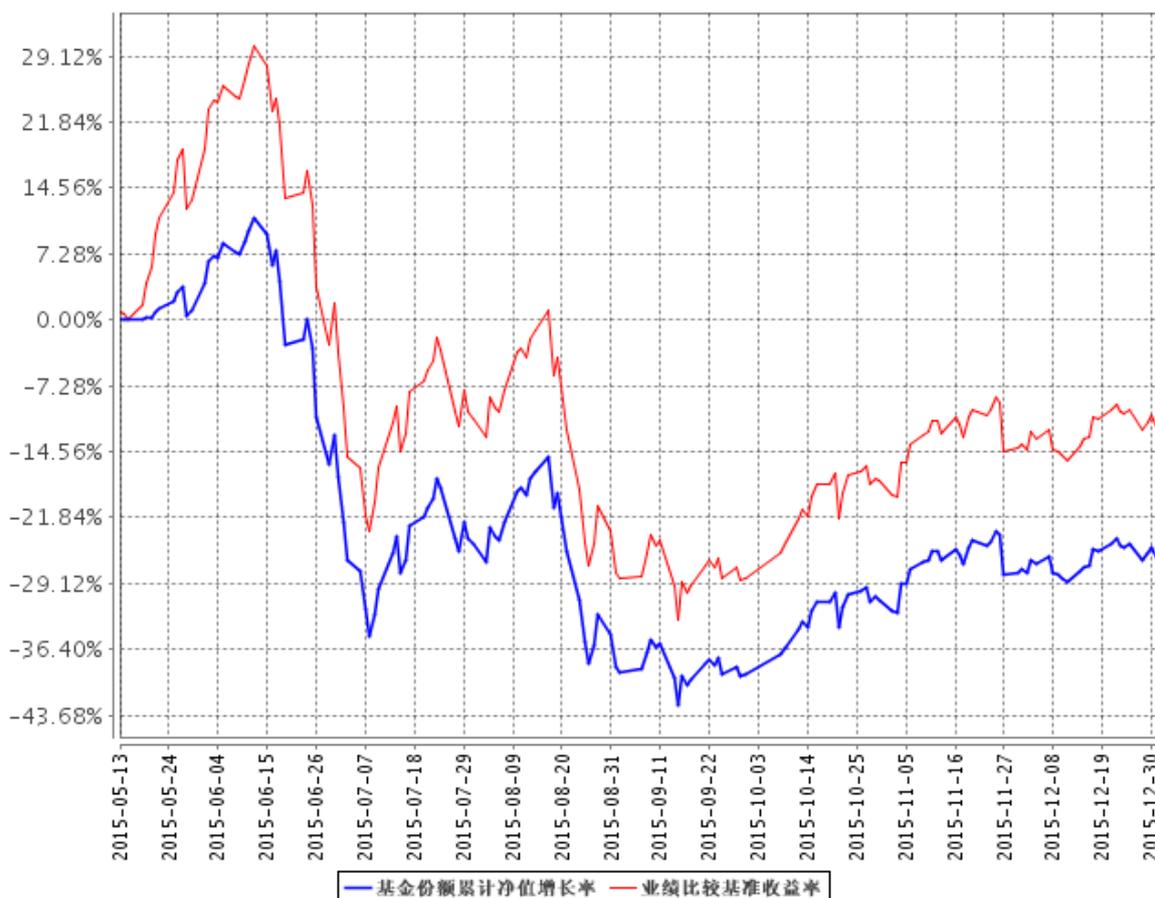
3.2 基金净值表现

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	20.95%	1.84%	23.13%	1.94%	-2.18%	-0.10%
过去六个月	-15.58%	2.92%	-13.51%	3.07%	-2.07%	-0.15%
自基金合同生效起至今	-26.34%	2.85%	-11.92%	3.09%	-14.42%	-0.24%

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

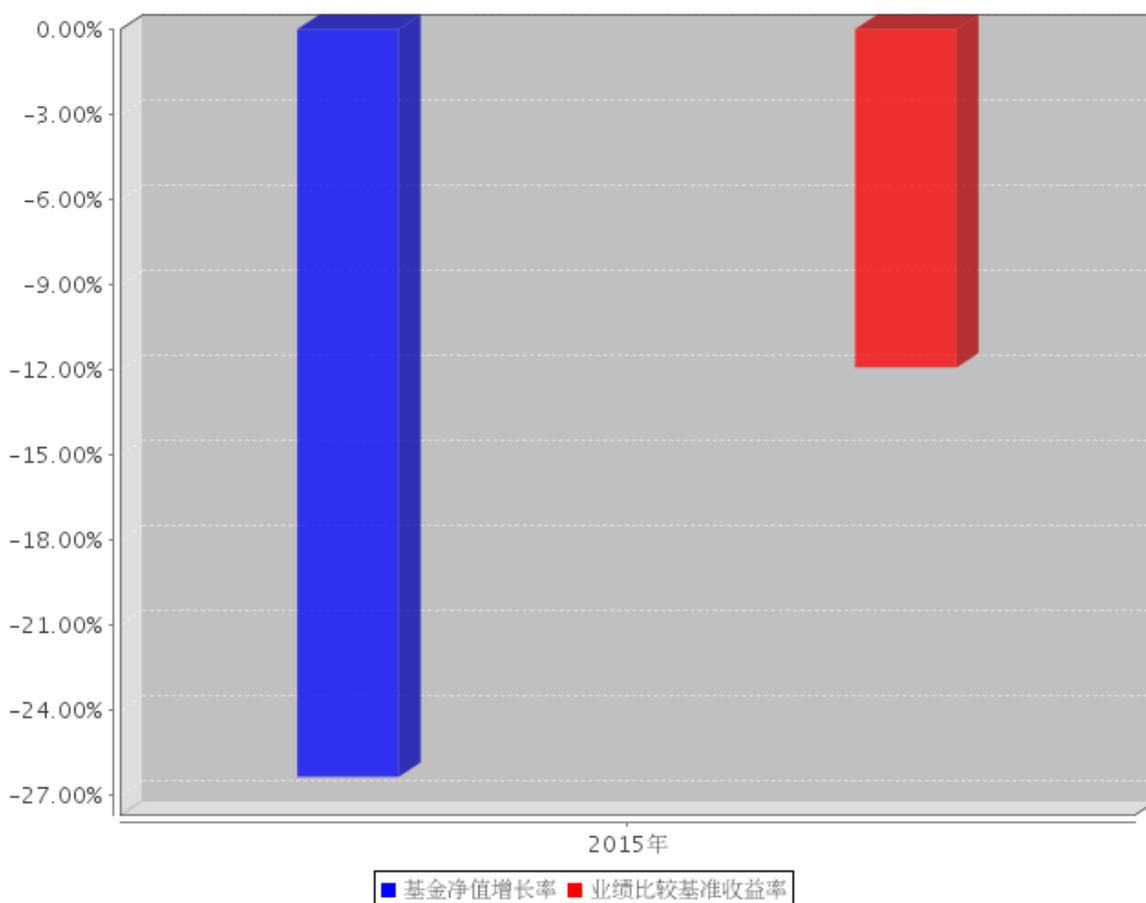


注：1、图示日期为 2015 年 5 月 13 日至 2015 年 12 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分（四）投资范围中规定的比例，即本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。

3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来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



注：基金合同生效日为 2015 年 5 月 13 日，2015 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

§ 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	2015 年 5 月 13 日	-	14 年	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

				<p>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</p>
--	--	--	--	--

					<p>300ETF 联接基金基金经理。2015 年 2 月起任华泰柏瑞指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500ETF 及华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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、法规的规定以及本基金的《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

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、法规的规定以及本基金的《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。

4.3.2 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。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，紧密跟踪业绩基准、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。基金建仓期结束至本报告期末（基金成立未满一年），本基金的累计跟踪偏离为-0.247%，日均绝对跟踪偏离度为 0.045%，期间日跟踪误差为 0.065%。

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 0.7366 元，累计净值为 0.7366 元，本报告期内基金份额净值下跌-26.34%，本基金的业绩比较基准下跌-11.92%。

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业绩基准基本一致的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2015 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统事先进行合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的

专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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。

4.8 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 4 次；每次分配比例不低于基金期末可分配利润的 10%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。报告期内基金未实施收益分配。

§ 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

2015 年，本基金托管人在对华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托

管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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 审计报告

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 21923 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：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

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
资产：		
银行存款		23,679,226.11
结算备付金		39,862.32
存出保证金		147,359.80
交易性金融资产		267,542,194.96
其中：股票投资		7,112,734.60
基金投资		260,429,460.36

债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		-
应收利息		3,641.17
应收股利		-
应收申购款		128,442.55
递延所得税资产		-
其他资产		399,628.70
资产总计		291,940,355.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		5,855,632.63
应付赎回款		1,217,793.33
应付管理人报酬		10,631.65
应付托管费		2,126.35
应付销售服务费		-
应付交易费用		160,444.87
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		302,399.73
负债合计		7,549,028.56
所有者权益:		
实收基金		386,097,345.38
未分配利润		-101,706,018.33
所有者权益合计		284,391,327.05
负债和所有者权益总计		291,940,355.61

注:

1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日, 基金份额净值 0.7366 元, 基金份额总额 386,097,345.38 份。
2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-126,908,282.80
1.利息收入		517,422.40
其中：存款利息收入		459,575.13
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		57,847.27
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-95,560,110.61
其中：股票投资收益		-95,775,204.37
基金投资收益		-824,933.74
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		1,040,027.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-32,066,826.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		201,231.59
减：二、费用		2,124,787.73
1. 管理人报酬		652,982.85
2. 托管费		130,596.56
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		1,028,263.62
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用		312,944.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-129,033,070.53
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-129,033,070.53

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日)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）	661,930,408.74	-	661,930,408.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-129,033,070.53	-129,033,070.53
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）	-275,833,063.36	27,327,052.20	-248,506,011.16
其中：1.基金申购款	96,950,274.43	-23,508,443.60	73,441,830.83
2.基金赎回款	-372,783,337.79	50,835,495.80	-321,947,841.99
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）	386,097,345.38	-101,706,018.33	284,391,327.05

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：

<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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]508 号《关于核准华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》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《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基

金联接基金基金合同》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 661,756,456.44 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2015)第 455 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于 2015 年 5 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 661,930,408.74 份基金份额，其中认购资金利息折合 173,952.30 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。

本基金为华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证 500 指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股、非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。正常情况下，本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数 \times 95% + 银行活期存款税后收益率 \times 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 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》、《华泰柏瑞行业领先股票型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

7.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。

7.4.4.4 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，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；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，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。

对于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；对于

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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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也可按直线法计算。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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》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。

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、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
华泰联合证券有限责任公司	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
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

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
华泰证券	28,760,662.18	3.81%

债券交易

注：无。

债券回购交易

注：无。

基金交易

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年5月13日(基金合同生效日)至2015年12月31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	25,949.66	3.82%	25,949.66	16.17%

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 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等。

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 2015年5月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	652,982.85
其中：支付销售机构的客户维护费	553,236.41

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取 0)0.50%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 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) × 0.50% ÷ 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	130,596.56

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取 0)0.10% 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 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) × 0.10% ÷ 当年天数。

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：无。

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：本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

注：本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	23,679,226.11	446,091.71

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。

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：本基金报告期末未参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 171,414,112.00 份目标 ETF 基金份额，占其份额的比例为 53.83%。

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
000748	长城信息	2015年6月18日	重大资产重组	24.68	-	-	65,200	2,320,066.00	1,609,136.00	-
600978	宜华木业	2015年6月18日	重大资产重组	31.20	2016年1月21日	20.10	47,200	902,519.47	1,472,640.00	-
002018	华信国际	2015年6月15日	重大资产重组	30.62	-	-	47,300	1,609,921.00	1,448,326.00	-
000066	长城电脑	2015年6月18日	重大资产重组	15.19	-	-	64,800	1,301,266.00	984,312.00	-
002219	恒康医疗	2015年7月7日	重大资产重组	14.90	-	-	36,613	623,637.68	545,533.70	-
600729	重庆百货	2015年7月24日	重大资产重组	32.39	2016年1月4日	29.90	7,300	277,754.32	236,447.00	-
002174	游族网络	2015年7月23日	非公开发行股票	84.40	2016年2月15日	80.58	2,178	234,400.39	183,823.20	-
600219	南山铝业	2015年9月29日	重大资产重组	6.58	2016年1月25日	7.00	8,800	105,882.96	57,904.00	-
600699	均胜电子	2015年11月	重大资产重组	35.91	-	-	1,400	66,472.86	50,274.00	-

		月 4 日	重组							
600759	洲际 油气	2015 年 9 月 21 日	重大 资产 重组	7.85	-	-	5,600	75,910.70	43,960.00	-
601000	唐山 港	2015 年 10 月 29 日	重大 资产 重组	8.25	2016 年 2 月 17 日	7.98	5,100	74,550.29	42,075.00	-
600880	博瑞 传播	2015 年 9 月 16 日	重大 资产 重组	7.50	2016 年 1 月 18 日	8.25	4,400	82,146.79	33,000.00	-
600120	浙江 东方	2015 年 10 月 12 日	重大 资产 重组	19.86	-	-	1,400	55,260.29	27,804.00	-
600429	三元 股份	2015 年 9 月 21 日	重大 资产 重组	7.29	2016 年 1 月 27 日	7.49	2,100	26,457.67	15,309.00	-
600864	哈投 股份	2015 年 10 月 9 日	重大 资产 重组	10.88	2016 年 1 月 14 日	11.97	1,400	31,345.60	15,232.00	-

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) 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 260,776,419.06 元，属于第二层次的余额为 6,765,775.90 元，无属于第三层次的余额。

(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。

(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。

(2) 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	7,112,734.60	2.44
	其中：股票	7,112,734.60	2.44
2	基金投资	260,429,460.36	89.21
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,719,088.43	8.12
8	其他各项资产	679,072.22	0.23
9	合计	291,940,355.61	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	51,880.00	0.02
C	制造业	6,522,473.40	2.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,232.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	264,251.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	42,075.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	183,823.20	0.06
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
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	33,000.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	7,112,734.60	2.50

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	000748	长城信息	65,200	1,609,136.00	0.57
2	600978	宜华木业	47,200	1,472,640.00	0.52
3	002018	华信国际	47,300	1,448,326.00	0.51
4	000066	长城电脑	64,800	984,312.00	0.35
5	002219	恒康医疗	36,613	545,533.70	0.19
6	002384	东山精密	16,935	339,038.70	0.12
7	600729	重庆百货	7,300	236,447.00	0.08
8	002174	游族网络	2,178	183,823.20	0.06
9	600219	南山铝业	8,800	57,904.00	0.02
10	600699	均胜电子	1,400	50,274.00	0.02

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](http://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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

1	300059	东方财富	8,265,124.14	2.91
2	300168	万达信息	4,311,537.00	1.52
3	601099	太平洋	3,948,183.00	1.39
4	600820	隧道股份	2,727,721.68	0.96
5	600635	大众公用	2,721,828.80	0.96
6	600601	方正科技	2,688,292.01	0.95
7	600881	亚泰集团	2,683,907.00	0.94
8	002183	怡亚通	2,652,661.78	0.93
9	600895	张江高科	2,640,543.90	0.93
10	600158	中体产业	2,594,756.30	0.91
11	600037	歌华有线	2,550,179.00	0.90
12	002030	达安基因	2,409,900.76	0.85
13	000540	中天城投	2,398,872.00	0.84
14	300253	卫宁软件	2,398,269.30	0.84
15	600219	南山铝业	2,327,018.47	0.82
16	000748	长城信息	2,320,066.00	0.82
17	600978	宜华木业	2,309,838.00	0.81
18	601519	大智慧	2,292,505.00	0.81
19	600435	北方导航	2,273,528.00	0.80
20	300144	宋城演艺	2,261,491.00	0.80

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	7,606,352.50	2.67
2	300168	万达信息	3,964,472.00	1.39
3	601099	太平洋	3,710,944.17	1.30
4	600820	隧道股份	2,338,821.69	0.82
5	601872	招商轮船	2,155,896.00	0.76
6	000540	中天城投	2,093,653.49	0.74
7	002183	怡亚通	1,953,542.00	0.69
8	601519	大智慧	1,889,065.40	0.66
9	300144	宋城演艺	1,829,723.86	0.64
10	000712	锦龙股份	1,797,255.00	0.63
11	000977	浪潮信息	1,750,648.78	0.62

12	000012	南 玻 A	1,740,407.11	0.61
13	000566	海南海药	1,617,375.00	0.57
14	000031	中粮地产	1,552,383.52	0.55
15	000997	新 大 陆	1,520,997.04	0.53
16	002030	达安基因	1,480,023.48	0.52
17	000998	隆平高科	1,457,487.10	0.51
18	600266	北京城建	1,448,699.00	0.51
19	002266	浙富控股	1,447,216.63	0.51
20	000511	烯碳新材	1,425,973.18	0.50

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	490,769,669.21
卖出股票收入（成交）总额	264,259,281.18

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。

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	ETF500	指数型	交易型开放式	华泰柏瑞基金管理有限公司	260,429,460.36	91.57

8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.12 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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1

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。

8.13.2

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。

8.13.3 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	147,359.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	3,641.17
5	应收申购款	128,442.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	399,628.70
9	合计	679,072.22

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000748	长城信息	1,609,136.00	0.57	重大资产重组
2	600978	宜华木业	1,472,640.00	0.52	重大资产重组
3	002018	华信国际	1,448,326.00	0.51	重大资产重组
4	000066	长城电脑	984,312.00	0.35	重大资产重组
5	002219	恒康医疗	545,533.70	0.19	重大资产重组
6	600729	重庆百货	236,447.00	0.08	重大资产重组
7	002174	游族网络	183,823.20	0.06	非公开发行股票
8	600219	南山铝业	57,904.00	0.02	重大资产重组
9	600699	均胜电子	50,274.00	0.02	重大资产重组

§ 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

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
3,507	110,093.34	1,589,407.45	0.41%	384,507,937.93	99.59%

9.2 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。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015 年 5 月 13 日) 基金份额总额	661, 930, 408. 74
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	96, 950, 274. 43
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	372, 783, 337. 79
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以 "-" 填列)	-
本报告期期末基金份额总额	386, 097, 345. 38

§ 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。

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。

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（特殊普通合伙）的报酬为 60,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 1 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	
华鑫证券	1	206,067,015.07	27.30%	182,348.78	26.86%	-
光大证券	2	203,370,846.08	26.94%	185,148.90	27.27%	-

中投证券	1	134,082,359.24	17.76%	118,900.91	17.51%	-
国信证券	2	45,862,250.42	6.08%	41,752.90	6.15%	-
西南证券	1	34,983,464.58	4.63%	32,580.45	4.80%	-
长江证券	1	30,398,109.03	4.03%	28,310.20	4.17%	-
国金证券	1	29,911,612.95	3.96%	27,231.80	4.01%	-
华泰证券	2	28,760,662.18	3.81%	25,949.66	3.82%	-
海通证券	2	28,194,059.97	3.74%	24,948.98	3.67%	-
华创证券	1	10,295,869.30	1.36%	9,110.86	1.34%	-
东吴证券	2	2,871,309.37	0.38%	2,616.68	0.39%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
西藏同信	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

西部证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
 - 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
 - 3) 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) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、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、上述交易单元均系本报告期内租用。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	300,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	1,615,728.78	6.13%
西南证券	-	-	-	-	-	-	3,761,201.91	14.27%
长江证券	-	-	-	-	-	-	9,025,206.03	34.25%
国金证券	-	-	-	-	-	-	11,946,851.47	45.34%
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏同信	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

华泰柏瑞基金管理有限公司
2016 年 3 月 29 日