

华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

本基金名称自 2015 年 8 月 6 日起，由“华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞价值增长混合”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司 2015 年 8 月 6 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞价值增长混合
基金主代码	460005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 7 月 16 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	345,784,894.93 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566

传真	021-38601799	010-66594942
----	--------------	--------------

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-73,765,387.03	182,420,147.21	44,605,205.18
本期利润	-138,989,759.96	202,574,261.41	65,801,333.42
加权平均基金份额本期利润	-0.3434	1.1482	0.3279
本期基金份额净值增长率	-10.88%	94.05%	33.52%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	1.2774	1.6259	0.2616
期末基金资产净值	887,078,084.40	1,078,150,654.62	241,618,250.43
期末基金份额净值	2.5654	3.0675	1.6102

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.62%	0.93%	1.43%	0.57%	0.19%	0.36%
过去六个月	5.61%	0.90%	4.28%	0.61%	1.33%	0.29%

过去一年	-10.88%	1.81%	-8.16%	1.12%	-2.72%	0.69%
过去三年	130.90%	2.07%	38.69%	1.43%	92.21%	0.64%
过去五年	177.16%	1.79%	1.30%	136.58%	0.49%	
自基金合同生效起至今	304.05%	1.70%	27.00%	1.40%	277.05%	0.30%

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

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

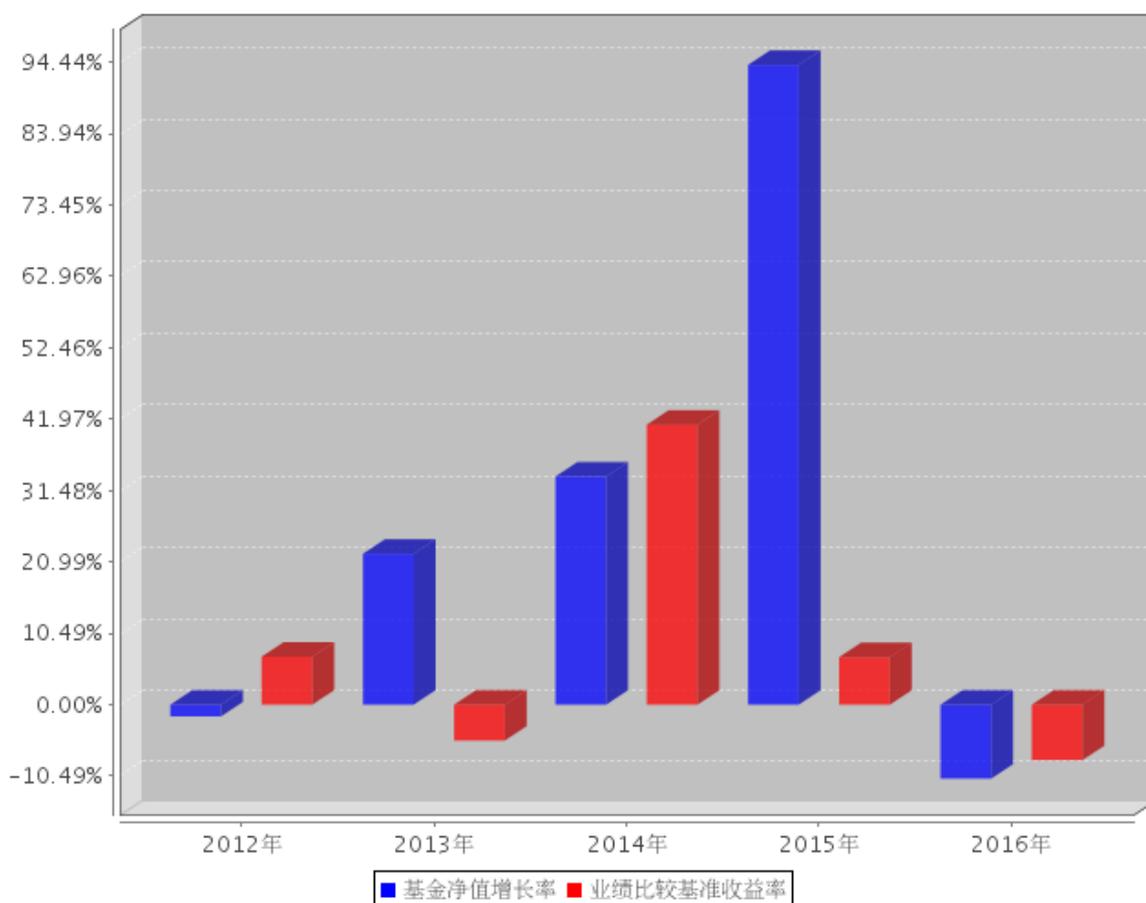


注：图示日期为 2008 年 7 月 16 日至 2016 年 12 月 31 日。

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

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效日为 2008 年 7 月 16 日，2008 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2016	1.6300	42,850,645.91	17,548,045.24	60,398,691.15	注：-
2015	0.3000	2,869,957.27	1,417,944.72	4,287,901.99	注：-
2014	-	-	-	-	注：-
合计	1.9300	45,720,603.18	18,965,989.96	64,686,593.14	注：-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成

为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金。截至 2016 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 974.88 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方纬	本基金的基金经理	2014 年 8 月 22 日	-	13	经济学硕士。2003 年 9 月至 2005 年 1 月任上海金信研究所研究员；

				<p>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增长混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 4 月至 2016 年 8 月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。2015 年 5 月至 2016 年 8 月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。2015 年 8 月至 2016 年 11 月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 月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月起任华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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《华泰柏瑞价值增长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 公平交易制度和控制方法

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平，只在少数情况下“存在显著的倾向性”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究表明，交易价差方向没有规律性，即没有明确的利益输送方向。造成少量显著交易价差的原因来自两方面：一是报告期内股票市场的波动幅度较大，为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件；二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异，对证券买卖时点的把握也不同，导致股票买卖存在价差。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报

告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，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%的，合计 2 次，为旗下组合主动投资需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

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，沪深 300 指数下跌 11.28%，中证 500 指数下跌 17.78%，创业板指数下跌 27.71%。本基金年度收益率-10.88%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 2.5654 元，累计净值为 3.2684 元，本报告期内基金份额净值下跌 10.88%，本基金的业绩比较基准下跌 8.16%。

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 2017 年，货币环境趋于中性，但经济持续复苏，企业盈利回升，盈利增长将推动指数上升。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

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

确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2)开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司投资研究业务、异常交易和公平交易管理、市场宣传、客户服务、信息技术安全、人员管理、基金核算与注册登记等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3)促进公司各项内部管理制度的完善

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

(4)通过各种合规培训提高员工合规意识

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 6 次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的 80%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本报告期内 1 月 19 日本基金进行收益分配，每份额分红 0.163 元。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21088 号
--------	-------------------------

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金(原华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金,以下简称“华泰柏瑞价值增长基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是华泰柏瑞价值增长基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为,上述华泰柏瑞价值增长基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞价值增长基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	单峰	傅琛慧
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	
会计师事务所的地址	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	

审计报告日期	2017 年 3 月 28 日
--------	-----------------

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		51,090,656.37	91,330,703.29
结算备付金		14,300,497.72	12,190,846.13
存出保证金		741,377.46	723,844.25
交易性金融资产		830,135,888.23	992,280,369.76
其中：股票投资		830,135,888.23	992,280,369.76
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		5,082,423.03	-
应收利息		23,696.10	24,377.85
应收股利		-	-
应收申购款		927,354.92	3,448,577.24
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		902,301,893.83	1,099,998,718.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,432,204.15	-
应付赎回款		1,138,485.97	12,345,268.30
应付管理人报酬		1,169,107.65	1,351,777.18

应付托管费		194,851.28	225,296.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		6,905,650.32	7,519,223.18
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		383,510.06	406,499.04
负债合计		15,223,809.43	21,848,063.90
所有者权益：			
实收基金		345,784,894.93	351,473,790.69
未分配利润		541,293,189.47	726,676,863.93
所有者权益合计		887,078,084.40	1,078,150,654.62
负债和所有者权益总计		902,301,893.83	1,099,998,718.52

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.5654 元，基金份额总额 345,784,894.93 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-87,002,233.22	228,283,564.17
1. 利息收入		1,052,268.36	540,495.53
其中：存款利息收入		1,052,268.36	394,396.64
债券利息收入		-	129,920.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	16,178.34
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-24,186,094.26	206,383,782.40
其中：股票投资收益		-38,940,918.02	202,847,858.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-44,590.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		14,754,823.76	3,580,513.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”		-65,224,372.93	20,154,114.20

号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)		1,355,965.61	1,205,172.04
减: 二、费用		51,987,526.74	25,709,302.76
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	15,071,260.45	6,550,314.01
2. 托管费	7.4.8.2.2	2,511,876.78	1,091,718.99
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		33,992,428.26	17,672,974.86
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		411,961.25	394,294.90
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-138,989,759.96	202,574,261.41
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-138,989,759.96	202,574,261.41

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

本报告期: 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	351,473,790.69	726,676,863.93	1,078,150,654.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	-	-138,989,759.96	-138,989,759.96
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)	-5,688,895.76	14,004,776.65	8,315,880.89
其中: 1. 基金申购款	474,285,314.03	697,402,107.63	1,171,687,421.66
2. 基金赎回款	-479,974,209.79	-683,397,330.98	-1,163,371,540.77
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)	-	-60,398,691.15	-60,398,691.15

五、期末所有者权益（基金净值）	345,784,894.93	541,293,189.47	887,078,084.40
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	150,053,585.36	91,564,665.07	241,618,250.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	202,574,261.41	202,574,261.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	201,420,205.33	436,825,839.44	638,246,044.77
其中：1. 基金申购款	653,867,017.55	1,107,516,395.78	1,761,383,413.33
2. 基金赎回款	-452,446,812.22	-670,690,556.34	-1,123,137,368.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-4,287,901.99	-4,287,901.99
五、期末所有者权益（基金净值）	351,473,790.69	726,676,863.93	1,078,150,654.62

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金(原名为华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 543 号《关于核准友邦华泰价值增长股票型证券投资基金募集的批复》核准,由友邦华泰基金管理有限公司(已自 2010 年 4 月 30 日起更名为华泰柏瑞基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《友邦华泰价值增长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 406,224,705.76 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 109 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《友邦华泰价值增长股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 7 月 16

日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 406,303,580.25 份基金份额，其中认购资金利息折合 78,874.49 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》的规定，华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金。

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

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2017 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金直销机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
华泰证券股份 有限公司	7,363,129,055.35	32.69%	3,091,959,084.78	25.98%

7.4.8.1.4 权证交易

注：无。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券股份 有限公司	6,744,858.43	32.58%	4,813,200.02	69.70%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例 (%)
华泰证券股份 有限公司	2,774,532.17	25.62%	1,723,363.34	22.92%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	15,071,260.45	6,550,314.01
其中：支付销售机构的客户维护费	3,803,960.82	1,563,860.03

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 1.50%的年费率计提，计算方法如下：

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

H 为每日应支付的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.8.2.2 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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,511,876.78	1,091,718.99

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

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

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2008 年 7 月 16 日）持有的基金份额	10,007,525.00	10,007,525.00
期初持有的基金份额	19,746,182.58	19,746,182.58
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	19,746,182.58	-
期末持有的基金份额	-	19,746,182.58
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	5.6181%

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	51,090,656.37	884,614.22	91,330,703.29	312,176.20

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300449	汉邦高科	2016年11月11日	临时停牌	48.44	2017年2月24日	43.88	173,365	7,540,786.61	8,397,800.60	-
000563	陕国投A	2016年10月14日	临时停牌	7.48	2017年1月18日	6.73	956,600	5,641,074.49	7,155,368.00	-
002162	悦心健康	2016年12月22日	临时停牌	6.61	-	-	900,476	5,788,952.11	5,952,146.36	-
600303	曙光股份	2016年12月15日	临时停牌	9.02	2017年1月17日	9.92	645,100	6,266,494.00	5,818,802.00	-
300150	世纪瑞尔	2016年11月8日	临时停牌	9.97	-	-	577,400	5,845,125.05	5,756,678.00	-
002579	中京电子	2016年12月5日	临时停牌	13.68	2017年3月1日	14.29	323,000	4,450,034.74	4,418,640.00	-
600973	宝胜股份	2016年11月28日	临时停牌	8.05	2017年2月22日	8.86	489,000	3,909,080.04	3,936,450.00	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 788,700,003.27 元，属于第二层次的余额为 41,435,884.96 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 916,511,107.71 元，第二层次 75,769,262.05，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	830,135,888.23	92.00
	其中：股票	830,135,888.23	92.00
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	65,391,154.09	7.25
7	其他各项资产	6,774,851.51	0.75
8	合计	902,301,893.83	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	564,892,490.56	63.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	62,345,042.98	7.03
E	建筑业	20,408,448.71	2.30
F	批发和零售业	34,054,026.23	3.84
G	交通运输、仓储和邮政业	12,919,906.68	1.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,072,166.44	5.31
J	金融业	7,155,368.00	0.81

K	房地产业	44,123,369.96	4.97
L	租赁和商务服务业	7,133,880.00	0.80
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,126,012.67	1.71
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	14,905,176.00	1.68
S	综合	-	-
	合计	830,135,888.23	93.58

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002546	新联电子	1,001,500	9,083,605.00	1.02
2	603309	维力医疗	357,000	9,035,670.00	1.02
3	601199	江南水务	1,137,500	8,781,500.00	0.99
4	300449	汉邦高科	173,365	8,397,800.60	0.95
5	600525	长园集团	586,109	8,176,220.55	0.92
6	300206	理邦仪器	846,795	8,044,552.50	0.91
7	300307	慈星股份	743,700	7,793,976.00	0.88
8	002293	罗莱生活	554,567	7,458,926.15	0.84
9	002006	精功科技	664,703	7,444,673.60	0.84
10	300442	普丽盛	169,700	7,317,464.00	0.82

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www. Huatai-pb.com](http://www.Huatai-pb.com) 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	300059	东方财富	55,290,824.50	5.13
2	600019	宝钢股份	42,331,279.02	3.93
3	000776	广发证券	33,582,829.18	3.11
4	600016	民生银行	31,887,001.00	2.96
5	600000	浦发银行	31,857,173.63	2.95
6	601318	中国平安	31,835,682.62	2.95
7	000333	美的集团	31,794,947.58	2.95
8	601166	兴业银行	31,792,577.38	2.95
9	000001	平安银行	31,781,782.75	2.95
10	601328	交通银行	31,769,034.59	2.95
11	601009	南京银行	31,641,507.05	2.93
12	600048	保利地产	31,590,834.96	2.93
13	601818	光大银行	31,512,494.00	2.92
14	601169	北京银行	31,421,517.93	2.91
15	600036	招商银行	31,132,684.31	2.89
16	600886	国投电力	31,060,602.93	2.88
17	600340	华夏幸福	30,145,076.80	2.80
18	002415	海康威视	30,012,202.69	2.78
19	600717	天津港	29,543,845.73	2.74
20	600068	葛洲坝	29,454,944.15	2.73
21	601377	兴业证券	29,453,626.67	2.73
22	300307	慈星股份	29,436,597.32	2.73
23	600104	上汽集团	29,363,514.92	2.72
24	600015	华夏银行	29,347,486.14	2.72
25	002142	宁波银行	29,337,427.45	2.72
26	300206	理邦仪器	29,172,317.33	2.71
27	601633	长城汽车	28,912,700.82	2.68
28	600674	川投能源	28,825,682.08	2.67
29	600741	华域汽车	28,777,836.45	2.67
30	601186	中国铁建	28,531,912.56	2.65

31	601668	中国建筑	28,529,720.25	2.65
32	600004	白云机场	27,918,353.97	2.59
33	600066	宇通客车	27,597,520.85	2.56
34	002236	大华股份	26,884,245.11	2.49
35	601939	建设银行	26,091,821.28	2.42
36	601398	工商银行	25,957,971.00	2.41
37	600222	太龙药业	25,944,387.89	2.41
38	000625	长安汽车	25,654,079.13	2.38
39	300086	康芝药业	25,562,289.89	2.37
40	300339	润和软件	25,387,381.95	2.35
41	601288	农业银行	25,036,877.00	2.32
42	601999	出版传媒	24,920,810.66	2.31
43	002463	沪电股份	24,696,874.47	2.29
44	300258	精锻科技	24,671,811.98	2.29
45	300289	利德曼	24,499,783.72	2.27
46	600850	华东电脑	24,467,367.28	2.27
47	600062	华润双鹤	23,867,682.30	2.21
48	600027	华电国际	23,774,351.98	2.21
49	002013	中航机电	23,710,011.48	2.20
50	600782	新钢股份	23,604,090.42	2.19
51	000028	国药一致	23,558,043.23	2.19
52	601111	中国国航	23,134,354.08	2.15
53	300239	东宝生物	22,851,397.45	2.12
54	600569	安阳钢铁	22,784,006.87	2.11
55	300048	合康新能	22,737,182.00	2.11
56	300267	尔康制药	22,720,730.98	2.11
57	000753	漳州发展	22,449,348.48	2.08
58	600028	中国石化	22,301,968.00	2.07
59	600973	宝胜股份	22,038,660.06	2.04
60	300137	先河环保	21,982,006.87	2.04
61	600521	华海药业	21,978,889.99	2.04
62	000418	小天鹅A	21,851,005.77	2.03
63	601007	金陵饭店	21,698,227.85	2.01
64	000971	高升控股	21,594,664.19	2.00

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	56,870,841.43	5.27
2	601328	交通银行	55,864,800.23	5.18
3	601009	南京银行	54,388,236.48	5.04
4	601166	兴业银行	53,444,710.43	4.96
5	600000	浦发银行	53,003,703.83	4.92
6	601169	北京银行	52,838,081.31	4.90
7	600104	上汽集团	52,725,368.32	4.89
8	600036	招商银行	52,400,236.11	4.86
9	000001	平安银行	52,222,441.77	4.84
10	600048	保利地产	51,442,435.82	4.77
11	601318	中国平安	51,435,496.71	4.77
12	002142	宁波银行	50,947,483.03	4.73
13	601818	光大银行	50,836,693.69	4.72
14	300059	东方财富	50,669,473.58	4.70
15	600066	宇通客车	50,507,647.26	4.68
16	600886	国投电力	49,850,813.74	4.62
17	601668	中国建筑	49,806,313.06	4.62
18	600741	华域汽车	49,757,202.24	4.62
19	002415	海康威视	49,740,954.11	4.61
20	601633	长城汽车	49,512,444.72	4.59
21	600015	华夏银行	49,409,946.93	4.58
22	000625	长安汽车	46,601,649.27	4.32
23	601398	工商银行	45,878,683.00	4.26
24	601288	农业银行	45,294,424.00	4.20
25	601939	建设银行	45,280,714.88	4.20
26	600019	宝钢股份	43,474,141.61	4.03
27	600858	银座股份	40,251,431.66	3.73
28	601006	大秦铁路	34,512,772.74	3.20
29	000550	江铃汽车	34,230,994.71	3.17
30	600068	葛洲坝	33,932,471.05	3.15
31	600011	华能国际	33,518,069.51	3.11
32	000776	广发证券	32,850,977.19	3.05
33	600016	民生银行	32,768,779.71	3.04
34	600717	天津港	31,804,270.62	2.95
35	600340	华夏幸福	31,595,082.40	2.93

36	601336	新华保险	31,488,947.58	2.92
37	600674	川投能源	30,319,177.50	2.81
38	600004	白云机场	29,242,629.97	2.71
39	601377	兴业证券	29,180,968.00	2.71
40	002236	大华股份	27,646,062.50	2.56
41	600030	中信证券	27,561,294.67	2.56
42	601186	中国铁建	26,623,868.32	2.47
43	600062	华润双鹤	26,392,758.31	2.45
44	300086	康芝药业	26,205,632.08	2.43
45	000971	高升控股	26,091,324.46	2.42
46	000726	鲁泰A	25,960,119.26	2.41
47	300258	精锻科技	25,741,607.77	2.39
48	000418	小天鹅A	25,107,224.75	2.33
49	601111	中国国航	25,058,709.57	2.32
50	300339	润和软件	24,875,892.22	2.31
51	600850	华东电脑	24,806,398.12	2.30
52	300136	信维通信	24,588,825.47	2.28
53	002013	中航机电	24,478,282.23	2.27
54	600782	新钢股份	24,410,577.74	2.26
55	600521	华海药业	24,262,645.20	2.25
56	000895	双汇发展	23,899,153.29	2.22
57	600795	国电电力	23,421,333.00	2.17
58	002508	老板电器	23,399,089.34	2.17
59	600027	华电国际	23,390,278.52	2.17
60	000028	国药一致	23,326,518.08	2.16
61	600028	中国石化	23,299,585.00	2.16
62	600569	安阳钢铁	22,805,386.62	2.12
63	000069	华侨城A	22,393,425.61	2.08
64	600667	太极实业	22,312,983.60	2.07
65	600350	山东高速	22,281,321.63	2.07
66	600383	金地集团	22,069,845.70	2.05
67	600585	海螺水泥	22,044,053.13	2.04
68	000002	万科A	21,832,530.35	2.02
69	000036	华联控股	21,796,870.82	2.02
70	601999	出版传媒	21,795,845.94	2.02
71	300342	天银机电	21,646,022.84	2.01
72	300100	双林股份	21,636,895.49	2.01

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	11,234,220,915.42
卖出股票收入（成交）总额	11,292,200,106.00

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

8.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	741,377.46
2	应收证券清算款	5,082,423.03
3	应收股利	-
4	应收利息	23,696.10
5	应收申购款	927,354.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,774,851.51

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300449	汉邦高科	8,397,800.60	0.95	停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
62,362	5,544.80	18,586,631.72	5.38%	327,198,263.21	94.62%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	256,020.35	0.0740%

9.4 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

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2008 年 7 月 16 日 ）基金份额总额	406,303,580.25
本报告期期初基金份额总额	351,473,790.69
本报告期基金总申购份额	474,285,314.03
减:本报告期基金总赎回份额	479,974,209.79
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	345,784,894.93

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016 年 11 月 24 日，经公司股东会批准贾波先生、翟军先生、文光伟先生、沈志群先生、李亦宜女士为公司董事。

2016 年 11 月 24 日，经公司董事会选举贾波先生为公司董事长，任职时间自 2016 年 12 月 14 日起。

2016 年 11 月 24 日，经公司股东会批准何雅茵女士、刘晓冰先生为公司监事。

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 80,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 9 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	37	363,129,055.35	32.69%	6,744,858.43	32.58%	-
渤海证券	36	319,215,723.18	28.05%	5,792,011.68	27.98%	-
广发证券	24	618,754,594.71	20.50%	4,230,006.05	20.43%	-
银河证券	12	366,547,815.27	10.51%	2,203,959.45	10.65%	-
宏源证券	21	361,145,673.66	6.04%	1,267,634.12	6.12%	-
兴业证券	1	497,508,628.34	2.21%	463,325.66	2.24%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

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

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；

3) 资金雄厚, 信誉良好。内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足本基金运作高度保密的要求。

4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理基金进行证券交易的需要, 并能为基金提供全面的信息服务。

5) 具备研究实力, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务, 并能根据基金投资的特定要求, 提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注: 无。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2017 年 3 月 29 日