

# 华泰柏瑞创新升级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、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	华泰柏瑞创新升级
基金主代码	000566
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 5 月 6 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	140,699,750.11 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，本基金追求基金资产的长期增值，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	本基金将采取积极、主动的资产配置策略，精选与经济结构调整与转型主题直接相关，具备长期盈利能力提升的上市公司，力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率×20%+中证新兴产业指数收益率×40%+中债总指数（全价）收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，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

## 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 弄证大五道口广场 1 号楼 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 5 月 6 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-38,423,922.34	233,895,072.10	28,119,338.50
本期利润	-111,967,168.84	273,501,924.65	61,616,099.61
加权平均基金份额本期利润	-0.5249	0.7283	0.3146
本期基金份额净值增长率	-13.31%	58.07%	35.00%
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	0.7689	0.8216	0.2017
期末基金资产净值	260,278,039.57	629,645,878.35	502,881,240.00
期末基金份额净值	1.850	2.134	1.350

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

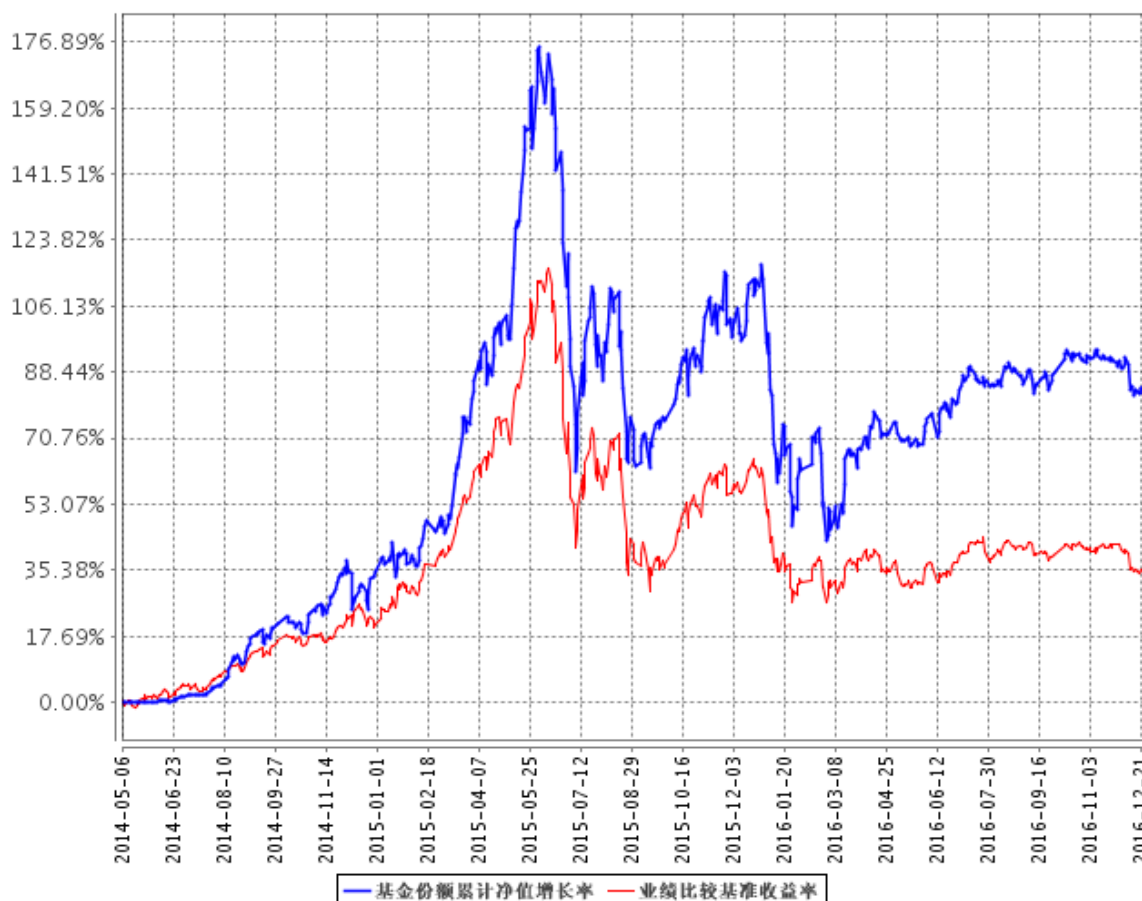
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.60%	0.75%	-3.25%	0.53%	1.65%	0.22%
过去六个月	2.95%	0.78%	-2.08%	0.57%	5.03%	0.21%

过去一年	-13.31%	1.87%	-16.08%	1.09%	2.77%	0.78%
自基金合同生效起至今	85.00%	2.03%	34.82%	1.30%	50.18%	0.73%

### 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

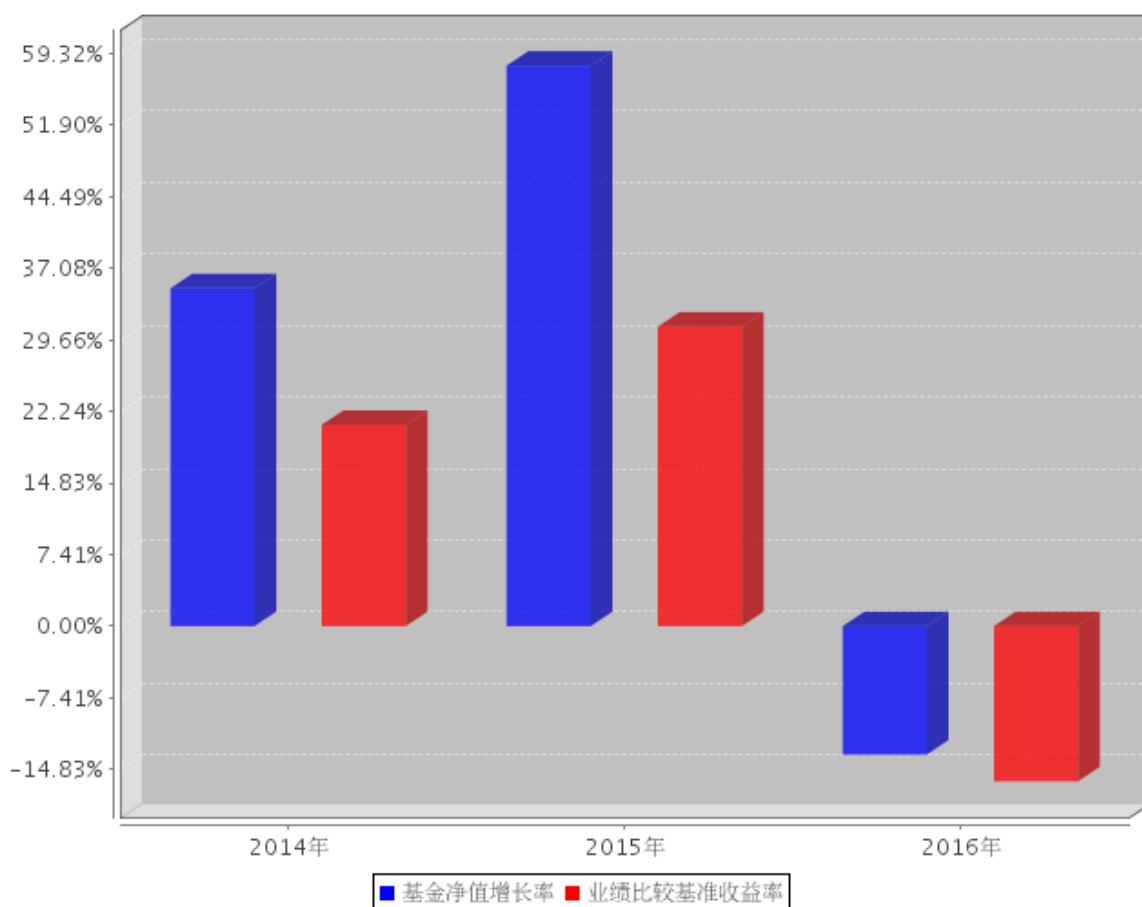


注：1. 图示日期为 2014 年 5 月 6 日至 2016 年 12 月 31 日。

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）投资范围的要求，本基金持有的股票占基金资产的比例为 30%-95%，其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%；债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-70%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来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：本基金合同于 2014 年 5 月 6 日生效，2014 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

注：无。

## § 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、华泰柏瑞享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		
张慧	本基金的基金经理 / 投资部总监助理	2014年5月6日	-	9	经济学硕士，9年证券从业经历。2007年7月至2010年6月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010年6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，2013年9

					月起任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理，2014年5月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2015年2月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年1月起任投资部总监助理。
--	--	--	--	--	---

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《华泰柏瑞创新升级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。同时潜在利益输送金额比较小，因此不构成利益输送。造成少量显著交易价差的原因来自两方面：一是报告期内股票市场的波动幅度较大，为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件；二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异，对证券买卖时点的把握也不同，导致股票买卖存在价差。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的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% 的交易共有 1 次，系因策略需要，认为公司有投资价值，后续交易日还有持续买入。

## 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

16 年全年市场呈现先抑后扬的 V 字型格局，全年指数基本收阴，沪深 300 指数下跌 11.28%，创业板指数下跌 27.71%，中证 500 指数下跌 17.78%。主要的跌幅基本在年初完成，年初的下跌由于人民币贬值加剧，“熔断”机制造成超跌。而由于经济基本面在 16 年逐渐好转，带动上市公司盈利在随后的几个季度里不断改善，带动股指从 16 年 3 月开始逐级震荡走高。

16 年 1 季度市场基本在下跌和震荡整固中完成。由于投资人对国际、国内经济和流动性的担心，叠加股票估值重回高位以及全球风险资产下跌共振，“春季躁动”行情落空，风险偏好急剧下降，导致 1 月份整体跌幅较大。1 月份各行业指数跌幅基本与 15 年涨幅成反比，高估值主题概念股跌幅居前。2 月份，在滞胀预期推动下，大宗、涨价、供给侧改革等主题表现较好，成长股在快速反弹后有较大回撤，很多公司股价创出年内新低。随着投资人的担忧逐渐缓解，风险偏好开始回升。3 月份成长股和小市值公司涨幅居前，稳定消费类资产亦有不错表现，各板块和主题

均有轮动机会，但持续性不强。

进入 16 年 2 季度之后，市场指数波动区间明显收窄，但在指数变化不大的情况下，2 季度行业和主题热点轮动开始活跃。这其中以新能源车产业链的表现最为优异。主题层面，行业空间较大的半导体、OLED 等相对收益明显，稀土主题强势上涨。除此之外，还有一些主题的轮动较快，持续力并不是很强，如物联网、区块链等。

16 年下半年之后，市场开始对宏观经济的逐渐回暖有所察觉，一方面工业品价格开始上涨，另一方面 PPP、基建等订单也在集中爆发。尽管在国庆期间各地出台了针对地产行业强烈的限购政策，但随着经济数据的好转，供给侧改革相关的煤炭、钢铁价格和美国经济复苏预期下的基本金属价格在 10-12 月的期间有显著的上涨，刺激了相关行业的股价抬升。

与此同时，保险资金在 2016 年的配置压力也导致了市场出现了多次的险资举牌主题行情。以宝能系、安邦、恒大等为代表的产业资本和保险资金在 4 季度纷纷举牌高股息、资产折价明显的大盘蓝筹股票，成为带动 4 季度前期指数显著上升的主要原因。

本基金在 1 月份对市场相对乐观导致了净值跌幅较大。在市场调整的过程中，本基金优化了持仓结构，保持了高仓位，使得在反弹中净值回升亦较快。在 2 季度初，本基金认为投资人对于市场过于悲观的预期修复可能进入尾声，因此我们在 4 月上旬的反弹中逐渐降低仓位获利了结，在 4 月中旬开始的调整中净值回撤有限。

下半年由于指数的波动区间愈发收窄，本基金在结构上降低了成长股的配置比例，逐步转向周期、蓝筹和消费行业的轮动化配置。并且在风格上，尽量降低过小市值公司的投资比例，同时更加关注对业绩兑现程度的选股标准。基金净值在下半年基本也保持了区间内窄幅波动的态势。

#### 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 1.850 元，本报告期份额净值增长率为-13.31%，同期业绩比较基准增长率为-16.08%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受到去年 1 月熔断的心理影响，2017 年 1-2 月投资者绝对收益目标的情绪浓烈，市场并未呈现出趋势性的行情，领涨板块之间的轮动较快。

步入 3 月之后，春节后的旺季开工逐渐临近，预计工业需求将会逐渐回暖，从今年地方两会对于全年固定资产投资的规划来看，地方基建投资的冲动较高。2 月 PMI 数据已经出现反弹，3 月工业增加值、PMI 等数据预计也将继续回升，整个经济月度数据在 3 月有利于提升风险偏好，目前 1-2 月的高频数据显示经济回暖仍在持续，我们预期 3 月主要工业周期品价格将会重新有所

上涨。但与此同时，我们也注意到一二线城市的房地产销量等先导指标开始出现回落，对此，2 季度的经济是否会在旺季之后开始有下滑迹象，本基金也将在未来的投资过程中持续跟踪。

而流动性方面，未来几个月还将维持中性偏紧的态势。一方面，我们需要关注美联储加息预期的变化以及对人民币贬值和外汇流出压力的影响。目前来看，中美长期国债利差仍旧保持在合理位置，短期人民币流出的压力不大。但预计最晚在 2 季度，联储将会启动一次加息进程，届时对于新兴市场可能都会有一定冲击。另一方面，国内通胀、房价如果继续走高，央行和住建部等政府部门可能出台进一步的调控政策。

整体而言，我们对于未来 3 个月的市场走势认为先上后下，支撑市场上行的主要动力在于 3 月实体经济需求的逐渐印证。而 2 季度中后期开始存在的市场风险，更多将源于物价上涨后政府主动调控的行为，以及美联储逐渐收紧可能给新兴国家市场带来的资金抽离。

市场结构上，3 月上行的主线应当还是围绕着经济复苏逻辑，因此周期品预计将会是行业配置中相对收益的主要获取板块。国内需求上，更加看好供需格局较好的钢铁、造纸，而海外方面，有色和石油价格预计也将有所回升。

4 月之后，本基金可能转为相对防御的配置结构，目前来看，高速、旅游和受益消费升级的消费品等行业可能是配置的方向。

主题机会上，我们相对看好偏蓝筹的主题，国企混改、一带一路等主题将会是逢低关注的方向，本基金将会结合上市公司自身因素、股价所处位置，结合政策预期来有所布局。

#### 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基金投资业务、交易合规、市场宣传、客户服务、信息技术安全、交易佣金分配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 12 次；每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 25%；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。基金合同生效不满 3 个月，收益可不

分配。截止本报告期末，本基金可分配收益为 108,184,533.31 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”）在华泰柏瑞创新升级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 21048 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	华泰柏瑞创新升级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创新升级混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞创新升级混合基金”)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创新升级混合基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p>

	我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述华泰柏瑞创新升级混合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创新升级混合基金 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	上海湖滨路 202 号普华永道中心 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：华泰柏瑞创新升级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
<b>资产：</b>			
银行存款		25,822,990.77	43,739,966.43
结算备付金		1,540,700.11	5,605,128.35
存出保证金		237,338.74	769,661.71
交易性金融资产		233,607,921.61	579,759,490.19
其中：股票投资		233,607,921.61	579,759,490.19
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		1,883,106.21	5,591,640.12
应收利息		9,558.40	21,144.12
应收股利		-	-
应收申购款		6,749.98	760,600.55
递延所得税资产		-	-

其他资产		-	-
资产总计		263,108,365.82	636,247,631.47
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2016年12月31日</b>	<b>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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		339,917.11	-
应付赎回款		931,494.35	737,452.73
应付管理人报酬		380,318.88	770,560.90
应付托管费		63,386.47	128,426.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		743,108.08	4,593,944.19
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		372,101.36	371,368.48
负债合计		2,830,326.25	6,601,753.12
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		140,699,750.11	295,107,143.56
未分配利润		119,578,289.46	334,538,734.79
所有者权益合计		260,278,039.57	629,645,878.35
负债和所有者权益总计		263,108,365.82	636,247,631.47

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.850 元，基金份额总额 140,699,750.11 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞创新升级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	2015年1月1日至
		2016年12月31日	2015年12月31日
<b>一、收入</b>		-98,731,017.87	305,227,791.30
1. 利息收入		700,239.54	1,550,882.28
其中：存款利息收入		692,713.15	1,212,678.77
债券利息收入		-	213,950.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,526.39	124,252.69



其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-26,666,564.16	254,892,840.79
其中：股票投资收益		-27,840,432.87	252,784,726.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	415,860.00
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		1,173,868.71	1,692,253.97
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-73,543,246.50	39,606,852.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		778,553.25	9,177,215.68
<b>减：二、费用</b>		13,236,150.97	31,725,866.65
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	5,709,592.99	10,665,474.37
2. 托管费	7.4.8.2.2	951,598.87	1,777,579.08
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		6,157,856.74	18,851,660.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		417,102.37	431,152.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-111,967,168.84	273,501,924.65
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-111,967,168.84	273,501,924.65

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞创新升级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）	295,107,143.56	334,538,734.79	629,645,878.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净	-	-111,967,168.84	-111,967,168.84

利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-154,407,393.45	-102,993,276.49	-257,400,669.94
其中: 1. 基金申购款	140,925,747.80	106,435,578.28	247,361,326.08
2. 基金赎回款	-295,333,141.25	-209,428,854.77	-504,761,996.02
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)	140,699,750.11	119,578,289.46	260,278,039.57
	<b>上年度可比期间</b>		
	<b>2015年1月1日至2015年12月31日</b>		
<b>项目</b>	<b>实收基金</b>	<b>未分配利润</b>	<b>所有者权益合计</b>
一、期初所有者权益(基金净值)	372,406,137.72	130,475,102.28	502,881,240.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	273,501,924.65	273,501,924.65
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)	-77,298,994.16	-69,438,292.14	-146,737,286.30
其中: 1. 基金申购款	856,084,192.76	708,394,689.77	1,564,478,882.53
2. 基金赎回款	-933,383,186.92	-777,832,981.91	-1,711,216,168.83
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)	295,107,143.56	334,538,734.79	629,645,878.35

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

华泰柏瑞创新升级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

(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]88号《关于核准华泰柏瑞创新升级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《华泰柏瑞创新升级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 267,666,871.23 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(2014)第 224 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 5 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 267,739,518.28 份基金份额,其中认购资金利息折合 72,647.05 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,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货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(须符合中国证监会相关规定)。本基金持有的股票占基金资产的比例为 30%-95%,其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%;债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-70%,其中,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为中证 TMT 产业主题指数收益率 $\times$ 20%+中证新兴产业指数收益率 $\times$ 40%+中债总指数(全价)收益率 $\times$ 40%。

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》、《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券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 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31

日止期间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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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) 对于内地投资者持有的基金类别，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，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
柏瑞投资有限责任公司	基金管理人的股东
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	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	239,402,452.59	5.98%	15,102,674.76	0.12%

##### 7.4.8.1.2 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	218,167.15	5.93%	218,167.15	29.36%

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	13,364.44	0.12%	-	-

### 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 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
当期发生的基金应支付 的管理费	5,709,592.99	10,665,474.37
其中：支付销售机构的客 户维护费	1,112,787.86	1,612,823.19

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 1.5%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 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	951,598.87	1,777,579.08

注：支付基金托管人中国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×0.25% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

### 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：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

注：本报告期末及上年可比期间基金管理人未投资本基金。

##### 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：本报告期末及上年可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 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	
	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	25,822,990.77	648,259.26	43,739,966.40	959,183.98

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：本基金报告期末未参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 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

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 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
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	1,908	40,640.40	40,640.40	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-

		日	日							
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	1,985	20,723.40	20,723.40	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	863	12,176.93	12,176.93	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	416	9,634.56	9,634.56	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

### 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
002239	奥特佳	2016年10月18日	临时停牌	15.57	2017年2月7日	14.12	1,196,662	16,282,791.49	18,632,027.34	-
000050	深天马A	2016年9月12日	临时停牌	18.82	-	-	1,800	38,477.18	33,876.00	-
300088	长信	2016	临时	15.80	-	-	1,534	23,536.07	24,237.20	-



	科技	年 9 月 12 日	停牌							
002635	安洁 科技	2016 年 11 月 8 日	临时 停牌	36.40	2017 年 2 月 8 日	33.50	600	23,574.61	21,840.00	-
300271	华宇 软件	2016 年 12 月 19 日	临时 停牌	17.45	-	-	500	9,574.20	8,725.00	-
300065	海兰 信	2016 年 12 月 8 日	临时 停牌	35.89	-	-	150	4,670.77	5,383.50	-

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

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。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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。

### 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 214,528,908.40 元，属于第二层次的余额为 19,079,013.21 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 460,240,310.85 元，第二层次的余额为 119,519,179.34 元，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，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	233,607,921.61	88.79
	其中：股票	233,607,921.61	88.79
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	27,363,690.88	10.40
7	其他各项资产	2,136,753.33	0.81
8	合计	263,108,365.82	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	2,137,814.40	0.82
B	采矿业	49,234.00	0.02
C	制造业	191,359,208.78	73.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,776.66	0.01
E	建筑业	157,937.89	0.06
F	批发和零售业	16,385,412.96	6.30
G	交通运输、仓储和邮政业	11,658.44	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	574,880.20	0.22
J	金融业	13,181,130.00	5.06
K	房地产业	2,652,577.95	1.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,982,758.40	2.68
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	76,531.93	0.03
S	综合	-	-
	合计	233,607,921.61	89.75

### 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：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 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	002239	奥特佳	1,196,662	18,632,027.34	7.16
2	002236	大华股份	937,650	12,827,052.00	4.93
3	300232	洲明科技	854,875	12,754,735.00	4.90
4	002519	银河电子	568,637	12,737,468.80	4.89
5	002475	立讯精密	598,087	12,410,305.25	4.77
6	600298	安琪酵母	588,518	10,487,390.76	4.03
7	600519	贵州茅台	28,908	9,659,608.20	3.71
8	600166	福田汽车	2,970,038	9,177,417.42	3.53
9	002138	顺络电子	523,900	9,068,709.00	3.48
10	002430	杭氧股份	977,050	8,451,482.50	3.25

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	002236	大华股份	41,170,594.58	6.54
2	002475	立讯精密	32,897,169.84	5.22
3	002616	长青集团	27,676,461.14	4.40
4	002502	骅威文化	27,372,106.42	4.35
5	002376	新北洋	26,031,877.92	4.13
6	300232	洲明科技	25,709,584.50	4.08
7	000959	首钢股份	25,473,996.02	4.05
8	002425	凯撒文化	24,617,011.15	3.91
9	300271	华宇软件	24,478,587.54	3.89
10	002322	理工环科	23,589,413.69	3.75
11	600885	宏发股份	22,820,639.62	3.62

12	601009	南京银行	22,722,697.11	3.61
13	601939	建设银行	22,284,993.00	3.54
14	601288	农业银行	21,951,049.00	3.49
15	300065	海兰信	21,696,647.49	3.45
16	600376	首开股份	19,218,846.10	3.05
17	601689	拓普集团	18,800,367.53	2.99
18	002239	奥特佳	18,780,735.66	2.98
19	600115	东方航空	18,722,868.28	2.97
20	600569	安阳钢铁	18,122,525.27	2.88
21	600782	新钢股份	17,849,888.74	2.83
22	600172	黄河旋风	17,806,042.43	2.83
23	300115	长盈精密	17,753,229.59	2.82
24	600519	贵州茅台	16,956,418.48	2.69
25	002299	圣农发展	16,804,294.35	2.67
26	002664	信质电机	16,440,551.32	2.61
27	002138	顺络电子	16,337,759.66	2.59
28	600166	福田汽车	16,193,151.94	2.57
29	600370	三房巷	16,085,082.92	2.55
30	300136	信维通信	15,867,909.31	2.52
31	002519	银河电子	15,724,349.10	2.50
32	300017	网宿科技	15,705,667.49	2.49
33	300359	全通教育	15,489,350.89	2.46
34	601166	兴业银行	15,198,151.30	2.41
35	601398	工商银行	15,159,190.00	2.41
36	002418	康盛股份	15,060,263.84	2.39
37	002001	新 和 成	14,960,419.00	2.38
38	300364	中文在线	14,625,964.76	2.32
39	600383	金地集团	14,409,450.50	2.29
40	300198	纳川股份	14,172,515.03	2.25
41	600298	安琪酵母	13,430,554.89	2.13
42	000971	高升控股	12,911,277.47	2.05
43	600188	兖州煤业	12,839,327.64	2.04
44	002368	太极股份	12,804,440.50	2.03
45	601699	潞安环能	12,678,933.91	2.01
46	601225	陕西煤业	12,609,236.78	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	000971	高升控股	72,119,137.24	11.45
2	002094	青岛金王	41,307,062.21	6.56
3	002425	凯撒文化	38,568,281.84	6.13
4	300136	信维通信	31,038,098.86	4.93
5	002376	新北洋	30,869,200.20	4.90
6	002236	大华股份	30,579,472.62	4.86
7	002616	长青集团	28,707,584.25	4.56
8	002502	骅威文化	28,346,386.15	4.50
9	000959	首钢股份	26,439,988.86	4.20
10	300271	华宇软件	25,843,198.70	4.10
11	002322	理工环科	24,013,454.01	3.81
12	601009	南京银行	22,259,065.61	3.54
13	601939	建设银行	22,126,565.21	3.51
14	601288	农业银行	21,860,971.00	3.47
15	300065	海兰信	21,106,187.50	3.35
16	600782	新钢股份	20,872,001.21	3.31
17	601689	拓普集团	20,665,713.76	3.28
18	600172	黄河旋风	19,885,502.64	3.16
19	002020	京新药业	19,394,015.76	3.08
20	600376	首开股份	19,261,604.93	3.06
21	600569	安阳钢铁	19,251,664.36	3.06
22	002475	立讯精密	19,060,163.81	3.03
23	300198	纳川股份	18,865,716.08	3.00
24	600115	东方航空	17,951,846.75	2.85
25	600885	宏发股份	17,896,480.46	2.84
26	300017	网宿科技	17,716,962.20	2.81
27	600370	三房巷	17,280,576.67	2.74
28	002299	圣农发展	17,159,647.51	2.73
29	600383	金地集团	16,554,595.62	2.63
30	002664	信质电机	16,537,441.09	2.63
31	002635	安洁科技	16,398,383.12	2.60
32	600233	圆通速递	16,183,200.00	2.57
33	600137	浪莎股份	16,105,576.52	2.56
34	002418	康盛股份	15,286,433.50	2.43

35	300359	全通教育	15,217,468.57	2.42
36	601398	工商银行	15,048,741.88	2.39
37	601166	兴业银行	14,917,556.80	2.37
38	000593	大通燃气	14,786,085.50	2.35
39	601699	潞安环能	14,327,065.91	2.28
40	600188	兖州煤业	14,009,033.22	2.22
41	300364	中文在线	13,926,352.10	2.21
42	600146	商赢环球	13,854,951.65	2.20
43	300232	洲明科技	13,783,363.28	2.19
44	601225	陕西煤业	13,679,578.05	2.17
45	300230	永利股份	13,648,754.99	2.17
46	600887	伊利股份	13,363,298.02	2.12
47	300207	欣旺达	13,317,674.15	2.12
48	600493	凤竹纺织	13,252,386.25	2.10
49	600706	曲江文旅	13,209,549.83	2.10
50	002229	鸿博股份	13,110,299.92	2.08
51	002196	方正电机	12,999,960.61	2.06
52	002001	新和成	12,936,355.87	2.05

### 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	1,880,659,192.15
卖出股票收入（成交）总额	2,125,427,081.36

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

### 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：无。

## 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	237,338.74
2	应收证券清算款	1,883,106.21
3	应收股利	-
4	应收利息	9,558.40
5	应收申购款	6,749.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,136,753.33

### 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	002239	奥特佳	18,632,027.34	7.16	停牌

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

4,828	29,142.45	63,620,352.25	45.22%	77,079,397.86	54.78%
-------	-----------	---------------	--------	---------------	--------

### 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	626,628.46	0.4454%

### 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年5月6日）基金份额总额	267,739,518.28
本报告期期初基金份额总额	295,107,143.56
本报告期基金总申购份额	140,925,747.80
减：本报告期基金总赎回份额	295,333,141.25
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	140,699,750.11

## § 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 70000 元人民币，该事务所已向本基金提供了 3 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
兴业证券	1	552,638,361.53	13.81%	503,618.57	13.70%	-
华创证券	1	429,574,552.97	10.73%	391,471.55	10.65%	-
华安证券	2	363,555,252.11	9.08%	333,775.45	9.08%	-
中信建投	3	324,626,044.22	8.11%	295,831.35	8.04%	-
万联证券	2	297,986,130.65	7.45%	274,669.94	7.47%	-
东北证券	1	276,316,766.63	6.90%	257,336.02	7.00%	-
银河证券	1	259,790,273.65	6.49%	241,942.26	6.58%	-
华泰证券	3	239,402,452.59	5.98%	218,167.15	5.93%	-
广发证券	1	234,890,265.91	5.87%	218,754.84	5.95%	-
长江证券	1	205,915,102.12	5.14%	191,771.11	5.21%	-
海通证券	2	177,088,880.68	4.42%	161,381.51	4.39%	-
齐鲁证券	2	123,102,845.02	3.08%	114,645.51	3.12%	-
信达证券	1	100,800,635.83	2.52%	91,860.22	2.50%	-
华融证券	1	97,496,382.86	2.44%	88,848.37	2.42%	-
国金证券	1	76,245,176.04	1.90%	71,006.98	1.93%	-
东吴证券	2	55,074,928.21	1.38%	50,189.96	1.36%	-
华鑫证券	1	54,239,935.31	1.36%	49,428.81	1.34%	-
国联证券	2	51,793,585.43	1.29%	47,199.62	1.28%	-
光大证券	2	42,056,031.28	1.05%	39,167.14	1.07%	-
浙商证券	2	39,825,791.63	1.00%	36,293.22	0.99%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

长城证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	42,000,000.00	100.00%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

北京高华	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

华泰柏瑞基金管理有限公司  
2017 年 3 月 29 日