

# 华泰柏瑞积极成长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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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，应阅读年报报告正文。

本报告期自 2015 年 1 月 1 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	1,463,440,023.34 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%（2007/05/29-2015/09/30） 沪深 300 指数×60%+中债国债总指数×40%（2015/10/1-至今）
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

## 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	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## § 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	906,788,408.15	820,363,182.94	391,317,461.98
本期利润	427,858,249.64	1,466,875,396.87	190,683,274.81
加权平均基金份额本期利润	0.2335	0.5597	0.0648
本期基金份额净值增长率	20.73%	65.34%	8.51%
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	0.6798	0.3323	-0.0990
期末基金资产净值	2,472,575,222.13	3,799,301,862.15	2,690,239,049.68
期末基金份额净值	1.6896	1.4897	0.9010

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

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

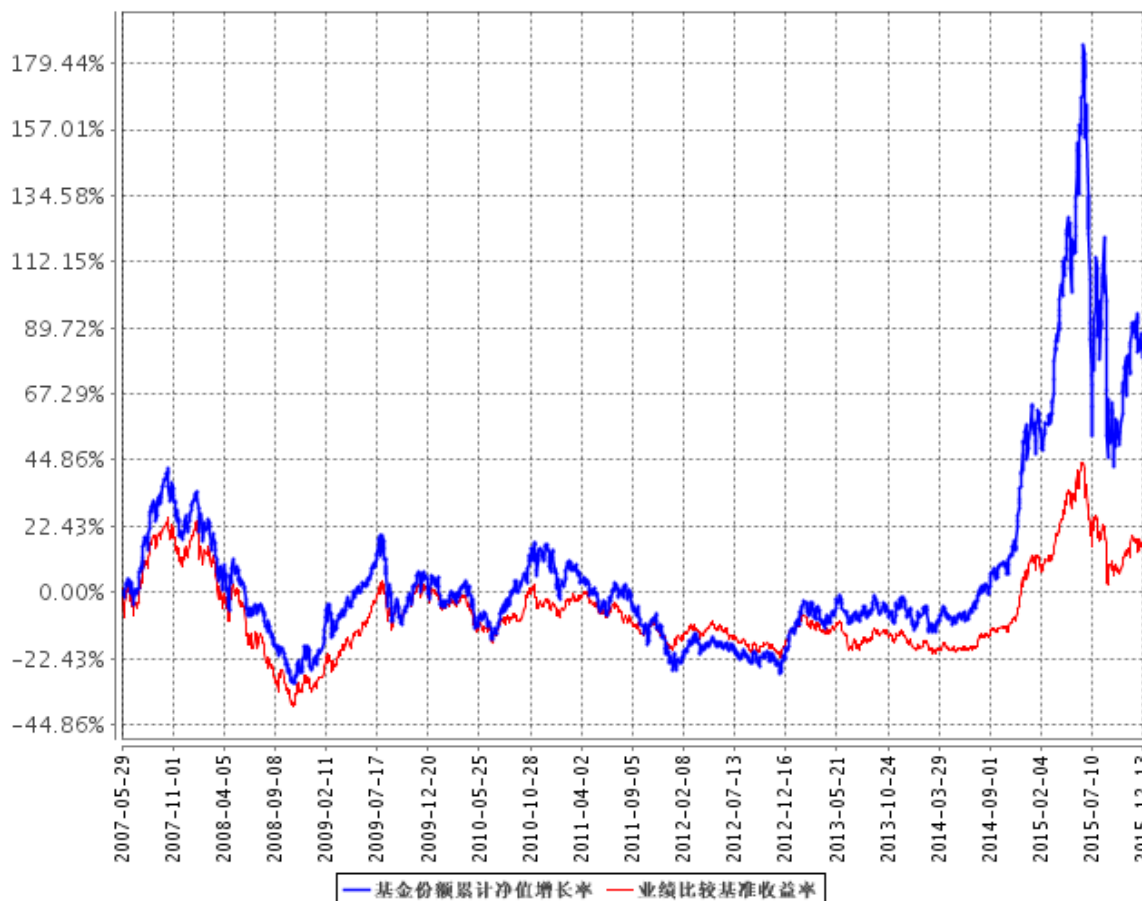
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	24.20%	2.18%	10.71%	1.00%	13.49%	1.18%
过去六个月	-19.27%	3.85%	-9.02%	1.61%	-10.25%	2.24%
过去一年	20.73%	3.22%	6.65%	1.49%	14.08%	1.73%
过去三年	116.62%	2.11%	35.47%	1.07%	81.15%	1.04%
过去五年	67.40%	1.81%	23.91%	0.97%	43.49%	0.84%
自基金合同生效起至今	88.80%	1.73%	17.97%	1.16%	70.83%	0.57%

注：本基金的业绩基准自成立至 2015 年 9 月 30 日由沪深 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；自 2015 年 10 月 1 日起至今由沪深 300 指数和中债国债总指数按照 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

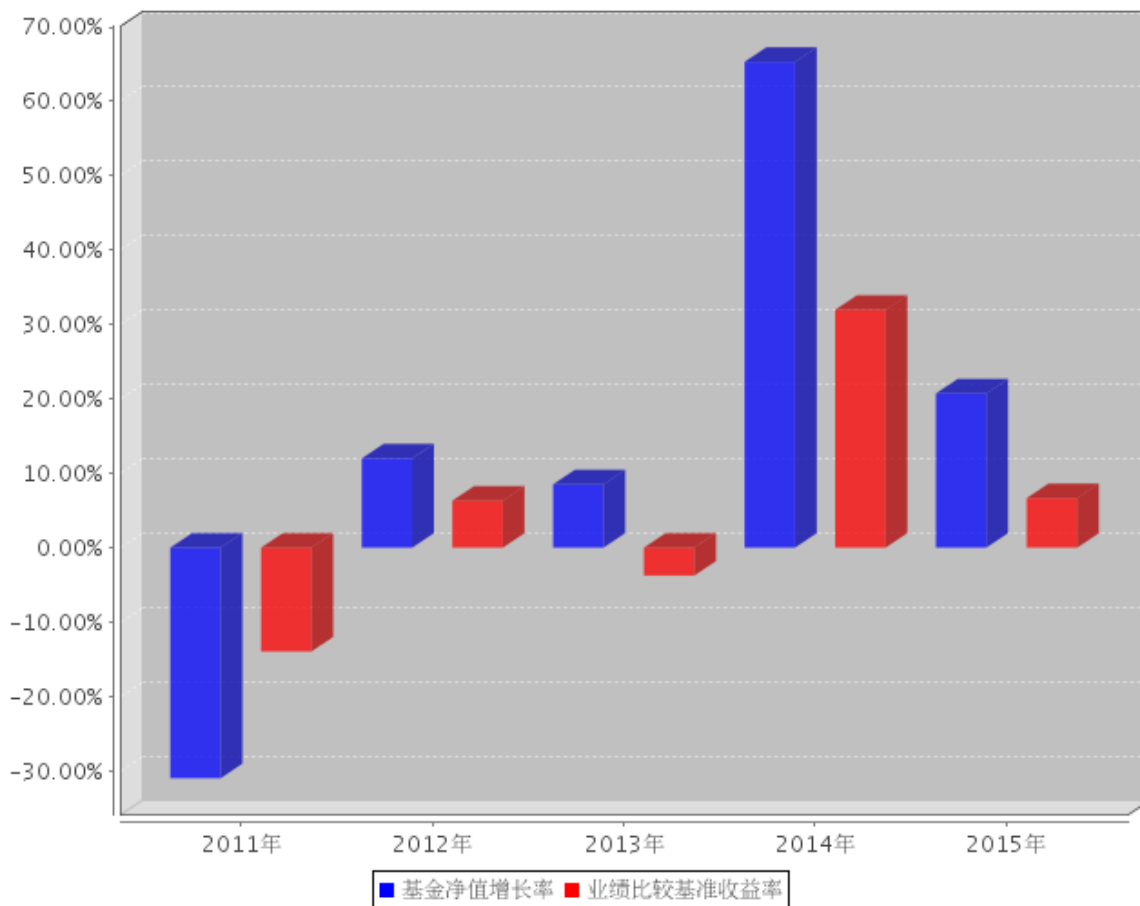


注：图示日期为 2007 年 5 月 29 日至 2015 年 12 月 31 日。

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%。

### 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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2015	0.8500	116,881,266.65	85,580,698.69	202,461,965.34	
2014	-	-	-	-	
2013	-	-	-	-	
合计	0.8500	116,881,266.65	85,580,698.69	202,461,965.34	

## § 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。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。2015 年 3 月起担任华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 4 月起任投资部副总监。2015 年 6 月起任投资部总监。

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。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

本基金年初便对融资融券快速增长的风险高度重视，对市场持谨慎态度，并在持仓结构方面做好防守准备，减持了上一年度涨幅较大的板块，重点配置交运、百货等防守性品种。另外本基金也做好了择时准备。然而，由于这次杠杆崩塌导致的股灾是史无前例的，加之股市下跌伊始就罕见的高调救市风声，以致本基金错失减仓机会。

尽管本基金在过去的一年继续实现了“实现正收益并跑赢业绩基准”的目标，但相对排名并不理想。2015 年市场风格差异巨大是主要原因。本基金参考指数是沪深 300 指数，低估了主题概念股的炒作能力，未能享受“泡沫化生存”带来的交易型机会。

### 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 1.6896 元，本报告期份额净值增长率为 20.73%，同期业绩比较基准增长率为 6.65%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前我国正处于“三期叠加”的特殊时点。经济转型难免会遇到总量增长的压力。尽管宽松的货币环境不改，但其边际作用在降低，而且汇率波动可能带来短期的负面冲击。在积极的财政政策的支持下，预计 2016 年上半年经济情况相对乐观。

经历了 2015 年的剧烈动荡，预计 2016 年市场将更加理性。如果股市不是赌场，它终究会回到“经济晴雨表”的本质上来。“山有多高，谷有多深”，在泡沫消除之后，市场将引来健康发展。展望 2016 年的证券市场，契合经济、技术发展方向的新兴产业在去除泡沫之后将具备更多的机会。

## 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 6 次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的 80%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本期末，基金可供分配利润为 994,852,166.58 元。本报告期内，本基金符合分红条件，于 2015 年 1 月 20 日进行分配，每 10 份基金份额共派发现金红利 0.85 元，利润分配合计 202,461,965.34 元，其中现金形式发放总额为 116,881,266.65 元，再投资形式发放总额为 85,580,698.69 元。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

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 21914 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：华泰柏瑞积极成长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
<b>资产：</b>			
银行存款		404,877,509.55	338,849,433.97
结算备付金		6,443,740.49	11,477,152.54
存出保证金		462,691.94	685,840.42
交易性金融资产		2,025,020,584.54	3,618,609,596.45
其中：股票投资		1,914,785,584.54	3,438,426,596.45
基金投资		-	-
债券投资		110,235,000.00	180,183,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	60,980,136.47
应收证券清算款		45,784,649.68	25,182,078.97
应收利息		2,543,859.78	5,756,012.22
应收股利		-	-
应收申购款		489,563.49	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,485,622,599.47	4,061,540,251.04

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
<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		-	90,077,084.74
应付赎回款		4,120,722.84	159,331,658.44
应付管理人报酬		3,159,480.05	4,807,241.68
应付托管费		526,579.98	801,206.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		4,229,695.06	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		1,010,899.41	1,517,246.58
负债合计		13,047,377.34	262,238,388.89
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		1,463,440,023.34	2,550,314,898.45
未分配利润		1,009,135,198.79	1,248,986,963.70
所有者权益合计		2,472,575,222.13	3,799,301,862.15
负债和所有者权益总计		2,485,622,599.47	4,061,540,251.04

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6896 元，基金份额总额

1,463,440,023.34 份。



## 7.2 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 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
<b>一、收入</b>		504,155,221.57	1,533,600,470.87
1. 利息收入		7,223,964.49	9,327,177.07
其中：存款利息收入		1,550,999.71	969,868.64
债券利息收入		4,762,762.40	6,505,328.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		910,202.38	1,851,979.99
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		972,187,399.21	874,706,020.79
其中：股票投资收益		947,080,834.78	834,539,080.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-286,910.00	-1,141,988.61
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		25,393,474.43	41,308,929.04
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-478,930,158.51	646,512,213.93
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		3,674,016.38	3,055,059.08
<b>减：二、费用</b>		76,296,971.93	66,725,074.00
1. 管理人报酬		46,410,582.00	38,061,410.49
2. 托管费		7,735,096.99	6,343,568.50
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		21,668,683.56	21,849,179.40
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		482,609.38	470,915.61
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		427,858,249.64	1,466,875,396.87
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		427,858,249.64	1,466,875,396.87

### 7.3 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 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）	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（本期净利润）	-	427,858,249.64	427,858,249.64
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）	-1,086,874,875.11	-465,248,049.21	-1,552,122,924.32
其中：1. 基金申购款	1,633,616,482.21	1,498,603,905.25	3,132,220,387.46
2. 基金赎回款	-2,720,491,357.32	-1,963,851,954.46	-4,684,343,311.78
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）	1,463,440,023.34	1,009,135,198.79	2,472,575,222.13
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）	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（本期净利润）	-	1,466,875,396.87	1,466,875,396.87
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）	-435,416,187.84	77,603,603.44	-357,812,584.40

列)			
其中：1. 基金申购款	1,343,389,030.68	181,981,612.76	1,525,370,643.44
2. 基金赎回款	-1,778,805,218.52	-104,378,009.32	-1,883,183,227.84
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）	2,550,314,898.45	1,248,986,963.70	3,799,301,862.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 韩勇 _____	_____ 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金(原名为友邦华泰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，由友邦华泰基金管理有限公司(已自2010年4月30日起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《友邦华泰积极成长混合型证券投资基金基金合同》(现更名为《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，《友邦华泰积极成长混合型证券投资基金基金合同》(现更名为《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%。自基金合同生效日至 2015 年 9 月 30 日，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×60%+中信标普国债指数×40%。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 28 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》，自 2015 年 10 月 1 日起，本基金的业绩比较基准变更为：沪深 300 指数×60%+中债国债总指数×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2016 年 03 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》、《华泰柏瑞积极成长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

除 7.4.5.2 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。

#### 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

本基金在本报告期间无须说明的会计估计变更。

##### 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、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	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(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

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。

#### 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	937,890,296.02	6.87%	1,465,761,658.04	10.25%

###### 7.4.8.1.2 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	851,550.95	6.87%	-	-
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	1,304,916.02	10.15%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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。

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	46,410,582.00	38,061,410.49
其中：支付销售机构的客户维护费	5,150,096.00	4,374,917.47

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。

### 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	7,735,096.99	6,343,568.50

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。

**7.4.8.2.3 销售服务费**

注：本期和上年可比期间均无数据。

**7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：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自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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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	-	4,661,072.26
期末持有的基金份额	-	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.0000%

**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：本报告期及 2014 年度，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	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



	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	404,877,509.55	1,422,422.78	338,849,433.97	837,545.19

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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

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。

#### 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
002465	海格通信	2015年12月30日	筹划重大事项	16.69	2016年2月4日	15.02	5,892,936	63,161,022.70	98,353,101.84	-
600783	鲁信创投	2015年12月31日	重要事项未公告	39.07	2016年1月4日	37.60	2,327,093	74,084,827.60	90,919,523.51	-
600153	建发股份	2015年6月29日	筹划重大资产重组	14.69	-	-	6,001,796	54,098,439.73	88,166,383.24	-
002320	海峡股份	2015年6月25日	筹划重大资产重组	19.29	2016年1月7日	24.69	1,691,822	23,277,113.34	32,635,246.38	-
600859	王府井	2015年	筹划非公开发行股	27.22	2016年1月4日	27.22	800,000	14,558,359.63	21,776,000.00	-

		12月21日	票事项							
600864	哈投股份	2015年10月9日	筹划重大资产重组	10.88	2016年1月14日	11.97	1,299,932	25,543,945.44	14,143,260.16	-
600133	东湖高新	2015年12月28日	筹划非公开发行股票事项	12.10	2016年1月12日	10.89	600,000	7,430,453.75	7,260,000.00	-

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的金融工具中属于第一层次的余额为 1,561,532,069.41 元，属于第二层次的余额为 463,488,515.13 元，无第三层次的余额 (2014 年 12 月 31 日：第一层次 3,315,605,716.50 元，第二层次 303,003,879.95 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或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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	1,914,785,584.54	77.03
	其中：股票	1,914,785,584.54	77.03
2	固定收益投资	110,235,000.00	4.43
	其中：债券	110,235,000.00	4.43
	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	411,321,250.04	16.55
7	其他各项资产	49,280,764.89	1.98
8	合计	2,485,622,599.47	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	55,040,201.28	2.23
B	采矿业	-	-
C	制造业	624,157,792.51	25.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	66,802,008.01	2.70
E	建筑业	116,306,065.44	4.70
F	批发和零售业	305,505,172.84	12.36
G	交通运输、仓储和邮政业	506,592,556.42	20.49
H	住宿和餐饮业	28,814,080.65	1.17

I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	19,375,361.28	0.78
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	-	-
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	101,272,822.60	4.10
S	综合	90,919,523.51	3.68
	合计	1,914,785,584.54	77.44

### 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	000417	合肥百货	11,486,960	125,552,472.80	5.08
2	600350	山东高速	16,145,110	114,791,732.10	4.64
3	603167	渤海轮渡	9,216,641	114,470,681.22	4.63
4	601999	出版传媒	7,974,238	101,272,822.60	4.10
5	002465	海格通信	5,892,936	98,353,101.84	3.98
6	600012	皖通高速	7,035,114	94,059,474.18	3.80
7	000498	山东路桥	10,396,204	93,253,949.88	3.77
8	002202	金风科技	4,074,330	92,853,980.70	3.76
9	600783	鲁信创投	2,327,093	90,919,523.51	3.68
10	600153	建发股份	6,001,796	88,166,383.24	3.57

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

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603167	渤海轮渡	186,215,793.07	4.90
2	000498	山东路桥	159,287,272.90	4.19
3	601999	出版传媒	150,194,874.49	3.95
4	600350	山东高速	144,273,774.53	3.80
5	600115	东方航空	101,424,372.04	2.67
6	000417	合肥百货	97,974,660.73	2.58
7	600789	鲁抗医药	97,629,053.45	2.57
8	600369	西南证券	96,973,246.40	2.55
9	600783	鲁信创投	96,744,342.56	2.55
10	600705	中航资本	94,936,073.37	2.50
11	601111	中国国航	93,774,671.64	2.47
12	601872	招商轮船	92,510,974.57	2.43
13	000713	丰乐种业	88,034,682.48	2.32
14	601318	中国平安	85,999,794.58	2.26
15	002111	威海广泰	84,522,939.94	2.22
16	600894	广日股份	80,084,927.00	2.11
17	600900	长江电力	76,828,462.00	2.02
18	600270	外运发展	76,171,588.72	2.00
19	000830	鲁西化工	72,804,057.44	1.92
20	002500	山西证券	70,933,937.88	1.87

### 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	601111	中国国航	379,099,216.32	9.98
2	600029	南方航空	364,701,783.37	9.60
3	600705	中航资本	315,749,880.43	8.31
4	600221	海南航空	286,203,561.63	7.53
5	000024	招商地产	208,933,773.93	5.50
6	603167	渤海轮渡	193,419,579.72	5.09
7	600115	东方航空	185,005,449.23	4.87
8	600048	保利地产	180,966,114.39	4.76
9	601872	招商轮船	151,729,176.85	3.99
10	600153	建发股份	138,007,624.83	3.63
11	600500	中化国际	105,991,071.47	2.79
12	000732	泰禾集团	95,379,182.84	2.51
13	002465	海格通信	92,283,739.29	2.43
14	600369	西南证券	92,062,412.31	2.42
15	002146	荣盛发展	89,646,430.87	2.36
16	002023	海特高新	86,724,821.09	2.28
17	600900	长江电力	85,236,879.74	2.24
18	601318	中国平安	85,091,672.58	2.24
19	000417	合肥百货	84,033,752.18	2.21
20	000002	万科A	83,702,902.02	2.20
21	600270	外运发展	80,383,048.94	2.12
22	000778	新兴铸管	78,372,359.47	2.06
23	600026	中海发展	78,192,068.78	2.06
24	600690	青岛海尔	78,110,156.70	2.06
25	600012	皖通高速	77,680,361.91	2.04

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	5,829,221,258.57
卖出股票收入（成交）总额	7,820,616,296.75

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	110,235,000.00	4.46
	其中：政策性金融债	110,235,000.00	4.46
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	110,235,000.00	4.46

## 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	150403	15 农发 03	600,000	60,120,000.00	2.43
2	150416	15 农发 16	500,000	50,115,000.00	2.03

## 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：本基金本报告期期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

### 8.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	462,691.94
2	应收证券清算款	45,784,649.68
3	应收股利	-

4	应收利息	2,543,859.78
5	应收申购款	489,563.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,280,764.89

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 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	002465	海格通信	98,353,101.84	3.98	筹划重大事项
2	600783	鲁信创投	90,919,523.51	3.68	重要事项未公告
3	600153	建发股份	88,166,383.24	3.57	筹划重大事项

## § 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
50,123	29,196.98	555,964,137.81	37.99%	907,475,885.53	62.01%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,692,367.18	0.1156%

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（ 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	1,633,616,482.21
减:本报告期基金总赎回份额	2,720,491,357.32
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	1,463,440,023.34

## § 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。

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。

### 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 元人民币，该事务所已向本基金提供了 9 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券		12,332,442,139.22	17.09%	2,157,177.98	17.41%	-
国信证券		11,145,258,484.91	8.39%	1,021,974.90	8.25%	-
中金公司		11,042,451,623.82	7.64%	950,100.72	7.67%	-
浙商证券		11,023,909,487.78	7.50%	906,058.57	7.31%	-
申银万国		11,021,876,820.22	7.49%	933,139.34	7.53%	-
国泰君安		11,000,029,026.51	7.33%	903,503.50	7.29%	-

国金证券	1	943,957,659.37	6.92%	850,126.12	6.86%	-
华泰证券	2	937,890,296.02	6.87%	851,550.95	6.87%	-
招商证券	1	753,028,948.95	5.52%	679,556.22	5.48%	-
西南证券	1	690,026,100.72	5.06%	629,284.92	5.08%	-
长城证券	1	641,394,167.16	4.70%	583,921.85	4.71%	-
东方证券	1	539,782,288.93	3.95%	494,512.23	3.99%	-
中原证券	1	443,229,828.13	3.25%	409,702.59	3.31%	-
方正证券	1	388,634,272.76	2.85%	343,903.08	2.78%	-
德邦证券	1	272,507,490.63	2.00%	248,090.56	2.00%	-
海通证券	1	208,037,742.96	1.52%	186,526.18	1.51%	-
中信证券	1	160,177,436.96	1.17%	145,826.94	1.18%	-
银河证券	1	104,845,290.27	0.77%	95,451.19	0.77%	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	280,000,000.00	16.67%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	700,000,000.00	41.67%	-	-

长城证券	-	-	400,000,000.00	23.81%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	50,000,000.00	2.98%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	150,000,000.00	8.93%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	100,000,000.00	5.95%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

注：1、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。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华泰柏瑞基金管理有限公司  
2016 年 3 月 29 日