

华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 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 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

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 主要财务指标和基金净值表现	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 其他指标.....	错误!未定义书签。
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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.....	10
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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	33
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.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40

7.12 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
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.....	42
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.....	42
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	42
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	错误!未定义书签。
§12 备查文件目录.....	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞量化绝对收益混合
基金主代码	001073
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 29 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	216, 236, 176. 88 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，灵活应用多种策略对冲投资组合的市场风险，谋求投资组合资产的长期增值。
投资策略	在力求有效控制投资风险的前提下，通过全市场选股构建预期收益高于市场回报的投资组合，同时利用股指期货等多种策略对冲投资组合的市场风险，以求获得不依赖市场整体走向的比较稳定的长期资产增值。
业绩比较基准	三个月银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用量化对冲策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。

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	tianqingl.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 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

	层	
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	http://www.huatai-pb.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 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	401,741.52
本期利润	482,754.07
加权平均基金份额本期利润	0.0043
本期加权平均净值利润率	0.42%
本期基金份额净值增长率	0.23%
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	1,933,066.25
期末可供分配基金份额利润	0.0089
期末基金资产净值	218,169,243.13
期末基金份额净值	1.0089
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	0.89%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

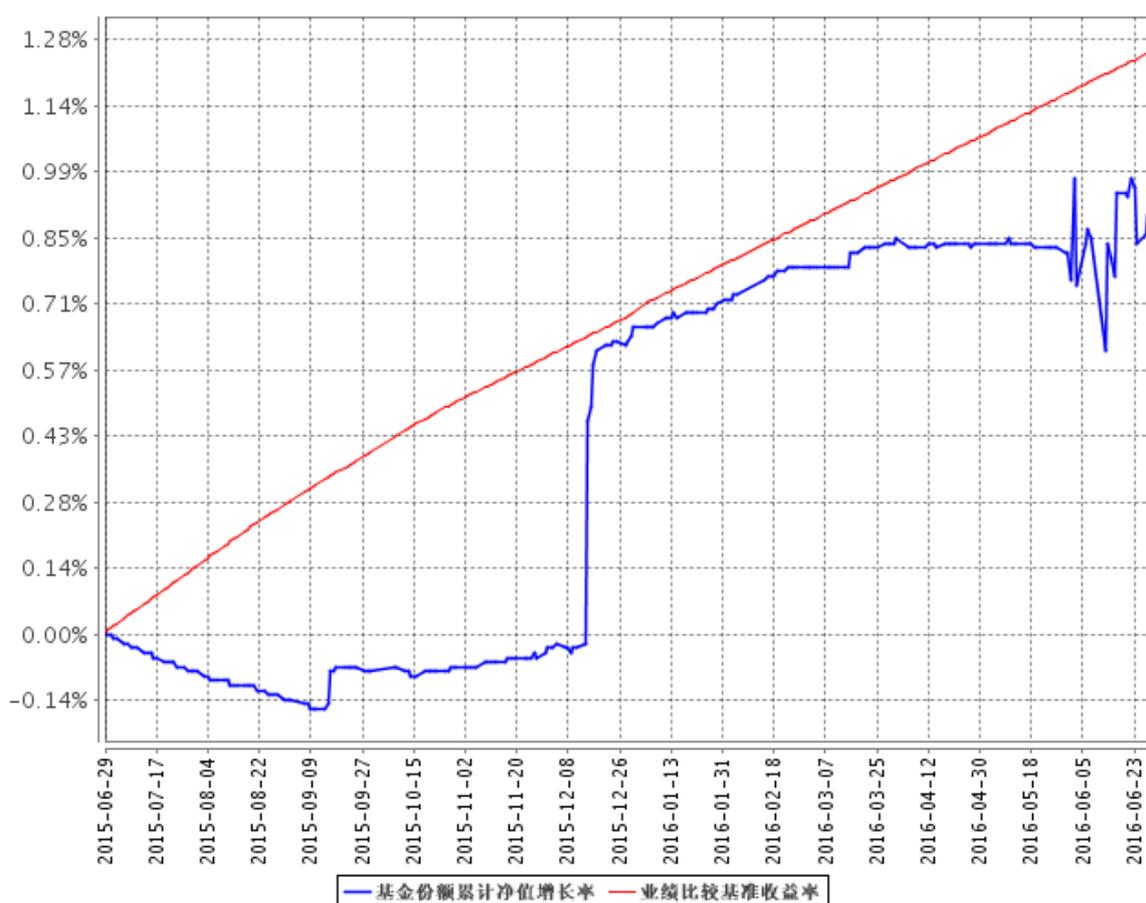
3.2 基金净值表现

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	0.07%	0.12%	0.09%	0.00%	-0.02%	0.12%
过去三个月	0.05%	0.07%	0.28%	0.00%	-0.23%	0.07%
过去六个月	0.23%	0.05%	0.56%	0.00%	-0.33%	0.05%
过去一年	0.89%	0.05%	1.24%	0.00%	-0.35%	0.05%
自基金合同生效起至今	0.89%	0.05%	1.25%	0.00%	-0.36%	0.05%

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：注： 1、图示日期为 2015 年 06 月 29 日至 2016 年 6 月 30 日。

2、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十二部分（二）投资范围中规定的各项比例：本基金股票资产的投资比

例占基金资产的 0-95%；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%。

§ 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		
田汉卿	副总经理、本基金的基金经理	2015 年 6 月 29 日	-	13	副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI）担任投资经理，2012 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013 年 8 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 10 月起任公司副总经理，2014 年 12 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016 年 5 月起任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的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA 毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式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《证券投资基金管理人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

本基金采用 alpha 套利策略，通过量化选股模型构建具有持续稳定收益的股票组合，同时利用对应的股指期货合约进行对冲，实现稳定的绝对收益。本基金股票组合跟踪沪深 300 指数，利用沪深 300 股指期货套保功能对冲市场风险；当前我们投资建仓的最大障碍是股指期货贴水太深。尽管股灾之后股指期货的监管规则有一些变化，但这方面对我们投资策略的影响是可控的，投资效率尽管要打一定的折扣，但基本仍可达到绝大多数投资人对绝对收益的预期。

一方面，我们会密切关注基差的波动情况，一旦基差回复到合适点点位，我们会按照既定的策略建仓；另一方面，我们也在积极研究负基差状态下的动态对冲策略，降低对冲成本。

今年上半年中前五个月由于贴水程度很深，我们选择了空仓，操作上以现金管理为主，以安全性和流动性为首要考虑因素，主要投资于货币基金和交易所质押式国债逆回购，保持较高流动性以备市场条件改善时可以立即建仓；6 月初，市场情绪有所恢复，股指期货贴水有所收窄，考虑指数分红的影响和组合预期超额收益水平，我们认为是一个比较好的建仓时点，因此我们进行了开仓操作，当前仓位仍比较低，但我们在积极寻找合适时机提高仓位为组合争取收益。

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 1.0089 元，本报告期份额净值增长率为 0.23%，同期业绩比较基准增长率为 0.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A 股市场在经历了 2015 年的大幅波动之后，2016 年开年又进一步大幅下挫。在经历了 5 月份和 6 月初的进一步调整和风险释放之后，我们认为下半年市场的下行空间不会太大，除非发生金融危机。

尽管今年境外境内的不确定性因素很多，国内经济基本面较弱，也面临去产能调结构的压力，当前股市投资者的信心仍比较脆弱，但我们认为 A 股市场下半年应该还是有一定的机会。根本的驱动因素还是大量资金依然缺少合适的投资方向，而 A 股市场在风险释放之后依然会是一个不错的选择。另外，当前时点中小创的估值仍然相对偏高，尽管有去产能的因素，我们仍然认为 2016 年中大盘的机会可能好于小盘。

如果股票现货市场有一定的起色，股指期货的贴水收敛的可能性也会增大。一方面，我们将坚持在股票投资方面控制风险追求超额收益，并通过股指期货对冲市场风险，实现绝对收益。另一方面，我们也将密切关注国内股指期货市场的变化，一旦贴水收敛到一定程度或消失，我们会积极增加对冲组合仓位。

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

本报告期内基金未实施收益分配。

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

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：华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,064,630.03	3,185,066.46
结算备付金		79,528,395.17	109,884,337.92
存出保证金		5,661,096.00	755.03
交易性金融资产	6.4.7.2	39,000,937.90	9,993,000.00
其中：股票投资		29,001,937.90	-
基金投资		-	-
债券投资		9,999,000.00	9,993,000.00
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	85,000,000.00	-

应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	269,014.93	102,323.09
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		218,524,074.03	123,165,482.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		184,871.36	335,988.41
应付托管费		30,811.88	55,998.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	34,723.34	-
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	104,424.32	240,000.00
负债合计		354,830.90	631,986.47
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	216,236,176.88	121,729,761.48
未分配利润	6.4.7.10	1,933,066.25	803,734.55
所有者权益合计		218,169,243.13	122,533,496.03
负债和所有者权益总计		218,524,074.03	123,165,482.50

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0089 元，基金份额总额 216,236,176.88 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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6月29日(基 金合同生效日)至 2015年6月30日
一、收入		1,635,723.41	19,878.10
1.利息收入		1,205,633.19	19,878.10

其中：存款利息收入	6.4.7.11	410,171.31	19,878.10
债券利息收入		107,112.33	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		688,349.55	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		309,321.31	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,616.60	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	-	-
股利收益	6.4.7.16	314,937.91	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	81,012.55	-
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	39,756.36	-
减：二、费用		1,152,969.34	26,837.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	852,069.64	20,423.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	142,011.65	3,403.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	43,137.86	-
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	115,750.19	3,010.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		482,754.07	-6,959.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		482,754.07	-6,959.53

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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）	121,729,761.48	803,734.55	122,533,496.03

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	482,754.07	482,754.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	94,506,415.40	646,577.63	95,152,993.03
其中：1.基金申购款	139,222,519.01	992,534.22	140,215,053.23
2.基金赎回款	-44,716,103.61	-345,956.59	-45,062,060.20
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）	216,236,176.88	1,933,066.25	218,169,243.13
项目	上年度可比期间 2015年6月29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）	496,952,339.78	-	496,952,339.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,959.53	-6,959.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）		-	
其中：1.基金申购款		-	
2.基金赎回款	-	-	-
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）	496,952,339.78	-6,959.53	496,945,380.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 韩勇

基金管理人负责人

 房伟力

主管会计工作负责人

 赵景云

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金(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]42号《关于准予华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》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 496,894,780.21 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 801 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 496,952,339.78 份基金份额,其中认购资金利息折合 57,559.57 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。

本基金为发起式基金。发起资金认购金额均为华泰柏瑞基金管理有限公司使用自有资金认购本基金基金份额而投入的人民币 10,002,400 元,折合为 10,002,400 份基金份额,承诺持有期限为 3 年。

根据《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金每三个月开放一次,每次开放期不超过 5 个工作日,每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份后续每三个日历月中最后一个日历月,每个开放期的首日为当月沪深 300 股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日(不含该日)之间的期间,之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和最新公布的《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》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）、股指期货、权证、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、银行存款等固定收益类资产和现金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。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的比例范围为 80%-120%，其中，权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为：三个月银行定期存款税后收益率。

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 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》、《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 1 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 2016 年 1 月 1 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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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。

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	9,064,630.03
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,064,630.03

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	29,223,265.35	29,001,937.90	-221,327.45
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,990,000.00	9,999,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	9,990,000.00	9,999,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	39,213,265.35	39,000,937.90	-212,327.45

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	-28,601,820	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	

合计	-28,601,820	-	-
----	-------------	---	---

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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	85,000,000.00	-
合计	85,000,000.00	-

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	1,797.34
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	43,894.41
应收债券利息	192,328.77
应收买入返售证券利息	30,994.41
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	269,014.93

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	34,723.34
银行间市场应付交易费用	-
合计	34,723.34

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	-
预提费用	104,424.32
合计	104,424.32

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	121,729,761.48	121,729,761.48
本期申购	139,222,519.01	139,222,519.01
本期赎回(以“-”号填列)	-44,716,103.61	-44,716,103.61
- 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	216,236,176.88	216,236,176.88

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	793,249.00	10,485.55	803,734.55
本期利润	401,741.52	81,012.55	482,754.07
本期基金份额交易产生的变动数	818,917.82	-172,340.19	646,577.63
其中：基金申购款	1,175,080.56	-182,546.34	992,534.22

基金赎回款	-356,162.74	10,206.15	-345,956.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,013,908.34	-80,842.09	1,933,066.25

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	51,636.41
定期存款利息收入	247,500.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	108,232.72
其他	2,802.18
合计	410,171.31

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	4,159,192.66
减：卖出股票成本总额	4,164,809.26
买卖股票差价收入	-5,616.60

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

注：无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

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：无。

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：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

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：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

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	314,937.91
基金投资产生的股利收益	-
合计	314,937.91

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	-215,327.45

——股票投资	-221,327.45
——债券投资	6,000.00
——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	296,340.00
合计	81,012.55

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	38,840.87
转换费收入	915.49
合计	39,756.36

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 基金之间的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

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	43,137.86
银行间市场交易费用	-
合计	43,137.86

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	29,835.26
信息披露费	74,589.06

其他费用-场内交易费用	2,325.87
银行间账户服务费	9,000.00
合计	115,750.19

6.4.7.21 分部报告

注：无。

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，本基金并无须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
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：1、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

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 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：无。

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6月29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	852,069.64	20,423.05
其中：支付销售机构的客户维护费	625,588.20	-

注：支付基金管理人 华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.50% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

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6月29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	142,011.65	3,403.84

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

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：本基金本报告期与关联方未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

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年6	上年度可比期间 2015年6月29日(基金合同生效
----	------------------------	------------------------------

	月 30 日	日)至 2015 年 6 月 30 日
基金合同生效日 (2015 年 6 月 29 日) 持有的基金份额	10,002,400.00	10,002,400.00
期初持有的基金份额	10,002,400.00	10,002,400.00
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	10,002,400.00	10,002,400.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.6257%	2.0127%

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 6 月 29 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	9,064,630.03	51,636.41	496,952,339.78	19,878.10

注: 本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管, 按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注: 无。

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

注: 本基金报告期末未持有认购新发/增发证券而流通受限证券。

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
600019	宝钢股份	2016年6月27日	临时停牌	4.90	-	-	132,300	696,728.00	648,270.00	-

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

本基金为特殊的混合型基金，通过采用量化对冲策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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。本基金通过构建有效的投资组合，在严格控制风险的前提下，力求获得长期稳定的收益。

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，因而与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。

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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，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约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，因此账面余额既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。

本基金持有及承担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、存出保证金及债券投资等。

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	9,064,630.03	-	-	-	-	-	9,064,630.03
结算备付金	79,528,395.17	-	-	-	-	-	79,528,395.17
存出保证金	-	-	-	-	-	5,661,096.00	5,661,096.00
交易性金融资产	-	-9,999,000.00	-	-	-	-29,001,937.90	39,000,937.90
买入返售金融资产	85,000,000.00	-	-	-	-	-	85,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	269,014.93	269,014.93
资产总计	173,593,025.20	9,999,000.00	-	-	-	-34,932,048.83	218,524,074.03
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	184,871.36	184,871.36
应付托管费	-	-	-	-	-	30,811.88	30,811.88
应付交易费用	-	-	-	-	-	34,723.34	34,723.34
其他负债	-	-	-	-	-	104,424.32	104,424.32
负债总计	-	-	-	-	-	354,830.90	354,830.90
利率敏感度缺口	173,593,025.20	9,999,000.00	-	-	-	-34,577,217.93	218,169,243.13
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	3,185,066.46	-	-	-	-	-	3,185,066.46
结算备付金	109,884,337.92	-	-	-	-	-	109,884,337.92
存出保证金	755.03	-	-	-	-	-	755.03
交易性金融资产	-	-	-9,993,000.00	-	-	-	9,993,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	102,323.09	102,323.09

资产总计	113,070,159.41	-9,993,000.00	-	-	102,323.09	123,165,482.50
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	335,988.41	335,988.41
应付托管费	-	-	-	-	55,998.06	55,998.06
其他负债	-	-	-	-	240,000.00	240,000.00
负债总计	-	-	-	-	631,986.47	631,986.47
利率敏感度缺口	113,070,159.41	-9,993,000.00	-	-	-529,663.38	122,533,496.03

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 4.58%，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的债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围为 80%-120%，其中，权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权

益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。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	29,001,937.90	13.29	-	-
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	29,001,937.90	13.29	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：截至 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资占净值比例为 13.29%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

§ 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	29,001,937.90	13.27
	其中：股票	29,001,937.90	13.27
2	固定收益投资	9,999,000.00	4.58
	其中：债券	9,999,000.00	4.58
	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	85,000,000.00	38.90
	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	88,593,025.20	40.54
7	其他各项资产	5,930,110.93	2.71
8	合计	218,524,074.03	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	-	-
B	采矿业	1,278,421.00	0.59
C	制造业	8,727,832.00	4.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	905,377.00	0.41
E	建筑业	1,505,545.00	0.69
F	批发和零售业	813,426.00	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	1,728,537.00	0.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	805,753.00	0.37
J	金融业	9,472,386.90	4.34
K	房地产业	2,063,843.00	0.95
L	租赁和商务服务业	721,300.00	0.33
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	16,000.00	0.01
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	963,517.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	29,001,937.90	13.29

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	600000	浦发银行	72,930	1,135,520.10	0.52
2	601668	中国建筑	159,100	846,412.00	0.39
3	600048	保利地产	91,600	790,508.00	0.36
4	000858	五粮液	24,300	790,479.00	0.36
5	601318	中国平安	23,600	756,144.00	0.35
6	601009	南京银行	74,120	695,986.80	0.32
7	600109	国金证券	51,400	692,872.00	0.32
8	600705	中航资本	115,800	680,904.00	0.31
9	600060	海信电器	38,500	680,680.00	0.31
10	601166	兴业银行	44,500	678,180.00	0.31
11	000413	东旭光电	78,600	675,174.00	0.31
12	300315	掌趣科技	63,700	668,213.00	0.31
13	600688	上海石化	107,700	656,970.00	0.30
14	601328	交通银行	116,600	656,458.00	0.30
15	600816	安信信托	38,600	651,182.00	0.30
16	000338	潍柴动力	83,200	649,792.00	0.30
17	600019	宝钢股份	132,300	648,270.00	0.30
18	000540	中天城投	102,400	637,952.00	0.29
19	600741	华域汽车	45,200	633,252.00	0.29
20	601998	中信银行	111,600	632,772.00	0.29
21	600415	小商品城	99,800	616,764.00	0.28
22	600188	兖州煤业	55,900	611,546.00	0.28
23	600027	华电国际	121,900	603,405.00	0.28
24	000063	中兴通讯	39,000	559,260.00	0.26
25	000778	新兴铸管	115,100	534,064.00	0.24
26	600177	雅戈尔	38,300	528,157.00	0.24
27	000895	双汇发展	24,800	517,824.00	0.24

28	600068	葛洲坝	83,400	485,388.00	0.22
29	601333	广深铁路	115,800	452,778.00	0.21
30	601111	中国国航	66,200	447,512.00	0.21
31	600028	中国石化	92,900	438,488.00	0.20
32	300144	宋城演艺	17,500	435,925.00	0.20
33	600999	招商证券	25,500	420,750.00	0.19
34	600030	中信证券	25,000	405,750.00	0.19
35	000001	平安银行	44,400	386,280.00	0.18
36	002142	宁波银行	25,900	382,802.00	0.18
37	000166	申万宏源	45,200	380,132.00	0.17
38	600221	海南航空	117,700	373,109.00	0.17
39	601872	招商轮船	79,300	371,124.00	0.17
40	000425	徐工机械	119,400	365,364.00	0.17
41	000793	华闻传媒	34,400	339,872.00	0.16
42	601607	上海医药	18,200	328,510.00	0.15
43	600585	海螺水泥	22,100	321,334.00	0.15
44	600104	上汽集团	15,700	318,553.00	0.15
45	600886	国投电力	43,800	289,080.00	0.13
46	000776	广发证券	15,200	254,752.00	0.12
47	600352	浙江龙盛	28,600	246,532.00	0.11
48	000333	美的集团	9,800	232,456.00	0.11
49	601211	国泰君安	12,000	213,480.00	0.10
50	601933	永辉超市	50,200	207,326.00	0.10
51	601800	中国交建	16,500	173,745.00	0.08
52	601898	中煤能源	30,900	159,444.00	0.07
53	000963	华东医药	2,300	155,020.00	0.07
54	600196	复星医药	7,700	146,454.00	0.07
55	601633	长城汽车	17,100	144,324.00	0.07
56	300085	银之杰	4,600	137,540.00	0.06
57	601377	兴业证券	18,600	137,454.00	0.06
58	600015	华夏银行	13,600	134,504.00	0.06
59	000156	华数传媒	6,700	124,285.00	0.06
60	600998	九州通	7,000	122,570.00	0.06
61	000825	太钢不锈	35,600	112,496.00	0.05
62	600038	中直股份	2,700	111,996.00	0.05
63	002007	华兰生物	3,400	106,760.00	0.05
64	600875	东方电气	10,800	106,056.00	0.05
65	002183	怡亚通	7,300	104,536.00	0.05
66	000999	华润三九	4,000	96,880.00	0.04

67	600029	南方航空	11,900	84,014.00	0.04
68	600016	民生银行	8,200	73,226.00	0.03
69	601088	中国神华	4,900	68,943.00	0.03
70	002236	大华股份	4,700	61,570.00	0.03
71	600340	华夏幸福	2,300	56,074.00	0.03
72	600373	中文传媒	2,500	51,875.00	0.02
73	600376	首开股份	4,600	51,152.00	0.02
74	601601	中国太保	1,400	37,856.00	0.02
75	000783	长江证券	2,900	33,640.00	0.02
76	600036	招商银行	1,100	19,250.00	0.01
77	000069	华侨城 A	2,500	16,000.00	0.01
78	600795	国电电力	4,400	12,892.00	0.01
79	601628	中国人寿	600	12,492.00	0.01
80	300251	光线传媒	1,000	11,560.00	0.01
81	002008	大族激光	300	6,852.00	0.00
82	600690	青岛海尔	500	4,440.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600000	浦发银行	1,211,252.00	0.99
2	601668	中国建筑	868,684.00	0.71
3	601318	中国平安	810,068.00	0.66
4	000858	五粮液	782,445.00	0.64
5	600048	保利地产	774,238.00	0.63
6	601009	南京银行	738,698.00	0.60
7	601166	兴业银行	735,954.00	0.60
8	600019	宝钢股份	696,728.00	0.57
9	300315	掌趣科技	678,327.00	0.55
10	601328	交通银行	678,177.00	0.55
11	600705	中航资本	676,979.00	0.55
12	600109	国金证券	673,273.00	0.55
13	600741	华域汽车	665,724.48	0.54
14	000338	潍柴动力	659,598.00	0.54

15	600688	上海石化	659,332.00	0.54
16	000540	中天城投	656,895.00	0.54
17	600415	小商品城	647,344.00	0.53
18	601998	中信银行	645,852.00	0.53
19	600027	华电国际	641,124.89	0.52
20	000413	东旭光电	637,094.00	0.52

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	600350	山东高速	583,093.00	0.48
2	000400	许继电气	436,462.00	0.36
3	601088	中国神华	389,846.00	0.32
4	601555	东吴证券	353,964.00	0.29
5	601633	长城汽车	313,495.38	0.26
6	000333	美的集团	166,618.38	0.14
7	600340	华夏幸福	153,797.02	0.13
8	600029	南方航空	145,753.00	0.12
9	000539	粤电力 A	130,181.27	0.11
10	600583	海油工程	129,420.50	0.11
11	000568	泸州老窖	124,069.00	0.10
12	000999	华润三九	113,493.00	0.09
13	002142	宁波银行	104,866.00	0.09
14	000166	申万宏源	92,135.00	0.08
15	000895	双汇发展	83,693.00	0.07
16	000001	平安银行	76,029.00	0.06
17	300144	宋城演艺	74,936.00	0.06
18	601111	中国国航	72,352.11	0.06
19	601398	工商银行	69,664.00	0.06
20	000069	华侨城 A	66,473.00	0.05

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	33,388,074.61
卖出股票收入（成交）总额	4,159,192.66

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	9,999,000.00	4.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	9,999,000.00	4.58

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	019518	15 国债 18	100,000	9,999,000.00	4.58

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
----	----	----------	---------	-----------	------

IF1609	沪深 300 股指期货 1609	-31	-28,305,480.00	296,340.00	-
公允价值变动总额合计（元）					296,340.00
股指期货投资本期收益（元）					0.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采用 alpha 套利策略，通过量化选股模型构建具有持续稳定收益的股票组合，同时利用对应的股指期货合约进行对冲，实现稳定的绝对收益。本基金股票组合跟踪沪深 300 指数，利用沪深 300 股指期货套保功能对冲市场风险；当前我们投资建仓的最大障碍是股指期货贴水太深。尽管股灾之后股指期货的监管规则有一些变化，但这方面对我们投资策略的影响是可控的，投资效率尽管要打一定的折扣，但基本仍可达到绝大多数投资人对绝对收益的预期。

如果股票现货市场有一定的起色，股指期货的贴水收敛的可能性也会增大。一方面，我们将坚持在股票投资方面控制风险追求超额收益，并通过股指期货对冲市场风险，实现绝对收益。另一方面，我们也将密切关注国内股指期货市场的变化，一旦贴水收敛到一定程度或消失，我们会积极增加对冲组合仓位。

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中航资本（600705）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。

中航资本 2015 年 7 月 29 日发布《关于全资子公司中航投资控股有限公司收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》。公司全资子公司中航投资控股有限公司因涉嫌违规减持中航黑豹股份有限公司股票，被中国证监会立案调查。

中航资本全资子公司中航投资于 2016 年 5 月 5 日收到了《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（〔2016〕40 号）。中国证监会决定责令中航投资改正，在收到《行政处罚决定书》之日起 3 日内对超比例减持情况进行报告和公告，并就超比例减持行为公开致歉；对中航投资超比例减持未披露及限制期内减持行为，对中航投资予以警告；对中航投资超比例减持未披露行为处以 40 万元罚款，对限制期内减持行为处以 180 万元罚款，合计处以 220 万元罚款。

此事件对公司整体影响不大，股价已经充分反应。我们量化选股模型认为公司的成长性和估值在非银金融股中都是较好的，所以进行了配置。基金持仓会随着市场变化而变化。

7.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,661,096.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	269,014.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,930,110.93

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,541	140,321.98	149,015,544.55	68.91%	67,220,632.33	31.09%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

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：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额占 基金总份 额比例 (%)	发起份额总 数	发起份额占 基金总份 额比例 (%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资 金	10,002,400.00	4.63	10,002,400.00	4.63	3
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,400.00	4.63	10,002,400.00	4.63	3

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月29日）基金份额总额	496,952,339.78
本报告期期初基金份额总额	121,729,761.48
本报告期基金总申购份额	139,222,519.01
减：本报告期基金总赎回份额	44,716,103.61
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	216,236,176.88

§ 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	
万联证券	2	34,665,690.87	92.33%	32,063.80	92.34%	-
华创证券	1	1,733,269.02	4.62%	1,612.52	4.64%	-
方正证券	1	1,148,307.38	3.06%	1,047.02	3.02%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

宏信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

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

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，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。
- 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。

10.7.2 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

万联证券	-	-	343,000,000.00	23.44%	-	-
华创证券	-	-	465,000,000.00	31.78%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	338,000,000.00	23.10%	-	-
国信证券	-	-	317,000,000.00	21.67%	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-

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	关于华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购赎回及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月7日
2	华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金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
3	华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金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
4	华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金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
5	关于参加东亚银行（中国）有限	中国证券报、上海证	2016年3月29日

	公司 2016 年第二季度费率优惠活动的公告	券报、证券时报	
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于浙江同花顺基金销售有限公司新增旗下基金代销的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 17 日
7	关于华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金第三个开放期开放赎回及转换转出业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 9 日
8	关于华泰柏瑞绝对收益基金开展赎回（包含转换转出业务）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 9 日
9	华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书摘要 2016 年 1 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 6 日
10	华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书正文 2016 年 1 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 6 日
11	华泰柏瑞量化绝对收益证券投资基金 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 31 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

华泰柏瑞基金管理有限公司
2016 年 8 月 27 日