

# 华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金 2016 年年度报告

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 重要提示及目录

### 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。

## 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.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	错误!未定义书签。
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
8.3 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.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52

8.7 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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
8.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
9.3 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 .....	54
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
11.4 基金投资策略的改变 .....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
11.8 其他重大事件 .....	58
<b>§12 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>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
13.1 备查文件目录 .....	59
13.2 存放地点 .....	60
13.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金
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
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 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	贾波	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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、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
本期加权平均净值利润率	-29.69%	38.39%	27.38%
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
期末可供分配利润	108,184,533.31	242,460,460.81	75,117,733.49
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
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	85.00%	113.40%	35.00%

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。

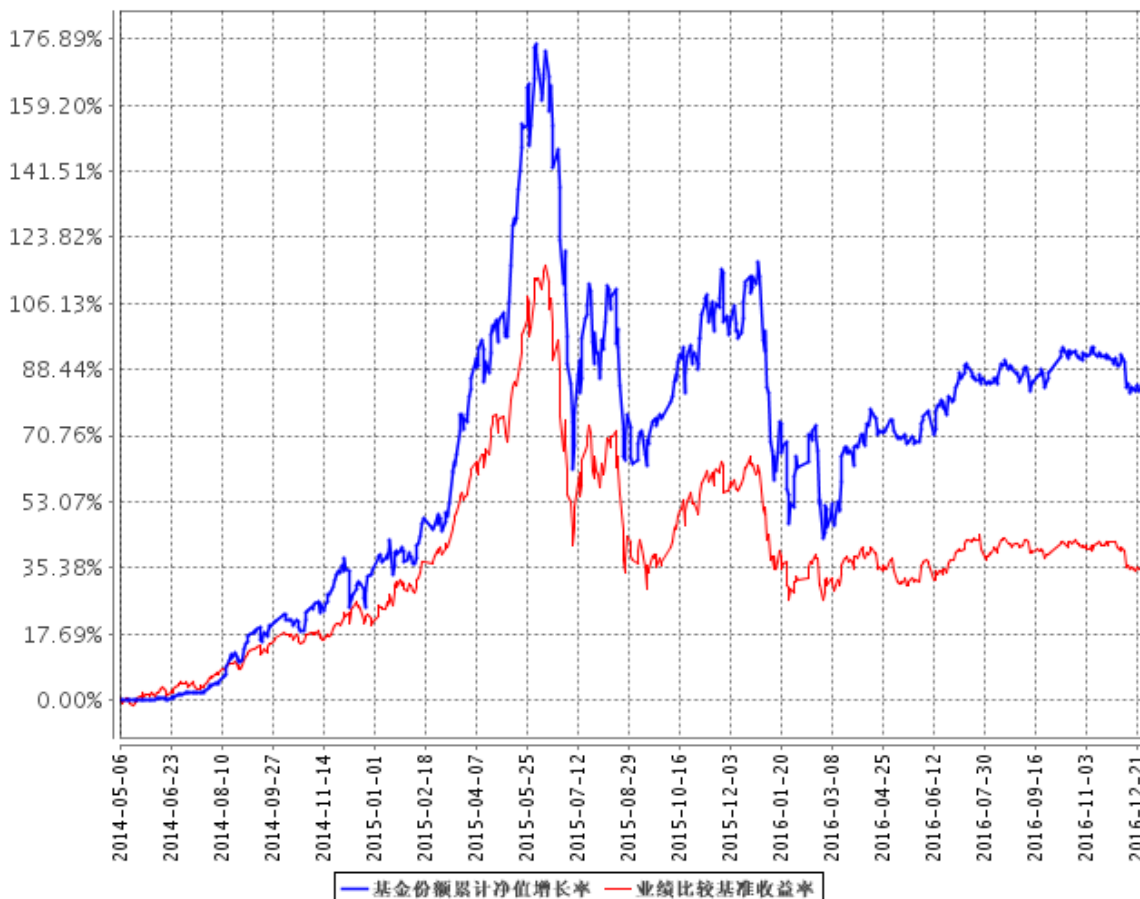
### 3.2 基金净值表现

#### 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

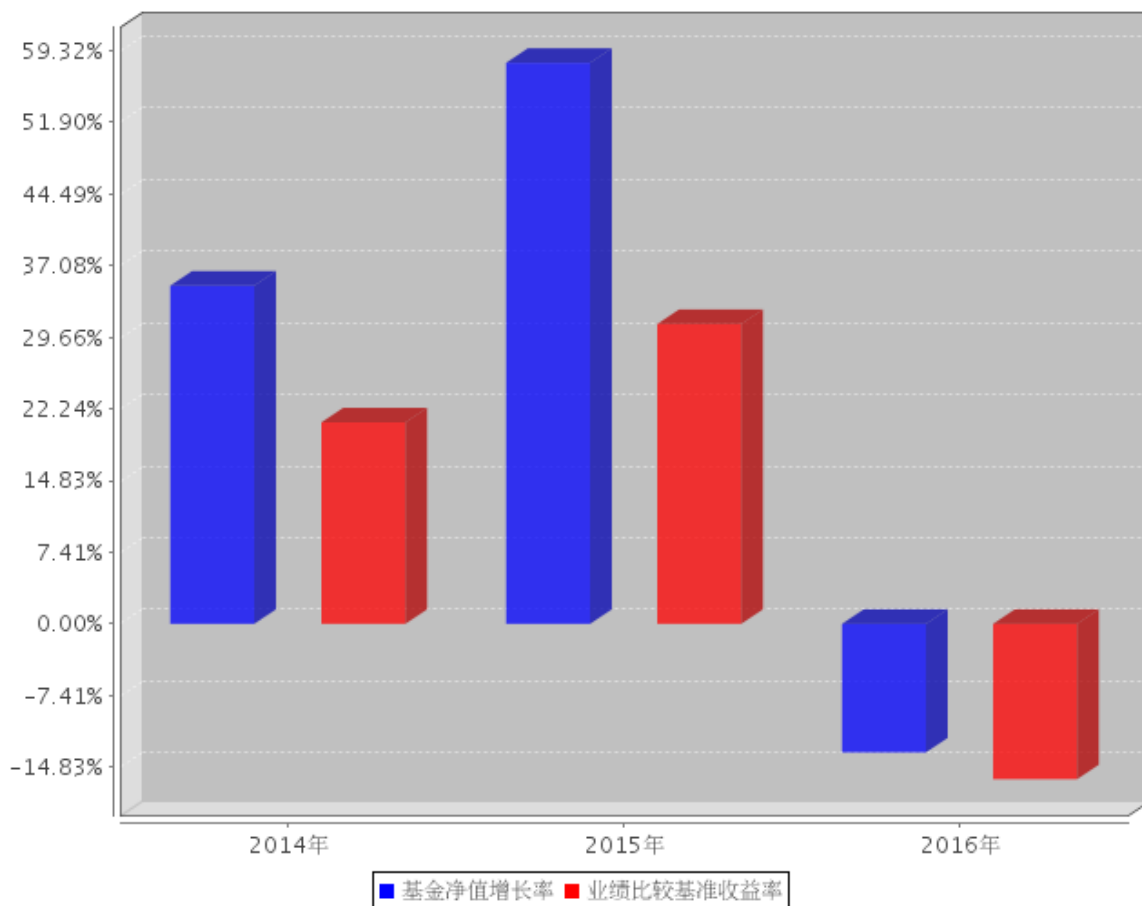


注：1. 图示日期为 2014 年 5 月 6 日至 2016 年 12 月 31 日。

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

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《华泰柏瑞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房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。

### § 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> <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	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,883,106.21	5,591,640.12
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-
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 2016 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	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	7.4.7.9	140,699,750.11	295,107,143.56
未分配利润	7.4.7.10	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 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
<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	7.4.7.11	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	7.4.7.12	-27,840,432.87	252,784,726.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	415,860.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,173,868.71	1,692,253.97
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-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）	7.4.7.18	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	7.4.10.2.1	5,709,592.99	10,665,474.37
2. 托管费	7.4.10.2.2	951,598.87	1,777,579.08
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	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	7.4.7.20	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（本期利润）	-	-111,967,168.84	-111,967,168.84
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
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		



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×20%+中证新兴产业指数收益率×40%+中债总指数（全价）收益率×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。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最

近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允



价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 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 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	25,822,990.77	43,739,966.43
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	25,822,990.77	43,739,966.43

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	234,047,554.45	233,607,921.61	-439,632.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	234,047,554.45	233,607,921.61	-439,632.84
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	506,655,876.53	579,759,490.19	73,103,613.66
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-

	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计	506,655,876.53	579,759,490.19	73,103,613.66	

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	8,664.29	17,361.90
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	776.63	3,401.18
应收债券利息	-	-
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	117.48	381.04
合计	9,558.40	21,144.12

### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	743, 108. 08	4, 593, 719. 19
银行间市场应付交易费用	-	225. 00
合计	743, 108. 08	4, 593, 944. 19

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2, 101. 36	1, 368. 48
预提费用	370, 000. 00	370, 000. 00
合计	372, 101. 36	371, 368. 48

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	295, 107, 143. 56	295, 107, 143. 56
本期申购	140, 925, 747. 80	140, 925, 747. 80
本期赎回（以“-”号填列）	-295, 333, 141. 25	-295, 333, 141. 25
- 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	140, 699, 750. 11	140, 699, 750. 11

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	242, 460, 460. 81	92, 078, 273. 98	334, 538, 734. 79
本期利润	-38, 423, 922. 34	-73, 543, 246. 50	-111, 967, 168. 84
本期基金份额交易产生的变动数	-95, 852, 005. 16	-7, 141, 271. 33	-102, 993, 276. 49
其中：基金申购款	96, 485, 362. 39	9, 950, 215. 89	106, 435, 578. 28
基金赎回款	-192, 337, 367. 55	-17, 091, 487. 22	-209, 428, 854. 77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	108, 184, 533. 31	11, 393, 756. 15	119, 578, 289. 46

### 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	648,259.26	959,183.98
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	29,327.98	217,035.97
其他	15,125.91	36,458.99
合计	692,713.45	1,212,678.94

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	2,125,427,081.36	6,279,328,077.33
减：卖出股票成本总额	2,153,267,514.23	6,026,543,350.51
买卖股票差价收入	-27,840,432.87	252,784,726.82

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	-	415,860.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	415,860.00

#### 7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	32,138,512.95
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	30,994,530.00
减：应收利息总额	-	728,122.95
买卖债券差价收入	-	415,860.00

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内未投资资产支持证券。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内未投资贵金属。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内未投资贵金属。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内未投资贵金属。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未投资贵金属。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内未投资衍生工具。

### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期内未投资衍生工具。

### 7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	1,173,868.71	1,692,253.97
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,173,868.71	1,692,253.97

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-73,543,246.50	39,606,852.55
——股票投资	-73,543,246.50	39,606,852.55
——债券投资	-	-
——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	-73,543,246.50	39,606,852.55

### 7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	748,929.07	8,871,592.76
转换费收入	29,624.18	305,622.92
合计	778,553.25	9,177,215.68

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

2、本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用的 25% 的部分归



入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	6,157,856.74	18,851,210.73
银行间市场交易费用	-	450.00
合计	6,157,856.74	18,851,660.73

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行划款手续费	24,402.37	47,453.47
银行间账户服务费	22,700.00	13,700.00
合计	417,102.37	431,153.47

#### 7.4.7.21 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) 本基金的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，不需要披露分部信息。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

### 7.4.9 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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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%

##### 7.4.10.1.2 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。

### 7.4.10.1.3 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%	-	-

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年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。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

### 7.4.10.3 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。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期末及上年可比期间基金管理人未投资本基金。

#### 7.4.10.4.2 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：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。

### 7.4.10.5 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。

### 7.4.10.6 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。

### 7.4.10.7 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。

### 7.4.11 利润分配情况

#### 7.4.11.1 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。

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

#### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位:股)	成本总额	总额	
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	-
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	-

#### 7.4.12.2 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	复牌日期	复牌开盘单	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	-------	-------	--------	--------	----

				价		价				
002239	奥特佳	2016 年 10 月 18 日	临时停 牌	15.57	-	-	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	长信科 技	2016 年 9 月 12 日	临时停 牌	15.80	-	-	1,534	23,536.07	24,237.20	-
002635	安洁科 技	2016 年 11 月 8 日	临时停 牌	36.40	-	-	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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

#### 7.4.13.3 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公司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 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	25,822,990.77	-	-	-	-	-	25,822,990.77



结算备付金	1,540,700.11	-	-	-	-	-	1,540,700.11
存出保证金	237,338.74	-	-	-	-	-	237,338.74
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-233,607,921.61	233,607,921.61
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,883,106.21	1,883,106.21
应收利息	-	-	-	-	-	9,558.40	9,558.40
应收申购款	-	-	-	-	-	6,749.98	6,749.98
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	27,601,029.62	-	-	-	-	-235,507,336.20	263,108,365.82
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	339,917.11	339,917.11
应付赎回款	-	-	-	-	-	931,494.35	931,494.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	380,318.88	380,318.88
应付托管费	-	-	-	-	-	63,386.47	63,386.47
应付交易费用	-	-	-	-	-	743,108.08	743,108.08
其他负债	-	-	-	-	-	372,101.36	372,101.36
负债总计	-	-	-	-	-	2,830,326.25	2,830,326.25
利率敏感度缺口	27,601,029.62	-	-	-	-	-232,677,009.95	260,278,039.57
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	43,739,966.43	-	-	-	-	-	43,739,966.43
结算备付金	5,605,128.35	-	-	-	-	-	5,605,128.35
存出保证金	769,661.71	-	-	-	-	-	769,661.71
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-579,759,490.19	579,759,490.19
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,591,640.12	5,591,640.12
应收利息	-	-	-	-	-	21,144.12	21,144.12
应收申购款	-	-	-	-	-	760,600.55	760,600.55
资产总计	50,114,756.49	-	-	-	-	-586,132,874.98	636,247,631.47
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	737,452.73	737,452.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	770,560.90	770,560.90
应付托管费	-	-	-	-	-	128,426.82	128,426.82
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,593,944.19	4,593,944.19
其他负债	-	-	-	-	-	371,368.48	371,368.48
负债总计	-	-	-	-	-	6,601,753.12	6,601,753.12
利率敏感度缺口	50,114,756.49	-	-	-	-	-579,531,121.86	629,645,878.35

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产

净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的方法，深入挖掘在中国经济结构调整和产业升级过程中出现的主题投资机会。持续跟踪国家政策、产业发展趋势、技术、工艺、商业模式的最新变化，对创新和转型升级主题相关行业的范围进行动态调整。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金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% 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	233,607,921.61	89.75	579,759,490.19	92.08
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	233,607,921.61	89.75	579,759,490.19	92.08

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除本基金业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准下降 5%	-11,760,000.00	-26,040,000.00
业绩比较基准上升 5%	11,760,000.00	26,040,000.00	

#### 7.4.14 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	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
11	300115	长盈精密	307,514	8,013,814.84	3.08
12	600056	中国医药	376,292	7,160,836.76	2.75
13	000826	启迪桑德	206,440	6,808,391.20	2.62
14	600109	国金证券	495,000	6,449,850.00	2.48
15	601377	兴业证券	828,800	6,340,320.00	2.44
16	002007	华兰生物	170,500	6,095,375.00	2.34
17	000066	长城电脑	479,872	5,969,607.68	2.29
18	002273	水晶光电	292,737	5,825,466.30	2.24
19	000568	泸州老窖	176,209	5,814,897.00	2.23
20	600885	宏发股份	176,100	5,626,395.00	2.16
21	603868	飞科电器	117,480	5,505,112.80	2.12
22	600511	国药股份	170,078	5,119,347.80	1.97
23	601607	上海医药	252,824	4,945,237.44	1.90
24	000915	山大华特	114,054	4,805,095.02	1.85
25	300199	翰宇药业	235,543	4,235,063.14	1.63
26	000028	国药一致	58,100	3,886,890.00	1.49
27	600329	中新药业	204,400	3,564,736.00	1.37
28	600525	长园集团	249,927	3,486,481.65	1.34
29	600160	巨化股份	250,000	2,645,000.00	1.02
30	600240	华业资本	240,000	2,577,600.00	0.99
31	000858	五粮液	73,859	2,546,658.32	0.98
32	000501	鄂武商A	121,200	2,365,824.00	0.91
33	300106	西部牧业	130,800	2,109,804.00	0.81
34	600268	国电南自	137,500	1,240,250.00	0.48
35	300370	安控科技	96,500	891,660.00	0.34
36	002195	二三四五	27,000	305,640.00	0.12
37	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.09
38	600054	黄山旅游	10,864	174,367.20	0.07
39	601233	桐昆股份	9,800	140,728.00	0.05
40	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.05
41	601328	交通银行	21,200	122,324.00	0.05
42	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.04
43	603098	森特股份	4,293	103,332.51	0.04
44	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.03
45	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.03
46	002322	理工环科	2,945	70,267.70	0.03
47	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.03

48	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.02
49	300207	欣旺达	4,400	61,160.00	0.02
50	600383	金地集团	4,700	60,912.00	0.02
51	300336	新文化	2,861	56,218.65	0.02
52	002281	光迅科技	700	54,950.00	0.02
53	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.02
54	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.02
55	600887	伊利股份	2,659	46,798.40	0.02
56	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.02
57	002353	杰瑞股份	2,101	42,650.30	0.02
58	002277	友阿股份	2,955	42,433.80	0.02
59	603877	太平鸟	1,908	40,640.40	0.02
60	002304	洋河股份	560	39,536.00	0.02
61	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.01
62	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
63	603218	日月股份	826	34,402.90	0.01
64	603609	禾丰牧业	2,623	33,915.39	0.01
65	000050	深天马 A	1,800	33,876.00	0.01
66	300197	铁汉生态	2,600	32,968.00	0.01
67	601939	建设银行	5,900	32,096.00	0.01
68	600000	浦发银行	1,900	30,799.00	0.01
69	600498	烽火通信	1,200	30,252.00	0.01
70	600036	招商银行	1,680	29,568.00	0.01
71	603886	元祖股份	1,618	28,638.60	0.01
72	601288	农业银行	9,200	28,520.00	0.01
73	600188	兖州煤业	2,600	28,236.00	0.01
74	002299	圣农发展	1,320	28,010.40	0.01
75	000060	中金岭南	2,300	25,645.00	0.01
76	300088	长信科技	1,534	24,237.20	0.01
77	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
78	601818	光大银行	6,100	23,851.00	0.01
79	002110	三钢闽光	1,764	23,284.80	0.01
80	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.01
81	600826	兰生股份	806	22,019.92	0.01
82	600688	上海石化	3,400	21,896.00	0.01
83	002635	安洁科技	600	21,840.00	0.01
84	002249	大洋电机	2,490	21,488.70	0.01
85	603239	浙江仙通	679	21,354.55	0.01
86	603035	常熟汽饰	1,985	20,723.40	0.01

87	300364	中文在线	514	20,313.28	0.01
88	300113	顺网科技	700	18,823.00	0.01
89	600782	新钢股份	5,424	18,116.16	0.01
90	603989	艾华集团	479	17,631.99	0.01
91	601166	兴业银行	1,000	16,140.00	0.01
92	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.01
93	000959	首钢股份	2,200	14,564.00	0.01
94	300078	思创医惠	547	14,172.77	0.01
95	601689	拓普集团	476	14,003.92	0.01
96	300136	信维通信	487	13,879.50	0.01
97	002616	长青集团	670	13,359.80	0.01
98	300587	天铁股份	863	12,176.93	0.00
99	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
100	002245	澳洋顺昌	1,307	11,658.44	0.00
101	002094	青岛金王	386	11,580.00	0.00
102	603008	喜临门	594	10,870.20	0.00
103	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
104	000823	超声电子	800	9,944.00	0.00
105	603228	景旺电子	416	9,634.56	0.00
106	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
107	300271	华宇软件	500	8,725.00	0.00
108	000752	西藏发展	500	8,280.00	0.00
109	600048	保利地产	800	7,304.00	0.00
110	600547	山东黄金	200	7,302.00	0.00
111	601699	潞安环能	900	7,245.00	0.00
112	002196	方正电机	300	7,188.00	0.00
113	300296	利亚德	204	6,878.88	0.00
114	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00
115	600869	智慧能源	874	6,764.76	0.00
116	002050	三花智控	600	6,624.00	0.00
117	300065	海兰信	150	5,383.50	0.00
118	600491	龙元建设	400	4,616.00	0.00
119	600507	方大特钢	600	4,062.00	0.00
120	002640	跨境通	200	3,660.00	0.00
121	600376	首开股份	295	3,483.95	0.00
122	002068	黑猫股份	400	3,352.00	0.00
123	001979	招商蛇口	200	3,278.00	0.00
124	600839	四川长虹	670	2,800.60	0.00
125	600489	中金黄金	200	2,418.00	0.00



126	002155	湖南黄金	200	2,290.00	0.00
127	600667	太极实业	241	1,858.11	0.00
128	601898	中煤能源	300	1,743.00	0.00
129	002310	东方园林	101	1,429.15	0.00
130	601398	工商银行	200	882.00	0.00
131	000601	韶能股份	100	859.00	0.00
132	600006	东风汽车	100	688.00	0.00
133	000596	古井贡酒	10	455.00	0.00

## 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：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。

### 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

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

## § 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%

### 9.2 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%

### 9.3 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

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			
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	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金招募说明书正文 2016 年 2 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 19 日
2	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金招募说明书摘要 2016 年 2 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 19 日
3	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 10 月 25 日
4	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金 2016 年半年报摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 27 日
5	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金	中国证券报、上海证	2016 年 8 月 27 日

	资基金 2016 年半年报	券报、证券时报	
6	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资 资基金 2016 年第二季度报告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2016 年 7 月 21 日
7	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资 资基金招募说明书正文 2016 年 1 号	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2016 年 6 月 18 日
8	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资 资基金招募说明书摘要 2016 年 1 号	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2016 年 6 月 18 日
9	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资 资基金 2016 年一季报	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2016 年 4 月 20 日
10	华泰柏瑞基金继续参加中国工商 银行个人电子银行基金申购费率 优惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2016 年 3 月 31 日
11	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资 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
12	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资 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
13	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资 资基金 2015 年四季度报告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2016 年 1 月 21 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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

## 12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层。

## 12.3 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  
2017 年 3 月 29 日