

华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金 2015 年年度报告

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。

本基金名称自 2015 年 8 月 6 日起，由“华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞价值增长混合”，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》。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	15
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	15
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 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.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	68
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.....	68

8.7 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	69
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	69
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	69
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12 投资组合报告附注	69
§9 基金份额持有人信息	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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	71
§10 开放式基金份额变动	71
§11 重大事件揭示	71
11.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
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	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.8 其他重大事件	74
§12 备查文件目录	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞价值增长混合
基金主代码	460005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 7 月 16 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	351,473,790.69 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于市场估值相对较低、基本面良好、能够为股东持续创造价值的公司，重点关注其中基本面有良性变化、市场认同度逐步提高的优质个股，在充分控制投资组合风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	基于对宏观经济和投资环境的分析和预测，全面评估证券市场各大类资产的中长期预期风险收益率，确定基金资产在股票、债券和现金及其他资产之间的配置比例，适度控制系统性风险。 主要通过积极主动地精选为股东持续创造价值的股票来获取超额收益。重点投资于基本面趋势良好或出现良性转折、价格相对低估、基本面趋势认同度逐步或加速提高的优质股票，辅以适度的行业配置调整来优化股票的选择和配置的权重。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	较高风险、较高收益

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	北京市复兴门内大街 1 号

	弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市复兴门内大街 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 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

§ 3 主要财务指标、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	182,420,147.21	44,605,205.18	98,953,621.31
本期利润	202,574,261.41	65,801,333.42	81,966,790.04
加权平均基金份额本期利润	1.1482	0.3279	0.2376
本期加权平均净值利润率	45.56%	27.41%	21.62%
本期基金份额净值增长率	94.05%	33.52%	22.18%
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	571,470,501.55	39,250,091.19	-5,557,357.67
期末可供分配基金份额利润	1.6259	0.2616	-0.0247
期末基金资产净值	1,078,150,654.62	241,618,250.43	270,906,714.08
期末基金份额净值	3.0675	1.6102	1.2060
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	353.38%	133.64%	74.99%

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

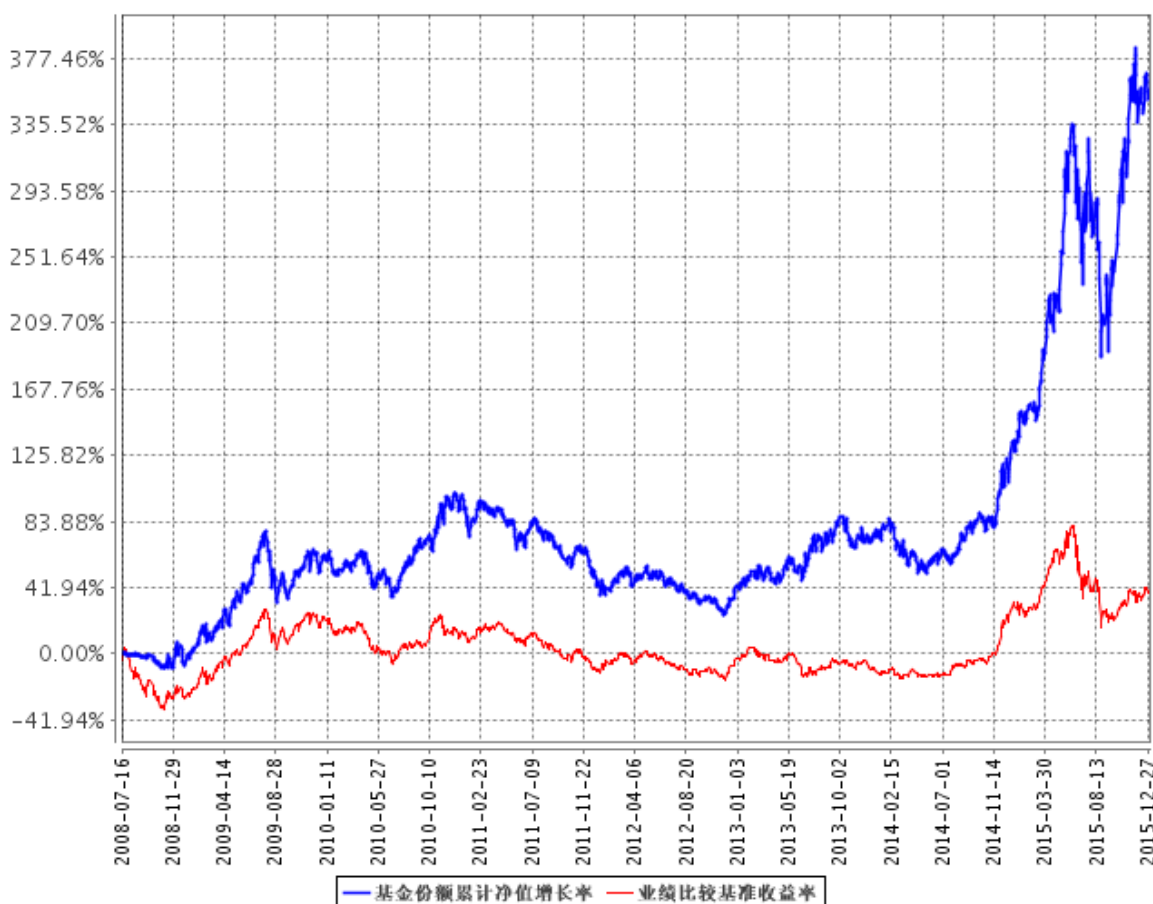
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	32.46%	2.50%	13.57%	1.34%	18.89%	1.16%
过去六个月	14.74%	3.28%	-12.31%	2.14%	27.05%	1.14%
过去一年	94.05%	2.76%	6.98%	1.99%	87.07%	0.77%
过去三年	216.55%	1.97%	43.01%	1.43%	173.54%	0.54%
过去五年	129.52%	1.68%	22.97%	1.29%	106.55%	0.39%
自基金合同生效起至今	353.38%	1.68%	38.29%	1.43%	315.09%	0.25%

注：本基金的业绩基准由沪深 300 指数和上证国债指数按照 80%与 20%之比构建，并每日进行再平衡。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

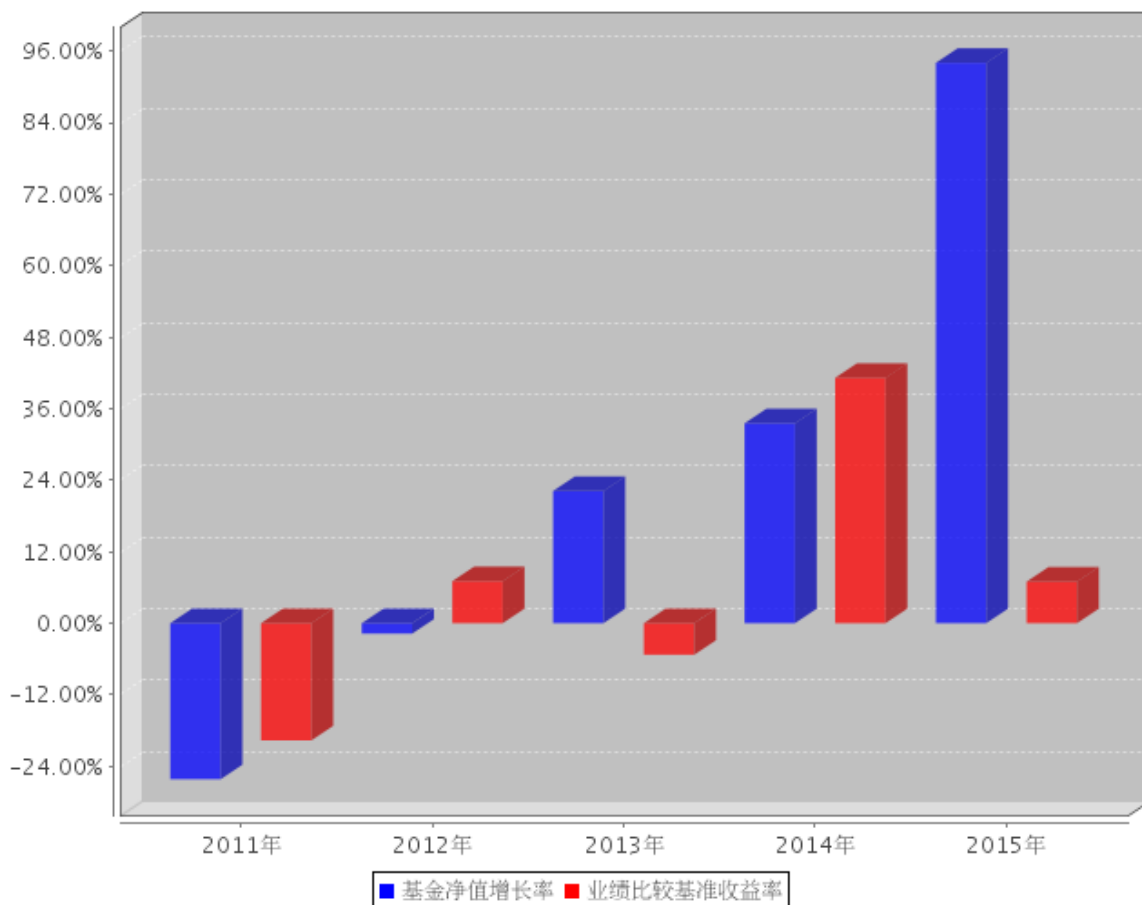


注：图示日期为 2008 年 7 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日。

按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（二）投资范围、（十）之 2、基金投资组合比例限制中规定的各项比例，投资于股票的比例为基金资产的 60%-95%，现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%。

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	0.3000	2,869,957.27	1,417,944.72	4,287,901.99	
2014	-	-	-	-	
2013	-	-	-	-	
合计	0.3000	2,869,957.27	1,417,944.72	4,287,901.99	

§ 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		
方纬	本基金的基金经理	2014 年 8 月 22 日	-	12	经济学硕士。2003 年 9 月至 2005 年 1 月任上海金信研究所研究员；2005 年 1 月至

				<p>2007 年 2 月任万家基金管理有限公司高级研究员；2007 年 2 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2014 年 8 月任华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 4 月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起任华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金</p>
--	--	--	--	--

					经理。 2015 年 8 月起任华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型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《华泰柏瑞价值增长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，不存在不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，沪深 300 指数上涨 5.58%，中证 500 指数上涨 43.12%，创业板指数上涨 84.41%，本基金上涨 94.05%。

回顾 2015 年，本基金在 6-7 月市场大幅度回调过程中，有效控制住了净值回撤风险，且抓住了在 9-12 月的大反弹，为投资者取得了较大的超额收益。

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 3.0675 元，累计净值为 3.6075 元，本报告期内基金份额净值上涨 94.05%，本基金的业绩比较基准上涨 6.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年，经济在“供给侧改革”的引导下，大概率继续维持“L”型趋势；汇率改革、信用风险等引发短期流动性紧张可能导致市场波动。本基金尽力顺应猴年股市的“猴性”，为投资人继续获取超额收益。

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进行事先合规性设置，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投资研究业务、异常交易和公平交易管理、市场宣传、客户服务、信息技术安全、人员管理、基金核算与注册登记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、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。

4.8 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 6 次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的 80%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。1 月 20 日本金进行收益分配，每份额分红 0.03 元。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金（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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 21909 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金(原华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金,以下简称“华泰柏瑞价值增长基金”)的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是华泰柏瑞价值增长基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p>

	我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述华泰柏瑞价值增长基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华泰柏瑞价值增长基金 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。	
注册会计师的姓名	单 峰	张 勇
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	
会计师事务所的地址	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2016 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

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	91,330,703.29	3,547,302.36
结算备付金		12,190,846.13	1,577,254.37
存出保证金		723,844.25	156,878.10
交易性金融资产	7.4.7.2	992,280,369.76	234,475,824.85
其中：股票投资		992,280,369.76	224,458,824.85
基金投资		-	-
债券投资		-	10,017,000.00
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		-	8,152,907.67
应收利息	7.4.7.5	24,377.85	351,907.34
应收股利		-	-
应收申购款		3,448,577.24	84,151.37
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,099,998,718.52	248,346,226.06
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		-	3,308,842.03
应付赎回款		12,345,268.30	1,719,216.45
应付管理人报酬		1,351,777.18	295,344.71
应付托管费		225,296.20	49,224.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	7,519,223.18	993,135.44
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	406,499.04	362,212.87
负债合计		21,848,063.90	6,727,975.63
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	351,473,790.69	150,053,585.36
未分配利润	7.4.7.10	726,676,863.93	91,564,665.07
所有者权益合计		1,078,150,654.62	241,618,250.43
负债和所有者权益总计		1,099,998,718.52	248,346,226.06

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.0675 元，基金份额总额 351,473,790.69 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

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		228,283,564.17	74,501,537.26
1. 利息收入		540,495.53	843,791.92
其中：存款利息收入	7.4.7.11	394,396.64	209,368.25
债券利息收入		129,920.55	284,190.67
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		16,178.34	350,233.00
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		206,383,782.40	52,076,086.88
其中：股票投资收益	7.4.7.12	202,847,858.42	50,919,891.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-44,590.00	145,341.60
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	3,580,513.98	1,010,853.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	20,154,114.20	21,196,128.24
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	1,205,172.04	385,530.22
减：二、费用		25,709,302.76	8,700,203.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,550,314.01	3,621,554.01
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,091,718.99	603,592.36
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	17,672,974.86	4,084,159.33
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	394,294.90	390,898.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		202,574,261.41	65,801,333.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		202,574,261.41	65,801,333.42

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

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）	150,053,585.36	91,564,665.07	241,618,250.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	202,574,261.41	202,574,261.41

润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	201,420,205.33	436,825,839.44	638,246,044.77
其中: 1. 基金申购款	653,867,017.55	1,107,516,395.78	1,761,383,413.33
2. 基金赎回款	-452,446,812.22	-670,690,556.34	-1,123,137,368.56
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)	-	-4,287,901.99	-4,287,901.99
五、期末所有者权益(基金净值)	351,473,790.69	726,676,863.93	1,078,150,654.62
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)	224,631,355.54	46,275,358.54	270,906,714.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	65,801,333.42	65,801,333.42
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)	-74,577,770.18	-20,512,026.89	-95,089,797.07
其中: 1. 基金申购款	63,016,754.35	15,294,566.75	78,311,321.10
2. 基金赎回款	-137,594,524.53	-35,806,593.64	-173,401,118.17
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)	150,053,585.36	91,564,665.07	241,618,250.43

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:

<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

华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金(原名为华泰柏瑞价值增长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[2008]第 543

号《关于核准友邦华泰价值增长股票型证券投资基金募集的批复》核准，由友邦华泰基金管理有限公司(已自 2010 年 4 月 30 日起更名为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《友邦华泰价值增长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 406,224,705.76 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(2008)第 109 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《友邦华泰价值增长股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 7 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 406,303,580.25 份基金份额，其中认购资金利息折合 78,874.49 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。

根据证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《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》的规定，华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%；现金、债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中，基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%。

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞价值增长混合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、中国基金业协会发布的有关

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。

7.4.4.1 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。

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。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。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其他各类应收款项等。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其他各类应付款项等。

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。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，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和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场, 采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时, 尽可能最大程度使用市场参数, 减少使用与本基金特定相关的参数。

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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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或者发行价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, 其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益, 其中包括从公

允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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为正数，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，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，即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) 本基金的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，不需要披露分部信息。

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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	91,330,703.29	3,547,302.36
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	91,330,703.29	3,547,302.36

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	949,208,733.76	992,280,369.76	43,071,636.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券 交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	949,208,733.76	992,280,369.76	43,071,636.00
	项目	上年度末 2014年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
	股票	201,513,713.05	224,458,824.85	22,945,111.80
	贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
	债券			
	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	10,044,590.00	10,017,000.00	-27,590.00
	合计	10,044,590.00	10,017,000.00	-27,590.00
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	211,558,303.05	234,475,824.85	22,917,521.80

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	17,985.09	1,969.54
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	6,034.49	780.69
应收债券利息	-	349,079.45
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	358.27	77.66
合计	24,377.85	351,907.34

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	7,519,223.18	993,135.44
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	7,519,223.18	993,135.44

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	46,499.04	2,212.87
预提费用	360,000.00	360,000.00
合计	406,499.04	362,212.87

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	150,053,585.36	150,053,585.36
本期申购	653,867,017.55	653,867,017.55
本期赎回(以“-”号填列)	-452,446,812.22	-452,446,812.22
- 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	351,473,790.69	351,473,790.69

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	39,250,091.19	52,314,573.88	91,564,665.07
本期利润	182,420,147.21	20,154,114.20	202,574,261.41
本期基金份额交易产生的变动数	354,088,165.14	82,737,674.30	436,825,839.44
其中：基金申购款	898,622,627.95	208,893,767.83	1,107,516,395.78
基金赎回款	-544,534,462.81	-126,156,093.53	-670,690,556.34
本期已分配利润	-4,287,901.99	-	-4,287,901.99
本期末	571,470,501.55	155,206,362.38	726,676,863.93

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	312,176.20	172,232.28
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	76,186.23	35,139.32
其他	6,034.21	1,996.65
合计	394,396.64	209,368.25

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	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
卖出股票成交总额	5,678,366,636.15	1,360,763,211.31
减：卖出股票成本总额	5,475,518,777.73	1,309,843,319.40
买卖股票差价收入	202,847,858.42	50,919,891.91

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-44,590.00	145,341.60
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	-44,590.00	145,341.60

7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,479,000.00	21,097,944.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,044,590.00	20,288,500.00
减：应收利息总额	479,000.00	664,103.00
买卖债券差价收入	-44,590.00	145,341.60

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,580,513.98	1,010,853.37
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,580,513.98	1,010,853.37

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	20,154,114.20	21,196,128.24
——股票投资	20,126,524.20	21,294,718.24
——债券投资	27,590.00	-98,590.00
——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	-	-
合计	20,154,114.20	21,196,128.24

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
基金赎回费收入	1,016,570.56	99,945.47
转换费收入	188,601.48	2,867.15
其他收入	-	282,717.60
合计	1,205,172.04	385,530.22

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于 25% 的部分归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	17,672,974.86	4,083,984.33
银行间市场交易费用	-	175.00
合计	17,672,974.86	4,084,159.33

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行划款手续费	15,694.90	12,898.14
其他费用	600.00	-
银行间账户服务费	18,000.00	18,000.00
合计	394,294.90	390,898.14

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2016 年 1 月 14 日宣告 2016 年度第一次分红，向截至 2016 年 1 月 19 日止在本基金注册登记人登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 1.6300 元。

7.4.9 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、基金注册登记机构、基金直销机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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	3,091,959,084.78	25.98%	338,958,626.00	12.55%

7.4.10.1.2 权证交易

注：无。

7.4.10.1.3 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 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
华泰证券股份 有限公司	2,774,532.17	25.62%	1,723,363.34	22.92%
关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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
华泰证券股份 有限公司	301,941.72	12.50%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，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后的净额列示。

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 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 的管理费	6,550,314.01	3,621,554.01
其中：支付销售机构的客 户维护费	1,563,860.03	506,525.70

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

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

H 为每日应支付的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 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	1,091,718.99	603,592.36

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 0.25%的年费率计提，计算方法如下：

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

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
基金合同生效日（2008 年 7 月 16 日）持有的基金份额	10,007,525.00	10,007,525.00
期初持有的基金份额	19,746,182.58	19,746,182.58
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	19,746,182.58	19,746,182.58
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.6181%	13.1594%

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.5 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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	91,330,703.29	312,176.20	3,547,302.36	172,232.28

有限公司				
------	--	--	--	--

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 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 19 日	2015 年 1 月 20 日	0.3000	2,869,957.27	1,417,944.72	4,287,901.99	
合计	-	-	0.3000	2,869,957.27	1,417,944.72	4,287,901.99	

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无

7.4.12.2 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
000002	万科 A	2015-12-19	重大资产重组	24.43			1,090,600	21,402,335.50	26,643,358.00	-
300324	旋极信息	2015-11-07	重大资产重组	20.75			227,669	8,805,129.07	11,212,698.25	-
300365	恒华科技	2015-09-24	重大资产重组	21.80	2016-01-22	23.98	171,900	3,858,673.00	7,369,353.00	-
000876	新希望	2015-10-16	重大资产重组	25.76	2016-02-05	28.34	368,200	6,697,451.79	6,484,002.00	-
603869	北部湾旅	2015-08-15	重大事项	17.61			222,500	4,258,830.42	5,731,600.00	-
600271	航天信息	2015-12-01	重大资产重组	49.25			76,800	3,520,567.44	5,488,128.00	-
300247	乐金健康	2015-11-14	重大资产重组	42.87	2016-01-27	38.58	237,400	4,738,731.80	4,926,050.00	-
002174	游族	2015-07-23	重大资	84.40	2016-02-15	80.58	49,962	4,467,817.13	4,216,792.80	-

	网络		产重组							
300326	凯利泰	2015-10-10	重大资产重组	71.46			169,600	3,519,548.00	3,697,280.00	-

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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，通过主动投资追求适度风险水平下的较高收益”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2014 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变

现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。

本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	91,330,703.29	-	-	-	-	-	91,330,703.29
结算备付金	12,190,846.13	-	-	-	-	-	12,190,846.13
存出保证金	723,844.25	-	-	-	-	-	723,844.25
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-992,280,369.76	992,280,369.76
应收利息	-	-	-	-	-	24,377.85	24,377.85
应收申购款	212,006.26	-	-	-	-	3,236,570.98	3,448,577.24
资产总计	104,457,399.93	-	-	-	-	-995,541,318.59	1,099,998,718.52
资产总计	104,457,399.93	-	-	-	-	-995,541,318.59	1,099,998,718.52
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-12,345,268.30	12,345,268.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-1,351,777.18	1,351,777.18
应付托管费	-	-	-	-	-	-225,296.20	225,296.20
应付交易费用	-	-	-	-	-	-7,519,223.18	7,519,223.18
其他负债	-	-	-	-	-	-406,499.04	406,499.04
负债总计	-	-	-	-	-	-21,848,063.90	21,848,063.90
利率敏感度缺口	104,457,399.93	-	-	-	-	-973,693,254.69	1,078,150,654.62
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	3,547,302.36	-	-	-	-	-	3,547,302.36
结算备付金	1,577,254.37	-	-	-	-	-	1,577,254.37
存出保证金	156,878.10	-	-	-	-	-	156,878.10
交易性金融资产	-	-	-10,017,000.00	-	-	-224,458,824.85	234,475,824.85
应收证券清算款	-	-	-	-	-	8,152,907.67	8,152,907.67
应收利息	-	-	-	-	-	351,907.34	351,907.34
应收申购款	395.26	-	-	-	-	83,756.11	84,151.37
资产总计	5,281,830.09	-	-10,017,000.00	-	-	-233,047,395.97	248,346,226.06
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,308,842.03	3,308,842.03
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,719,216.45	1,719,216.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	295,344.71	295,344.71
应付托管费	-	-	-	-	-	49,224.13	49,224.13
应付交易费用	-	-	-	-	-	993,135.44	993,135.44
其他负债	-	-	-	-	-	362,212.87	362,212.87

负债总计	-	-	-	-	6,727,975.63	6,727,975.63
利率敏感度缺口	5,281,830.09	-10,017,000.00	-	-	-226,319,420.34	241,618,250.43

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，（2014 年 12 月 31 日，本基金持有交易性债券投资比例为 4.15%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%；现金、债券资产（含短期融资券和资产证券化产品）、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 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	992,280,369.76	92.04	224,458,824.85	92.90
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	992,280,369.76	92.04	224,458,824.85	92.90

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	48,300,000.00	11,450,000.00
	沪深 300 指数下降 5%	-48,300,000.00	-11,450,000.00

7.4.14 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 916,511,107.71 元，属于第二层次的余额为 75,769,262.05 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 218,384,873.01 元，第二层次 16,090,951.84，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(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。

(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	992,280,369.76	90.21
	其中：股票	992,280,369.76	90.21
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	103,521,549.42	9.41
7	其他各项资产	4,196,799.34	0.38
8	合计	1,099,998,718.52	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	10,134,740.00	0.94
C	制造业	321,064,717.95	29.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	64,742,177.00	6.00
E	建筑业	22,116,456.00	2.05
F	批发和零售业	24,742,956.42	2.29
G	交通运输、仓储和邮政业	21,749,984.00	2.02
H	住宿和餐饮业	2,988,103.30	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,790,844.05	2.76
J	金融业	379,158,071.04	35.17
K	房地产业	85,816,878.00	7.96
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	18,931,600.00	1.76
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	11,043,842.00	1.02
S	综合	-	-
	合计	992,280,369.76	92.04

8.3 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	601328	交通银行	4,368,700	28,134,428.00	2.61
2	000002	万科A	1,090,600	26,643,358.00	2.47
3	600858	银座股份	2,237,157	24,742,956.42	2.29
4	000333	美的集团	739,017	24,254,537.94	2.25
5	002358	森源电气	1,297,677	23,942,140.65	2.22
6	600015	华夏银行	1,957,000	23,757,980.00	2.20
7	000895	双汇发展	1,160,807	23,692,070.87	2.20
8	600066	宇通客车	1,052,594	23,672,839.06	2.20
9	600030	中信证券	1,214,100	23,492,835.00	2.18
10	601166	兴业银行	1,360,400	23,222,028.00	2.15
11	600177	雅戈尔	1,417,400	23,075,272.00	2.14
12	600036	招商银行	1,282,500	23,072,175.00	2.14
13	002142	宁波银行	1,481,954	22,985,106.54	2.13
14	000651	格力电器	1,016,500	22,718,775.00	2.11
15	601318	中国平安	627,000	22,572,000.00	2.09
16	600104	上汽集团	1,062,100	22,537,762.00	2.09
17	601169	北京银行	2,137,500	22,507,875.00	2.09
18	601009	南京银行	1,263,375	22,361,737.50	2.07
19	600048	保利地产	2,095,700	22,298,248.00	2.07
20	600741	华域汽车	1,318,600	22,231,596.00	2.06
21	601668	中国建筑	3,488,400	22,116,456.00	2.05
22	000001	平安银行	1,833,500	21,983,665.00	2.04
23	601939	建设银行	3,800,000	21,964,000.00	2.04
24	600011	华能国际	2,506,100	21,878,253.00	2.03
25	000625	长安汽车	1,282,500	21,764,025.00	2.02
26	601006	大秦铁路	2,523,200	21,749,984.00	2.02
27	601818	光大银行	5,118,600	21,702,864.00	2.01
28	601288	农业银行	6,708,900	21,669,747.00	2.01
29	601398	工商银行	4,721,500	21,624,470.00	2.01
30	601633	长城汽车	1,795,500	21,617,820.00	2.01
31	600795	国电电力	5,485,300	21,557,229.00	2.00
32	600000	浦发银行	1,166,600	21,313,782.00	1.98
33	600886	国投电力	2,551,700	21,306,695.00	1.98
34	002415	海康威视	613,672	21,104,180.08	1.96
35	000550	江铃汽车	700,889	21,012,652.22	1.95
36	000726	鲁泰A	1,474,277	19,932,225.04	1.85
37	601336	新华保险	371,800	19,411,678.00	1.80

38	600999	招商证券	801,000	17,381,700.00	1.61
39	600383	金地集团	1,000,000	13,800,000.00	1.28
40	000069	华侨城 A	1,500,000	13,200,000.00	1.22
41	300324	旋极信息	227,669	11,212,698.25	1.04
42	300426	唐德影视	134,681	11,043,842.00	1.02
43	000423	东阿阿胶	200,000	10,460,000.00	0.97
44	601088	中国神华	500,000	7,485,000.00	0.69
45	300365	恒华科技	171,900	7,369,353.00	0.68
46	000060	中金岭南	499,903	7,013,639.09	0.65
47	000971	高升控股	200,000	6,992,000.00	0.65
48	000876	新希望	368,200	6,484,002.00	0.60
49	300342	天银机电	130,000	5,980,000.00	0.55
50	603869	北部湾旅	222,500	5,731,600.00	0.53
51	600271	航天信息	76,800	5,488,128.00	0.51
52	300136	信维通信	167,300	4,943,715.00	0.46
53	300247	乐金健康	237,400	4,926,050.00	0.46
54	002174	游族网络	49,962	4,216,792.80	0.39
55	300326	凯利泰	169,600	3,697,280.00	0.34
56	600651	飞乐音响	240,000	3,540,000.00	0.33
57	600258	首旅酒店	99,970	2,988,103.30	0.28
58	000603	盛达矿业	146,800	2,649,740.00	0.25
59	603936	博敏电子	1,000	51,280.00	0.00

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	601328	交通银行	100,800,858.87	41.72
2	601318	中国平安	85,668,258.77	35.46
3	601166	兴业银行	84,739,962.94	35.07
4	600000	浦发银行	73,676,554.37	30.49
5	601398	工商银行	73,641,632.21	30.48
6	601288	农业银行	67,957,858.72	28.13
7	601939	建设银行	64,694,376.81	26.78
8	600036	招商银行	59,657,875.35	24.69
9	600048	保利地产	59,140,853.89	24.48

10	601169	北京银行	52,041,313.84	21.54
11	600066	宇通客车	51,164,998.04	21.18
12	300059	东方财富	49,729,654.20	20.58
13	600015	华夏银行	49,163,942.86	20.35
14	600030	中信证券	48,168,341.30	19.94
15	601818	光大银行	47,927,818.88	19.84
16	000001	平安银行	47,419,507.65	19.63
17	000002	万 科A	46,804,472.02	19.37
18	600104	上汽集团	44,111,773.76	18.26
19	601009	南京银行	42,780,370.51	17.71
20	600309	万华化学	42,426,917.07	17.56
21	002024	苏宁云商	40,681,852.25	16.84
22	601668	中国建筑	39,023,555.71	16.15
23	000550	江铃汽车	38,168,119.21	15.80
24	000895	双汇发展	37,571,954.88	15.55
25	000726	鲁 泰A	37,346,596.10	15.46
26	600837	海通证券	36,607,212.57	15.15
27	000625	长安汽车	36,492,582.06	15.10
28	002142	宁波银行	35,083,421.30	14.52
29	600016	民生银行	34,988,671.65	14.48
30	600011	华能国际	34,621,304.36	14.33
31	300357	我武生物	30,726,978.56	12.72
32	601336	新华保险	30,419,768.77	12.59
33	000651	格力电器	30,006,567.47	12.42
34	000333	美的集团	29,328,582.68	12.14
35	002358	森源电气	28,594,637.97	11.83
36	600741	华域汽车	28,377,122.57	11.74
37	002415	海康威视	27,914,488.40	11.55
38	601633	长城汽车	27,713,456.42	11.47
39	300253	卫宁健康	27,658,851.69	11.45
40	002405	四维图新	27,252,439.96	11.28
41	601088	中国神华	27,134,584.45	11.23
42	601377	兴业证券	25,738,734.75	10.65
43	600718	东软集团	25,407,749.90	10.52
44	002236	大华股份	25,388,596.85	10.51
45	601006	大秦铁路	25,376,937.95	10.50

46	600585	海螺水泥	25,147,712.11	10.41
47	300204	舒泰神	24,787,115.22	10.26
48	300009	安科生物	24,691,780.39	10.22
49	300183	东软载波	24,232,717.16	10.03
50	601601	中国太保	24,046,143.38	9.95
51	300101	振芯科技	24,011,746.06	9.94
52	600886	国投电力	23,255,473.87	9.62
53	000415	渤海金控	23,220,025.17	9.61
54	300050	世纪鼎利	22,988,685.16	9.51
55	600177	雅戈尔	22,358,677.24	9.25
56	600418	江淮汽车	22,017,556.00	9.11
57	600536	中国软件	21,966,702.23	9.09
58	300324	旋极信息	21,876,999.55	9.05
59	600795	国电电力	21,710,513.00	8.99
60	000776	广发证券	21,669,412.46	8.97
61	600858	银座股份	21,532,851.67	8.91
62	600518	康美药业	21,483,946.86	8.89
63	601628	中国人寿	21,279,856.00	8.81
64	300077	国民技术	21,190,966.11	8.77
65	300229	拓尔思	20,452,550.27	8.46
66	002008	大族激光	20,131,774.00	8.33
67	000783	长江证券	19,798,843.70	8.19
68	600519	贵州茅台	19,685,532.72	8.15
69	300015	爱尔眼科	19,387,886.18	8.02
70	300003	乐普医疗	19,380,315.52	8.02
71	002099	海翔药业	18,915,662.22	7.83
72	300296	利亚德	18,513,533.23	7.66
73	300199	翰宇药业	18,475,412.87	7.65
74	000661	长春高新	18,379,415.51	7.61
75	000008	神州高铁	18,323,732.31	7.58
76	300271	华宇软件	18,308,168.66	7.58
77	300113	顺网科技	18,277,378.66	7.56
78	002446	盛路通信	17,980,400.88	7.44
79	600823	世茂股份	17,819,525.82	7.38
80	600276	恒瑞医药	17,784,188.69	7.36
81	600352	浙江龙盛	17,769,128.90	7.35

82	601998	中信银行	17,703,722.18	7.33
83	600999	招商证券	17,624,308.45	7.29
84	601788	光大证券	17,590,049.48	7.28
85	300336	新文化	17,574,530.95	7.27
86	300379	东方通	17,413,739.26	7.21
87	300297	蓝盾股份	17,311,812.11	7.16
88	002195	二三四五	17,295,220.81	7.16
89	600867	通化东宝	17,225,757.51	7.13
90	002230	科大讯飞	17,108,297.86	7.08
91	600690	青岛海尔	17,057,083.07	7.06
92	002019	亿帆鑫富	17,013,368.52	7.04
93	002280	联络互动	16,864,563.35	6.98
94	002153	石基信息	16,676,901.19	6.90
95	002364	中恒电气	16,669,718.69	6.90
96	300075	数字政通	16,444,019.63	6.81
97	002241	歌尔声学	16,348,040.01	6.77
98	300017	网宿科技	15,834,499.68	6.55
99	601199	江南水务	15,723,963.66	6.51
100	600566	济川药业	15,633,466.90	6.47
101	000423	东阿阿胶	15,563,368.69	6.44
102	002074	国轩高科	15,455,394.79	6.40
103	300274	阳光电源	15,195,506.03	6.29
104	601999	出版传媒	15,190,905.15	6.29
105	300027	华谊兄弟	14,884,994.77	6.16
106	300202	聚龙股份	14,843,921.58	6.14
107	600887	伊利股份	14,795,583.98	6.12
108	600485	信威集团	14,794,324.67	6.12
109	002202	金风科技	14,711,004.60	6.09
110	002279	久其软件	14,605,812.51	6.04
111	002609	捷顺科技	14,476,568.52	5.99
112	603567	珍宝岛	14,306,468.96	5.92
113	300352	北信源	14,110,032.52	5.84
114	300237	美晨科技	14,090,954.56	5.83
115	300136	信维通信	14,038,424.43	5.81
116	600383	金地集团	13,992,180.00	5.79
117	600115	东方航空	13,943,793.46	5.77

118	000718	苏宁环球	13,921,849.17	5.76
119	300072	三聚环保	13,907,174.57	5.76
120	300426	唐德影视	13,777,538.82	5.70
121	300422	博世科	13,737,134.13	5.69
122	002407	多氟多	13,521,354.00	5.60
123	002437	誉衡药业	13,424,155.67	5.56
124	300295	三六五网	13,325,154.55	5.51
125	300016	北陆药业	13,311,616.71	5.51
126	600613	神奇制药	13,303,431.38	5.51
127	000069	华侨城 A	13,291,084.00	5.50
128	600705	中航资本	13,267,895.71	5.49
129	300294	博雅生物	13,210,745.36	5.47
130	300316	晶盛机电	13,203,641.29	5.46
131	002466	天齐锂业	12,903,167.00	5.34
132	300212	易华录	12,874,419.95	5.33
133	300026	红日药业	12,860,857.02	5.32
134	002657	中科金财	12,620,034.70	5.22
135	600028	中国石化	12,591,097.80	5.21
136	300292	吴通控股	12,586,517.88	5.21
137	000876	新希望	12,490,559.79	5.17
138	000400	许继电气	12,455,462.54	5.16
139	300032	金龙机电	12,379,662.55	5.12
140	002439	启明星辰	12,329,335.41	5.10
141	600172	黄河旋风	12,281,174.45	5.08
142	300267	尔康制药	12,279,480.08	5.08
143	300124	汇川技术	12,271,379.75	5.08
144	300398	飞凯材料	12,183,597.23	5.04
145	600588	用友网络	12,175,162.21	5.04
146	002146	荣盛发展	12,165,265.68	5.03
147	300315	掌趣科技	12,154,743.94	5.03
148	300445	康斯特	12,103,727.97	5.01
149	600694	大商股份	12,090,562.16	5.00
150	300436	广生堂	12,024,835.77	4.98
151	300289	利德曼	12,003,243.95	4.97
152	002640	跨境通	11,933,429.73	4.94
153	300231	银信科技	11,788,100.12	4.88

154	000100	TCL 集团	11,758,851.00	4.87
155	600325	华发股份	11,388,991.20	4.71
156	300130	新国都	11,359,013.89	4.70
157	601872	招商轮船	11,336,733.93	4.69
158	600809	山西汾酒	11,317,237.39	4.68
159	300311	任子行	11,295,258.76	4.67
160	002517	恺英网络	11,283,891.46	4.67
161	600201	生物股份	11,271,759.36	4.67
162	300443	金雷风电	11,110,819.67	4.60
163	002368	太极股份	10,935,238.00	4.53
164	002658	雪迪龙	10,904,372.88	4.51
165	000997	新大陆	10,782,806.66	4.46
166	300439	美康生物	10,739,826.35	4.44
167	300190	维尔利	10,719,837.31	4.44
168	300045	华力创通	10,682,390.00	4.42
169	300142	沃森生物	10,681,690.66	4.42
170	300146	汤臣倍健	10,643,104.55	4.40
171	002251	步步高	10,605,351.00	4.39
172	300362	天翔环境	10,493,255.00	4.34
173	300224	正海磁材	10,458,749.79	4.33
174	300181	佐力药业	10,422,196.50	4.31
175	600771	广誉远	10,399,273.28	4.30
176	300219	鸿利光电	10,379,163.04	4.30
177	600570	恒生电子	10,369,190.00	4.29
178	002362	汉王科技	10,354,654.00	4.29
179	000004	国农科技	10,339,448.44	4.28
180	300287	飞利信	10,322,136.95	4.27
181	300326	凯利泰	10,303,339.72	4.26
182	300302	同有科技	10,222,823.00	4.23
183	300182	捷成股份	10,183,728.23	4.21
184	002568	百润股份	10,167,482.00	4.21
185	600322	天房发展	10,130,408.34	4.19
186	300206	理邦仪器	10,084,836.96	4.17
187	300074	华平股份	10,067,868.40	4.17
188	300378	鼎捷软件	10,047,523.35	4.16
189	300382	斯莱克	10,033,288.62	4.15

190	000039	中集集团	9,986,927.81	4.13
191	000971	高升控股	9,978,138.00	4.13
192	300248	新开普	9,976,297.25	4.13
193	300356	光一科技	9,958,017.34	4.12
194	300178	腾邦国际	9,892,711.82	4.09
195	300353	东土科技	9,803,069.99	4.06
196	300242	明家科技	9,796,661.36	4.05
197	300285	国瓷材料	9,772,738.54	4.04
198	002595	豪迈科技	9,753,534.81	4.04
199	300368	汇金股份	9,711,164.00	4.02
200	300144	宋城演艺	9,684,679.26	4.01
201	000898	鞍钢股份	9,673,870.00	4.00
202	300053	欧比特	9,627,600.28	3.98
203	002426	胜利精密	9,584,621.00	3.97
204	000722	湖南发展	9,579,170.19	3.96
205	002063	远光软件	9,504,485.72	3.93
206	000559	万向钱潮	9,449,780.20	3.91
207	300171	东富龙	9,422,364.24	3.90
208	600781	辅仁药业	9,410,895.71	3.89
209	600716	凤凰股份	9,380,634.83	3.88
210	000539	粤电力A	9,354,362.00	3.87
211	300018	中元华电	9,305,027.48	3.85
212	300166	东方国信	9,252,048.17	3.83
213	600446	金证股份	9,236,536.12	3.82
214	000504	南华生物	9,231,797.00	3.82
215	600973	宝胜股份	9,224,648.50	3.82
216	300222	科大智能	9,188,758.15	3.80
217	002107	沃华医药	9,180,837.13	3.80
218	300078	思创医惠	9,164,080.00	3.79
219	601989	中国重工	9,154,671.00	3.79
220	600380	健康元	9,098,100.72	3.77
221	000793	华闻传媒	9,064,301.40	3.75
222	002216	三全食品	9,060,729.40	3.75
223	300299	富春通信	9,041,445.00	3.74
224	601222	林洋能源	9,020,849.44	3.73
225	000566	海南海药	9,003,716.92	3.73

226	300104	乐视网	9,001,482.00	3.73
227	601588	北辰实业	8,994,524.44	3.72
228	600057	象屿股份	8,993,828.02	3.72
229	300246	宝莱特	8,980,861.00	3.72
230	603869	北部湾旅	8,858,371.42	3.67
231	002460	赣锋锂业	8,844,617.10	3.66
232	000712	锦龙股份	8,799,383.33	3.64
233	300345	红宇新材	8,745,725.09	3.62
234	300215	电科院	8,729,789.83	3.61
235	300347	泰格医药	8,723,538.57	3.61
236	300250	初灵信息	8,703,114.39	3.60
237	002508	老板电器	8,685,777.02	3.59
238	300282	汇冠股份	8,623,635.11	3.57
239	300232	洲明科技	8,622,729.38	3.57
240	000078	海王生物	8,599,852.00	3.56
241	300208	恒顺众昇	8,595,178.94	3.56
242	002373	千方科技	8,559,311.03	3.54
243	300118	东方日升	8,542,276.58	3.54
244	002612	朗姿股份	8,537,312.40	3.53
245	300203	聚光科技	8,527,555.47	3.53
246	300429	强力新材	8,504,527.17	3.52
247	300301	长方集团	8,478,553.15	3.51
248	600029	南方航空	8,476,112.20	3.51
249	300262	巴安水务	8,466,756.80	3.50
250	300196	长海股份	8,456,303.84	3.50
251	300070	碧水源	8,446,122.00	3.50
252	300291	华录百纳	8,445,428.11	3.50
253	300307	慈星股份	8,431,918.59	3.49
254	300223	北京君正	8,430,161.83	3.49
255	300031	宝通科技	8,429,661.00	3.49
256	300255	常山药业	8,403,583.37	3.48
257	300047	天源迪科	8,399,808.42	3.48
258	300451	创业软件	8,379,757.04	3.47
259	300188	美亚柏科	8,367,047.90	3.46
260	000925	众合科技	8,357,333.12	3.46
261	300300	汉鼎股份	8,315,186.89	3.44

262	600037	歌华有线	8,295,930.01	3.43
263	300012	华测检测	8,273,169.04	3.42
264	300156	神雾环保	8,218,934.96	3.40
265	600703	三安光电	8,129,625.00	3.36
266	000413	东旭光电	8,058,806.00	3.34
267	600801	华新水泥	8,049,276.00	3.33
268	600240	华业资本	8,045,152.88	3.33
269	002039	黔源电力	8,006,977.43	3.31
270	300381	溢多利	7,993,362.75	3.31
271	600362	江西铜业	7,988,587.80	3.31
272	002494	华斯股份	7,985,976.00	3.31
273	000060	中金岭南	7,981,753.88	3.30
274	002183	怡亚通	7,939,569.45	3.29
275	600436	片仔癀	7,938,626.15	3.29
276	002189	利达光电	7,910,407.00	3.27
277	000979	中弘股份	7,840,402.64	3.24
278	300395	菲利华	7,788,429.60	3.22
279	300011	鼎汉技术	7,725,842.56	3.20
280	000988	华工科技	7,720,027.12	3.20
281	300264	佳创视讯	7,719,995.15	3.20
282	600498	烽火通信	7,719,575.20	3.19
283	000667	美好集团	7,709,485.03	3.19
284	300318	博晖创新	7,674,278.00	3.18
285	600466	蓝光发展	7,652,235.00	3.17
286	002616	长青集团	7,625,171.80	3.16
287	000733	振华科技	7,607,739.22	3.15
288	300227	光韵达	7,592,519.54	3.14
289	600648	外高桥	7,569,648.96	3.13
290	600157	永泰能源	7,557,755.10	3.13
291	002573	清新环境	7,546,664.98	3.12
292	002218	拓日新能	7,501,602.51	3.10
293	000430	张家界	7,483,972.41	3.10
294	002635	安洁科技	7,465,904.58	3.09
295	600074	保千里	7,442,869.00	3.08
296	002643	万润股份	7,428,126.50	3.07
297	002383	合众思壮	7,415,729.67	3.07

298	000035	中国天楹	7,372,270.53	3.05
299	600416	湘电股份	7,348,368.00	3.04
300	002349	精华制药	7,304,883.88	3.02
301	002583	海能达	7,299,165.46	3.02
302	600559	老白干酒	7,294,811.40	3.02
303	002523	天桥起重	7,292,337.13	3.02
304	300348	长亮科技	7,259,206.94	3.00
305	600198	大唐电信	7,214,085.00	2.99
306	002675	东诚药业	7,099,440.00	2.94
307	000547	航天发展	7,022,951.30	2.91
308	601007	金陵饭店	7,003,937.41	2.90
309	002354	天神娱乐	6,961,497.76	2.88
310	002044	美年健康	6,945,281.20	2.87
311	600649	城投控股	6,896,373.00	2.85
312	600035	楚天高速	6,880,602.55	2.85
313	600637	东方明珠	6,810,899.23	2.82
314	002425	凯撒股份	6,786,267.38	2.81
315	002669	康达新材	6,781,561.47	2.81
316	000555	神州信息	6,770,043.00	2.80
317	002551	尚荣医疗	6,745,055.33	2.79
318	600674	川投能源	6,741,994.00	2.79
319	600285	羚锐制药	6,724,292.40	2.78
320	601117	中国化学	6,718,739.20	2.78
321	002178	延华智能	6,677,915.23	2.76
322	600486	扬农化工	6,667,918.40	2.76
323	002273	水晶光电	6,663,128.60	2.76
324	600358	国旅联合	6,629,927.00	2.74
325	600236	桂冠电力	6,622,447.00	2.74
326	000883	湖北能源	6,584,812.18	2.73
327	300033	同花顺	6,573,401.60	2.72
328	600805	悦达投资	6,553,719.48	2.71
329	600556	慧球科技	6,514,254.00	2.70
330	002041	登海种业	6,379,820.11	2.64
331	600593	大连圣亚	6,314,800.54	2.61
332	002028	思源电气	6,219,650.54	2.57
333	600831	广电网络	6,078,397.56	2.52

334	600804	鹏博士	6,076,026.68	2.51
335	300418	昆仑万维	6,040,011.66	2.50
336	300364	中文在线	6,027,885.00	2.49
337	002267	陕天然气	6,010,344.00	2.49
338	002322	理工监测	5,999,941.16	2.48
339	600027	华电国际	5,896,862.00	2.44
340	000024	招商地产	5,843,285.39	2.42
341	300310	宜通世纪	5,807,936.85	2.40
342	000801	四川九洲	5,780,444.46	2.39
343	603167	渤海轮渡	5,774,141.00	2.39
344	300427	红相电力	5,752,367.25	2.38
345	600350	山东高速	5,739,314.00	2.38
346	603168	莎普爱思	5,720,656.50	2.37
347	002718	友邦吊顶	5,719,205.40	2.37
348	300168	万达信息	5,693,234.02	2.36
349	600661	新南洋	5,636,000.00	2.33
350	600138	中青旅	5,627,592.60	2.33
351	002261	拓维信息	5,537,729.20	2.29
352	002555	三七互娱	5,536,229.00	2.29
353	300098	高新兴	5,483,304.38	2.27
354	300006	莱美药业	5,480,715.49	2.27
355	002465	海格通信	5,468,454.39	2.26
356	002294	信立泰	5,441,608.38	2.25
357	300055	万邦达	5,388,522.00	2.23
358	300269	联建光电	5,307,624.90	2.20
359	600598	北大荒	5,280,000.00	2.19
360	600645	中源协和	5,258,547.67	2.18
361	002100	天康生物	5,252,758.26	2.17
362	600826	兰生股份	5,242,727.00	2.17
363	000671	阳光城	5,216,019.18	2.16
364	002390	信邦制药	5,198,195.58	2.15
365	000829	天音控股	5,163,765.45	2.14
366	300359	全通教育	5,145,616.00	2.13
367	002510	天汽模	5,133,878.47	2.12
368	300230	永利股份	5,091,023.84	2.11
369	300323	华灿光电	5,079,499.42	2.10

370	300086	康芝药业	5,048,428.94	2.09
371	002699	美盛文化	5,035,005.24	2.08
372	600658	电子城	5,028,876.00	2.08
373	300058	蓝色光标	5,021,388.00	2.08
374	000656	金科股份	4,981,658.72	2.06
375	600856	中天能源	4,943,624.68	2.05
376	000939	凯迪生态	4,896,153.36	2.03
377	300254	仟源医药	4,869,762.81	2.02
378	002665	首航节能	4,843,781.00	2.00

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	601318	中国平安	86,905,714.63	35.97
2	601328	交通银行	79,272,368.91	32.81
3	601166	兴业银行	62,099,554.13	25.70
4	600036	招商银行	52,692,552.05	21.81
5	601398	工商银行	52,677,552.62	21.80
6	300059	东方财富	52,208,007.74	21.61
7	600000	浦发银行	51,913,647.17	21.49
8	600837	海通证券	51,741,258.31	21.41
9	601288	农业银行	45,991,177.00	19.03
10	601939	建设银行	44,611,451.68	18.46
11	600016	民生银行	44,242,932.90	18.31
12	600030	中信证券	43,003,591.28	17.80
13	600309	万华化学	41,251,022.34	17.07
14	002024	苏宁云商	40,907,125.29	16.93
15	600536	中国软件	40,769,263.44	16.87
16	000002	万科A	38,113,924.63	15.77
17	601818	光大银行	36,415,844.94	15.07
18	601628	中国人寿	36,171,902.49	14.97
19	600048	保利地产	34,617,557.64	14.33
20	300253	卫宁健康	32,151,679.61	13.31
21	601169	北京银行	30,558,565.56	12.65
22	300357	我武生物	30,170,586.35	12.49
23	600066	宇通客车	28,724,810.82	11.89

24	002405	四维图新	27,926,575.93	11.56
25	600015	华夏银行	27,555,253.73	11.40
26	600718	东软集团	27,260,026.15	11.28
27	601377	兴业证券	27,020,694.07	11.18
28	300101	振芯科技	26,821,000.56	11.10
29	000001	平安银行	26,073,375.37	10.79
30	002236	大华股份	25,441,977.84	10.53
31	300204	舒泰神	25,354,690.33	10.49
32	300113	顺网科技	24,602,368.82	10.18
33	600518	康美药业	24,192,052.81	10.01
34	601601	中国太保	23,677,402.48	9.80
35	600585	海螺水泥	23,336,690.20	9.66
36	300183	东软载波	23,099,033.14	9.56
37	601336	新华保险	22,954,351.09	9.50
38	300050	世纪鼎利	22,496,435.10	9.31
39	000776	广发证券	22,242,947.33	9.21
40	600104	上汽集团	22,228,471.54	9.20
41	300009	安科生物	21,685,434.81	8.98
42	300336	新文化	21,651,008.50	8.96
43	300077	国民技术	21,444,402.49	8.88
44	000415	渤海金控	21,295,695.59	8.81
45	002280	联络互动	21,273,460.70	8.80
46	601009	南京银行	21,036,112.83	8.71
47	000783	长江证券	20,573,469.23	8.51
48	601998	中信银行	20,214,586.54	8.37
49	300271	华宇软件	19,962,785.98	8.26
50	002446	盛路通信	19,939,783.67	8.25
51	300296	利亚德	19,574,549.54	8.10
52	300199	翰宇药业	19,434,866.94	8.04
53	300229	拓尔思	19,431,076.94	8.04
54	002099	海翔药业	19,304,052.20	7.99
55	600519	贵州茅台	19,221,261.85	7.96
56	002439	启明星辰	19,154,524.32	7.93
57	600823	世茂股份	19,057,779.55	7.89
58	000661	长春高新	18,868,832.38	7.81
59	601088	中国神华	18,723,094.33	7.75
60	002008	大族激光	18,651,702.89	7.72
61	002466	天齐锂业	18,434,604.79	7.63

62	300297	蓝盾股份	18,356,794.05	7.60
63	600418	江淮汽车	18,324,190.61	7.58
64	600276	恒瑞医药	18,219,611.36	7.54
65	002230	科大讯飞	18,203,479.64	7.53
66	300003	乐普医疗	18,141,224.29	7.51
67	000008	神州高铁	18,017,041.58	7.46
68	002195	二三四五	18,007,316.13	7.45
69	002364	中恒电气	18,002,667.56	7.45
70	300015	爱尔眼科	17,925,637.35	7.42
71	000726	鲁泰A	17,850,874.76	7.39
72	002153	石基信息	17,756,600.46	7.35
73	601788	光大证券	17,729,910.14	7.34
74	600352	浙江龙盛	17,574,961.34	7.27
75	600867	通化东宝	17,420,651.30	7.21
76	600690	青岛海尔	17,386,166.25	7.20
77	300379	东方通	17,196,896.20	7.12
78	300075	数字政通	17,164,695.12	7.10
79	002241	歌尔声学	16,824,445.82	6.96
80	000550	江铃汽车	16,391,175.99	6.78
81	300368	汇金股份	16,189,052.80	6.70
82	601199	江南水务	16,188,036.90	6.70
83	002019	亿帆鑫富	16,106,241.06	6.67
84	601668	中国建筑	15,916,275.52	6.59
85	300016	北陆药业	15,689,420.07	6.49
86	300017	网宿科技	15,527,338.41	6.43
87	300352	北信源	15,395,867.76	6.37
88	002279	久其软件	15,362,078.38	6.36
89	600566	济川药业	15,243,437.01	6.31
90	002074	国轩高科	15,203,459.10	6.29
91	000718	苏宁环球	15,202,190.79	6.29
92	300295	三六五网	15,167,253.04	6.28
93	002640	跨境通	15,092,135.59	6.25
94	601999	出版传媒	15,024,827.96	6.22
95	300202	聚龙股份	14,855,945.06	6.15
96	600485	信威集团	14,851,387.24	6.15
97	002268	卫士通	14,836,151.48	6.14
98	300422	博世科	14,785,826.83	6.12
99	300027	华谊兄弟	14,710,919.49	6.09

100	002657	中金金财	14,550,647.40	6.02
101	000895	双汇发展	14,542,814.30	6.02
102	603567	珍宝岛	14,342,489.02	5.94
103	300302	同有科技	14,338,912.13	5.93
104	300274	阳光电源	14,331,072.82	5.93
105	002202	金风科技	14,233,303.65	5.89
106	600705	中航资本	14,142,984.43	5.85
107	000625	长安汽车	13,941,109.74	5.77
108	002142	宁波银行	13,929,705.83	5.77
109	300231	银信科技	13,899,172.00	5.75
110	300248	新开普	13,707,640.02	5.67
111	600115	东方航空	13,580,000.00	5.62
112	600613	神奇制药	13,525,907.43	5.60
113	002609	捷顺科技	13,444,893.30	5.56
114	002437	誉衡药业	13,353,703.26	5.53
115	600887	伊利股份	13,174,027.00	5.45
116	300315	掌趣科技	13,172,922.10	5.45
117	002407	多氟多	13,157,698.08	5.45
118	300324	旋极信息	13,051,441.47	5.40
119	300294	博雅生物	12,889,415.39	5.33
120	600011	华能国际	12,876,380.71	5.33
121	600588	用友网络	12,787,377.52	5.29
122	600570	恒生电子	12,779,457.20	5.29
123	300130	新国都	12,707,710.56	5.26
124	600028	中国石化	12,704,130.00	5.26
125	300032	金龙机电	12,630,956.90	5.23
126	600172	黄河旋风	12,584,047.12	5.21
127	600201	生物股份	12,546,585.98	5.19
128	000004	国农科技	12,506,679.88	5.18
129	300292	吴通控股	12,481,266.05	5.17
130	000400	许继电气	12,474,423.32	5.16
131	300316	晶盛机电	12,464,227.94	5.16
132	300026	红日药业	12,449,057.04	5.15
133	300443	金雷风电	12,444,476.65	5.15
134	300072	三聚环保	12,342,086.57	5.11
135	300045	华力创通	12,337,585.34	5.11
136	002658	雪迪龙	12,333,392.38	5.10
137	300398	飞凯材料	12,301,829.79	5.09

138	300267	尔康制药	12,276,610.35	5.08
139	600446	金证股份	12,212,952.30	5.05
140	000566	海南海药	12,210,337.11	5.05
141	002368	太极股份	12,085,505.99	5.00
142	000997	新大陆	12,050,349.88	4.99
143	000100	TCL 集团	11,918,037.00	4.93
144	300182	捷成股份	11,875,385.79	4.91
145	300237	美晨科技	11,840,089.45	4.90
146	002568	百润股份	11,776,823.46	4.87
147	601872	招商轮船	11,748,473.78	4.86
148	300124	汇川技术	11,737,622.29	4.86
149	002362	汉王科技	11,643,650.56	4.82
150	300289	利德曼	11,643,578.19	4.82
151	600809	山西汾酒	11,569,520.63	4.79
152	600694	大商股份	11,476,985.10	4.75
153	300178	腾邦国际	11,406,167.08	4.72
154	300053	欧比特	11,380,808.07	4.71
155	002460	赣锋锂业	11,374,081.44	4.71
156	002146	荣盛发展	11,342,550.26	4.69
157	600716	凤凰股份	11,205,507.88	4.64
158	300219	鸿利光电	11,196,716.96	4.63
159	300311	任子行	11,110,711.85	4.60
160	000629	攀钢钒钛	11,040,000.00	4.57
161	002251	步步高	11,020,665.95	4.56
162	300188	美亚柏科	10,935,531.86	4.53
163	300436	广生堂	10,872,625.11	4.50
164	002517	恺英网络	10,804,770.86	4.47
165	600380	健康元	10,776,173.41	4.46
166	300144	宋城演艺	10,752,653.61	4.45
167	300378	鼎捷软件	10,719,118.18	4.44
168	300356	光一科技	10,701,282.47	4.43
169	300395	菲利华	10,686,842.29	4.42
170	600325	华发股份	10,673,735.50	4.42
171	002183	怡亚通	10,633,652.22	4.40
172	300078	思创医惠	10,631,912.43	4.40
173	300285	国瓷材料	10,597,368.21	4.39
174	600322	天房发展	10,578,078.18	4.38
175	300212	易华录	10,553,773.00	4.37

176	300208	恒顺众昇	10,542,535.69	4.36
177	300445	康斯特	10,507,572.63	4.35
178	300224	正海磁材	10,452,589.79	4.33
179	000504	南华生物	10,354,275.68	4.29
180	300181	佐力药业	10,316,824.79	4.27
181	600057	象屿股份	10,173,189.81	4.21
182	601989	中国重工	10,151,074.00	4.20
183	300362	天翔环境	10,135,888.76	4.20
184	600771	广誉远	10,121,742.95	4.19
185	300146	汤臣倍健	10,119,235.36	4.19
186	000559	万向钱潮	10,108,703.62	4.18
187	002373	千方科技	10,052,137.03	4.16
188	300166	东方国信	10,048,723.77	4.16
189	300364	中文在线	10,031,483.25	4.15
190	600973	宝胜股份	10,010,490.29	4.14
191	300190	维尔利	9,944,767.66	4.12
192	000898	鞍钢股份	9,909,083.13	4.10
193	300353	东土科技	9,901,971.22	4.10
194	000988	华工科技	9,845,910.23	4.07
195	300250	初灵信息	9,839,124.39	4.07
196	600781	辅仁药业	9,764,999.75	4.04
197	300215	电科院	9,751,628.00	4.04
198	002426	胜利精密	9,703,403.86	4.02
199	300382	斯莱克	9,699,915.06	4.01
200	300287	飞利信	9,696,461.07	4.01
201	300142	沃森生物	9,657,439.88	4.00
202	002107	沃华医药	9,595,740.75	3.97
203	600240	华业资本	9,585,615.52	3.97
204	300439	美康生物	9,582,200.90	3.97
205	300074	华平股份	9,528,349.18	3.94
206	601588	北辰实业	9,357,515.00	3.87
207	300206	理邦仪器	9,341,002.48	3.87
208	300018	中元华电	9,334,253.90	3.86
209	000712	锦龙股份	9,233,386.01	3.82
210	300242	明家科技	9,224,864.34	3.82
211	000539	粤电力A	9,218,267.20	3.82
212	000793	华闻传媒	9,093,781.74	3.76
213	300104	乐视网	9,040,106.00	3.74

214	002063	远光软件	9,030,330.20	3.74
215	002595	豪迈科技	8,973,001.61	3.71
216	000722	湖南发展	8,972,331.79	3.71
217	000039	中集集团	8,954,814.35	3.71
218	300291	华录百纳	8,945,767.95	3.70
219	002383	合众思壮	8,848,008.32	3.66
220	600029	南方航空	8,824,284.00	3.65
221	300246	宝莱特	8,785,634.00	3.64
222	002551	尚荣医疗	8,781,112.65	3.63
223	600649	城投控股	8,781,067.30	3.63
224	600648	外高桥	8,747,231.74	3.62
225	002216	三全食品	8,658,153.00	3.58
226	002039	黔源电力	8,655,231.92	3.58
227	002583	海能达	8,644,486.91	3.58
228	002261	拓维信息	8,593,376.48	3.56
229	300429	强力新材	8,550,434.87	3.54
230	000979	中弘股份	8,505,942.98	3.52
231	002508	老板电器	8,501,745.68	3.52
232	300347	泰格医药	8,455,396.00	3.50
233	600703	三安光电	8,402,846.60	3.48
234	300222	科大智能	8,401,256.79	3.48
235	000413	东旭光电	8,383,287.75	3.47
236	600801	华新水泥	8,374,559.43	3.47
237	600466	蓝光发展	8,349,959.44	3.46
238	300345	红宇新材	8,348,549.20	3.46
239	300118	东方日升	8,248,311.19	3.41
240	601222	林洋能源	8,247,586.12	3.41
241	002612	朗姿股份	8,241,530.97	3.41
242	002643	万润股份	8,195,157.02	3.39
243	300011	鼎汉技术	8,142,286.74	3.37
244	300196	长海股份	8,137,703.76	3.37
245	300136	信维通信	8,121,699.57	3.36
246	601007	金陵饭店	8,103,939.62	3.35
247	600362	江西铜业	8,088,536.80	3.35
248	000430	张家界	8,081,887.73	3.34
249	000035	中国天楹	8,072,371.63	3.34
250	000925	众合科技	8,069,377.38	3.34
251	600436	片仔癀	8,044,883.46	3.33

252	000667	美好集团	8,031,724.00	3.32
253	600037	歌华有线	8,022,517.40	3.32
254	002635	安洁科技	8,014,868.24	3.32
255	000547	航天发展	8,003,204.13	3.31
256	000078	海王生物	7,976,091.99	3.30
257	300070	碧水源	7,970,179.07	3.30
258	300203	聚光科技	7,957,887.68	3.29
259	300171	东富龙	7,957,146.29	3.29
260	300326	凯利泰	7,954,448.31	3.29
261	002189	利达光电	7,940,876.35	3.29
262	300299	富春通信	7,937,826.50	3.29
263	300232	洲明科技	7,929,211.24	3.28
264	002573	清新环境	7,928,906.31	3.28
265	002218	拓日新能	7,916,005.14	3.28
266	300012	华测检测	7,884,156.74	3.26
267	300300	汉鼎股份	7,875,674.20	3.26
268	600074	保千里	7,871,931.50	3.26
269	002616	长青集团	7,860,109.02	3.25
270	300227	光韵达	7,849,012.27	3.25
271	600157	永泰能源	7,847,166.44	3.25
272	002415	海康威视	7,839,223.50	3.24
273	002358	森源电气	7,838,542.14	3.24
274	300282	汇冠股份	7,798,385.08	3.23
275	300031	宝通科技	7,785,549.00	3.22
276	601117	中国化学	7,774,354.00	3.22
277	300262	巴安水务	7,767,974.40	3.21
278	600637	东方明珠	7,739,826.16	3.20
279	002494	华斯股份	7,729,798.23	3.20
280	300301	长方集团	7,728,086.68	3.20
281	002523	天桥起重	7,667,064.23	3.17
282	600383	金地集团	7,632,100.00	3.16
283	300255	常山药业	7,609,542.63	3.15
284	002555	三七互娱	7,552,715.67	3.13
285	300307	慈星股份	7,523,723.28	3.11
286	002669	康达新材	7,510,754.27	3.11
287	300047	天源迪科	7,451,571.74	3.08
288	000971	高升控股	7,388,937.00	3.06
289	600804	鹏博士	7,360,304.95	3.05

290	300451	创业软件	7,346,885.50	3.04
291	002465	海格通信	7,336,682.58	3.04
292	000333	美的集团	7,298,932.39	3.02
293	300381	溢多利	7,278,626.12	3.01
294	300156	神雾环保	7,274,216.76	3.01
295	000733	振华科技	7,256,884.00	3.00
296	002425	凯撒股份	7,241,895.87	3.00
297	300223	北京君正	7,224,471.58	2.99
298	600198	大唐电信	7,184,367.33	2.97
299	600805	悦达投资	7,169,205.00	2.97
300	000651	格力电器	7,133,645.80	2.95
301	603168	莎普爱思	7,126,134.77	2.95
302	300033	同花顺	7,123,683.04	2.95
303	002354	天神娱乐	7,083,493.04	2.93
304	002349	精华制药	7,072,454.20	2.93
305	600358	国旅联合	7,071,501.58	2.93
306	600831	广电网络	7,040,135.00	2.91
307	600741	华域汽车	7,037,567.57	2.91
308	002322	理工监测	6,946,786.36	2.88
309	300310	宜通世纪	6,946,573.52	2.88
310	600498	烽火通信	6,946,233.80	2.87
311	000555	神州信息	6,937,887.76	2.87
312	300318	博晖创新	6,936,254.84	2.87
313	300269	联建光电	6,891,204.50	2.85
314	000157	中联重科	6,870,000.00	2.84
315	300264	佳创视讯	6,864,910.51	2.84
316	002044	美年健康	6,776,055.40	2.80
317	600285	羚锐制药	6,729,477.61	2.79
318	002273	水晶光电	6,723,092.86	2.78
319	002041	登海种业	6,637,752.56	2.75
320	600593	大连圣亚	6,633,482.24	2.75
321	002178	延华智能	6,622,650.20	2.74
322	300359	全通教育	6,606,258.82	2.73
323	002100	天康生物	6,528,134.93	2.70
324	002390	信邦制药	6,503,099.32	2.69
325	300348	长亮科技	6,397,160.69	2.65
326	002510	天汽模	6,387,001.00	2.64
327	000671	阳光城	6,361,732.07	2.63

328	600035	楚天高速	6,347,259.01	2.63
329	000069	华侨城 A	6,280,000.00	2.60
330	002028	思源电气	6,175,825.08	2.56
331	002675	东诚药业	6,133,969.80	2.54
332	000883	湖北能源	6,121,476.96	2.53
333	300098	高新兴	6,084,242.80	2.52
334	600598	北大荒	6,055,640.01	2.51
335	000528	柳 工	6,050,365.50	2.50
336	600416	湘电股份	6,049,341.00	2.50
337	300055	万邦达	6,033,560.95	2.50
338	600559	老白干酒	6,030,568.40	2.50
339	000801	四川九洲	6,016,939.80	2.49
340	600486	扬农化工	5,987,269.00	2.48
341	600138	中青旅	5,943,143.53	2.46
342	600674	川投能源	5,909,005.00	2.45
343	600645	中源协和	5,900,224.64	2.44
344	300312	邦讯技术	5,895,926.29	2.44
345	300168	万达信息	5,885,775.32	2.44
346	000423	东阿阿胶	5,852,410.84	2.42
347	600236	桂冠电力	5,718,813.12	2.37
348	002326	永太科技	5,714,971.00	2.37
349	002718	友邦吊顶	5,642,938.11	2.34
350	600856	中天能源	5,602,161.17	2.32
351	600027	华电国际	5,468,335.78	2.26
352	600556	慧球科技	5,450,979.92	2.26
353	002294	信立泰	5,446,686.38	2.25
354	600826	兰生股份	5,404,447.00	2.24
355	601799	星宇股份	5,402,475.52	2.24
356	300160	秀强股份	5,370,471.83	2.22
357	603869	北部湾旅	5,364,635.31	2.22
358	002618	丹邦科技	5,357,336.00	2.22
359	300058	蓝色光标	5,350,793.12	2.21
360	300418	昆仑万维	5,329,441.00	2.21
361	300195	长荣股份	5,326,019.98	2.20
362	300254	仟源医药	5,315,978.12	2.20
363	002191	劲嘉股份	5,310,578.08	2.20
364	300323	华灿光电	5,303,064.55	2.19
365	002169	智光电气	5,294,480.56	2.19

366	000939	凯迪生态	5,235,434.70	2.17
367	000024	招商地产	5,218,219.00	2.16
368	000018	神州长城	5,183,747.90	2.15
369	600521	华海药业	5,180,636.11	2.14
370	002699	美盛文化	5,150,421.85	2.13
371	300427	红相电力	5,149,093.00	2.13
372	300273	和佳股份	5,142,798.49	2.13
373	600658	电子城	5,134,591.99	2.13
374	002690	美亚光电	5,132,751.53	2.12
375	300025	华星创业	5,097,574.75	2.11
376	000524	岭南控股	5,073,967.15	2.10
377	300054	鼎龙股份	5,043,383.51	2.09
378	300259	新天科技	4,972,225.23	2.06
379	002665	首航节能	4,959,742.00	2.05
380	002285	世联行	4,958,559.70	2.05
381	601555	东吴证券	4,949,051.86	2.05
382	000656	金科股份	4,948,351.00	2.05
383	300213	佳讯飞鸿	4,920,420.25	2.04
384	002104	恒宝股份	4,899,403.14	2.03
385	600661	新南洋	4,891,451.34	2.02
386	002308	威创股份	4,891,190.10	2.02
387	300086	康芝药业	4,890,633.52	2.02
388	002089	新海宜	4,870,741.16	2.02
389	300024	机器人	4,858,271.71	2.01

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	6,223,213,798.44
卖出股票收入（成交）总额	5,678,366,636.15

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。

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	723,844.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,377.85
5	应收申购款	3,448,577.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,196,799.34

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

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	000002	万科A	26,643,358.00	2.47	临时停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：无。

§ 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
108,666	3,234.44	34,985,867.17	9.95%	316,487,923.52	90.05%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员	247,349.79	0.07%

持有本开放式基金		
----------	--	--

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

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 10 至 50 万份。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008 年 7 月 16 日）基金份额总额	406,303,580.25
本报告期期初基金份额总额	150,053,585.36
本报告期基金总申购份额	653,867,017.55
减:本报告期基金总赎回份额	452,446,812.22
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	351,473,790.69

§ 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 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 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 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有限公司的报酬为 60,000.00 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	
中投证券	1	13,806,668,468.83	31.98%	3,453,395.23	31.88%	-
华泰证券	3	3,091,959,084.78	25.98%	2,774,532.17	25.62%	-
宏源证券	2	2,191,104,850.21	18.41%	1,999,780.08	18.46%	-
兴业证券	1	2,111,312,184.02	17.74%	1,965,823.38	18.15%	-
银河证券	1	678,786,703.87	5.70%	617,968.42	5.71%	-
广发证券	1	21,656,657.88	0.18%	19,735.71	0.18%	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

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
中投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	126,200,000.00	100.00%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞价值增长基金恢复大额申购等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-12-31
2	关于继续参加平安银行基金定投及申购费率优惠推广活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-12-31
3	关于参加农业银行定期定额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	2015-12-30
4	关于参加浙商银行网上银行及定期定额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	2015-12-30
5	华泰柏瑞基金管理有限公司继续参加中国工商银行“2016 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-12-28
6	关于参加中国农业银行网上银行、手机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	2015-12-23
7	关于参加中国邮政储蓄银行个人网上银行和手机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	2015-12-22
8	关于参加安信证券基金定期定额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	2015-11-16
9	华泰柏瑞基金管理有限公司参加国都证券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	2015-08-28
10	华泰柏瑞基金关于继续参加天天基金网费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-08-25
11	华泰柏瑞基金关于继续参加恒丰	中国证券报、上海证券	2015-08-25

	银行费率优惠活动的公告	报、证券时报	
12	华泰柏瑞基金管理有限公司参加中金公司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	2015-08-17
13	增加中经北证为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投、费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-08-10
14	增加泰诚财富为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投、费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-08-10
15	关于变更旗下部分股票型证券投资基金类别、基金名称并修改基金合同部分条款的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-08-06
16	华泰柏瑞基金管理有限公司参加平安证券开放式基金申购、定期定额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	2015-07-18
17	华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金暂停大额申购(转换转入、定期定额投资)的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-07-14
18	华泰柏瑞基金管理有限公司华泰柏瑞基金管理有限公司关于公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-07-07
19	参加交通银行网上银行、手机银行基金申购手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-06-30
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-06-20
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证券	2015-06-05

	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	报、证券时报	
22	关于华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金参与深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-06-01
23	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金参与天天基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-05-28
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于开展我司网上直销交易认购、申购、转换费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-05-25
25	关于网上直销平台新增通联支付支持银行业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-04-03
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-04-01
27	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	2015-04-01
28	关于在中国工商银行开通旗下部分基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-03-04
29	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	2015-02-17
30	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	2015-02-04
31	华泰柏瑞价值增长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	2015-01-14

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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

12.3 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
2016 年 3 月 29 日