

# 华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 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。

本报告期自 2015 年 5 月 25 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞惠利混合	
基金主代码	001340	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 25 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,988,791,301.59 份	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞惠利 A	华泰柏瑞惠利 C
下属分级基金的交易代码:	001340	001341
报告期末下属分级基金的份额总额	3,988,095,880.51 份	695,421.08 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	洪渊
	联系电话	021-38601777	010-66105799
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	010-66105798

### 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	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
--------------------	---

址	
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	2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	
	华泰柏瑞惠利 A	华泰柏瑞惠利 C
本期已实现收益	39,336,671.99	12,971.51
本期利润	73,788,981.16	-21,561.74
加权平均基金份额本期利润	0.0190	-0.0008
本期基金份额净值增长率	2.10%	-1.80%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0091	-0.0288
期末基金资产净值	4,069,852,829.72	683,006.25
期末基金份额净值	1.021	0.982

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

华泰柏瑞惠利 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.69%	0.13%	0.65%	0.01%	1.04%	0.12%
过去六个月	2.00%	0.12%	1.40%	0.01%	0.60%	0.11%
自基金合同生效起至今	2.10%	0.11%	1.73%	0.01%	0.37%	0.10%

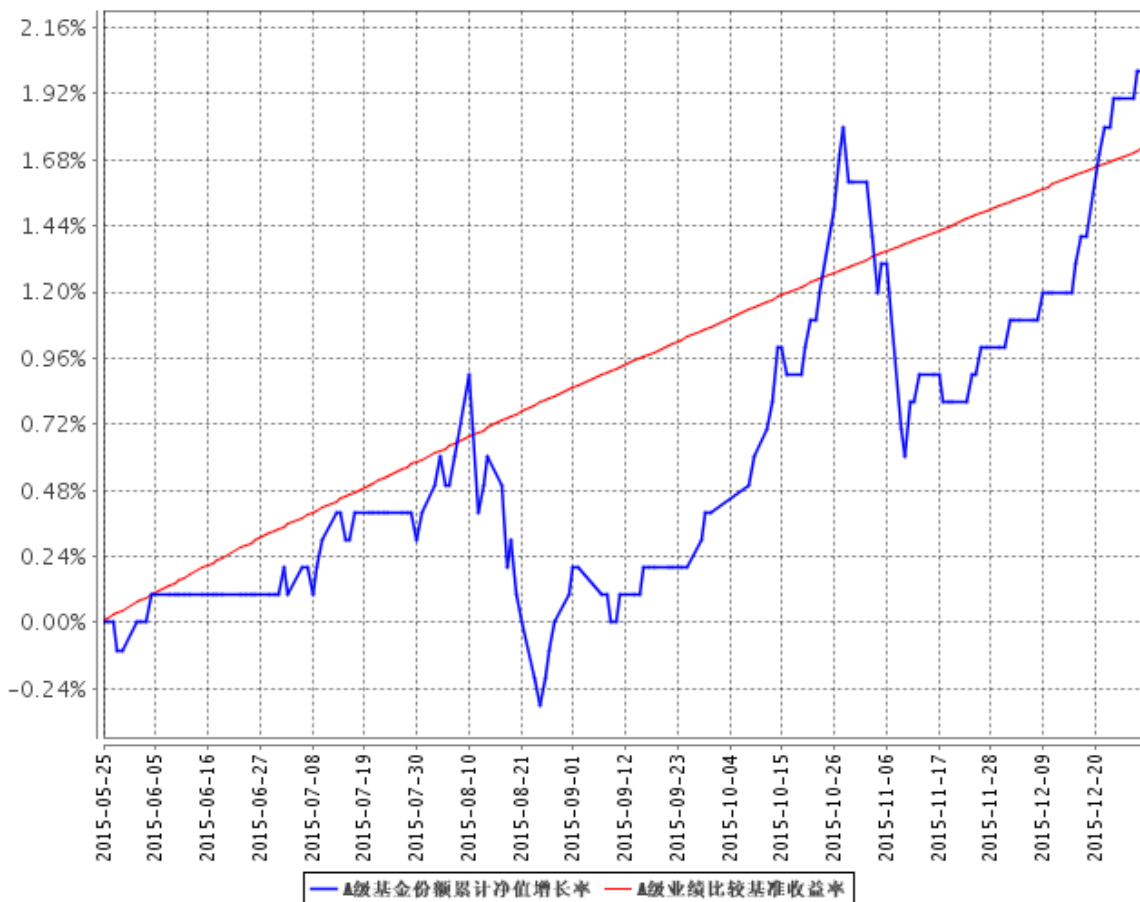
华泰柏瑞惠利 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月						
过去六个月						
自基金合同生效起至今						

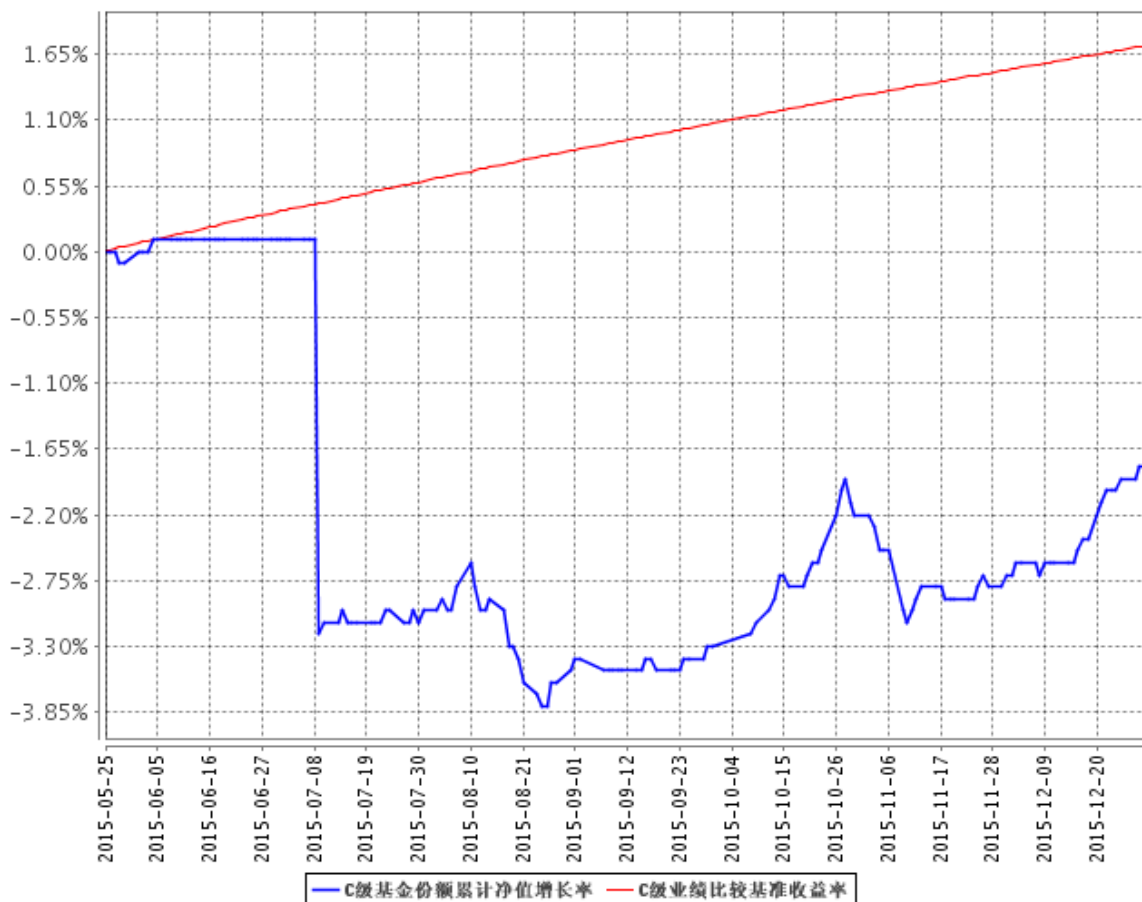
过去三个月	1.55%	0.12%	0.65%	0.01%	0.90%	0.11%
过去六个月	-1.90%	0.32%	1.40%	0.01%	-3.30%	0.31%
自基金合同生效起至今	-1.80%	0.29%	1.73%	0.01%	-3.53%	0.28%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

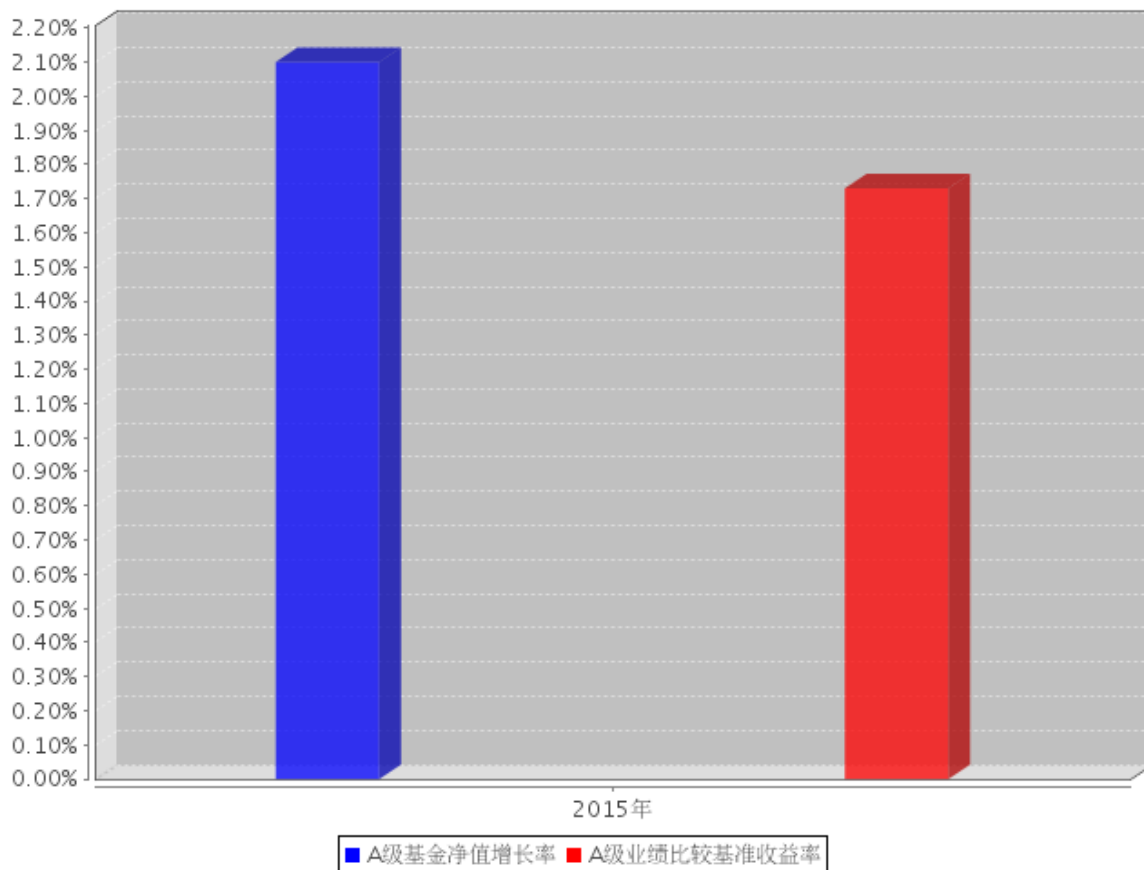


注：1、图示日期为 2015 年 5 月 25 日至 2015 年 12 月 31 日。

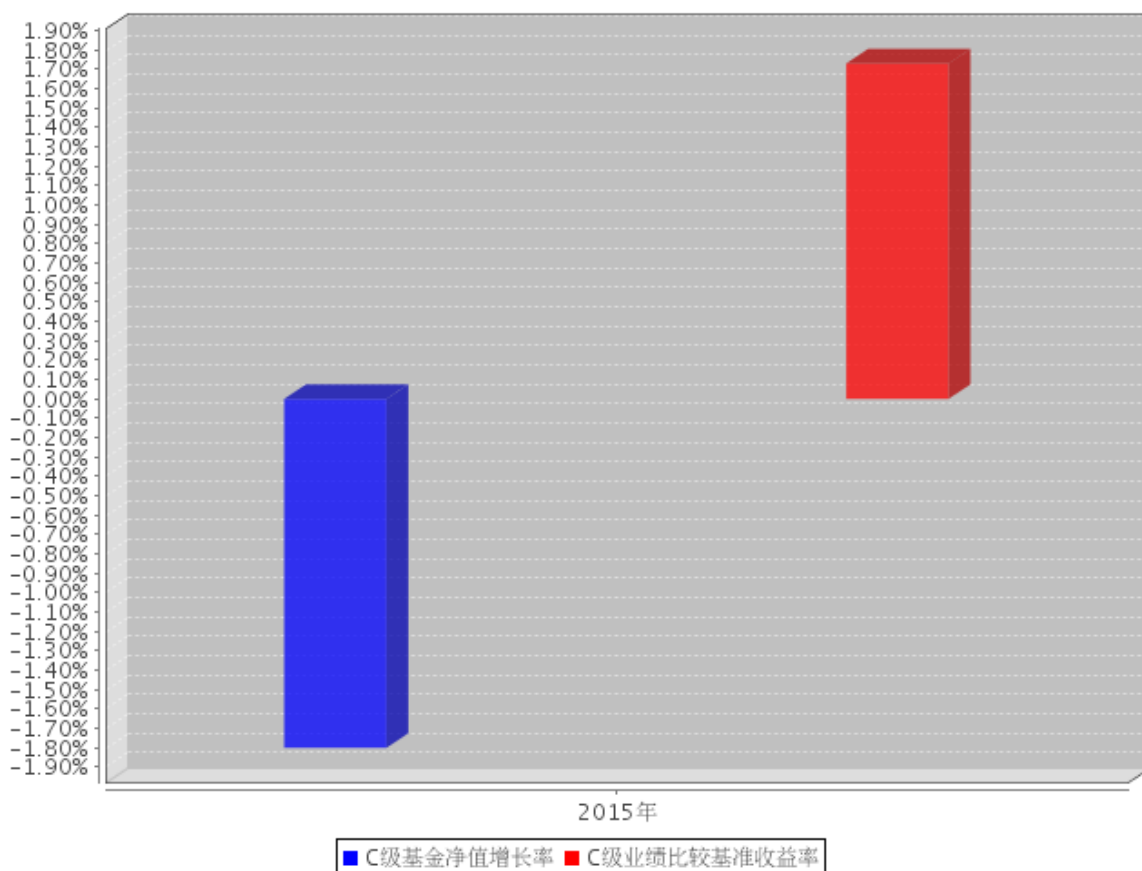
2、按基金合同规定，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围中规定的各项比例，投资于股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

### 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

### A级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



**C级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：基金合同生效日为 2015 年 5 月 25 日，2015 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：本基金成立以来未进行利润分配。

## § 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。截至 2015 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 1299.23 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方纬	本基金的基金经理	2015 年 5 月 25 日	-	12	经济学硕士。 2003 年 9 月至 2005 年 1 月任上海金信研究所研究员； 2005 年 1 月至 2007 年 2 月任万家基金管理有限公司高级研究员； 2007 年 2 月加入

				<p>华泰柏瑞基金管理 有限公司， 历任研究 员、高级 研究员、 基金经理 助理。 2014 年 8 月任华 泰柏瑞价 值增长混 合型证券 投资基金 的基金经 理。 2015 年 4 月起任 华泰柏瑞 新利灵活 配置混合 型证券投资 基金的 基金经理。 2015 年 5 月起任 华泰柏瑞 消费成长 灵活配置 混合型证 券投资基金 的基金经 理和 华泰柏瑞 惠利灵活 配置混合 型证券投资 基金的基 金经理。 2015 年 8 月起任 华泰柏瑞 中国制造 2025 灵活 配置混合</p>
--	--	--	--	--

					型证券投资基金的基金经理。
杨景涵	本基金基金经理	2015 年 5 月 25 日	-	10	<p>中山大学经济学硕士。特许金融分析师（CFA），金融风险管理师（FRM）。2004 年至 2006 年于平安资产管理有限公司，任投资分析师；2006 年至 2009 年 9 月于生命人寿保险公司，历任投连投资经理、投资经理、基金投资部负责人。2009 年 10 月加入本公司，任专户投资部投资经理。2014 年 6 月至 2015 年 4 月任研究部总监助理。2015 年 4 月起任华泰柏瑞</p>

					新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《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《华泰柏瑞丰盛纯债债券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。

本报告期公司旗下基金所管理的投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金自 5 月 25 日成立，为打新为主的混合基金。自成立起，建仓操作非常稳健，并灵活运用了指期货，在建仓期尽可能的对冲了部分系统性风险，很好的避过了 6 月以后的市场大跌以及后续的股灾，并保持往下高效参与打新的操作。股灾以后，新股发行暂停，本基金及时转投债券和定增市场，很好的保持了净值的稳健回报，此外，在二级市场适当增配了一定的股票，也取得了一定收益。自四季度以后，基金优选参与了多个定增项目，以优于同期的折价率获配了多个项目，取得了短期较好的回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类和 C 类份额净值分别为 1.021 元和 0.982 元，分别上涨 2.1%和-1.8%，同期本基金的业绩比较基准上涨 1.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年，国内宏观经济总体呈现增速下降，财政政策放宽和货币政策灵活稳健的特征，在这种特征下，上市公司盈利暂时不会有一个根本性的转变，尽管短期内会有一些改善。而股票市场估值水平除了某些行业的权重股以外，总体仍然较高，吸引力有限，总体而言，二级市场难以产生趋势性行情。债券市场也由于利率处于较低位置和通胀水平的逐步提升，缺乏大的机会。惠利基金将继续灵活参与定增、二级市场以及债券市场投资，并适当运用股指期货作为套期保值手段，在严格遵守股指期货指引的情况下，使用严格控制的期货头寸对持仓股票选取合适的合约进行套期保值，尽力为持有人提升基金净值。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2015 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、研究、销售、后台运营、反洗钱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，可进行收益分配。本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 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，本基金托管人在对华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

普华永道会计师事务所对本基金的年度报告出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2016)第 21926 号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款		152,434,464.99
结算备付金		14,779,063.16



存出保证金		326,574.36
交易性金融资产		2,484,873,646.02
其中：股票投资		1,885,689,646.02
基金投资		-
债券投资		599,184,000.00
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		600,001,100.00
应收证券清算款		811,728,174.08
应收利息		9,441,511.88
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		4,073,584,534.49
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 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		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		62,277.66
应付管理人报酬		1,747,245.56
应付托管费		582,415.19
应付销售服务费		232.08
应付交易费用		346,528.03
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		310,000.00
负债合计		3,048,698.52
<b>所有者权益：</b>		
实收基金		3,988,791,301.59
未分配利润		81,744,534.38
所有者权益合计		4,070,535,835.97
负债和所有者权益总计		4,073,584,534.49

注：1、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，华泰柏瑞惠利 A 级份额净值 1.021 元，份额 3,988,095,880.51 份；华泰柏瑞丰盛纯债债券 C 级份额净值 0.982 元，份额 695,421.08 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		103,452,658.76
1.利息收入		65,742,065.07
其中：存款利息收入		11,428,124.57
债券利息收入		46,784,232.54
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		7,529,707.96
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-5,365,249.39
其中：股票投资收益		-12,675,473.06
基金投资收益		-
债券投资收益		6,070,276.09
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		554,800.00
股利收益		685,147.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		34,417,775.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		8,658,067.16
<b>减：二、费用</b>		29,685,239.34
1. 管理人报酬		18,210,467.74
2. 托管费		4,720,368.92
3. 销售服务费		78,641.13
4. 交易费用		2,121,226.24
5. 利息支出		4,158,287.05
其中：卖出回购金融资产支出		4,158,287.05
6. 其他费用		396,248.26
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		73,767,419.42
减：所得税费用		-



会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015] 881号《关于准予华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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》、《证券投资基金运作管理办法》、《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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4,207,599,952.88元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第531号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,208,008,503.97份基金份额,其中认购资金利息折合408,551.09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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不计提销售服务费的,称为A类;在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类。本基金A类、C类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《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》、《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和最新公布的《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票市值占基金资产净值的0%-95%。其中,基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税

后)+1%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2016 年 3 月 29 日批准报出。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

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

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 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

### 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。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

### 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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具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其他各类应收款项等。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额资产和其他各类应付款项等。

#### 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；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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或者发行价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；于处置时，其处置价格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则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的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为正数，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，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，即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。

#### 7.4.4.13 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和债券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) 对于在锁定期内的非公开发行股票，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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低

于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 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。

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

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

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

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

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

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金直销机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 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

注：无。

##### 7.4.8.1.2 权证交易

注：无。

##### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注：无。

#### 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
----	----

	2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,210,467.74
其中：支付销售机构的客户维护费	7,400.49

注：1. 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的适用年费率计提，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 X 适用年费率 / 当年天数。2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 11 月 25 日，管理人报酬的适用年费率为 0.80%，自 2015 年 11 月 26 日起适用年费率为 0.60%。

2. 根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司 2015 年 11 月 26 日《华泰柏瑞基金管理有限公司关于降低华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金管理费并修改基金合同和托管协议的公告》，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2015 年 11 月 26 日起，基金管理费率由 0.80%/年下降为 0.60%/年。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

	本期 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,720,368.92

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2%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 X 0.2% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

	本期 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
获得销售服务费的各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞惠利 A	华泰柏瑞惠利 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	76,484.17	76,484.17
工商银行股份有限公司	-	-	-

华泰证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	76,484.17	76,484.17

注：本基金 A 类基金份额不再计提销售服务费，C 类基金份额应支付销售机构的销售服务费，按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应支付的销售服务费

E 为前一日的 C 类基金份额的基金资产净值

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

#### 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

单位：人民币元

本期 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	103,576,416.94	-	-	-	-	-

#### 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：无。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	152,434,464.99	3,392,507.65

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

### 7.4.9 期末（2015 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
600708	海博股份	2015 年 11 月 23 日	2016 年 11 月 17 日	非公开发行流通受限	10.96	11.18	23,813,868	260,999,993.28	266,239,044.24	-
300083	劲胜精密	2015 年 12 月 28 日	2016 年 12 月 30 日	非公开发行流通受限	31.91	32.16	8,147,916	259,999,999.56	262,036,978.56	-
601908	京运通	2015 年 12 月 1 日	2016 年 11 月 26 日	非公开发行流通受限	7.88	7.91	27,347,716	215,500,002.08	216,320,433.56	-
002004	华邦健康	2015 年 12 月 30 日	2016 年 12 月 31 日	非公开发行流通受限	12.80	12.81	15,625,000	200,000,000.00	200,156,250.00	-
600823	世茂股份	2015 年 12 月 29 日	2016 年 12 月 24 日	非公开发行流通受限	9.89	9.92	19,211,324	189,999,994.36	190,576,334.08	-
600076	青鸟华光	2015 年 12 月 9 日	2016 年 12 月 7 日	非公开发行流通受限	9.01	9.10	16,648,169	150,000,002.69	151,498,337.90	-
002467	二六三	2015 年 12 月 28 日	2016 年 12 月 29 日	非公开发行流通受限	12.72	12.85	9,433,962	119,999,996.64	121,226,411.70	-
002157	正邦科技	2015 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 5 日	非公开发行流通受限	17.30	17.31	6,589,595	113,999,993.50	114,065,889.45	-
603456	九洲	2015 年	2016	非公开	58.00	59.03	1,714,655	99,449,990.00	101,216,084.65	-

	药业	12月7日	2015年12月3日	发行流通受限						
002596	海南瑞泽	2015年12月21日	2016年12月16日	非公开发行流通受限	20.11	21.36	4,177,026	83,999,992.86	89,221,275.36	-
000010	深华新	2015年12月31日	2017年1月4日	非公开发行流通受限	7.12	7.13	11,424,157	81,339,997.84	81,454,239.41	-
600891	秋林集团	2015年11月23日	2016年11月21日	非公开发行流通受限	7.51	7.85	7,000,000	52,570,000.00	54,950,000.00	-
002085	万丰奥威	2015年12月30日	2016年12月31日	非公开发行流通受限	33.03	32.18	302,755	9,999,997.65	9,742,655.90	-
002778	高科石化	2015年12月28日	2016年1月7日	新股流通受限	8.50	8.50	500	4,250.00	4,250.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 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

注：本基金本报告期末银行间市场债券正回购金额为零。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末交易所市场债券正回购金额为零。

#### 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 2015 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 26,981,461.21 元，属于第二层次的余额为 2,457,892,184.81 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和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 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。

##### (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	1,885,689,646.02	46.29
	其中：股票	1,885,689,646.02	46.29
2	固定收益投资	599,184,000.00	14.71
	其中：债券	599,184,000.00	14.71
	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	600,001,100.00	14.73
	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	167,213,528.15	4.10
7	其他各项资产	821,496,260.32	20.17
8	合计	4,073,584,534.49	100.00

### 8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,157,568,370.46	28.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	81,454,239.41	2.00
F	批发和零售业	54,950,000.00	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	122,514,865.62	3.01
J	金融业	12,277,400.00	0.30
K	房地产业	456,815,378.32	11.22
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,885,689,646.02	46.33

### 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	600708	光明地产	23,813,868	266,239,044.24	6.54
2	300083	劲胜精密	8,147,916	262,036,978.56	6.44
3	601908	京运通	27,347,716	216,320,433.56	5.31
4	002004	华邦健康	15,625,000	200,156,250.00	4.92
5	600823	世茂股份	19,211,324	190,576,334.08	4.68
6	600076	青鸟华光	16,648,169	151,498,337.90	3.72
7	002467	二六三	9,433,962	121,226,411.70	2.98
8	002157	正邦科技	6,589,595	114,065,889.45	2.80
9	603456	九洲药业	1,714,655	101,216,084.65	2.49
10	002596	海南瑞泽	4,177,026	89,221,275.36	2.19

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600708	光明地产	260,999,993.28	6.41
2	300083	劲胜精密	259,999,999.56	6.39
3	601908	京运通	215,500,002.08	5.29
4	002004	华邦健康	200,000,000.00	4.91
5	600823	世茂股份	189,999,994.36	4.67
6	600076	青鸟华光	150,000,002.69	3.69
7	002467	二六三	119,999,996.64	2.95
8	002157	正邦科技	113,999,993.50	2.80
9	603456	九洲药业	99,449,990.00	2.44
10	002596	海南瑞泽	83,999,992.86	2.06
11	000010	深华新	81,339,997.84	2.00
12	000625	长安汽车	63,390,332.10	1.56
13	600048	保利地产	55,290,331.74	1.36
14	601288	农业银行	53,334,953.00	1.31
15	000651	格力电器	53,258,219.97	1.31
16	600891	秋林集团	52,570,000.00	1.29
17	600104	上汽集团	49,488,145.48	1.22
18	600000	浦发银行	48,077,675.72	1.18
19	601166	兴业银行	48,066,942.30	1.18
20	601169	北京银行	43,869,720.59	1.08

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	55,956,180.16	1.37
2	600048	保利地产	51,463,349.54	1.26
3	601288	农业银行	50,204,462.49	1.23
4	000625	长安汽车	46,887,603.66	1.15
5	600000	浦发银行	46,814,377.71	1.15
6	601166	兴业银行	45,290,795.47	1.11
7	600104	上汽集团	43,441,326.01	1.07
8	601169	北京银行	42,854,809.81	1.05

9	000001	平安银行	40,498,066.03	0.99
10	600352	浙江龙盛	28,265,547.87	0.69
11	601633	长城汽车	26,175,269.57	0.64
12	601668	中国建筑	24,524,111.36	0.60
13	600015	华夏银行	24,146,824.97	0.59
14	601009	南京银行	22,149,845.04	0.54
15	601939	建设银行	17,971,476.97	0.44
16	000895	双汇发展	13,142,166.36	0.32
17	000333	美的集团	10,252,863.98	0.25
18	601318	中国平安	10,158,960.28	0.25
19	002142	宁波银行	8,606,327.14	0.21
20	000550	江铃汽车	8,374,459.34	0.21

注：不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,551,100,421.61
卖出股票收入（成交）总额	674,948,094.89

注：不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	205,025,000.00	5.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	394,159,000.00	9.68
	其中：政策性金融债	394,159,000.00	9.68
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	599,184,000.00	14.72

### 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

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	150023	15 付息国债 23	1,500,000	152,160,000.00	3.74
2	150413	15 农发 13	1,200,000	120,132,000.00	2.95
3	150218	15 国开 18	1,100,000	115,522,000.00	2.84
4	150210	15 国开 10	1,000,000	108,360,000.00	2.66
5	150016	15 付息国债 16	500,000	52,865,000.00	1.30

### 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、处罚的情形。

### 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	326,574.36
2	应收证券清算款	811,728,174.08
3	应收股利	-
4	应收利息	9,441,511.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	821,496,260.32

### 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	600708	光明地产	266,239,044.24	6.54	非公开发行
2	300083	劲胜精密	262,036,978.56	6.44	非公开发行
3	601908	京运通	216,320,433.56	5.31	非公开发行
4	002004	华邦健康	200,156,250.00	4.92	非公开发行
5	600823	世茂股份	190,576,334.08	4.68	非公开发行
6	600076	青鸟华光	151,498,337.90	3.72	非公开发行
7	002467	二六三	121,226,411.70	2.98	非公开发行
8	002157	正邦科技	114,065,889.45	2.80	非公开发行
9	603456	九洲药业	101,216,084.65	2.49	非公开发行
10	002596	海南瑞泽	89,221,275.36	2.19	非公开发行

## § 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华泰柏瑞惠利 A	146	27,315,725.21	3,986,138,616.90	99.95%	1,957,263.61	0.05%
华泰柏瑞惠利 C	102	6,817.85	-	0.00%	695,421.08	100.00%
合计	248	16,083,835.89	3,986,138,616.90	99.93%	2,652,684.69	0.07%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞惠利 A	华泰柏瑞惠利 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 25 日）基金 份额总额	4,206,769,074.02	1,239,429.95
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	2,149,733,229.20	180,230,558.14
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回 份额	2,368,406,422.71	180,774,567.01
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	3,988,095,880.51	695,421.08

## § 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

2015 年 12 月 4 日，公司任命董元星先生为公司副总经理，董元星先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试，其任命已在中国证券投资基金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2015 年 12 月 11 日，公司任命程安至先生为公司副总经理，程安至先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试，其任命已在中国证券投资基金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2015 年 5 月 13 日，经公司股东会批准杨智雅女士为公司董事，2015 年 10 月 19 日，经公司股东会批准童辉先生为公司监事。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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 100,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 1 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、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	2,739,991.26	0.20%	2,551.76	0.20%	-
中信证券	1	719,265,832.56	52.07%	666,371.30	52.43%	-
申银万国	1	8,285,781.41	0.60%	7,550.81	0.59%	-
东兴证券	1	18,075,035.92	1.31%	15,994.59	1.26%	-
安信证券	1	25,836,264.22	1.87%	22,862.47	1.80%	-
广发证券	1	22,802,060.75	1.65%	21,235.67	1.67%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	-	-
兴业证券	1	176,695,109.30	12.79%	161,022.62	12.67%	-
湘财证券	1	182,927,298.68	13.24%	170,359.62	13.40%	-
方正证券	1	224,232,641.47	16.23%	202,761.86	15.95%	-
长江证券	1	391,597.80	0.03%	356.88	0.03%	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：1) 具有相应的业务经营资格；2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服；5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
招商证券	-	0.00%	-	0.00%	0.00	0.00%
中信证券	-	0.00%	10,534,300,000.00	48.37%	0.00	0.00%
申银万国	-	0.00%	-	0.00%	0.00	0.00%
东兴证券	-	0.00%	-	0.00%	0.00	0.00%
安信证券	-	0.00%	-	0.00%	0.00	0.00%
广发证券	-	0.00%	-	0.00%	0.00	0.00%
华泰证券	-	0.00%	9,697,200,000.00	44.53%	0.00	0.00%
兴业证券	-	0.00%	-	0.00%	0.00	0.00%
湘财证券	-	0.00%	1,546,400,000.00	7.10%	0.00	0.00%
方正证券	-	0.00%	-	0.00%	0.00	0.00%
长江证券	-	0.00%	-	0.00%	0.00	0.00%

华泰柏瑞基金管理有限公司  
2016年3月29日