

# 华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金 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的法律责任。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、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。

本报告中财务资料未经审计。

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

## 1.2 目录

<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.....	7
3.3 其他指标.....	错误!未定义书签。
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
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.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41

7.12 投资组合报告附注.....	41
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
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
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>43</b>
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.....	46
<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>46</b>
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	华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞新利混合	
基金主代码	001247	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 4 月 28 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	852,961,421.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞新利 A	华泰柏瑞新利 C
下属分级基金的交易代码:	001247	002091
报告期末下属分级基金的份额总额	852,961,411.25 份	9.80 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值，前瞻性地把握不同时期股票市场、债券市场和银行间市场的收益率，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为混合型基金，以获取长期稳定收益为目标。当股票市场的整体估值水平严重地偏离了企业实际的盈利状况和预期的成长率，出现明显的价值高估，如果不及时调整将可能给基金份额持有人带来潜在的资本损失时，本基金将进行大类资产配置调整，降低股票资产的比例，同时相应提高债券等其他资产的比例。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+1%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

### 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 弄上海证大五道口广场 1 号 17	北京市西城区复兴门内大街 1 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	基金管理人及基金托管人住所

## 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

基金级别	华泰柏瑞新利 A	华泰柏瑞新利 C
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)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	23,155,445.95	135,275.27
本期利润	-14,560,050.38	-523,901.05
加权平均基金份额本期利润	-0.0080	-0.0149
本期加权平均净值利润率	-0.78%	-1.46%
本期基金份额净值增长率	-0.10%	-0.22%
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	22,595,748.24	0.23
期末可供分配基金份额利润	0.0265	0.0235
期末基金资产净值	878,607,895.64	10.08
期末基金份额净值	1.0301	1.0286
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	3.01%	1.46%

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

华泰柏瑞新利 A

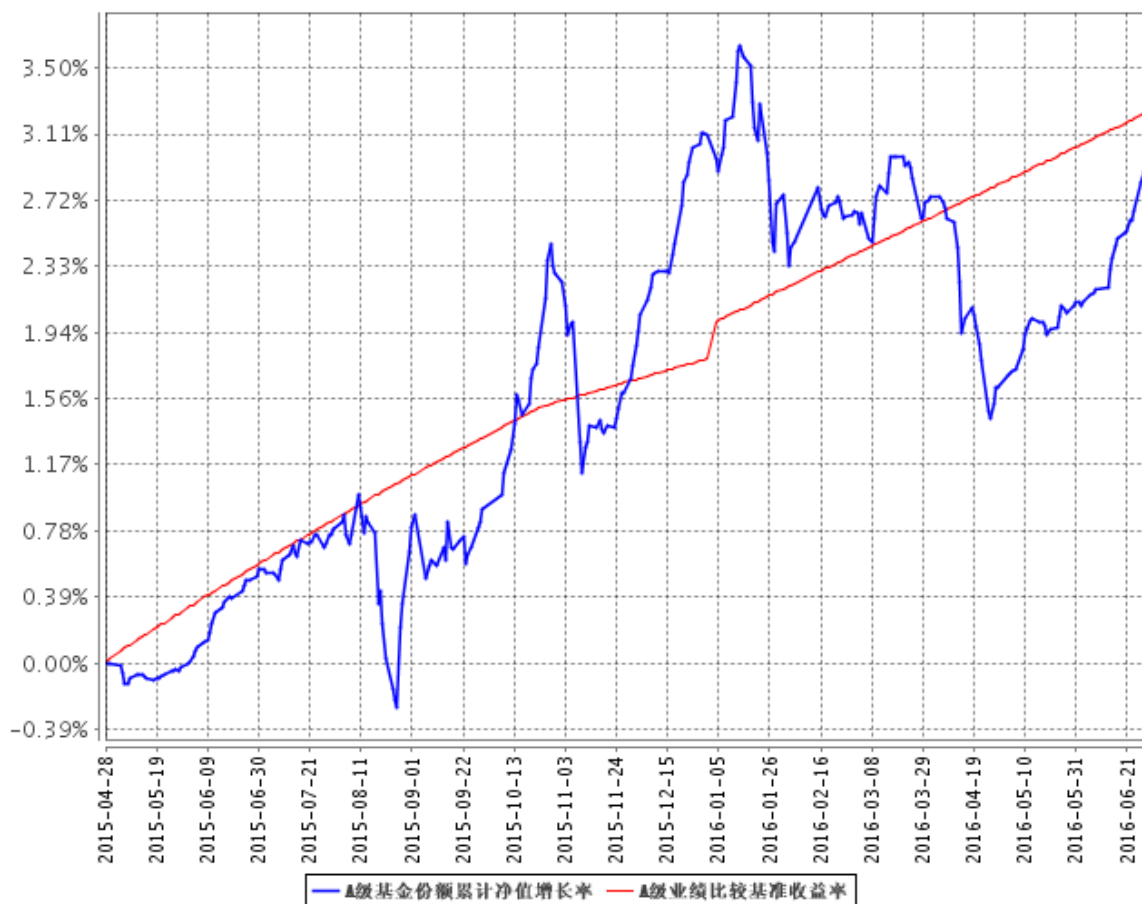
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.87%	0.04%	0.20%	0.01%	0.67%	0.03%
过去三个月	0.28%	0.08%	0.62%	0.01%	-0.34%	0.07%
过去六个月	-0.10%	0.11%	1.24%	0.01%	-1.34%	0.10%
过去一年	2.45%	0.12%	2.64%	0.01%	-0.19%	0.11%
自基金合同生效起至今	3.01%	0.11%	3.25%	0.01%	-0.24%	0.10%

华泰柏瑞新利 C

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	0.80%	0.06%	0.20%	0.01%	0.60%	0.05%
过去三个月	0.23%	0.09%	0.62%	0.01%	-0.39%	0.08%
过去六个月	-0.22%	0.11%	1.24%	0.01%	-1.46%	0.10%
自基金合同生效起至今	1.46%	0.10%	1.54%	0.01%	-0.08%	0.09%

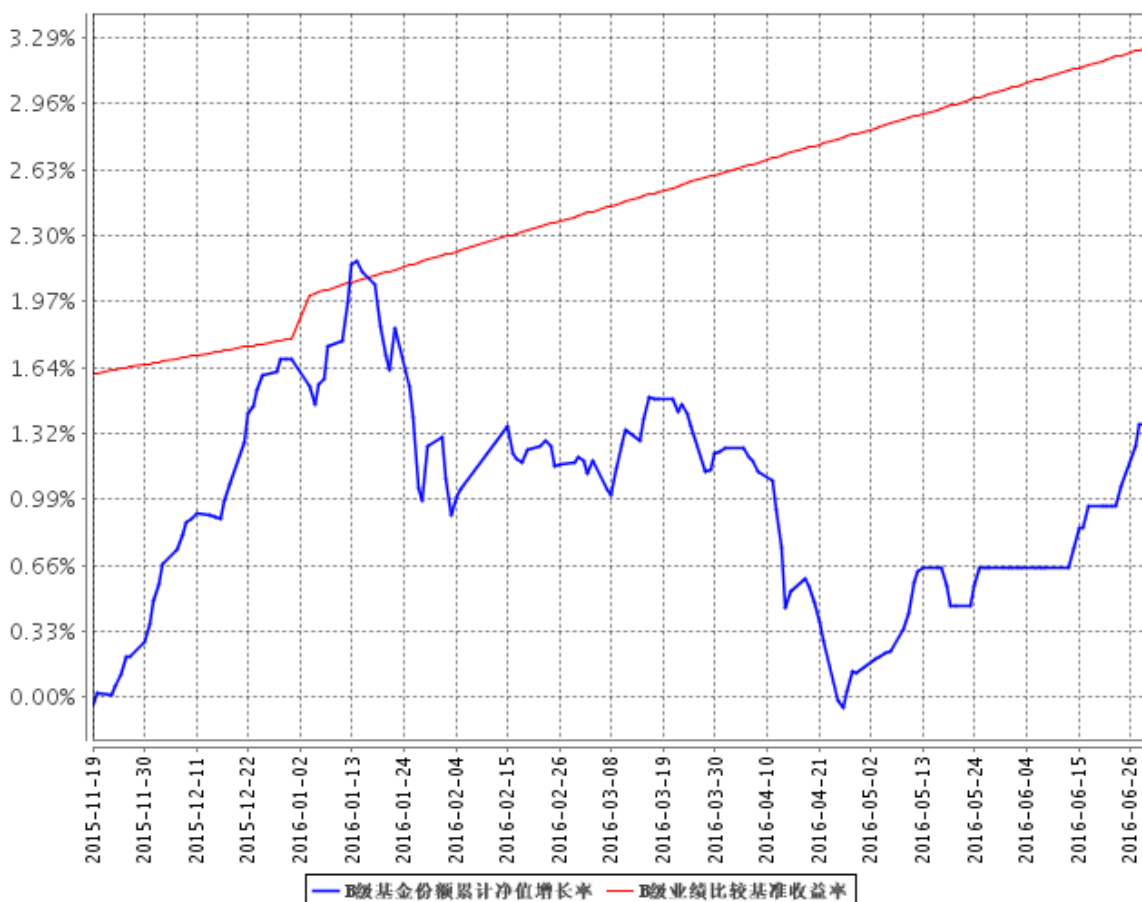
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级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





**B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



注：1. A级图示日期为2015年4月28日至2016年6月30日。C级图示日期为2015年11月19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		
方纬	基金经理	2015 年 4 月 28 日	-	13	2005 年 1 月任上海金信研究所研究员；2005 年 1 月至 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 月起任华泰柏瑞价值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。2016 年 3 月起任华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金的基金经理。
杨景涵	基金经 理	2015 年 4 月 28 日	-	11	中山大学经济学硕士。特许金融分析师 (CFA)，金融风险管理师 (FRM)。2004 年至 2006 年于平安资产管理有限公司，任投资分析师；2006 年至 2009 年 9 月于生命人寿保险公司，历任投连投资经理、投资经理、基金投资部负责人。2009 年 10 月加入本公司，任专户投资部投资经理。2014 年 6 月至 2015 年 4 月任研究部总监助理。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 月起任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

## 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》、《公开募集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《华泰柏瑞新利灵活配置混合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

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部

为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平，只在少数情况下“存在显著的倾向性”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究，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。

#### 4.3.2 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

2016 年上半年，宏观经济增速下行，A 股市场整体估值水平下移，债券市场在货币政策持续保持实质性宽松和财政政策进取的背景下，年初调整以后走出一轮大的牛市。新利基金把握住了债券市场的牛市机会和打新市场的套利机会，稳步的提升基金净值。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类和 C 类份额净值分别为 1.0301 元和 1.0286 元，分别下降-0.1% 和-0.22%，同期本基金的业绩比较基准上涨 1.24%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济增速趋向在较低水平上的稳定，货币政策将保持稳健，边际宽松程度可能会有所下降，地产投资增速将下行，基建投资增速将上行，整体宏观环境看，对于股票市场

和债券市场将保持中性。投资机会主要来自于细分领域的个券选择。预期下半年整体新股的收益率将有所回落，债券收益率也将稳步下行。新利基金将积极优选品种，力争在整体收益率水平下行的环境下，稳步积累投资收益，提升基金净值。

#### 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

基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，收益分配基准日可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞新利灵活配置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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金

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	2,544,204.38	31,208,019.41
结算备付金		17,394,554.89	33,418,851.34
存出保证金		17,614.36	92,766.77
交易性金融资产	6.4.7.2	882,001,298.32	1,740,799,085.28
其中：股票投资		23,863,298.32	28,561,085.28
基金投资		-	-
债券投资		858,138,000.00	1,712,238,000.00
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	-	794,401,511.60
应收证券清算款		14,994,916.99	1,685,902.30
应收利息	6.4.7.5	9,551,905.07	34,080,216.19
应收股利		-	-
应收申购款		-	2,016.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		926,504,494.01	2,635,688,369.86
<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		45,000,000.00	240,000,000.00
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		1,912,256.03	2,554,889.98
应付管理人报酬		580,573.42	3,111,525.37
应付托管费		181,429.18	518,587.56
应付销售服务费		-	1.38
应付交易费用	6.4.7.7	19,831.01	1,024,486.42
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	202,498.65	349,627.10
负债合计		47,896,588.29	247,559,117.81
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	852,961,421.05	2,315,988,809.37
未分配利润	6.4.7.10	25,646,484.67	72,140,442.68
所有者权益合计		878,607,905.72	2,388,129,252.05
负债和所有者权益总计		926,504,494.01	2,635,688,369.86

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额为 852,961,421.05 份，其中 A 类基金份额净值 1.0301 元，A 类基金份额总额 852961411.25 份；C 类基金份额净值 1.0286 元，C 类基金份额总额 9.80 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金

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 4 月 28 日(基金 合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-376,593.98	39,866,863.78
1.利息收入		33,927,482.07	10,443,070.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	979,636.91	4,252,324.94
债券利息收入		32,547,523.08	104,590.16
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		400,322.08	6,086,155.83
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,859,310.07	19,813,711.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,045,064.44	15,976,081.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-4,452,944.57	-
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	-	3,641,880.00
股利收益	6.4.7.16	267,190.20	195,749.62

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-38,374,672.65	8,611,785.36
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	1,211,286.53	998,296.35
<b>减：二、费用</b>		14,707,357.45	12,917,526.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,257,888.17	10,689,713.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,378,657.72	1,781,618.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	34,930.64	-
4. 交易费用	6.4.7.19	214,774.16	343,390.16
5. 利息支出		3,593,259.58	-
其中：卖出回购金融资产支出		3,593,259.58	-
6. 其他费用	6.4.7.20	227,847.18	102,803.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-15,083,951.43	26,949,337.40
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-15,083,951.43	26,949,337.40

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金

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）	2,315,988,809.37	72,140,442.68	2,388,129,252.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-15,083,806.88	-15,083,806.88
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）	-1,463,027,388.32	-	-1,494,437,539.45
其中：1.基金申购款	52,486,560.07	1,501,124.90	53,987,684.97
2.基金赎回款	-1,515,513,948.39		



		-32,911,276.03	-1,548,425,224.42
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)	852,961,421.05	25,646,484.67	878,607,905.72
项目	上年度可比期间 2015年4月28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)	1,652,694,626.58	-	1,652,694,626.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,949,337.40	26,949,337.40
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)	3,511,424,641.46	1,642,609.09	3,513,067,250.55
其中：1.基金申购款	3,740,812,250.89	1,990,143.42	3,742,802,394.31
2.基金赎回款	-229,387,609.43	-347,534.33	-229,735,143.76
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)	5,164,119,268.04	28,591,946.49	5,192,711,214.53

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

华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会

会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]88号《关于核准华泰柏瑞新利灵活配置混合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《华泰柏瑞新利灵活配置混合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1,652,616,261.61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407号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年4月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,652,616,261.61份基金份额,其中认购资金利息折合78364.97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《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞创新升级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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%;每个交易日日终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%。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,经与基金托管人协商一致后,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理,届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事宜按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款利率(税后)+1%。

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日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下

合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 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 4 月 28 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 4 月 28 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

注:本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

注:本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

注: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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

### 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	2,544,204.38
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,544,204.38

#### 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	22,726,533.15	23,863,298.32	1,136,765.17	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	298,737,500.00	302,375,000.00	3,637,500.00
	银行间市场	552,391,958.62	555,763,000.00	3,371,041.38
	合计	851,129,458.62	858,138,000.00	7,008,541.38
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	873,855,991.77	882,001,298.32	8,145,306.55	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

### 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	2,606.33
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	9,217.36
应收债券利息	9,540,073.38
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	8.00
合计	9,551,905.07

### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

### 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	2,480.43
银行间市场应付交易费用	17,350.58
合计	19,831.01

### 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	3,594.49
预提费用	198,904.16
合计	202,498.65

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞新利 A		
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	2,315,978,132.59	2,315,978,132.59
本期申购	2,600,230.06	2,600,230.06
本期赎回(以“-”号填列)	-1,465,616,951.40	-1,465,616,951.40
- 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	852,961,411.25	852,961,411.25

金额单位：人民币元

华泰柏瑞新利 C		
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	10,676.78	10,676.78
本期申购	49,886,330.01	49,886,330.01
本期赎回(以“-”号填列)	-49,896,996.99	-49,896,996.99
- 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	9.80	9.80

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞新利 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,218,778.66	43,921,334.08	72,140,112.74
本期利润	23,155,445.95	-37,715,496.33	-14,560,050.38
本期基金份额交易	-28,778,476.37	-3,155,101.60	-31,933,577.97

产生的变动数			
其中：基金申购款	40,406.59	33,964.10	74,370.69
基金赎回款	-28,818,882.96	-3,189,065.70	-32,007,948.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,595,748.24	3,050,736.15	25,646,484.39

单位：人民币元

华泰柏瑞新利 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	127.45	202.49	329.94
本期利润	135,419.41	-659,175.91	-523,756.5
本期基金份额交易产生的变动数	-135,546.63	658,973.47	523,426.84
其中：基金申购款	601,394.66	825,359.55	1,426,754.21
基金赎回款	-736,941.29	-166,386.08	-903,327.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	0.23	0.05	0.28

#### 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	668,561.95
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	310,200.22
其他	874.74
合计	979,636.91

#### 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	59,857,192.23
减：卖出股票成本总额	52,812,127.79
买卖股票差价收入	7,045,064.44

### 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	-4,452,944.57
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	-4,452,944.57

#### 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	5,241,659,052.29
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,166,708,848.72
减：应收利息总额	79,403,148.14
买卖债券差价收入	-4,452,944.57

#### 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

单位：人民币元

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	267,190.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	267,190.20

#### 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	-38,374,672.65
——股票投资	-3,156,496.22
——债券投资	-35,218,176.43
——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	-38,374,672.65

#### 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	1,202,848.52
转换费收入 001247	8,438.01
合计	1,211,286.53

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% 的部分归入基金财产。

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，其中赎回费用不低于 25% 的部分归入基金财产。

#### 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	171,149.16
银行间市场交易费用	43,625.00
合计	214,774.16

#### 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	10,143.02
银行间账户服务费	18,600.00
其他费用	200.00
合计	227,847.18

#### 6.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

## 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：无。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

注：无。

## 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

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 4 月 28 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	8,257,888.17	10,689,713.75
其中:支付销售机构的客户维护费	1,213,520.03	-

注:本基金应支付基金管理人报酬,按前一日基金资产净值的 0.50%的年费率计提,计算方法如下:  $H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$  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三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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 4 月 28 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	2,378,657.72	1,781,618.95

注:本基金应支付基金托管人托管费,按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提,计算方法如下:  $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$  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三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

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞新利 A	华泰柏瑞新利 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	34,930.64	34,930.64
合计	-	34,930.64	34,930.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 4 月 28 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销售服务费		
	华泰柏瑞新利 A	华泰柏瑞新利 C	合计
合计	-	-	-

注:本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额支付销售机构销售服务费,按前一日 C 类基金资产净值的 0.2%的年费率计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应支付的销售服务费

E 为前一日的 C 类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各基金销售机构。

#### 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 4 月 28 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
中国银行股份有限公司	2,544,204.38	668,561.95	134,821,191.36	1,891,154.99

#### 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：本基金报告期末未参与关联方承销证券。

#### 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

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	6,574	85,330.52	85,330.52	-
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	-
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

#### 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
000651	格力电器	2016 年 2 月 22 日	临时停牌	19.22	-	-	541,653	10,282,416.94	10,410,570.66	-
601611	中国核建	2016 年 6 月 30 日	临时停牌	20.92	-	-	23,193	80,479.71	485,197.56	-

#### 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：本基金本报告期末没有在银行间市场债券正回购交易中抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末没有在交易所市场债券正回购交易中抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

注：无。

#### 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。

#### 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 06 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	0.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	100,120,000.00	-
合计	100,120,000.00	-

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	175,781,000.00	584,955,000.00
AAA 以下	31,176,000.00	51,720,000.00
未评级	551,061,000.00	1,075,563,000.00
合计	758,018,000.00	1,712,238,000.00

#### 6.4.13.3 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，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。

于 2016 年 06 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，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。

#### 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。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、存出保证金和结算备付金，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

##### 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	2,544,204.38	-	-	-	-	-	2,544,204.38

结算备付金	17,394,554.89	-	-	-	-	-	17,394,554.89
存出保证金	17,614.36	-	-	-	-	-	17,614.36
交易性金融资产	50,000,000.00	-	50,120,000.00	546,775,000.00	211,243,000.00	23,863,298.32	882,001,298.32
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-14,994,916.99	14,994,916.99
应收利息	-	-	-	-	-	-9,551,905.07	9,551,905.07
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	69,956,373.63	-	50,120,000.00	546,775,000.00	211,243,000.00	48,410,120.38	926,504,494.01
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	45,000,000.00	-	-	-	-	-	45,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	-1,912,256.03	1,912,256.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-580,573.42	580,573.42
应付托管费	-	-	-	-	-	-181,429.18	181,429.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	-19,831.01	19,831.01
其他负债	-	-	-	-	-	-202,498.65	202,498.65
负债总计	45,000,000.00	-	-	-	-	-2,896,588.29	47,896,588.29
利率敏感度缺口	24,956,373.63	-	50,120,000.00	546,775,000.00	211,243,000.00	45,513,532.09	878,607,905.72
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	31,208,019.41	-	-	-	-	-	31,208,019.41
结算备付金	33,418,851.34	-	-	-	-	-	33,418,851.34
存出保证金	92,766.77	-	-	-	-	-	92,766.77
交易性金融资产	-	-	140,278,000.00	1,157,602,000.00	414,358,000.00	28,561,085.28	1,740,799,085.28
买入返售金融资产	794,400,000.00	-	-	-	-	-	794,400,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-1,685,902.30	1,685,902.30
应收利息	-	-	-	-	-	-34,080,216.19	34,080,216.19
应收申购款	-	-	-	-	-	-2,016.97	2,016.97
其他资产	-	-	-	-	-	-1,511.60	1,511.60
资产总计	859,119,637.52	-	140,278,000.00	1,157,602,000.00	414,358,000.00	64,330,732.34	2,635,688,369.86
负债							
卖出回购金融资产款	240,000,000.00	-	-	-	-	-	240,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	-2,554,889.98	2,554,889.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-3,111,525.37	3,111,525.37
应付托管费	-	-	-	-	-	-518,587.56	518,587.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-1.38	1.38
应付交易费用	-	-	-	-	-	-1,024,486.42	1,024,486.42
其他负债	-	-	-	-	-	-349,627.10	349,627.10
负债总计	240,000,000.00	-	-	-	-	-7,559,117.81	247,559,117.81

利率敏感度缺口	619,119,637.52	-140,278,000.00	1,157,602,000.00	414,358,000.00	56,771,614.53	2,388,129,252.05
---------	----------------	-----------------	------------------	----------------	---------------	------------------

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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）
	市场利率下降 25 个基点	7,955,082.00	17,349,480.00
	市场利率上升 25 个基点	-7,814,588.00	-17,068,618.00

#### 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。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；每个交易日日终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	23,863,298.32	2.72	28,561,085.28	1.20

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	23,863,298.32	2.72	28,561,085.28	1.20

#### 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 2.72%，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	23,863,298.32	2.58
	其中：股票	23,863,298.32	2.58
2	固定收益投资	858,138,000.00	92.62
	其中：债券	858,138,000.00	92.62
	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	19,938,759.27	2.15
7	其他各项资产	24,564,436.42	2.65
8	合计	926,504,494.01	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	-	-

C	制造业	11,380,222.94	1.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,592,456.88	0.86
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,492.40	0.01
J	金融业	4,800,000.00	0.55
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	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	23,863,298.32	2.72

### 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	000651	格力电器	541,653	10,410,570.66	1.18
2	601668	中国建筑	1,335,951	7,107,259.32	0.81
3	601288	农业银行	1,500,000	4,800,000.00	0.55
4	601611	中国核建	23,193	485,197.56	0.06
5	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.03
6	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.02
7	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.02
8	601966	玲珑轮胎	6,574	85,330.52	0.01
9	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
10	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.01
11	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01

12	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
13	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
14	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
15	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
16	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
17	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
18	002805	丰元股份	971	5,631.80	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	601668	中国建筑	26,477,814.00	1.11
2	601288	农业银行	13,062,000.00	0.55
3	000651	格力电器	10,282,416.94	0.43
4	601900	南方传媒	112,559.06	0.00
5	002791	坚朗五金	85,697.61	0.00
6	601966	玲珑轮胎	85,330.52	0.00
7	601611	中国核建	80,479.71	0.00
8	603608	天创时尚	78,341.20	0.00
9	603919	金徽酒	72,247.76	0.00
10	002792	通宇通讯	70,678.14	0.00
11	002788	鹭燕医药	68,314.95	0.00
12	603868	飞科电器	59,372.79	0.00
13	601127	小康股份	50,326.22	0.00
14	300511	雪榕生物	48,307.04	0.00
15	300512	中亚股份	39,164.43	0.00
16	603861	白云电器	34,476.00	0.00
17	300474	景嘉微	33,649.88	0.00
18	300516	久之洋	33,142.50	0.00
19	601020	华钰矿业	31,426.86	0.00
20	603101	汇嘉时代	31,390.03	0.00

### 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	601668	中国建筑	22,419,245.36	0.94
2	601288	农业银行	12,373,600.00	0.52
3	000651	格力电器	4,335,346.52	0.18
4	000625	长安汽车	4,108,014.85	0.17
5	000895	双汇发展	2,746,651.75	0.12
6	601169	北京银行	2,306,900.00	0.10
7	000333	美的集团	1,480,272.00	0.06
8	300495	美尚生态	922,555.50	0.04
9	603996	中新科技	802,992.00	0.03
10	300494	盛天网络	606,972.10	0.03
11	002782	可立克	514,035.32	0.02
12	300493	润欣科技	506,128.40	0.02
13	603778	乾景园林	500,514.00	0.02
14	002786	银宝山新	482,655.60	0.02
15	603299	井神股份	453,530.70	0.02
16	002787	华源包装	425,167.17	0.02
17	601900	南方传媒	380,122.40	0.02
18	002777	久远银海	344,104.80	0.01
19	002785	万里石	318,001.00	0.01
20	300474	景嘉微	317,256.20	0.01

### 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	51,270,837.05
卖出股票收入（成交）总额	59,857,192.23

### 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	251,125,000.00	28.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	349,936,000.00	39.83

	其中：政策性金融债	349,936,000.00	39.83
4	企业债券	82,273,000.00	9.36
5	企业短期融资券	50,120,000.00	5.70
6	中期票据	124,684,000.00	14.19
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	858,138,000.00	97.67

## 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	019512	15 付息国债 12	2,500,000	251,125,000.00	28.58
2	160303	16 进出 03	1,000,000	100,260,000.00	11.41
3	160210	16 国开 10	800,000	79,960,000.00	9.10
4	160208	16 国开 08	700,000	69,776,000.00	7.94
5	127293	15 国网 04	500,000	51,250,000.00	5.83

## 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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 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。



## 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

本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体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。

### 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股票。

### 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	17,614.36
2	应收证券清算款	14,994,916.99
3	应收股利	-
4	应收利息	9,551,905.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,564,436.42

### 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	000651	格力电器	10,410,570.66	1.18	临时停牌
2	601611	中国核建	485,197.56	0.06	临时停牌
3	601966	玲珑轮胎	85,330.52	0.01	新股锁定

## § 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

份额级别	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
华泰柏瑞新利 A	2,956	288,552.57	599,547,236.15	70.29%	253,414,175.10	29.71%
华泰柏瑞新利 C	1	9.80	-	-	9.80	100.00%
合计	2,957	288,455.00	599,547,236.15	70.29%	253,414,184.90	29.71%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

### 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：无。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞新利 A	华泰柏瑞新利 C
基金合同生效日（2015 年 4 月 28 日）基金份额总额	1,652,694,626.58	-
本报告期期初基金份额总额	2,315,978,132.59	10,676.78

本报告期基金总申购份额	2,600,230.06	49,886,330.01
减:本报告期基金总赎回份额	1,465,616,951.40	49,896,996.99
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	852,961,411.25	9.80

## § 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

本报告期内，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为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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
东北证券	1	52,028,086.40	47.44%	48,453.80	47.71%	-
兴业证券	1	26,651,880.75	24.30%	24,287.94	23.91%	-
万联证券	3	26,642,790.10	24.29%	24,812.54	24.43%	-
华创证券	1	948,908.11	0.87%	864.74	0.85%	-
齐鲁证券	1	698,425.09	0.64%	650.46	0.64%	-
中信建投	1	525,239.05	0.48%	478.67	0.47%	-
华安证券	2	503,363.41	0.46%	458.73	0.45%	-
国金证券	1	398,012.36	0.36%	370.69	0.36%	-
长江证券	1	380,122.40	0.35%	354.03	0.35%	-
信达证券	1	264,725.77	0.24%	241.25	0.24%	-
银河证券	1	242,440.30	0.22%	225.79	0.22%	-
东吴证券	1	223,333.11	0.20%	203.52	0.20%	-
浙商证券	1	87,996.48	0.08%	80.19	0.08%	-
广发证券	1	84,099.84	0.08%	78.31	0.08%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	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。

### 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
东北证券	-	-	3,684,500,000.00	18.16%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	2,560,000,000.00	12.61%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	1,740,000,000.00	8.57%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	580,000,000.00	2.86%	-	-
国金证券	847,009.59	50.17%	3,494,000,000.00	17.22%	-	-
长江证券	-	-	1,360,000,000.00	6.70%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	3,313,000,000.00	16.33%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	841,282.19	49.83%	3,562,000,000.00	17.55%	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

## 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	华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 2016 年 1 号正文	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 8 日
2	华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 2016 年 1 号摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 8 日
3	华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金 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	华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金 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	华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金 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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于北京钱景财富投资管理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	华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 21 日
8	增加平安证券为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务等的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 15 日
9	关于降低华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金管理费并修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 15 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 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

托管人住所

### **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