

华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 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及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	40
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	42
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
§11 备查文件目录.....	46
11.1 备查文件目录.....	46
11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	46

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞积极成长混合
基金主代码	460002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 5 月 29 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,889,108,289.32 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和风险管理手段，投资于具备持续突出增长能力的优秀企业，辅以特定市场状况下的大类资产配置调整，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票类资产为主要投资工具，通过精选个股获取资产的长期增值；通过适度的大类资产配置来降低组合的系统性风险。本基金将“自上而下”的趋势投资和“自下而上”的个股选择相结合。投资决策的重点在于寻找具有巨大发展潜力的趋势，发现并投资于有能力把握趋势并在竞争中处于优势的公司。
业绩比较基准	沪深 300 指数×60%+中信标普国债指数×40%
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
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	北京市复兴门内大街 1 号

	1 号 17 层	
邮政编码	200135	100818
法定代表人	齐亮	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,049,199,828.93
本期利润	1,280,472,602.58
加权平均基金份额本期利润	0.6202
本期加权平均净值利润率	35.46%
本期基金份额净值增长率	49.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,459,217,554.40
期末可供分配基金份额利润	0.7724
期末基金资产净值	3,953,518,842.33
期末基金份额净值	2.0928
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	133.86%

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.51%	3.73%	-4.27%	2.11%	3.76%	1.62%
过去三个月	23.64%	2.85%	7.50%	1.57%	16.14%	1.28%
过去六个月	49.55%	2.38%	17.23%	1.36%	32.32%	1.02%
过去一年	151.81%	1.91%	59.62%	1.11%	92.19%	0.80%
过去三年	187.01%	1.46%	52.24%	0.90%	134.77%	0.56%
自基金合同生效起至今	133.86%	1.51%	29.67%	1.13%	104.19%	0.38%

注：本基金的业绩基准由沪深 300 指数和中信标普国债指数按照 60%与 40%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 2007 年 5 月 29 日至 2015 年 6 月 30 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 30%-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%-70%。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司（原友邦华泰基金管理有限公司）。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原

AIGGIC) 和苏州新区高新技术产业股份有限公司, 出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金、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、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金、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、华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金、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发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金和华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金。截至 2015 年 6 月 30 日, 公司的公募基金管理规模为 766.62 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		
方伦煜	投资部总监、本基金的基金经理	2012 年 4 月 18 日	-	15	方伦煜先生, 管理学硕士, 15 年证券从业经历, 历任广发证券股份有限公司行业研究员、招商

					<p>证券有限公司投资经理、巨田基金管理有限公司研究员，广发证券股份有限公司投资经理。</p> <p>2008 年 6 月至 2010 年 2 月任中国人寿资产管理有限公司投资经理，2010 年 2 月至 2012 年 2 月任职于华安基金管理有限公司基金投资部，2012 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2012 年 4 月起担任华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2015 年 3 月起担任华泰柏瑞积极优选股票型证券投资</p>
--	--	--	--	--	--

					基金的基金经理。 2015 年 4 月起任投资部副总监。 2015 年 6 月起任投资部总监。
--	--	--	--	--	---

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、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

尽管没有基本面的支撑，但 A 股上半年走出了一轮超出市场大多数人预料的“改革牛”。随着监管部门规范股市杠杆，6 月中旬以后市场出现急跌、暴跌，上半年所谓的牛市似乎更像是

“杠杆泡沫”。

尽管我们此前有所准备，但下跌如此之迅猛，加之对政策作用估计过高，以致我们未能及时、果断降低仓位。虽然本基金在个股配置方面做好了应对市场出现极端变化的准备，但在高杠杆去化导致的“踩踏”过程中，“泥沙俱下”，我们精选的股票也同样暴跌，基金净值大幅回撤。

报告期内组合配置重点主要集中在国企改革相关个股和受益于油价低迷的航空、航运等板块。

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 2.0928 元，本报告期份额净值增长率为 49.55%，同期业绩比较基准增长率为 17.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着各项促进经济增长举措的实施以及改革的稳步推进，中国经济走稳是大概率事件。经过 6 月中下旬以来的大幅下跌，市场总体风险释放较为充分。在以证金公司为代表的“救市国家队”的努力下，市场情绪已经稳定下来。展望后市，下半年流动性宽松的局面不会改变，政策呵护市场的基调不变，尽管经济基本面仍难以出现明显改善，但如果在政策的支持下市场能找到新的、较大的主题性机会，不排除下半年市场出现结构性行情的可能。

在经济转型的大背景下，国企改革、新能源、节能环保和一些业绩出现大幅改善的个股存在较好的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、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。

4.7 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已实现净收益的 25%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。截至本报告期末，本基金已进行利润分配，于 1 月 20 日每份分 0.085 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

报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华泰柏瑞积极成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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	179,409,463.84	338,849,433.97
结算备付金		3,750,906.53	11,477,152.54
存出保证金		1,474,040.34	685,840.42
交易性金融资产	6.4.7.2	3,840,939,063.03	3,618,609,596.45
其中：股票投资		3,730,548,063.03	3,438,426,596.45
基金投资		-	-
债券投资		110,391,000.00	180,183,000.00

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	60,980,136.47
应收证券清算款		27,015,169.07	25,182,078.97
应收利息	6.4.7.5	2,858,721.20	5,756,012.22
应收股利		-	-
应收申购款		42,897,091.77	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,098,344,455.78	4,061,540,251.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	90,077,084.74
应付赎回款		133,779,867.73	159,331,658.44
应付管理人报酬		5,122,205.59	4,807,241.68
应付托管费		853,700.92	801,206.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,911,222.60	5,703,950.50
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,158,616.61	1,517,246.58
负债合计		144,825,613.45	262,238,388.89
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,889,108,289.32	2,550,314,898.45
未分配利润	6.4.7.10	2,064,410,553.01	1,248,986,963.70
所有者权益合计		3,953,518,842.33	3,799,301,862.15
负债和所有者权益总计		4,098,344,455.78	4,061,540,251.04

注： 报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.0928 元，基金份额总额 1,889,108,289.32 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		1,325,457,880.80	-22,252,082.73
1.利息收入		5,002,616.25	6,058,657.57
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,120,353.59	572,234.48
债券利息收入		2,972,060.28	3,892,446.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		910,202.38	1,593,976.45
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,086,927,901.33	122,009,497.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,077,336,419.54	91,903,738.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-319,510.00	-2,125,251.20
资产支持证券投资	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	9,910,991.79	32,231,010.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	231,272,773.65	-151,024,354.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,254,589.57	704,116.44
减：二、费用		44,985,278.22	27,388,129.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,803,993.52	17,847,107.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,467,332.27	2,974,517.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	13,466,256.81	6,336,096.84
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	247,695.62	230,407.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,280,472,602.58	-49,640,212.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,280,472,602.58	-49,640,212.18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,550,314,898.45	1,248,986,963.70	3,799,301,862.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,280,472,602.58	1,280,472,602.58
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)	-661,206,609.13	-262,587,047.93	-923,793,657.06
其中: 1.基金申购款	1,205,100,734.32	1,219,431,714.94	2,424,532,449.26
2.基金赎回款	-1,866,307,343.45	-1,482,018,762.87	-3,348,326,106.32
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)	-	-202,461,965.34	-202,461,965.34
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,889,108,289.32	2,064,410,553.01	3,953,518,842.33
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,985,731,086.29	-295,492,036.61	2,690,239,049.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-49,640,212.18	-49,640,212.18
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)	-459,935,106.61	54,029,762.54	-405,905,344.07
其中: 1.基金申购款	103,314,920.16	-14,708,801.75	88,606,118.41
2.基金赎回款	-563,250,026.77	68,738,564.29	-494,511,462.48
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)	2,525,795,979.68	-291,102,486.25	2,234,693,493.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 韩勇 _____	_____ 房伟力 _____	_____ 赵景云 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞积极成长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”)证监基金字[2007]第 131 号《关于同意友邦华泰积极成长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《华泰柏瑞积极成长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 8,920,448,257.95 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(2007)第 065 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金合同》于 2007 年 5 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 8,921,315,668.58 份基金份额,其中认购资金利息折合 867,410.63 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《华泰柏瑞积极成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、现金、短期金融工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 30%-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%-70%,其中,本基金持有全部股改权证的市值不得超过基金资产净值的 3%,本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%。本基金的业绩基准为:沪深 300 指数×60%+中信标普国债指数×40%。本财务报表由本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2015 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定

(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年1月1日至2014年6月30日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2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

除6.4.5.2会计估计变更的说明外，其他会计政策和会计估计与上年度相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

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)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	179,409,463.84
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	179,409,463.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,889,321,951.64	3,730,548,063.03	841,226,111.39
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	-	-	-
交易所市场	-	-	-

	银行间市场	109,953,360.00	110,391,000.00	437,640.00
	合计	109,953,360.00	110,391,000.00	437,640.00
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	2,999,275,311.64	3,840,939,063.03	841,663,751.39

注：1、债券投资中银行间同业市场交易债券均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公司独立提供。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	53,158.80
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	1,688.14
应收债券利息	2,803,210.96
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	663.30
合计	2,858,721.20

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,910,772.60
银行间市场应付交易费用	450.00
合计	3,911,222.60

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	360,262.33
预提费用	298,354.28
合计	1,158,616.61

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,550,314,898.45	2,550,314,898.45
本期申购	1,205,100,734.32	1,205,100,734.32
本期赎回(以“-”号填列)	-1,866,307,343.45	-1,866,307,343.45
- 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	1,889,108,289.32	1,889,108,289.32

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	847,369,873.84	401,617,089.86	1,248,986,963.70
本期利润	1,049,199,828.93	231,272,773.65	1,280,472,602.58
本期基金份额交易产生的变动数	-234,890,183.03	-27,696,864.90	-262,587,047.93
其中：基金申购款	701,608,912.48	517,822,802.46	1,219,431,714.94
基金赎回款	-936,499,095.51	-545,519,667.36	-1,482,018,762.87
本期已分配利润	-202,461,965.34	0.00	-202,461,965.34

本期末	1,459,217,554.40	605,192,998.61	2,064,410,553.01
-----	------------------	----------------	------------------

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	1,036,299.54
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	74,461.77
其他	9,592.28
合计	1,120,353.59

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	4,781,497,011.05
减：卖出股票成本总额	3,704,160,591.51
买卖股票差价收入	1,077,336,419.54

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-319,510.00
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	-319,510.00

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	136,159,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	130,319,510.00
减：应收利息总额	6,159,000.00
买卖债券差价收入	-319,510.00

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期末无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,910,991.79
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,910,991.79

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	231,272,773.65
——股票投资	230,731,223.65
——债券投资	541,550.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
合计	231, 272, 773. 65

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2, 167, 716. 33
转换费收入	86, 873. 24
合计	2, 254, 589. 57

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、本基金的转换费由基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用中的 25% 归入基金财产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	13, 465, 806. 81
银行间市场交易费用	450. 00
合计	13, 466, 256. 81

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	49, 588. 57
信息披露费	148, 765. 71
银行划款手续费	26, 641. 34
银行间帐户服务费	22, 500. 00
CFCA 证书费	200. 00
合计	247, 695. 62

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截止资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表或有事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：1、关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	937,890,296.02	10.97%	295,032,375.04	7.11%

债券交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券交易。

债券回购交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券回购交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30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	851,550.95	11.06%	735,175.59	18.80%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	262,249.65	7.04%	7,356.24	0.31%

注：上述佣金按股票交易量的千分之一计算，以扣除证管费和经手费后的净额列示。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。

关联方的佣金比率和计算方式与非关联方一致。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	26,803,993.52	17,847,107.51
其中：支付销售机构的 客户维护费	4,957,398.64	4,154,968.14

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付	4,467,332.27	2,974,517.99

的托管费		
------	--	--

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2007 年 5 月 29 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	4,661,072.26
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	4,661,072.26
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.1800%

注：本报告期内，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期及 2014 年度，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国银行股份有限公司	179,409,463.84	1,036,299.54	32,536,458.28

注：本报告期，基金托管人中国银行股份有限公司保管的银行存款按银行间同业存款利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配 合计	备注
1	2015 年 1 月 20 日	2015 年 1 月 20 日	0.8500	116,881,266.65	85,580,698.69	202,461,965.34	
合计	-	-	0.8500	116,881,266.65	85,580,698.69	202,461,965.34	

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
601111	中国 国航	2015 年 6 月 30 日	临时 停牌	15.36	2015 年 7 月 29 日	13.78	7,921,071	48,973,973.49	121,667,650.56	-

600153	建发股份	2015年6月29日	临时停牌	17.51	-	-	6,001,796	54,098,439.73	105,091,447.96	-
000778	新兴铸管	2015年6月15日	临时停牌	12.96	-	-	7,586,144	38,122,885.94	98,316,426.24	-
000539	粤电力A	2015年6月8日	临时停牌	11.94	2015年7月21日	10.75	3,891,117	31,008,909.32	46,459,936.98	-
002320	海峡股份	2015年6月26日	临时停牌	27.43	-	-	1,691,822	23,277,113.34	46,406,677.46	-
600395	盘江股份	2015年6月9日	临时停牌	15.71	2015年8月19日	14.00	1,949,781	16,191,549.22	30,631,059.51	-
000963	华东医药	2015年6月26日	临时停牌	71.48	2015年8月5日	69.20	400,566	21,786,706.36	28,632,457.68	-
002353	杰瑞股份	2015年5月27日	临时停牌	44.35	-	-	599,947	24,787,280.72	26,607,649.45	-
600643	爱建股份	2015年6月30日	临时停牌	16.73	-	-	1,300,000	29,443,297.00	21,749,000.00	-
002091	江苏国泰	2015年6月1日	临时停牌	26.22	-	-	100	1,629.70	2,622.00	-

注：1、本基金截至 2015 年 6 月 30 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期内无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期内无交易所市场债券正回购。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，通过主动投资追求适度风险水平下的较高收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 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。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	179,409,463.84	-	-	-	-	-	179,409,463.84
结算备付金	3,750,906.53	-	-	-	-	-	3,750,906.53
存出保证金	1,474,040.34	-	-	-	-	-	1,474,040.34
交易性金融资产	50,025,000.00	-	60,366,000.00	-	-	-3,730,548,063.03	3,840,939,063.03
应收证券清算款	-	-	-	-	-	27,015,169.07	27,015,169.07
应收利息	-	-	-	-	-	2,858,721.20	2,858,721.20
应收申购款	-	-	-	-	-	42,897,091.77	42,897,091.77
资产总计	234,659,410.71	-	60,366,000.00	-	-	-3,803,319,045.07	4,098,344,455.78
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	133,779,867.73	133,779,867.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,122,205.59	5,122,205.59
应付托管费	-	-	-	-	-	853,700.92	853,700.92
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,911,222.60	3,911,222.60
其他负债	-	-	-	-	-	1,158,616.61	1,158,616.61
负债总计	-	-	-	-	-	144,825,613.45	144,825,613.45
利率敏感度缺口	234,659,410.71	-	60,366,000.00	-	-	-3,658,493,431.62	3,953,518,842.33
上年度末 2014 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	338,849,433.97	-	-	-	-	-	338,849,433.97
结算备付金	11,477,152.54	-	-	-	-	-	11,477,152.54

存出保证金	685,840.42	-	-	-	-	685,840.42
交易性金融资产	30,006,000.00	-150,177,000.00	-	-	-3,438,426,596.45	3,618,609,596.45
买入返售金融资产	60,980,000.00	-	-	-	-	60,980,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	25,182,078.97	25,182,078.97
应收利息	-	-	-	-	5,756,012.22	5,756,012.22
其他资产	-	-	-	-	136.47	136.47
资产总计	441,998,426.93	-150,177,000.00	-	-	-3,469,364,824.11	4,061,540,251.04
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	90,077,084.74	90,077,084.74
应付赎回款	-	-	-	-	159,331,658.44	159,331,658.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,807,241.68	4,807,241.68
应付托管费	-	-	-	-	801,206.95	801,206.95
应付交易费用	-	-	-	-	5,703,950.50	5,703,950.50
其他负债	-	-	-	-	1,517,246.58	1,517,246.58
负债总计	-	-	-	-	262,238,388.89	262,238,388.89
利率敏感度缺口	441,998,426.93	-150,177,000.00	-	-	-3,207,126,435.22	3,799,301,862.15

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：截至 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.79% (2014 年 12 月 31 日：4.74%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的

30%-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%-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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	3,730,548,063.03	94.36	3,438,426,596.45	90.50
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	3,730,548,063.03	94.36	3,438,426,596.45	90.50

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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：人民币万元）	
		本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	增加约 18770 万元	增加约 12113 万元
	业绩比较基准下降 5%	减少约 18770 万元	减少约 12113 万元

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,730,548,063.03	91.03

	其中：股票	3,730,548,063.03	91.03
2	固定收益投资	110,391,000.00	2.69
	其中：债券	110,391,000.00	2.69
	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	183,160,370.37	4.47
7	其他各项资产	74,245,022.38	1.81
8	合计	4,098,344,455.78	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	68,011,603.40	1.72
B	采矿业	58,155,809.51	1.47
C	制造业	1,157,998,474.05	29.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	239,335,044.76	6.05
E	建筑业	149,590,167.75	3.78
F	批发和零售业	427,428,239.46	10.81
G	交通运输、仓储和邮政业	1,431,097,155.79	36.20
H	住宿和餐饮业	35,373,640.75	0.89
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	21,749,000.00	0.55
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,759,891.25	0.04
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	78,209,289.00	1.98
S	综合	61,839,747.31	1.56
	合计	3,730,548,063.03	94.36

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	603167	渤海轮渡	12,820,489	213,204,732.07	5.39
2	600029	南方航空	12,836,890	186,648,380.60	4.72
3	600350	山东高速	17,571,211	150,409,566.16	3.80
4	600115	东方航空	10,994,908	135,457,266.56	3.43
5	000417	合肥百货	10,408,392	127,502,802.00	3.23
6	000498	山东路桥	13,500,847	123,937,775.46	3.13
7	002465	海格通信	3,846,468	123,817,804.92	3.13
8	601111	中国国航	7,921,071	121,667,650.56	3.08
9	600221	海南航空	18,576,565	118,704,250.35	3.00
10	600153	建发股份	6,001,796	105,091,447.96	2.66
11	000778	新兴铸管	7,586,144	98,316,426.24	2.49
12	000429	粤高速 A	11,853,046	95,417,020.30	2.41
13	600500	中化国际	5,277,598	92,252,413.04	2.33
14	600789	鲁抗医药	4,965,784	80,793,305.68	2.04
15	600033	福建高速	13,423,156	78,659,694.16	1.99
16	601999	出版传媒	5,499,950	78,209,289.00	1.98
17	601872	招商轮船	6,057,291	72,687,492.00	1.84
18	000529	广弘控股	4,547,351	72,621,195.47	1.84
19	600012	皖通高速	5,547,014	72,000,241.72	1.82
20	000713	丰乐种业	4,788,752	68,000,278.40	1.72
21	600270	外运发展	2,163,563	63,089,497.08	1.60
22	002202	金风科技	3,231,240	62,912,242.80	1.59
23	002187	广百股份	3,227,536	60,354,923.20	1.53
24	600858	银座股份	4,248,864	58,294,414.08	1.47
25	000830	鲁西化工	5,713,849	56,909,936.04	1.44
26	600309	万华化学	2,099,946	50,776,694.28	1.28
27	000599	青岛双星	3,850,802	50,098,934.02	1.27
28	600098	广州发展	3,419,695	47,978,320.85	1.21
29	002037	久联发展	1,380,644	46,472,477.04	1.18
30	000539	粤电力 A	3,891,117	46,459,936.98	1.18
31	002320	海峡股份	1,691,822	46,406,677.46	1.17
32	600426	华鲁恒升	2,499,909	46,398,311.04	1.17
33	000589	黔轮胎 A	3,847,004	43,855,845.60	1.11

34	600011	华能国际	2,803,386	39,331,505.58	0.99
35	600894	广日股份	1,912,482	38,173,140.72	0.97
36	600783	鲁信创投	897,399	33,634,514.52	0.85
37	600192	长城电工	2,070,401	31,966,991.44	0.81
38	000524	岭南控股	1,453,055	31,458,640.75	0.80
39	600395	盘江股份	1,949,781	30,631,059.51	0.77
40	002648	卫星石化	1,976,270	29,920,727.80	0.76
41	000963	华东医药	400,566	28,632,457.68	0.72
42	000532	力合股份	949,991	28,205,232.79	0.71
43	002603	以岭药业	1,381,838	27,857,854.08	0.70
44	600188	兖州煤业	2,000,000	27,500,000.00	0.70
45	600617	国新能源	1,499,956	27,404,196.12	0.69
46	002353	杰瑞股份	599,947	26,607,649.45	0.67
47	600594	益佰制药	443,894	25,803,558.22	0.65
48	600846	同济科技	2,070,411	25,652,392.29	0.65
49	600859	王府井	800,000	25,200,000.00	0.64
50	601188	龙江交通	3,419,975	22,948,032.25	0.58
51	600810	神马股份	2,072,865	22,760,057.70	0.58
52	002450	康得新	734,841	22,486,134.60	0.57
53	000028	国药一致	299,954	22,349,572.54	0.57
54	600780	通宝能源	2,269,900	22,040,729.00	0.56
55	600548	深高速	2,549,903	21,801,670.65	0.55
56	600643	爱建股份	1,300,000	21,749,000.00	0.55
57	601992	金隅股份	1,799,912	21,508,948.40	0.54
58	600864	哈投股份	1,299,932	21,058,898.40	0.53
59	600650	锦江投资	983,885	20,454,969.15	0.52
60	000027	深圳能源	1,499,886	18,523,592.10	0.47
61	002332	仙琚制药	999,914	17,318,510.48	0.44
62	002433	太安堂	1,000,000	16,160,000.00	0.41
63	600151	航天机电	903,501	14,483,121.03	0.37
64	601798	蓝科高新	707,721	11,649,087.66	0.29
65	000916	华北高速	1,387,021	11,540,014.72	0.29
66	600027	华电国际	910,519	10,124,971.28	0.26
67	000488	晨鸣纸业	1,000,000	8,970,000.00	0.23
68	002601	佰利联	190,051	8,647,320.50	0.22
69	600969	郴电国际	302,927	6,164,564.45	0.16
70	600276	恒瑞医药	129,945	5,787,750.30	0.15
71	000721	西安饮食	300,000	3,915,000.00	0.10
72	002646	青青稞酒	89,600	2,614,528.00	0.07

73	000610	西安旅游	108,301	1,759,891.25	0.04
74	601985	中国核电	19,000	248,330.00	0.01
75	603158	腾龙股份	1,000	48,160.00	0.00
76	603979	金诚信	1,000	24,750.00	0.00
77	002772	众兴菌业	500	11,325.00	0.00
78	002312	三泰控股	175	6,555.50	0.00
79	002176	江特电机	100	2,792.00	0.00
80	002091	江苏国泰	100	2,622.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603167	渤海轮渡	186,215,793.07	4.90
2	000498	山东路桥	152,138,620.90	4.00
3	600350	山东高速	137,553,122.53	3.62
4	601999	出版传媒	106,290,066.17	2.80
5	600789	鲁抗医药	97,629,053.45	2.57
6	600369	西南证券	96,973,246.40	2.55
7	601872	招商轮船	92,510,974.57	2.43
8	000713	丰乐种业	88,034,682.48	2.32
9	601318	中国平安	85,999,794.58	2.26
10	600115	东方航空	82,413,536.96	2.17
11	600900	长江电力	76,828,462.00	2.02
12	600270	外运发展	76,171,588.72	2.00
13	000830	鲁西化工	72,804,057.44	1.92
14	000776	广发证券	68,090,367.00	1.79
15	002023	海特高新	67,623,611.53	1.78
16	600426	华鲁恒升	67,473,573.70	1.78
17	000417	合肥百货	66,576,984.56	1.75
18	000599	青岛双星	62,214,194.65	1.64
19	002465	海格通信	62,068,232.30	1.63
20	600309	万华化学	58,519,695.61	1.54

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601111	中国国航	253,582,447.98	6.67
2	600029	南方航空	241,842,090.96	6.37
3	600705	中航资本	228,044,999.33	6.00
4	000024	招商地产	208,933,773.93	5.50
5	600221	海南航空	201,680,317.73	5.31
6	600048	保利地产	180,966,114.39	4.76
7	603167	渤海轮渡	150,977,413.80	3.97
8	600153	建发股份	138,007,624.83	3.63
9	601872	招商轮船	98,385,410.15	2.59
10	000732	泰禾集团	93,883,555.64	2.47
11	600369	西南证券	92,062,412.31	2.42
12	002146	荣盛发展	89,646,430.87	2.36
13	002023	海特高新	86,724,821.09	2.28
14	600900	长江电力	85,236,879.74	2.24
15	601318	中国平安	85,091,672.58	2.24
16	000002	万科A	83,702,902.02	2.20
17	600026	中海发展	78,192,068.78	2.06
18	600690	青岛海尔	78,110,156.70	2.06
19	600012	皖通高速	77,680,361.91	2.04
20	600115	东方航空	69,920,094.10	1.84

注：不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,765,550,834.44
卖出股票收入（成交）总额	4,781,497,011.05

注：不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	110,391,000.00	2.79

	其中：政策性金融债	110,391,000.00	2.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	110,391,000.00	2.79

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150403	15 农发 03	600,000	60,366,000.00	1.53
2	140218	14 国开 18	500,000	50,025,000.00	1.27

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情形。

7.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,474,040.34
2	应收证券清算款	27,015,169.07
3	应收股利	-
4	应收利息	2,858,721.20
5	应收申购款	42,897,091.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	74,245,022.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601111	中国国航	121,667,650.56	3.08	临时停牌
2	600153	建发股份	105,091,447.96	2.66	临时停牌

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
63,027	29,973.00	774,196,638.60	40.98%	1,114,911,650.72	59.02%

8.2 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	2, 219, 674. 66	0. 1200%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 100 万份以上。

该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 50 万份至 100 万份。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	100 万以上
本基金基金经理持有本开放式基金	50-100 万

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 5 月 29 日）基金份额总额	8, 921, 315, 668. 58
本报告期期初基金份额总额	2, 550, 314, 898. 45
本报告期基金总申购份额	1, 205, 100, 734. 32
减：本报告期基金总赎回份额	1, 866, 307, 343. 45
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	1, 889, 108, 289. 32

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015 年 5 月 13 日，公司通过股东会书面决定同意姜治平先生辞去董事一职并任命杨智雅女

士为董事。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2015 年 4 月，李爱华先生不再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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
浙商证券	1	1,023,909,487.78	11.98%	906,058.57	11.77%	-
华泰证券	2	937,890,296.02	10.97%	851,550.95	11.06%	-
申银万国	1	886,943,612.84	10.38%	807,475.46	10.49%	-
中金公司	1	758,302,490.25	8.87%	690,354.74	8.97%	-
国信证券	1	746,158,041.12	8.73%	660,276.08	8.58%	-
长城证券	1	641,394,167.16	7.50%	583,921.85	7.59%	-
西南证券	1	638,070,597.42	7.47%	580,898.49	7.55%	-
广发证券	1	445,951,961.00	5.22%	405,994.20	5.27%	-
东方证券	1	391,615,981.13	4.58%	356,526.46	4.63%	-
方正证券	1	388,634,272.76	4.55%	343,903.08	4.47%	-

国金证券	1	382,677,027.07	4.48%	338,631.26	4.40%	-
国泰君安	1	296,291,896.31	3.47%	262,188.60	3.41%	-
德邦证券	1	272,507,490.63	3.19%	248,090.56	3.22%	-
招商证券	1	208,307,024.43	2.44%	184,331.03	2.39%	-
中信证券	1	160,177,436.96	1.87%	145,826.94	1.89%	-
中原证券	1	147,154,648.99	1.72%	133,969.75	1.74%	-
海通证券	1	115,862,383.35	1.36%	102,526.56	1.33%	-
银河证券	1	104,845,290.27	1.23%	95,451.19	1.24%	-

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	-	-	280,000,000.00	16.67%	-	-
长城证券	-	-	400,000,000.00	23.81%	-	-
西南证券	-	-	700,000,000.00	41.67%	-	-
德邦证券	-	-	150,000,000.00	8.93%	-	-

中信证券	-	-	100,000,000.00	5.95%	-	-
中原证券	-	-	50,000,000.00	2.98%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	参加交通银行网上银行、手机银行基金申购手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年6月30日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于开通中国工商银行借记卡直销网上交易以及费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年6月5日
3	关于华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金参与深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年6月1日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金参与天天基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年5月28日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于开展我司网上直销交易认购、申购、转换费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年5月25日
6	关于网上直销平台新增通联支付支持银行业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月3日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月1日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司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	2015年4月1日
9	关于在中国工商银行开通旗下部	中国证券报、上海	2015年3月4日

	分基金转换业务的公告	证券报、证券时报	
10	华泰柏瑞基金管理有限公司参加恒丰银行股份有限公司开放式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	2015 年 2 月 17 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司参加国都证券有限责任公司开放式基金网上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	2015 年 2 月 4 日

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

11.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费）021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2015 年 8 月 29 日