

# 华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	错误!未定义书签。
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	错误!未定义书签。
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	38
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	38
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39

7.12 投资组合报告附注.....	39
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	40
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>41</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	43
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>错误!未定义书签。</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>44</b>
12.1 备查文件目录.....	44
12.2 存放地点.....	44
12.3 查阅方式.....	44

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞积极优选股票
基金主代码	001097
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 月 26 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	830,361,430.12 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以对经济周期和产业周期的研究判断为基础，优选受益于经济发展、市场改革且处于行业领先地位的上市公司证券，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票类资产为主要投资工具，通过精选个股获取资产的长期增值；通过适度的大类资产配置来降低组合的系统性风险。 本基金将“自上而下”的趋势投资和“自下而上”的个股选择相结合。投资决策的重点在于寻找具有巨大发展潜力的趋势，发现并投资于有能力把握趋势并在竞争中处于优势的公司。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：80%*沪深 300 指数收益率+20%*中信标普国债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期收益和风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	田青
	联系电话	021-38601777	010-67595096
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	010-67595096
传真		021-38601799	010-66275853
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17	北京市西城区金融大街 25 号

	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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200135	100033
法定代表人	齐亮	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-176,343,091.53
本期利润	-130,658,353.29
加权平均基金份额本期利润	-0.1519
本期加权平均净值利润率	-25.56%
本期基金份额净值增长率	-20.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-337,572,957.20
期末可供分配基金份额利润	-0.4065
期末基金资产净值	492,788,472.92
期末基金份额净值	0.593
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-40.70%

### 3.2 基金净值表现

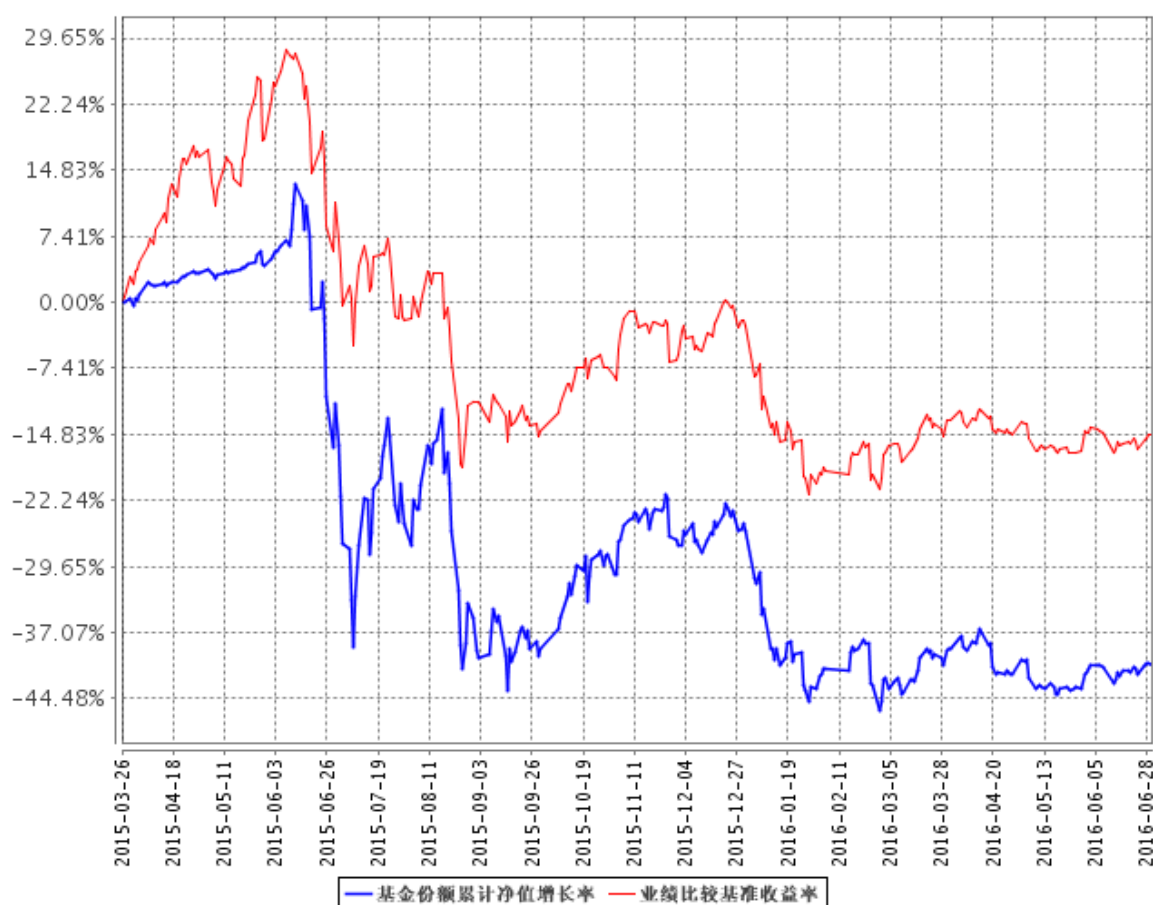
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	1.72%	1.01%	-0.34%	0.79%	2.06%	0.22%
过去三个月	-2.95%	1.28%	-1.79%	0.81%	-1.16%	0.47%
过去六个月	-20.19%	2.06%	-12.32%	1.47%	-7.87%	0.59%
过去一年	-33.15%	3.11%	-23.47%	1.84%	-9.68%	1.27%
自基金合同生效起至今	-40.70%	2.92%	-14.81%	1.89%	-25.89%	1.03%

### 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 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司（原友邦华泰基金管理有限公司）。华泰柏瑞基金管理

有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国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、华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金和华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金。截至 2016 年 6 月 30 日，公司的公募基金管理规模为 876.50 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		
方伦煜	投资部总监、本基金的基金经理	2015 年 3 月 26 日	-	16	方伦煜先生，管理学硕士，16 年证券从业经历，历任广发证券股份有限公司行业研究员、招商证券有限公司投资经理、巨田基金管理有限公司研究员，广



					发证券股份有限公司投资经理。2008 年 6 月至 2010 年 2 月任中国人寿资产管理有限公司投资经理，2010 年 2 月至 2012 年 2 月任职于华安基金管理有限公司基金投资部，2012 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2012 年 4 月起担任华泰柏瑞基金成长混合型证券投资基金基金经理。2015 年 3 月起担任华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起任投资部总监。
--	--	--	--	--	---

#### 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《华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易

所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场经历了一个暴跌到企稳横盘的过程。目前市场呈现一种微妙的均衡态势。一方面宏观经济前景不乐观,另一方面流动性仍然较为宽松,且刚经历了年初的“熔断”暴跌,市场上下两难。

尽管当前市场指数波澜不惊,但热点一直此起彼伏。本基金在契约允许的低仓位水平积极把握了白酒、煤炭和军工等主题热点的投资机会。

出于流动性等因素考虑,报告期内积极优选基金利用股指期货进行了套保操作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为 0.593 元,本报告期份额净值增长率为-20.19%,同期业绩比较基准增长率为-12.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前经济前景仍不明朗,具体政策走向难以把握,预计股票市场仍将继续震荡直至情况发生重大变化。由于当下市场心态极其不稳,投机气氛较重,其间不排除出现激烈震荡。

行业板块机会方面,“供给侧改革”相关板块和地缘政治有关主题可能会有较好表现。另外,其它与“涨价”相关的行业个股也将有表现机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,基金管理人严格执行基金估值控制流程,定期评估估值技术的合理性,每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人,基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注：无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	26,043,140.85	93,712,933.86
结算备付金		6,493,572.27	11,467,048.11
存出保证金		2,753,822.81	788,912.12
交易性金融资产	6.4.7.2	426,607,518.37	553,146,177.66
其中：股票投资		406,607,518.37	523,077,177.66
基金投资		-	-
债券投资		20,000,000.00	30,069,000.00

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		32,798,609.72	-
应收利息	6.4.7.5	549,901.80	401,669.04
应收股利		-	-
应收申购款		15,542.08	450,239.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		495,262,107.90	659,966,980.78
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,230,532.00
应付赎回款		646,959.44	433,999.04
应付管理人报酬		603,899.33	838,203.21
应付托管费		100,649.89	139,700.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	921,658.51	4,753,569.79
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	200,467.81	370,803.31
负债合计		2,473,634.98	8,766,807.87
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	830,361,430.12	876,264,545.92
未分配利润	6.4.7.10	-337,572,957.20	-225,064,373.01
所有者权益合计		492,788,472.92	651,200,172.91
负债和所有者权益总计		495,262,107.90	659,966,980.78

注 1. 报告截止日 2016 年 6 月 30 日, 基金份额净值 0.593 元, 基金份额总额 830,361,430.12 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金

本报告期: 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 3 月 26 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-123,180,568.74	-68,303,828.68
1.利息收入		560,519.32	3,225,305.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	270,306.21	1,938,643.21
债券利息收入		290,213.11	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,286,661.88
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-169,522,612.78	71,895,978.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-172,704,529.64	70,236,301.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	29,960.00	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-325,680.00	-
股利收益	6.4.7.16	3,477,636.86	1,659,677.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	45,684,738.24	-146,683,755.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	96,786.48	3,258,643.11
<b>减：二、费用</b>		7,477,784.55	11,729,160.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,824,298.63	6,155,582.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	637,383.09	1,025,930.33
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,800,699.05	4,401,752.58
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	215,403.78	145,895.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-130,658,353.29	-80,032,989.39
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-130,658,353.29	-80,032,989.39

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	876,264,545.92	-225,064,373.01	651,200,172.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-130,658,353.29	-130,658,353.29
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)	-45,903,115.80	18,149,769.10	-27,753,346.70
其中：1.基金申购款	29,568,814.96	-11,896,397.51	17,672,417.45
2.基金赎回款	-75,471,930.76	30,046,166.61	-45,425,764.15
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)	830,361,430.12	-337,572,957.20	492,788,472.92
项目	上年度可比期间 2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,706,941,661.53	-	1,706,941,661.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-80,032,989.39	-80,032,989.39
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)	-529,584,489.42	-52,551,849.81	-582,136,339.23
其中：1.基金申购款	299,569,979.58	-5,764,026.81	293,805,952.77
2.基金赎回款	-829,154,469.00	-46,787,823.00	-875,942,292.00
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)	1,177,357,172.11	-132,584,839.20	1,044,772,332.91

金净值)			
------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞积极优选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[2015]第 250 号《关于准予华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞积极优选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 1,706,729,101.43 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 186 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金合同》于 2015 年 3 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,706,729,101.43 份基金份额,其中认购资金利息折合 212,560.10 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 80-95%;在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为 80%\*沪深 300 指数收益率+20%\*中信标普国债指数收益率(税后)

本财务报表由本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2016 年 8 月 27 日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38

项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年3月36日(基金合同生效日)至2016年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年6月30日的财务状况以及2015年3月26日(基金合同生效日)至2016年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期内本基金采用的会计政策和会计估计与上年度相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金



派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	26,043,140.85
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	26,043,140.85

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	436,817,579.77	406,607,518.37	-30,210,061.40	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	19,982,520.00	20,000,000.00	17,480.00
	合计	19,982,520.00	20,000,000.00	17,480.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	456,800,099.77	426,607,518.37	-30,192,581.40	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	

货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-11,713,440	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-11,713,440	-	-	

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	8,637.47
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,681.24
应收债券利息	537,431.69
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	151.40
合计	549,901.80

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	921,508.51
银行间市场应付交易费用	150.00
合计	921,658.51

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,563.65
预提费用	198,904.16
合计	200,467.81

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	876,264,545.92	876,264,545.92
本期申购	29,568,814.96	29,568,814.96
本期赎回(以“-”号填列)	-75,471,930.76	-75,471,930.76
- 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	830,361,430.12	830,361,430.12

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-161,427,514.49	-63,636,858.52	-225,064,373.01
本期利润	-176,343,091.53	45,684,738.24	-130,658,353.29
本期基金份额交易产生的变动数	14,413,857.08	3,735,912.02	18,149,769.10
其中：基金申购款	-7,878,275.53	-4,018,121.98	-11,896,397.51
基金赎回款	22,292,132.61	7,754,034.00	30,046,166.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-323,356,748.94	-14,216,208.26	-337,572,957.20

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	174,610.83
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	92,105.31
其他	3,590.07
合计	270,306.21

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	941,074,943.23
减：卖出股票成本总额	1,113,779,472.87
买卖股票差价收入	-172,704,529.64

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	29,960.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	29,960.00

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,160,952.24

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,991,260.00
减：应收利息总额	139,732.24
买卖债券差价收入	29,960.00

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2016年1月1日至2016年6月30日
权证投资收益	-
股指期货-投资收益	-325,680

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,477,636.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,477,636.86

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	46,058,098.24
——股票投资	46,135,838.24
——债券投资	-77,740.00
——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	-373,360.00
合计	45,684,738.24

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	84,331.67
转换费收入	12,454.81
合计	96,786.48

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金财产。

2、本基金的转换费由基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用中的 25% 归入基金财产。

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	2,800,524.05

银行间市场交易费用	175.00
合计	2,800,699.05

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,178.12
银行划款手续费	7,499.62
银行间账户服务费	9,000.00
合计	215,403.78

#### 6.4.7.21 分部报告

注：本基金本报告期无分部报告。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

注：截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年3月26日(基金合同生效日)至 2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	-	-	3,250,336,936.29	100.00%

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内通过关联方交易单元未进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年3月26日(基金合同生效日)至 2015年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
华泰证券股份有限公	-	-	5,209,200,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

关联方名称	上年度可比期间 2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券股份 有限公司	2,927,905.19	100.00%	2,462,321.53	100.00%

注：本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。



## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年3月26日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,824,298.63	6,155,582.18
其中：支付销售机构的客户维护费	2,207,593.72	-

注1：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。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年3月26日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	637,383.09	1,025,930.33

注1：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提，计算方法如下：

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

H为每日应支付的托管费

E为前一日的基金资产净值

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

### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金报告期内无销售服务费。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年 6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	26,043,140.85	174,610.83	147,186,535.75	1,857,955.24

注1：本报告期，基金托管人建设银行股份有限公司保管的银行存款按银行间同业存款利率计息

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

#### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注	

601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	4,010	52,049.80	52,049.80	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项停牌	12.44	-	-	1,192,206	14,352,129.12	14,831,042.64	-
300351	永贵电器	2016年6月29日	重大事项停牌	33.93	-	-	150,000	5,266,928.00	5,089,500.00	-
601611	中国核建	2016年6月30日	重大事项停牌	20.92	-	-	10,084	34,991.48	210,957.28	-
300323	华灿光电	2016年4月18日	重大事项停牌	8.99	-	-	14,017	105,333.54	126,012.83	-

注：1、本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本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建设银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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发行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，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有的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、结算备付金和债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	26,043,140.85	-	-	-	-	-	26,043,140.85
结算备付金	6,493,572.27	-	-	-	-	-	6,493,572.27
存出保证金	336,462.81	-	-	-	-	2,417,360.00	2,753,822.81
交易性金融资产	20,000,000.00	-	-	-	-	406,607,518.37	426,607,518.37
应收证券清算款	-	-	-	-	-	32,798,609.72	32,798,609.72
应收利息	-	-	-	-	-	549,901.80	549,901.80
应收申购款	-	-	-	-	-	15,542.08	15,542.08
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	52,873,175.93	-	-	-	-	442,388,931.97	495,262,107.90
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	646,959.44	646,959.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	603,899.33	603,899.33
应付托管费	-	-	-	-	-	100,649.89	100,649.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	921,658.51	921,658.51
其他负债	-	-	-	-	-	200,467.81	200,467.81
负债总计	-	-	-	-	-	2,473,634.98	2,473,634.98
利率敏感度缺口	52,873,175.93	-	-	-	-	-439,915,296.99	492,788,472.92
上年度末 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	93,712,933.86	-	-	-	-	-	93,712,933.86
结算备付金	11,467,048.11	-	-	-	-	-	11,467,048.11
存出保证金	788,912.12	-	-	-	-	-	788,912.12
交易性金融资产	-	-	30,069,000.00	-	-	523,077,177.66	553,146,177.66
应收利息	-	-	-	-	-	401,669.04	401,669.04
应收申购款	-	-	-	-	-	450,239.99	450,239.99
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	105,968,894.09	-	30,069,000.00	-	-	523,929,086.69	659,966,980.78
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,230,532.00	2,230,532.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	433,999.04	433,999.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	838,203.21	838,203.21
应付托管费	-	-	-	-	-	139,700.52	139,700.52
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,753,569.79	4,753,569.79
其他负债	-	-	-	-	-	370,803.31	370,803.31
负债总计	-	-	-	-	-	8,766,807.87	8,766,807.87
利率敏感度缺口	105,968,894.09	-	30,069,000.00	-	-	-515,162,278.82	651,200,172.91

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.06%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

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 80-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	406,607,518.37	82.51	523,077,177.66	80.33
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	406,607,518.37	82.51	523,077,177.66	80.33

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上涨 5%		25,968,872.00
沪深 300 指数下跌 5%		-25,968,872.00	-34,120,000.00



## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	406,607,518.37	82.10
	其中：股票	406,607,518.37	82.10
2	固定收益投资	20,000,000.00	4.04
	其中：债券	20,000,000.00	4.04
	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	32,536,713.12	6.57
7	其他各项资产	36,117,876.41	7.29
8	合计	495,262,107.90	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	7,770,861.36	1.58
B	采矿业	69,024,252.88	14.01
C	制造业	127,643,877.67	25.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	210,957.28	0.04
F	批发和零售业	33,744,099.30	6.85
G	交通运输、仓储和邮政业	28,667,250.14	5.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,025,585.20	2.44
J	金融业	111,302,911.65	22.59
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	136,807.85	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	12,128,915.04	2.46
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	3,952,000.00	0.80
S	综合	-	-
	合计	406,607,518.37	82.51

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	6,799,952	30,191,786.88	6.13
2	000858	五粮液	799,950	26,022,373.50	5.28
3	600028	中国石化	5,499,988	25,959,943.36	5.27
4	601288	农业银行	8,000,000	25,600,000.00	5.19
5	002304	洋河股份	330,767	23,788,762.64	4.83
6	603167	渤海轮渡	1,869,124	18,597,783.80	3.77
7	002465	海格通信	1,192,206	14,831,042.64	3.01
8	601377	兴业证券	2,000,000	14,780,000.00	3.00
9	600894	广日股份	1,005,305	13,400,715.65	2.72
10	600016	民生银行	1,500,000	13,395,000.00	2.72
11	000078	海王生物	1,750,000	13,002,500.00	2.64
12	000050	深天马A	550,000	11,478,500.00	2.33
13	002128	露天煤业	1,500,000	11,265,000.00	2.29
14	601001	大同煤业	2,000,000	10,740,000.00	2.18
15	600775	南京熊猫	699,872	10,463,086.40	2.12
16	000776	广发证券	500,000	8,380,000.00	1.70
17	000983	西山煤电	999,952	8,149,608.80	1.65
18	300070	碧水源	545,008	8,109,719.04	1.65
19	601898	中煤能源	1,499,942	7,739,700.72	1.57
20	002714	牧原股份	150,000	7,579,500.00	1.54
21	600153	建发股份	600,000	7,200,000.00	1.46
22	600998	九州通	399,914	7,002,494.14	1.42
23	002736	国信证券	402,751	6,947,454.75	1.41
24	600109	国金证券	500,000	6,740,000.00	1.37

25	002376	新北洋	500,000	6,680,000.00	1.36
26	300203	聚光科技	250,000	6,600,000.00	1.34
27	000028	国药一致	98,815	6,432,856.50	1.31
28	600350	山东高速	1,042,809	5,526,887.70	1.12
29	600000	浦发银行	338,386	5,268,670.02	1.07
30	601225	陕西煤业	1,000,000	5,170,000.00	1.05
31	300351	永贵电器	150,000	5,089,500.00	1.03
32	300059	东方财富	219,824	4,880,092.80	0.99
33	002535	林州重机	599,990	4,847,919.20	0.98
34	002320	海峡股份	291,752	4,542,578.64	0.92
35	300187	永清环保	299,940	4,019,196.00	0.82
36	000793	华闻传媒	400,000	3,952,000.00	0.80
37	300383	光环新网	100,000	3,790,000.00	0.77
38	002230	科大讯飞	100,000	3,285,000.00	0.67
39	002371	七星电子	30,000	1,254,600.00	0.25
40	600782	新钢股份	153,375	817,488.75	0.17
41	600199	金种子酒	37,600	417,360.00	0.08
42	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.05
43	002036	联创电子	10,000	234,100.00	0.05
44	601611	中国核建	10,084	210,957.28	0.04
45	300511	雪榕生物	2,872	191,361.36	0.04
46	300512	中亚股份	1,873	187,150.16	0.04
47	601127	小康股份	6,512	155,441.44	0.03
48	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.03
49	603339	四方冷链	2,793	151,995.06	0.03
50	300323	华灿光电	14,017	126,012.83	0.03
51	603779	威龙股份	2,809	117,865.64	0.02
52	603959	百利科技	2,815	116,681.75	0.02
53	603101	汇嘉时代	3,563	106,248.66	0.02
54	300510	金冠电气	1,365	92,219.40	0.02
55	002798	帝王洁具	1,056	91,555.20	0.02
56	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.02
57	603029	天鹅股份	1,618	72,211.34	0.01
58	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.01
59	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
60	601966	玲珑轮胎	4,010	52,049.80	0.01
61	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
62	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
63	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00

64	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
65	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
66	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	82,147,043.79	12.61
2	601288	农业银行	72,023,401.58	11.06
3	600028	中国石化	68,658,745.56	10.54
4	300059	东方财富	40,359,418.80	6.20
5	002304	洋河股份	33,489,848.05	5.14
6	600690	青岛海尔	28,043,915.00	4.31
7	601788	光大证券	27,085,261.00	4.16
8	000858	五粮液	26,703,655.01	4.10
9	601111	中国国航	24,501,605.25	3.76
10	002128	露天煤业	22,361,815.00	3.43
11	600839	四川长虹	18,524,379.00	2.84
12	600109	国金证券	17,083,015.70	2.62
13	600029	南方航空	16,059,602.00	2.47
14	601898	中煤能源	15,350,368.56	2.36
15	601377	兴业证券	14,858,906.00	2.28
16	601169	北京银行	14,785,438.57	2.27
17	600999	招商证券	14,723,405.00	2.26
18	600016	民生银行	14,122,500.00	2.17
19	000078	海王生物	13,928,739.00	2.14
20	002456	欧菲光	11,800,754.48	1.81

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	601398	工商银行	52,398,000.00	8.05
2	601288	农业银行	47,156,247.46	7.24
3	600028	中国石化	41,409,038.88	6.36
4	601999	出版传媒	32,671,577.15	5.02
5	300059	东方财富	30,582,971.20	4.70
6	600012	皖通高速	30,208,752.26	4.64
7	600690	青岛海尔	29,630,240.25	4.55
8	000498	山东路桥	27,407,419.68	4.21
9	601788	光大证券	25,025,502.90	3.84
10	000417	合肥百货	22,611,778.60	3.47
11	002111	威海广泰	22,044,963.29	3.39
12	601111	中国国航	21,624,348.30	3.32
13	600783	鲁信创投	20,387,354.71	3.13
14	600839	四川长虹	18,939,343.00	2.91
15	603766	隆鑫通用	18,299,768.89	2.81
16	001696	宗申动力	17,473,401.00	2.68
17	600350	山东高速	16,516,228.38	2.54
18	601169	北京银行	15,256,766.14	2.34
19	600999	招商证券	13,735,551.30	2.11
20	002500	山西证券	13,701,075.72	2.10
21	600029	南方航空	13,329,268.41	2.05

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	951,173,975.34
卖出股票收入（成交）总额	941,074,943.23

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,000,000.00	4.06
	其中：政策性金融债	20,000,000.00	4.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,000,000.00	4.06

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150416	15 农发 16	200,000	20,000,000.00	4.06

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1607	中证 500 股指期货 1607	-10	-12,086,800.00	-373,360.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-373,360.00
股指期货投资本期收益（元）					-325,680.00

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

出于流动性等因素考虑，报告期内积极优选基金利用股指期货进行了套保操作。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除兴业证券（601377）外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

兴业证券股份有限公司 2016 年 6 月 12 日发布关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告。因公司涉嫌未按规定履行法定职责，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，公司被中国证监会立案调查。

兴业证券股份有限公司 2016 年 6 月 17 日收到上海证券交易所上市公司监管一部《关于对兴业证券股份有限公司被立案调查相关事项的问询函》。根据《证券法》、《证券发行上市保荐业务管理办法》等相关法规，立案调查期间的，中国证监会暂不受理兴业证券股份有限公司作为保荐机构的推荐，暂不受理相关保荐代表人具体负责的推荐，暂不受理兴业证券股份有限公司作为独立财务顾问出具的文件。预计兴业证券股份有限公司投资银行业务在立案调查期间将受到影响，投资银行业务当期收入可能减少；兴业证券股份有限公司正积极与监管机构及相关部门协商拟订投资者先行赔付方案，目前方案尚在研究中。

此事件将对公司当期经营业绩将产生一定影响，但对公司整体影响不大，股价已经充分反应了潜在风险。我们认为公司当前估值相对便宜，公司行业地位稳固，所以进行了配置。

### 7.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,753,822.81

2	应收证券清算款	32,798,609.72
3	应收股利	-
4	应收利息	549,901.80
5	应收申购款	15,542.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,117,876.41

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002465	海格通信	14,831,042.64	3.01	重大事项停牌

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
12,010	69,139.17	992,203.49	0.12%	829,369,226.63	99.88%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

该只基金的基金经理未持有本基金。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 3 月 26 日）基金份额总额	1,706,941,661.53
本报告期期初基金份额总额	876,264,545.92
本报告期基金总申购份额	29,568,814.96
减：本报告期基金总赎回份额	75,471,930.76
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	830,361,430.12

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	2	788,678,811.94	41.71%	565,326.65	35.63%	-
华创证券	1	530,666,973.30	28.06%	494,207.14	31.15%	-
爱建证券	1	217,266,130.86	11.49%	202,338.72	12.75%	-
方正证券	1	208,037,055.99	11.00%	189,583.86	11.95%	-
万联证券	2	146,327,281.87	7.74%	135,153.00	8.52%	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	2	-	-	-	-	-

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-

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。

3、本报告期内，本基金新增交易单元为西南证券、新时代证券、万联证券、南京证券、财达证券。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金更新的招募说明书 2016	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 5 月 8 日

	年第 1 号正文		
2	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金更新的招募说明书 2016 年第 1 号摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 5 月 8 日
3	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 20 日
4	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金 2015 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 29 日
5	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 29 日
6	华泰柏瑞积极优选 2015 年第四季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 21 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

### 11.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费）021-3878 4638 公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司  
2016 年 8 月 27 日