

华泰柏瑞行业领先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，投资者在做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 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞行业领先混合
基金主代码	460007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 8 月 3 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	197,124,537.86 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过采取自上而下和自下而上相结合的方法，从定量和定性的角度把握不同时期所蕴含的行业和个股投资机会，在充分控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	大类资产配置不作为本基金的核心策略。考虑到中国大陆 A 股市场现阶段仍存在较大的系统性风险，本基金将仅在股票资产整体出现较大程度高估或低估时进行适度的大类资产配置调整，一般情况下本基金将保持大类资产配置的基本稳定。本基金在股票投资中注重自上而下的行业配置，即以行业估值为基础，以行业基本面趋势变化为契机，结合国家产业政策的导向，在不同备选之间合理配置基金资产。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+上证国债指数×15%+同业存款利率×5%
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址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	390,845,397.94	238,518,132.88	145,064,246.84
本期利润	257,793,134.14	286,776,388.79	186,274,981.67
加权平均基金份额本期利润	0.7423	0.2789	0.1770
本期基金份额净值增长率	24.56%	39.65%	25.92%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.4964	-0.0216	-0.2977
期末基金资产净值	294,968,351.78	837,534,922.26	945,924,353.00
期末基金份额净值	1.496	1.201	0.860

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

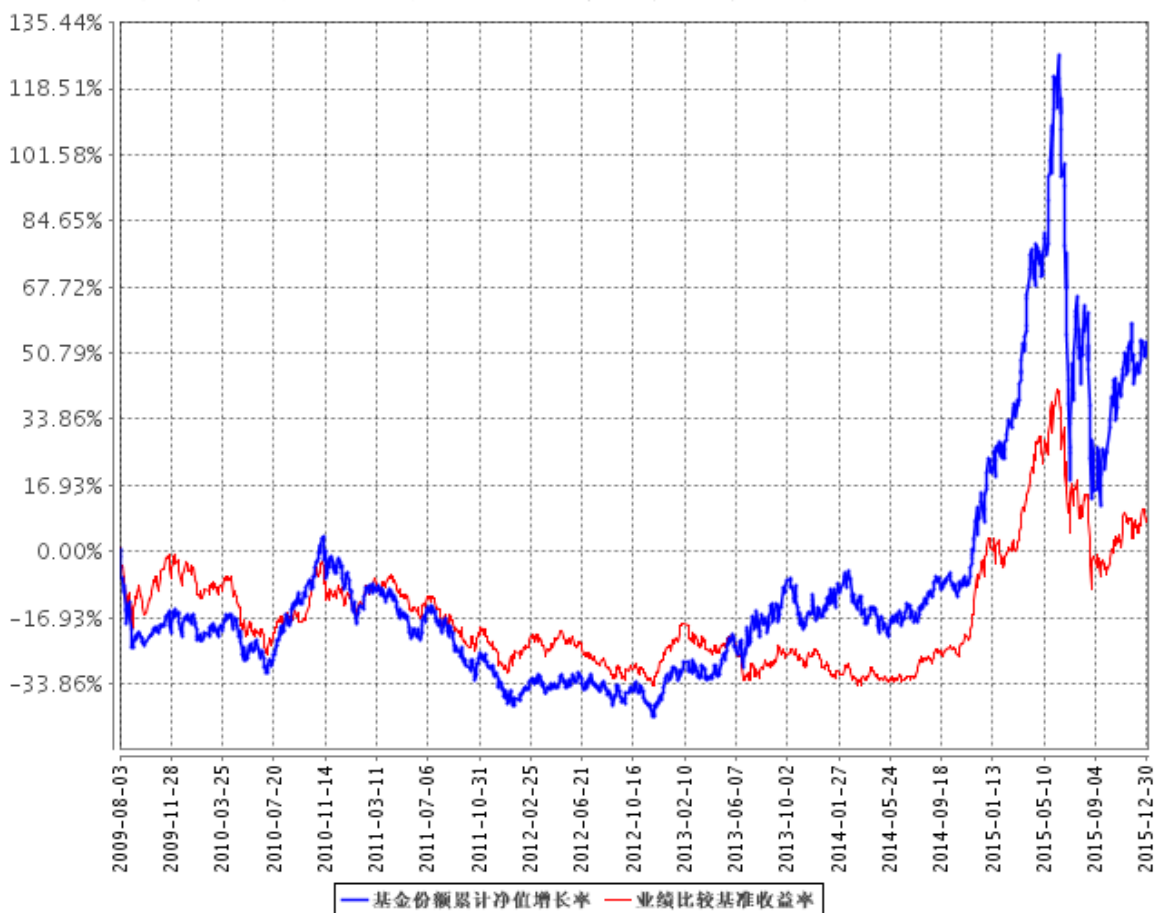
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	19.30%	2.28%	13.47%	1.34%	5.83%	0.94%
过去六个月	-15.29%	3.68%	-12.43%	2.14%	-2.86%	1.54%
过去一年	24.56%	3.09%	6.71%	1.99%	17.85%	1.10%
过去三年	119.03%	2.19%	42.25%	1.43%	76.78%	0.76%

过去五年	58.98%	1.87%	21.96%	1.29%	37.02%	0.58%
自基金合同生效起至今	49.60%	1.79%	7.58%	1.32%	42.02%	0.47%

注：本基金的业绩基准由沪深 300 指数、上证国债指数和同业存款利率按照 80%、15%和 5%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

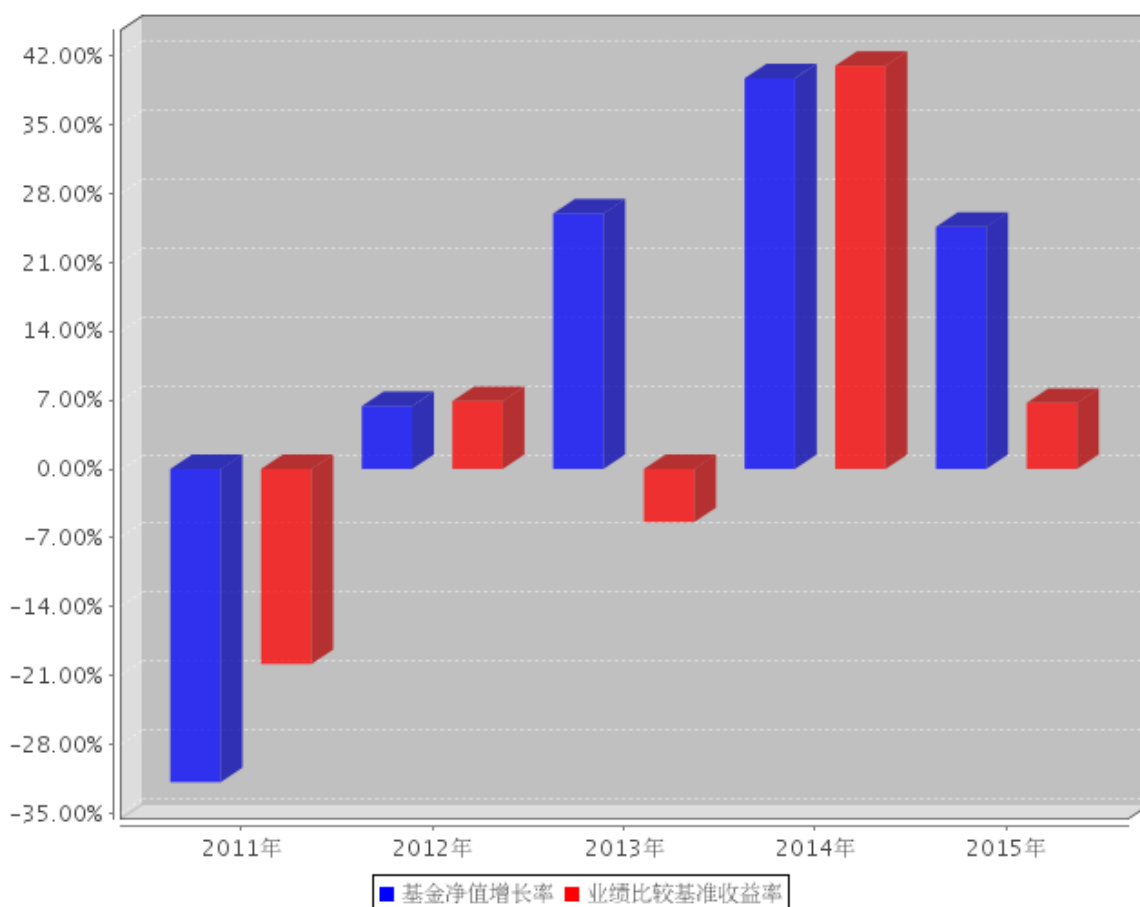


注：

- 1、图示日期为 2009 年 8 月 3 日至 2015 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十一条（二）投资范围、（八）之 2、基金投资组合比例限制中规定的各项比例，股票资产占基金资产的 60%—95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效日为 2009 年 8 月 3 日，2009 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。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		
吕慧建	本基金基金经理、投资部总监	2009 年 11 月 18 日	-	18 年	吕慧建先生，新加坡国立大学 MBA。历任中大投资管理有限公司行业研究员及中信基金管理有限公司的行业研究员。2007 年 6 月加入本公司，

					任高级行业研究员，2007 年 11 月起担任基金经理助理，自 2009 年 11 月起担任华泰柏瑞（原友邦华泰）行业领先混合型基金经理。2015 年 6 月起任投资部总监与华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
徐晓杰	本基金的基金经理	2015 年 5 月 15 日	-	9 年	博士研究生，9 年证券（基金）从业经历。2006 年 7 月至 2007 年 9 月任邦联资产管理有限公司研究员；2007 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究

					<p>员、高级研究员、基金经理助理。</p> <p>2014 年 4 月至 2015 年 5 月任研究部总监助理。</p> <p>2015 年 5 月起任华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 6 月起任华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 10 月起任华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为

的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。本报告期内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

2015 年中国经济底部运行，增速前高后低，整体稳定。由于整体需求不振，PPI 持续下行，企业盈利增速放缓。政府的政策重点主要在于调结构。在经济疲弱、出现一定通缩压力的情况下，货币政策较为宽松，M2 年度增速为 13.3%，高于年初政策目标。

经济平淡，在利率下行、类别资产配置吸引力下降的大背景下，A 股市场在 15 年上半年快速上涨。这轮上涨有着显著的主题驱动特征。政府提倡“物联网+”、证监会支持企业并购、市场资金加杠杆，创业板从年初的 1742 点快速上涨到 4038 点。6 月份市场出现调整，监管机构强制去杠杆，市场踩踏下跌。7 月份后，政府前后推出了多项救市政策，由于协调性欠佳，救市效果并不理想。9 月份市场逐步企稳并反弹。在市场下跌、救市过程中，大盘蓝筹表现较为稳健。随后的反弹中，创业板再度取得超额收益，并一直延续到 12 月底。

本基金在年初的时候较好地把握了成长股行情。4 月份基于对市场泡沫的谨慎，把仓位调整到大盘蓝筹中。但是，这一策略在市场再度大幅上涨后并没能坚持贯彻，在 5 月份再度把持仓风格转移到成长股中。在 6 月份以来的股灾中，我们对决策层的魄力和政策的突然大幅转向认识不充分，未能及时减仓，虽然通过选股较好地把握了反弹中的市场机会，但基金净值从高点下来的幅度依然巨大，教训十分深刻。

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 1.496 元，本报告期份额净值增长率为 24.56%，同期业绩比较基准增长率为 6.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2015 年，大宗商品的持续下跌的情况超过预期，世界经济整体疲弱，压低 PPI，企业盈利增长乏力。展望 2016 年，我们认为中国经济可能继续低位运行，宏观指标波动钝化。从年初以来的政策信号看，16 年政策重点转向去产能，淘汰过剩产能有望取得实质性进展。这对经济下行形成一定压力。作为保增长的重要手段，政府刺激地产销售的政策力度加大，并进一步

加码扩张性财政政策，支持经济在目标区间内运行。

我们认为，中国的经济结构将继续推进，产业结构优化，优势公司持续提高市场份额；新兴产业继续高速增长，和传统过剩产业的压力重重形成鲜明对比，不同生命周期的行业表现冰火两重天。

进入 2016 年，大宗原材料价格经历了再度下跌后开始企稳。我们预计 PPI 有望环比改善，有助于企业盈利改善。

2016 年开年伊始，全球资产价格出现大幅下跌，A 股同样跌幅巨大。这是否意味着全球资产价格体系会陷入一次全面的重新定价过程、进入一个长期熊市？在重新考虑各种因素后，我们阶段性地假设本轮下跌是市场悲观情绪的集中释放，市场在目前点位大幅下跌的可能性不大。我们会在以后的操作中仔细检视这一策略的潜在风险。

从年初 A 股市场的走势情况看，推动去产能的政策力度超预期，房地产销售回暖，上游周期股相对走强，形成的虹吸效应，在存量资金博弈的市场环境下，加大了成长股的抛压。

从一个较长的时间段来看，我们认为传统行业去产能不是短期内能够实现的，盈利的改善暂时还看不到。市场资金在成长股、价值股的配置之间取得新的平衡后，我们更愿意把资金配置在盈利前景更为明确的成长股上。

A 股市场在 15 年下半年暴跌的基础上，16 年初再度大幅下跌，从高点下来调整已经较为充分。在经济整体呈 L 走势的假设下，我们对 A 股市场走势持中性预期，涨跌空间相对有限。从策略上，我们将以选股为核心，重视盈利和估值，提升净值表现。

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，基金收益分配每年至多 4 次；每次分配比例不低于基金期末可分配利润的 10%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。报告期内基金未实施收益分配。

§ 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行业领先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，华泰柏瑞行业领先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行业领先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。本报告期内，华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金未进行利润分配。

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行业领先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 21915 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：华泰柏瑞行业领先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	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		15,951,741.77	46,922,182.70
结算备付金		3,532,697.72	5,559,195.40
存出保证金		265,923.95	483,348.63
交易性金融资产		277,742,143.86	794,676,459.40
其中：股票投资		277,742,143.86	793,457,475.43
基金投资		-	-
债券投资		-	1,218,983.97
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		963,754.42	14,085,302.07
应收利息		6,334.60	12,208.14
应收股利		-	-
应收申购款		95,830.19	240,707.31
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		298,558,426.51	861,979,403.65
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	9,368,216.52
应付赎回款		1,425,932.29	10,184,173.58
应付管理人报酬		376,192.21	1,068,976.26
应付托管费		62,698.71	178,162.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,360,932.45	3,250,971.81
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		364,319.07	393,980.52
负债合计		3,590,074.73	24,444,481.39
所有者权益：			

实收基金		197,124,537.86	697,092,058.74
未分配利润		97,843,813.92	140,442,863.52
所有者权益合计		294,968,351.78	837,534,922.26
负债和所有者权益总计		298,558,426.51	861,979,403.65

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4964 元，基金份额总额

197,124,537.86 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		279,702,480.34	314,893,996.66
1. 利息收入		312,092.73	443,643.35
其中：存款利息收入		311,195.01	427,172.17
债券利息收入		897.72	96.18
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	16,375.00
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		411,952,798.94	266,130,135.86
其中：股票投资收益		409,472,160.50	260,520,509.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益		832,854.10	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,647,784.34	5,609,626.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-133,052,263.80	48,258,255.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		489,852.47	61,961.54
减：二、费用		21,909,346.20	28,117,607.87
1. 管理人报酬		7,850,809.01	13,715,284.16
2. 托管费		1,308,468.21	2,285,880.60
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		12,370,884.96	11,703,726.35

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		379,184.02	412,716.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		257,793,134.14	286,776,388.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		257,793,134.14	286,776,388.79

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	697,092,058.74	140,442,863.52	837,534,922.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	257,793,134.14	257,793,134.14
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）	-499,967,520.88	-300,392,183.74	-800,359,704.62
其中：1. 基金申购款	164,703,360.94	94,988,858.90	259,692,219.84
2. 基金赎回款	-664,670,881.82	-395,381,042.64	-1,060,051,924.46
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）	197,124,537.86	97,843,813.92	294,968,351.78
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	1,100,352,026.86	-154,427,673.86	945,924,353.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	286,776,388.79	286,776,388.79
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）	-403,259,968.12	8,094,148.59	-395,165,819.53
其中：1. 基金申购款	125,547,164.04	-11,896,882.88	113,650,281.16
2. 基金赎回款	-528,807,132.16	19,991,031.47	-508,816,100.69
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）	697,092,058.74	140,442,863.52	837,534,922.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金(原名为友邦华泰行业领先股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]482号《关于核准友邦华泰行业领先股票型证券投资基金募集的批复》核准,由友邦华泰基金管理有限公司(现更名为华泰柏瑞基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同》(现更名为《华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金基金合同》)负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,249,392,302.39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(2009)第132号验资报告。经向中国证监会备案,《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同》于2009年8月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,249,632,307.10份基金份额,其中认购资金利息折合240,004.71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。

因基金管理人更名，经中国证监会批准，本基金名称自 2010 年 4 月 30 日起由“友邦华泰行业领先股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞行业领先股票”，基金代码保持不变。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及相基金合同的有关规定，并报中国证监会备案，本基金名称自 2015 年 8 月 6 日起由“华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%—95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数 X80%+上证国债指数 X15%+同业存款利率 X5%。

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》、《华泰柏瑞行业领先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 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金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》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。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	131,915,357.62	1.66%	417,539,768.75	5.47%

债券交易

注：无。

债券回购交易

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	119,827.32	1.67%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	371,900.04	5.45%	182,386.86	5.61%

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

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

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,850,809.01	13,715,284.16
其中：支付销售机构的客户维护费	1,626,687.55	3,339,175.23

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 1.50% 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 X 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,308,468.21	2,285,880.60

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 0.25% 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 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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：本报告期内，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国工商银行股份有限公司	15,951,741.77	250,647.00	46,922,182.70	377,706.39

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

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

注：无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000065	北方国际	2015年10月21日	重大资产重组	30.53	2016年3月15日	27.48	10,000	304,000.00	305,300.00	-
600873	梅花生物	2015年12月17日	发行股份购买资产	9.14	-	-	10,000	84,588.05	91,400.00	-

注：本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 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 277,345,443.86 元，属于第二层次的余额为 396,700.00 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 785,380,325.43 元，第二层次 9,296,133.97 元，无第三层次)。

(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(2014 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	277,742,143.86	93.03
	其中：股票	277,742,143.86	93.03
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	19,484,439.49	6.53
7	其他各项资产	1,331,843.16	0.45
8	合计	298,558,426.51	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	235,350.00	0.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	206,246,243.86	69.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	305,300.00	0.10
F	批发和零售业	-	-
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	45,354,050.00	15.38
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,527,200.00	1.87
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	20,074,000.00	6.81
S	综合	-	-
	合计	277,742,143.86	94.16

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	002517	泰亚股份	400,026	24,217,574.04	8.21
2	300367	东方网力	280,000	19,516,000.00	6.62
3	300285	国瓷材料	420,000	19,110,000.00	6.48
4	600485	信威集团	710,000	18,992,500.00	6.44
5	300310	宜通世纪	300,000	18,699,000.00	6.34
6	300144	宋城演艺	550,000	15,565,000.00	5.28
7	002008	大族激光	600,042	15,535,087.38	5.27
8	300017	网宿科技	250,000	14,997,500.00	5.08
9	002172	澳洋科技	1,000,000	14,880,000.00	5.04
10	300136	信维通信	500,051	14,776,507.05	5.01

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002714	牧原股份	68,830,863.95	8.22
2	002475	立讯精密	64,664,899.30	7.72
3	300113	顺网科技	63,540,796.10	7.59
4	600276	恒瑞医药	54,281,659.72	6.48
5	000566	海南海药	53,306,995.09	6.36
6	300144	宋城演艺	51,571,976.23	6.16
7	300253	卫宁软件	50,286,168.56	6.00
8	300285	国瓷材料	48,557,108.66	5.80
9	002375	亚厦股份	47,641,703.30	5.69
10	300017	网宿科技	47,383,379.44	5.66
11	601555	东吴证券	45,622,118.01	5.45
12	600570	恒生电子	45,605,191.18	5.45
13	600519	贵州茅台	43,695,109.08	5.22
14	601166	兴业银行	41,767,259.55	4.99
15	300136	信维通信	40,988,107.17	4.89
16	002236	大华股份	40,060,272.77	4.78
17	600900	长江电力	37,943,243.25	4.53
18	600517	置信电气	37,764,876.94	4.51
19	000776	广发证券	37,628,934.60	4.49
20	002142	宁波银行	37,065,897.43	4.43
21	002653	海思科	36,920,749.32	4.41
22	600536	中国软件	36,634,838.79	4.37
23	600999	招商证券	36,604,491.87	4.37
24	300271	华宇软件	36,051,735.01	4.30
25	600703	三安光电	35,497,629.35	4.24
26	002271	东方雨虹	34,602,387.44	4.13
27	000732	泰禾集团	32,954,438.00	3.93
28	002008	大族激光	32,682,319.72	3.90
29	000024	招商地产	32,020,092.24	3.82
30	002153	石基信息	31,649,135.65	3.78
31	002172	澳洋科技	30,896,100.08	3.69
32	002400	省广股份	30,467,532.30	3.64
33	002467	二六三	30,087,609.23	3.59
34	300273	和佳股份	29,814,032.43	3.56

35	300032	金龙机电	28,859,823.86	3.45
36	600037	歌华有线	28,573,474.75	3.41
37	300262	巴安水务	28,286,627.07	3.38
38	600109	国金证券	28,250,937.12	3.37
39	002081	金螳螂	27,645,315.80	3.30
40	600309	万华化学	27,509,484.49	3.28
41	002437	誉衡药业	27,395,924.34	3.27
42	002699	美盛文化	25,929,647.87	3.10
43	000333	美的集团	25,816,822.85	3.08
44	601318	中国平安	25,323,740.11	3.02
45	300261	雅本化学	25,266,825.62	3.02
46	300059	东方财富	25,166,282.57	3.00
47	600873	梅花生物	25,083,777.70	2.99
48	601336	新华保险	25,035,860.33	2.99
49	601818	光大银行	24,487,792.09	2.92
50	300011	鼎汉技术	24,374,422.32	2.91
51	002517	泰亚股份	24,262,258.86	2.90
52	002493	荣盛石化	23,979,828.24	2.86
53	300038	梅泰诺	23,622,917.84	2.82
54	002364	中恒电气	23,425,324.26	2.80
55	600485	信威集团	23,367,197.00	2.79
56	300498	温氏股份	23,287,149.12	2.78
57	002183	怡亚通	23,094,614.40	2.76
58	300310	宜通世纪	22,971,476.80	2.74
59	601788	光大证券	22,896,159.00	2.73
60	600409	三友化工	22,671,017.57	2.71
61	600845	宝信软件	21,891,839.35	2.61
62	601628	中国人寿	21,415,039.52	2.56
63	601908	京运通	21,261,999.14	2.54
64	002241	歌尔声学	20,596,863.35	2.46
65	600601	方正科技	20,418,631.38	2.44
66	002157	正邦科技	20,337,702.52	2.43
67	601377	兴业证券	20,161,491.51	2.41
68	300367	东方网力	20,085,655.12	2.40
69	002551	尚荣医疗	19,427,784.90	2.32
70	002299	圣农发展	19,285,043.12	2.30

71	002121	科陆电子	19,234,887.70	2.30
72	000851	高鸿股份	18,864,127.61	2.25
73	600332	白云山	18,737,661.87	2.24
74	002297	博云新材	18,425,112.83	2.20
75	002273	水晶光电	17,916,136.00	2.14
76	300139	晓程科技	17,914,782.40	2.14
77	300081	恒信移动	17,866,012.00	2.13
78	002230	科大讯飞	17,673,499.35	2.11
79	600986	科达股份	17,286,489.20	2.06
80	600399	抚顺特钢	17,183,101.80	2.05
81	002189	利达光电	17,054,305.27	2.04
82	000001	平安银行	16,948,500.00	2.02

注：不考虑相关交易费用。

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	002714	牧原股份	96,696,081.71	11.55
2	000024	招商地产	88,880,931.34	10.61
3	600519	贵州茅台	84,828,050.29	10.13
4	600536	中国软件	83,693,558.51	9.99
5	601318	中国平安	77,264,876.54	9.23
6	002475	立讯精密	75,548,008.53	9.02
7	002271	东方雨虹	73,483,016.59	8.77
8	300271	华宇软件	70,009,206.10	8.36
9	000566	海南海药	64,718,703.61	7.73
10	601555	东吴证券	59,724,220.14	7.13
11	300253	卫宁软件	59,655,543.79	7.12
12	002142	宁波银行	58,639,594.02	7.00
13	300113	顺网科技	58,390,162.72	6.97
14	601166	兴业银行	58,218,718.84	6.95
15	000776	广发证券	55,069,801.38	6.58
16	300032	金龙机电	52,523,304.48	6.27
17	600376	首开股份	52,475,894.62	6.27
18	600048	保利地产	52,009,960.16	6.21
19	002375	亚厦股份	51,466,164.26	6.14

20	002081	金螳螂	50,799,893.01	6.07
21	300144	宋城演艺	48,880,360.08	5.84
22	600276	恒瑞医药	48,593,249.42	5.80
23	600570	恒生电子	46,796,260.24	5.59
24	300273	和佳股份	43,233,747.99	5.16
25	601818	光大银行	42,619,212.14	5.09
26	600999	招商证券	41,946,730.60	5.01
27	600900	长江电力	40,832,864.36	4.88
28	000732	泰禾集团	40,724,445.35	4.86
29	002653	海思科	39,157,943.40	4.68
30	000625	长安汽车	38,320,475.15	4.58
31	000001	平安银行	37,379,699.87	4.46
32	601009	南京银行	37,111,701.30	4.43
33	300017	网宿科技	36,381,726.17	4.34
34	600556	慧球科技	36,087,935.46	4.31
35	600517	置信电气	35,973,046.61	4.30
36	002400	省广股份	34,840,899.73	4.16
37	002153	石基信息	34,508,297.77	4.12
38	600037	歌华有线	33,571,971.71	4.01
39	002364	中恒电气	33,323,252.66	3.98
40	601601	中国太保	32,890,972.12	3.93
41	300285	国瓷材料	32,582,170.89	3.89
42	601628	中国人寿	31,786,889.71	3.80
43	600036	招商银行	30,700,848.88	3.67
44	002437	誉衡药业	30,270,241.44	3.61
45	600109	国金证券	29,509,776.98	3.52
46	601377	兴业证券	29,489,204.00	3.52
47	300136	信维通信	29,322,404.70	3.50
48	002493	荣盛石化	29,192,518.67	3.49
49	002157	正邦科技	28,811,295.43	3.44
50	002304	洋河股份	27,702,898.10	3.31
51	300262	巴安水务	27,686,154.40	3.31
52	002699	美盛文化	27,674,130.82	3.30
53	601633	长城汽车	26,543,810.87	3.17
54	002268	卫士通	25,896,643.44	3.09
55	000555	神州信息	25,766,428.99	3.08
56	600873	梅花生物	25,651,227.11	3.06
57	300139	晓程科技	25,549,916.90	3.05

58	600309	万华化学	24,654,966.45	2.94
59	601336	新华保险	24,591,144.74	2.94
60	601788	光大证券	24,299,752.52	2.90
61	000333	美的集团	24,200,465.92	2.89
62	300059	东方财富	24,062,611.96	2.87
63	600703	三安光电	23,984,099.57	2.86
64	002467	二六三	23,533,247.79	2.81
65	000069	华侨城A	22,989,804.49	2.74
66	600601	方正科技	22,741,923.73	2.72
67	002236	大华股份	22,620,248.02	2.70
68	300075	数字政通	22,430,298.28	2.68
69	300011	鼎汉技术	22,211,927.26	2.65
70	002415	海康威视	22,017,376.84	2.63
71	601908	京运通	22,016,039.41	2.63
72	300498	温氏股份	21,291,432.42	2.54
73	002273	水晶光电	20,553,914.22	2.45
74	002241	歌尔声学	20,418,641.14	2.44
75	600887	伊利股份	19,550,360.29	2.33
76	002297	博云新材	19,443,816.52	2.32
77	000851	高鸿股份	19,253,739.27	2.30
78	002121	科陆电子	19,159,280.80	2.29
79	600845	宝信软件	18,932,337.93	2.26
80	002456	欧菲光	18,642,965.42	2.23
81	002183	怡亚通	18,361,714.87	2.19
82	300081	恒信移动	18,250,303.50	2.18
83	600332	白云山	18,238,991.72	2.18
84	002008	大族激光	18,168,883.96	2.17
85	000402	金融街	16,922,848.29	2.02
86	600518	康美药业	16,824,327.00	2.01
87	002230	科大讯飞	16,815,867.00	2.01

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,589,967,942.18
卖出股票收入（成交）总额	4,382,103,170.45

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

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情形，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情形。

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	265,923.95
2	应收证券清算款	963,754.42
3	应收股利	-
4	应收利息	6,334.60
5	应收申购款	95,830.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,331,843.16

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
8,389	23,497.98	47,683,854.69	24.19%	149,440,683.17	75.81%

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	1,690,180.58	0.8600%

注：本报告期末，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：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 100 万份以上。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 8 月 3 日）基金份额总额	2,249,632,307.10
本报告期期初基金份额总额	697,092,058.74
本报告期基金总申购份额	164,703,360.94
减：本报告期基金总赎回份额	664,670,881.82
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	197,124,537.86

§ 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 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

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。

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（特殊普通合伙）的报酬为 60,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 7 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	
安信证券	1	11,529,773,644.65	19.23%	1,353,697.90	18.92%	-
方正证券	1	11,252,381,949.18	15.75%	1,111,941.73	15.54%	-
中信证券	1	11,241,227,581.23	15.61%	1,130,400.96	15.80%	-
兴业证券	1	837,762,286.39	10.53%	763,453.18	10.67%	-
广发证券	3	755,517,190.79	9.50%	689,353.76	9.63%	-
国都证券	1	581,516,493.77	7.31%	514,585.17	7.19%	-
瑞银证券	2	430,312,220.81	5.41%	391,572.33	5.47%	-
东兴证券	2	299,353,220.09	3.76%	264,897.59	3.70%	-
湘财证券	2	221,057,551.03	2.78%	205,869.60	2.88%	-

招商证券	2	160,552,213.22	2.02%	147,937.42	2.07%	-
德邦证券	1	154,594,671.22	1.94%	140,742.50	1.97%	-
华泰证券	2	131,915,357.62	1.66%	119,827.32	1.67%	-
中金公司	2	125,066,278.91	1.57%	111,045.62	1.55%	-
申银万国	1	101,698,307.62	1.28%	92,677.81	1.30%	-
长江证券	1	60,793,288.32	0.76%	55,400.89	0.77%	-
爱建证券	1	51,253,102.04	0.64%	46,407.80	0.65%	-
华宝证券	1	9,361,639.74	0.12%	8,284.15	0.12%	-
上海证券	2	9,184,171.00	0.12%	8,361.22	0.12%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 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) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、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

安信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	2,052,848.00	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

华泰柏瑞基金管理有限公司
2016年3月29日