

华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资 基金 2015 年年度报告

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 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

本报告期自 2015 年 2 月 6 日起至 2015 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§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.....	10
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	55
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	55
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.....	55

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.....	55
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
8.12 投资组合报告附注.....	55
§9 基金份额持有人信息.....	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
§10 开放式基金份额变动.....	57
§11 重大事件揭示.....	57
11.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
11.4 基金投资策略的改变.....	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
11.8 其他重大事件.....	60
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞创新动力混合
基金主代码	000967
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月6日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	180,789,214.29份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，本基金追求基金资产的长期增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略，精选与经济结构调整与转型主题直接相关，具备长期盈利能力提升的上市公司，力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数（全价）收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199弄上海证大五道口广场 1号17层	北京市复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199弄上海证大五道口广场 1号17层	北京市复兴门内大街1号
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 层及托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 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 2 月 6 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	483,599,511.05
本期利润	508,625,192.76
加权平均基金份额本期利润	0.7387
本期加权平均净值利润率	64.49%
本期基金份额净值增长率	26.60%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配利润	48,162,173.11
期末可供分配基金份额利润	0.2664
期末基金资产净值	228,951,387.40
期末基金份额净值	1.266
3.1.3 累计期末指标	2015 年末
基金份额累计净值增长率	26.60%

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。

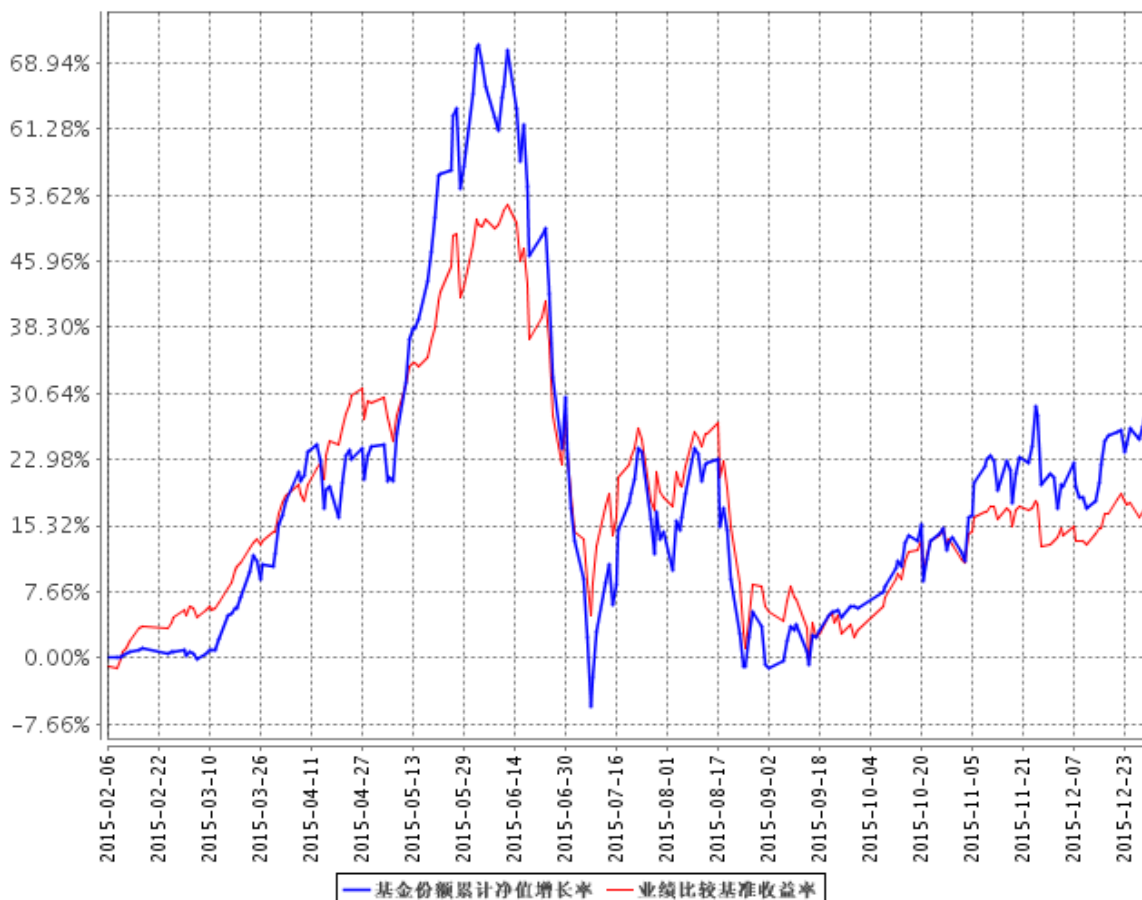
3.2 基金净值表现

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	19.66%	2.00%	12.73%	1.20%	6.93%	0.80%
过去六个月	-2.76%	2.74%	-7.32%	1.97%	4.56%	0.77%
自基金合同生效起至今	26.60%	2.61%	16.60%	1.77%	10.00%	0.84%

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

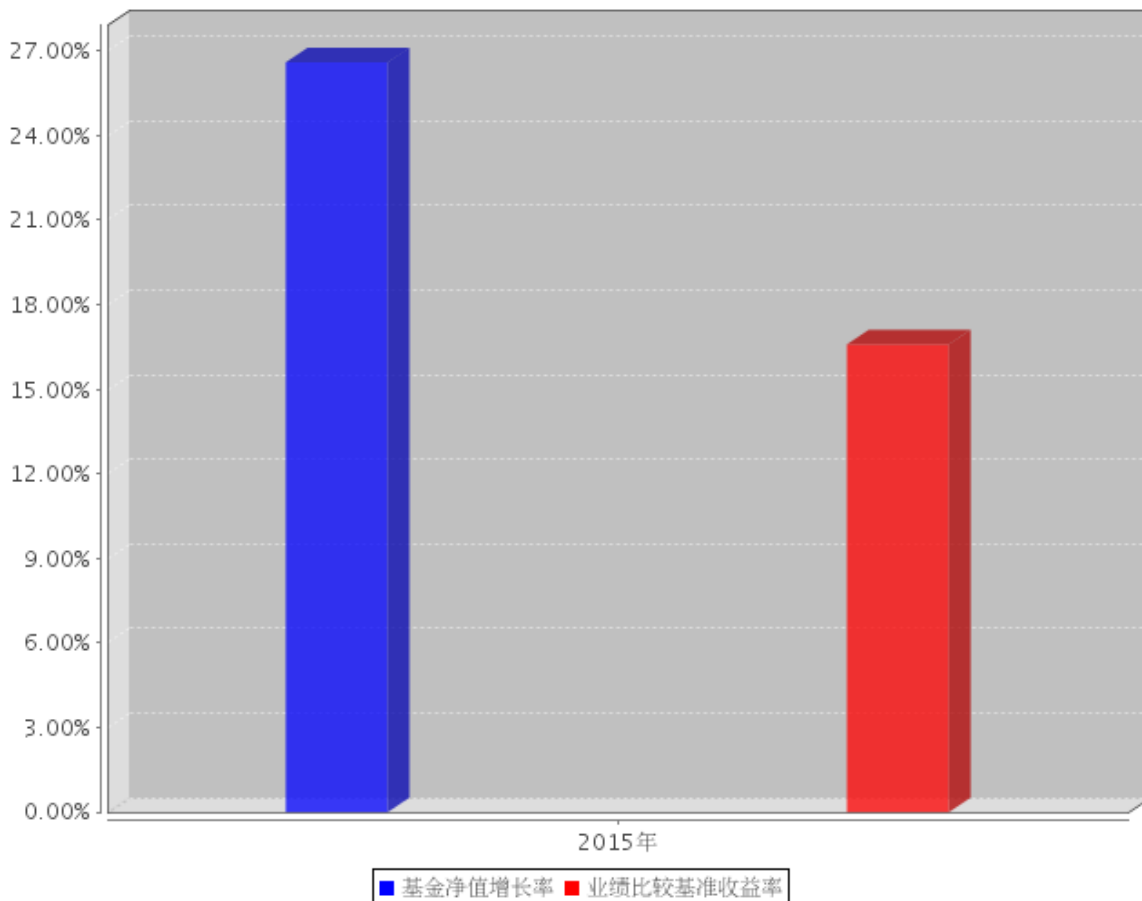


注：图示日期为 2015 年 2 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日。本基金持有的股票占基金资产的比例为 0%–95%，其中投资于创新动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日

终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值 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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2015 年 2 月 6 日生效，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：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		
张慧	本基金的基金经理	2015 年 2 月 6 日	-	9	经济学硕士，8 年证券从业经历。2007 年 7 月至 2010 年 6 月任国泰君安证券股份有限公司研究员。

					<p>2010 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司, 历任研究员、高级研究员、基金经理助理,</p> <p>2013 年 9 月起任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2014 年 5 月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 2 月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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《华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定, 在严格控制风险的基础上, 忠实履行基金管理职责, 为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内, 基金投资管理符合有关法律、法规

的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。本报告期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 年上半年在流动性和杠杆的推动下，股市大幅上涨，致使估值处于较高水平，年中开始的去杠杆使得市场以历史罕见的幅度和速度先后经历两次股灾，9 月份至年底有所反弹，小盘股反弹较多。全年指数收阳，沪深 300 指数上涨 5.58%，创业板指数上涨 84.41%，中证 500 指数上涨 43.12%。

一季度，互联网+概念向全市场各行业扩散，“数据变现”成为投资主线，带动了互联网金融、互联网医疗、工业 4.0、互联网家装、能源互联网、互联网汽车等一系列板块市值的快速上升。传统行业方面，成本改善的钢铁、航空、航运以及央企整合等主题也有不错表现。市场呈现普涨行情，金融板块表现较为落后。

4 月、5 月在杠杆资金推动下指数暴涨，“中小创”表现突出。6 月份市场在严查配资下开始去杠杆，指数快速下跌，后期演化成恐慌性下跌，市场流动性枯竭。7-8 月，随着投资者风险偏好降低，指数出现较大幅度下跌。管理层为避免出现金融危机强力救市，以外力方式打破流动性枯竭，并最终取得了明显的效果，市场的信心在三季度后期逐渐恢复。

四季度前期，由于央行对于汇率稳定的表态以及外盘大涨提升了投资者的风险偏好，市场在纠结中震荡上行。投资者对于股灾的痛苦回忆和基本面的泛善可陈使其持股心态依然不稳，市场不时出现较大幅度波动，较高的换手率体现出市场缺乏长线资金的参与。

本基金在一季度初做了较大幅度的风格切换，在限制两融政策出台后，减持了主板 beta 类资产，上半年重点配置了互联网和医改相关资产。在蓝筹股方面，主要配置了盈利大幅改善的航空股。在主题方面，阶段性参与了环保、信息安全、能源互联网、军工、工业 4.0、新能源汽车等，取得了较好的净值收益。

6 月初尽管降低了部分仓位，但仍显著对下跌的速度和空间估计不足。其间，本基金对组合结构进行了调整，减持了主题投资，增加了业绩与估值匹配的个股配置，但净值仍有回撤较大。三季度维持了较低的股票投资仓位，并通过择时操作使得基金净值在 8 月份股市二次探底中并未创出新低。在四季度，配置了绩优股、IP、她经济、彩票、转型等主题。基于对市场中期逻辑谨慎的看法，仓位虽有一定提升，但在四季度前期较低，拖累了净值表现，致使在股灾期间通过降低仓位获取的超额收益又有一定回吐。

净值增长率 26.6%，高于业绩基准 10 个百分点。

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 1.266 元，本报告期份额净值增长率为 26.6%，同期业绩比较基准增长率为 16.6%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

年初以来由于对国际、国内经济和流动性的担心，叠加股票估值重回高位以及全球风险资产下跌共振，“春季躁动”行情落空，风险偏好急剧下降，跌幅超出我们的预期。

短期市场进入“喘息期”。经济在稳增长政策和库存周期推动下有望阶段性企稳。美国再次加息前，人民币汇率也相对稳定。投资者仓位有所降低，配置结构也开始均衡。部分公司估值进入合理区间。与年初相比，投资环境边际上是改善的，指数存在阶段性修复的机会。但风险偏好重挫后，反弹空间较难给予过高预期。

周期股进入预期推动阶段。在通胀预期推动下，配合美元指数阶段性走弱，大宗商品等资产阶段性存在波动机会，相对看好铝、锌和原油。国内力推地产去库存，如果新开工能够恢复，地产下游相关行业存在估值修复机会。我们认为，预期推动的周期行情进入尾声，后续有待数据检验，目前的调研数据尚不支持。

在流行性边际变差的情况下，成长股面临估值收缩的压力，高估值小盘股的持续反弹需要较高的风险偏好，当前条件尚不具备。随着股价的下跌，合理估值的成长股的风险收益比重新回到相对合理区间，部分优质成长股将迎来中线买点，精选真成长和拐点型的公司才有望获取超额收益。

本基金对全年收益率持谨慎态度。从中期看，如果美国经济顺利复苏，加息周期下的新兴市场将承受压力。如果美国经济持续低于预期，全球经济可能陷入流动性陷阱。国内经济正在转型升级，内生性盈利较难超预期，叠加全球经济和金融形势的复杂局面，A 股独善其身的难度较大。

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业务、交易合规、市场宣传、客户服务、信息技术安全、交易佣金分配等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 25%；基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，收益分配基准日可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配。截止本报告期末，本基金可分配收益为 48,162,173.11 元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞创新动力混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 21905 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	华泰柏瑞创新动力混合型证券投资基金全体基金份额持有人：	
引言段	我们审计了后附的华泰柏瑞创新动力混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞创新动力混合基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是华泰柏瑞创新动力混合基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述华泰柏瑞创新动力混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华泰柏瑞创新动力混合基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 2 月 6 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。	
注册会计师的姓名	单峰	张勇

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2016 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞创新动力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	7.4.7.1	4,603,816.34
结算备付金		1,923,538.69
存出保证金		497,688.98
交易性金融资产	7.4.7.2	224,910,586.45
其中：股票投资		214,903,586.45
基金投资		-
债券投资		10,007,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		1,262,957.53
应收利息	7.4.7.5	72,856.84
应收股利		-
应收申购款		119,220.62
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		233,390,665.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		1,984,550.37

应付管理人报酬		293,972.99
应付托管费		48,995.49
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	1,714,731.20
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	397,028.00
负债合计		4,439,278.05
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	180,789,214.29
未分配利润	7.4.7.10	48,162,173.11
所有者权益合计		228,951,387.40
负债和所有者权益总计		233,390,665.45

注：1、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.266 元，基金份额总额 180,789,214.29 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2015 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 2 月 6 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 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		536,969,955.25
1. 利息收入		6,961,128.41
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,879,791.01
债券利息收入		67,622.95
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		5,013,714.45
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		494,866,281.74
其中：股票投资收益	7.4.7.12	493,411,338.84
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-

衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	1,454,942.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	25,025,681.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	10,116,863.39
减：二、费用		28,344,762.49
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	11,030,486.05
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,838,414.35
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	15,063,102.99
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	412,759.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		508,625,192.76
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		508,625,192.76

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 2 月 6 日（基金合同生效日）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）	2,312,980,881.15	-	2,312,980,881.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	508,625,192.76	508,625,192.76
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）	-2,132,191,666.86	-460,463,019.65	-2,592,654,686.51
其中：1. 基金申购款	220,584,301.24	64,637,104.67	285,221,405.91

2. 基金赎回款	-2,352,775,968.10	-525,100,124.32	-2,877,876,092.42
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）	180,789,214.29	48,162,173.11	228,951,387.40

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

华泰柏瑞创新动力灵活配置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”)证监许可[2014]1362号《关于核准华泰柏瑞创新动力灵活配置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《华泰柏瑞创新动力灵活配置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2,312,478,960.89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(2015)第102号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年2月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,312,980,881.15份基金份额,其中认购资金利息折合501,920.26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《华泰柏瑞创新动力灵活配置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(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、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金持有的股票占基金资产的比例为0%-95%,其中投资于创新动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的80%;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,本基

金保留的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值 5%。中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数（全价）收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 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》、《华泰柏瑞创新动力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 6.4.4 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 2 月 6 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 2 月 6 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金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中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值技术进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中证指数有限公司独立提供。

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，包括买卖债券的差价收入，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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	4,603,816.34
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计：	4,603,816.34

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	189,881,904.74	214,903,586.45	25,021,681.71	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	10,003,000.00	10,007,000.00	4,000.00
	合计	10,003,000.00	10,007,000.00	4,000.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	199,884,904.74	224,910,586.45	25,025,681.71	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无期末买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	3,742.75
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	1,244.74
应收债券利息	67,622.95
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	246.40
合计	72,856.84

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,714,731.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,714,731.20

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,028.00
预提费用	390,000.00
合计	397,028.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年2月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,312,980,881.15	2,312,980,881.15
本期申购	220,584,301.24	220,584,301.24
本期赎回(以“-”号填列)	-2,352,775,968.10	-2,352,775,968.10
- 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	180,789,214.29	180,789,214.29

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2015 年 1 月 12 日至 2015 年 1 月 30 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 2,312,478,960.89 元。根据《华泰柏瑞创新动力混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 501,920.26 元在本基金成立后，折算为 501,920.26 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《华泰柏瑞创新动力混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2015 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 3 月 29 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务和转换业务自 2015 年 3 月 30 日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	483,599,511.05	25,025,681.71	508,625,192.76
本期基金份额交易产生的变动数	-401,355,413.93	-59,107,605.72	-460,463,019.65
其中：基金申购款	76,926,039.06	-12,288,934.39	64,637,104.67
基金赎回款	-478,281,452.99	-46,818,671.33	-525,100,124.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	82,244,097.12	-34,081,924.01	48,162,173.11

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,670,652.33
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	194,873.51
其他	14,265.17
合计	1,879,791.01

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年2月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	5,097,540,664.49
减：卖出股票成本总额	4,604,129,325.65
买卖股票差价收入	493,411,338.84

7.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内未投资资产支持证券。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内未投资贵金属。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内未投资衍生工具。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年2月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,454,942.90
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,454,942.90

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年2月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	25,025,681.71
——股票投资	25,021,681.71
——债券投资	4,000.00
——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	25,025,681.71

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年2月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	9,997,651.80
转换费收入	119,211.59
合计	10,116,863.39

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

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

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年2月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	15,063,102.99
银行间市场交易费用	-
合计	15,063,102.99

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年2月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日
审计费用	90,000.00
信息披露费	300,000.00
银行划款手续费	13,559.10
其他费用	200.00
银行间账户服务费	9,000.00
合计	412,759.10

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
柏瑞投资有限责任公司	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

注：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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年2月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券股份	28,121,340.77	0.28%

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年2月6日(基金合同生效日)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	25,137.15	0.28%	-	-

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 2 月 6 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	11,030,486.05
其中：支付销售机构的客户维护费	6,528,636.56

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 2 月 6 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	1,838,414.35

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2015 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2015 年 2 月 6 日）持有的基金份额	-
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	4,848,690.59

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	4,848,690.59
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.6800%

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年2月6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
中国银行股份有限公司	4,603,816.34	1,670,652.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金报告期末未参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金报告期末未持有认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	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
002020	京新药业	2015年12月29日	临时停牌	33.55	2016年1月20日	30.20	164,000	5,316,643.00	5,502,200.00	-

002612	朗姿股份	2015年12月22日	临时停牌	75.46	-	-	52,000	2,159,682.94	3,923,920.00	-
002383	合众思壮	2015年12月15日	临时停牌	40.35	2016年3月17日	36.32	70,000	2,723,037.00	2,824,500.00	-
000796	凯撒旅游	2015年11月9日	临时停牌	27.46	-	-	100,000	2,686,696.80	2,746,000.00	-
603010	万盛股份	2015年12月29日	临时停牌	55.70	-	-	40,000	2,355,392.40	2,228,000.00	-
002707	众信旅游	2015年11月16日	临时停牌	52.62	2016年3月15日	47.36	200	6,740.00	10,524.00	-
300431	暴风科技	2015年10月27日	临时停牌	95.83	-	-	100	4,510.00	9,583.00	-

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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末没有在银行间市场债券正回购交易中抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末没有在交易所市场债券正回购交易中抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

是对风险管理工作的总结和披露。

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基

基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、存出保证金和结算备付金，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,603,816.34	-	-	-	-	-	4,603,816.34
结算备付金	1,923,538.69	-	-	-	-	-	1,923,538.69
存出保证金	497,688.98	-	-	-	-	-	497,688.98
交易性金融资产	-	-	10,007,000.00	-	-	214,903,586.45	224,910,586.45
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,262,957.53	1,262,957.53
应收利息	-	-	-	-	-	72,856.84	72,856.84
应收申购款	-	-	-	-	-	119,220.62	119,220.62
资产总计	7,025,044.01	-	10,007,000.00	-	-	216,358,621.44	233,390,665.45
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,984,550.37	1,984,550.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	293,972.99	293,972.99
应付托管费	-	-	-	-	-	48,995.49	48,995.49
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,714,731.20	1,714,731.20
其他负债	-	-	-	-	-	397,028.00	397,028.00
负债总计	-	-	-	-	-	4,439,278.05	4,439,278.05
利率敏感度缺口	7,025,044.01	-	10,007,000.00	-	-	211,919,343.39	228,951,387.40

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 12 月 31 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 4.37%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本

基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金将采取积极、主动的资产配置策略，精选与经济结构调整与转型主题直接相关，具备长期盈利能力提升的上市公司，力求实现基金资产的长期增值。 本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的方法，深入挖掘在中国经济结构调整和产业升级过程中出现的主题投资机会。持续跟踪国家政策、产业发展趋势、技术、工艺、商业模式的最新变化，对创新和转型升级主题相关行业的范围进行动态调整。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

基金的投资组合比例为：本基金持有的股票占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于创新动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；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，本基金保留的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值 5%。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	214,903,586.45	93.86
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	10,007,000.00	4.37
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	224,910,586.45	98.24

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除本基金业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末（2015年12月31日）
	业绩比较基准下降 5%	减少 916.00
	业绩比较基准上升 5%	增加 916.00

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 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 168,002,676.00 元，属于第二层次的余额为 56,907,910.44 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	214,903,586.45	92.08
	其中：股票	214,903,586.45	92.08
2	固定收益投资	10,007,000.00	4.29
	其中：债券	10,007,000.00	4.29
	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	6,527,355.03	2.80
7	其他各项资产	1,952,723.97	0.84
8	合计	233,390,665.45	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	168,465,787.45	73.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	13,085,150.00	5.72
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	2,746,000.00	1.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,816,030.10	4.72
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,382,100.00	1.91
L	租赁和商务服务业	5,716,524.00	2.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,691,994.90	4.23
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	214,903,586.45	93.86

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	000971	高升控股	848,289	29,656,183.44	12.95
2	002094	青岛金王	442,920	13,796,958.00	6.03
3	002229	鸿博股份	240,000	7,142,400.00	3.12
4	600593	大连圣亚	127,910	6,573,294.90	2.87
5	000593	大通燃气	450,000	6,448,500.00	2.82
6	600146	商赢环球	189,000	6,206,760.00	2.71

7	002425	凯撒股份	200,049	5,799,420.51	2.53
8	002181	粤传媒	360,000	5,706,000.00	2.49
9	603000	人民网	249,910	5,700,447.10	2.49
10	002020	京新药业	164,000	5,502,200.00	2.40
11	300230	永利股份	140,000	5,231,800.00	2.29
12	300202	聚龙股份	153,860	4,952,753.40	2.16
13	300136	信维通信	164,000	4,846,200.00	2.12
14	002072	凯瑞德	200,000	4,844,000.00	2.12
15	300211	亿通科技	160,000	4,657,600.00	2.03
16	002285	世联行	270,000	4,382,100.00	1.91
17	002456	欧菲光	140,000	4,342,800.00	1.90
18	300241	瑞丰光电	240,000	4,320,000.00	1.89
19	002612	朗姿股份	52,000	3,923,920.00	1.71
20	300095	华伍股份	250,000	3,792,500.00	1.66
21	600576	万家文化	135,000	3,670,650.00	1.60
22	002656	卡奴迪路	120,000	3,433,200.00	1.50
23	002590	万安科技	130,000	3,237,000.00	1.41
24	300031	宝通科技	100,000	3,140,000.00	1.37
25	600706	曲江文旅	130,000	3,118,700.00	1.36
26	600137	浪莎股份	79,950	3,056,488.50	1.33
27	600233	大杨创世	120,000	3,015,600.00	1.32
28	002674	兴业科技	150,000	2,977,500.00	1.30
29	600306	商业城	100,000	2,966,000.00	1.30
30	300340	科恒股份	79,905	2,902,149.60	1.27
31	002383	合众思壮	70,000	2,824,500.00	1.23
32	002635	安洁科技	100,000	2,780,000.00	1.21
33	000796	凯撒旅游	100,000	2,746,000.00	1.20
34	300051	三五互联	100,000	2,650,000.00	1.16
35	601566	九牧王	115,000	2,628,900.00	1.15
36	002376	新北洋	140,000	2,587,200.00	1.13
37	002406	远东传动	200,000	2,528,000.00	1.10
38	002284	亚太股份	120,000	2,481,600.00	1.08
39	300405	科隆精化	42,000	2,477,580.00	1.08
40	002029	七匹狼	180,000	2,460,600.00	1.07
41	002280	联络互动	40,000	2,456,000.00	1.07
42	002598	山东章鼓	171,600	2,383,524.00	1.04
43	300177	中海达	120,000	2,301,600.00	1.01
44	300308	中际装备	100,000	2,266,000.00	0.99
45	603010	万盛股份	40,000	2,228,000.00	0.97

46	000955	欣龙控股	210,000	2,123,100.00	0.93
47	603268	松发股份	27,000	1,854,360.00	0.81
48	600184	光电股份	48,000	1,387,680.00	0.61
49	300198	纳川股份	70,000	1,101,100.00	0.48
50	300101	振芯科技	15,000	442,650.00	0.19
51	600836	界龙实业	10,000	313,100.00	0.14
52	002322	理工监测	10,000	252,700.00	0.11
53	002615	哈尔斯	10,000	241,700.00	0.11
54	300045	华力创通	1,000	24,460.00	0.01
55	002707	众信旅游	200	10,524.00	0.00
56	300431	暴风科技	100	9,583.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	600029	南方航空	138,798,108.24	60.62
2	300253	卫宁软件	119,320,791.27	52.12
3	600536	中国软件	117,459,618.82	51.30
4	000566	海南海药	110,531,269.17	48.28
5	600061	国投安信	101,055,133.69	44.14
6	600594	益佰制药	98,442,235.53	43.00
7	002467	二六三	92,182,225.93	40.26
8	002153	石基信息	90,403,033.15	39.49
9	600999	招商证券	76,481,999.31	33.41
10	600115	东方航空	75,363,963.80	32.92
11	002081	金螳螂	72,859,038.15	31.82
12	300059	东方财富	67,847,841.30	29.63
13	600570	恒生电子	65,264,578.90	28.51
14	002405	四维图新	64,737,915.92	28.28
15	000166	申万宏源	63,937,247.75	27.93
16	000709	河北钢铁	61,938,918.43	27.05
17	000997	新大陆	58,029,135.14	25.35
18	601000	唐山港	53,255,644.74	23.26
19	002344	海宁皮城	51,473,058.04	22.48

20	600198	大唐电信	51,072,985.83	22.31
21	000733	振华科技	48,532,329.15	21.20
22	000732	泰禾集团	47,335,393.39	20.67
23	600559	老白干酒	47,145,004.50	20.59
24	601989	中国重工	46,202,386.70	20.18
25	600895	张江高科	45,607,752.57	19.92
26	000035	中国天楹	42,682,713.26	18.64
27	601111	中国国航	40,083,750.66	17.51
28	002183	怡亚通	39,974,332.95	17.46
29	300011	鼎汉技术	39,435,074.31	17.22
30	002398	建研集团	39,090,713.10	17.07
31	300081	恒信移动	38,842,708.00	16.97
32	601021	春秋航空	38,070,775.06	16.63
33	600741	华域汽车	37,644,805.36	16.44
34	600521	华海药业	35,131,760.36	15.34
35	000963	华东医药	35,051,012.92	15.31
36	000971	高升控股	34,952,255.45	15.27
37	002675	东诚药业	34,478,416.75	15.06
38	601166	兴业银行	34,403,363.74	15.03
39	000998	隆平高科	34,391,304.50	15.02
40	002236	大华股份	34,348,965.50	15.00
41	600391	成发科技	34,231,508.03	14.95
42	600005	武钢股份	34,040,617.49	14.87
43	300038	梅泰诺	32,915,391.09	14.38
44	002544	杰赛科技	32,307,836.44	14.11
45	600446	金证股份	31,827,573.51	13.90
46	601628	中国人寿	30,781,500.60	13.44
47	300017	网宿科技	30,098,656.85	13.15
48	002407	多氟多	29,737,398.58	12.99
49	002612	朗姿股份	29,165,781.85	12.74
50	600409	三友化工	28,818,313.50	12.59
51	600150	中国船舶	28,717,885.40	12.54
52	300234	开尔新材	28,448,881.42	12.43
53	600685	中船防务	28,325,585.40	12.37
54	600138	中青旅	26,638,493.82	11.63
55	600837	海通证券	26,502,696.84	11.58

56	600376	首开股份	25,984,068.89	11.35
57	600143	金发科技	25,626,531.61	11.19
58	600048	保利地产	25,494,750.91	11.14
59	601126	四方股份	24,843,344.00	10.85
60	000024	招商地产	24,717,416.43	10.80
61	002121	科陆电子	24,621,685.58	10.75
62	002094	青岛金王	24,311,017.90	10.62
63	600597	光明乳业	24,137,732.74	10.54
64	600587	新华医疗	23,134,063.00	10.10
65	000901	航天科技	23,035,198.08	10.06
66	000902	新洋丰	22,413,182.47	9.79
67	002251	步步高	22,329,245.30	9.75
68	300286	安科瑞	22,204,317.50	9.70
69	002428	云南锗业	21,585,370.52	9.43
70	002450	康得新	21,135,413.84	9.23
71	300291	华录百纳	21,027,090.40	9.18
72	002400	省广股份	20,538,291.46	8.97
73	000400	许继电气	20,522,618.75	8.96
74	600068	葛洲坝	19,936,119.00	8.71
75	300104	乐视网	19,901,966.54	8.69
76	601886	江河创建	19,512,172.80	8.52
77	002456	欧菲光	18,724,810.89	8.18
78	600651	飞乐音响	18,444,999.80	8.06
79	002169	智光电气	18,110,564.02	7.91
80	600674	川投能源	17,792,382.00	7.77
81	600118	中国卫星	17,777,254.35	7.76
82	300068	南都电源	17,765,986.00	7.76
83	002063	远光软件	17,756,234.92	7.76
84	300075	数字政通	17,681,969.42	7.72
85	002589	瑞康医药	17,572,206.50	7.68
86	600030	中信证券	17,467,412.98	7.63
87	601601	中国太保	17,417,370.38	7.61
88	300404	博济医药	17,147,899.00	7.49
89	002699	美盛文化	16,997,454.95	7.42
90	002657	中科金财	16,869,843.90	7.37
91	002616	长青集团	16,748,953.31	7.32

92	002546	新联电子	16,725,999.50	7.31
93	600406	国电南瑞	16,243,684.00	7.09
94	002009	天奇股份	16,143,791.69	7.05
95	600718	东软集团	15,957,513.98	6.97
96	002184	海得控制	15,918,696.55	6.95
97	000530	大冷股份	15,658,771.36	6.84
98	002364	中恒电气	15,305,400.88	6.69
99	601336	新华保险	14,890,392.12	6.50
100	300077	国民技术	14,340,484.20	6.26
101	000417	合肥百货	14,061,088.67	6.14
102	600729	重庆百货	13,725,779.10	6.00
103	600571	信雅达	13,670,097.80	5.97
104	002271	东方雨虹	13,370,986.98	5.84
105	600519	贵州茅台	13,012,207.50	5.68
106	300267	尔康制药	12,675,099.48	5.54
107	600863	内蒙华电	12,647,950.00	5.52
108	300083	劲胜精密	12,095,587.17	5.28
109	002273	水晶光电	11,611,367.79	5.07
110	603368	柳州医药	11,267,688.00	4.92
111	600270	外运发展	11,254,291.82	4.92
112	603899	晨光文具	11,177,993.00	4.88
113	000596	古井贡酒	11,177,836.80	4.88
114	002308	威创股份	10,847,081.11	4.74
115	002519	银河电子	10,725,937.60	4.68
116	002568	百润股份	10,679,378.00	4.66
117	002375	亚厦股份	10,638,015.05	4.65
118	601607	上海医药	10,629,748.00	4.64
119	002425	凯撒股份	10,608,753.68	4.63
120	300336	新文化	10,535,393.96	4.60
121	002250	联化科技	10,025,693.00	4.38
122	601058	赛轮金宇	9,999,774.96	4.37
123	600703	三安光电	9,989,162.75	4.36
124	300356	光一科技	9,962,817.02	4.35
125	000750	国海证券	9,953,246.00	4.35
126	002718	友邦吊顶	9,614,000.00	4.20
127	000939	凯迪生态	9,575,613.12	4.18

128	000919	金陵药业	9,447,487.00	4.13
129	300144	宋城演艺	9,414,457.84	4.11
130	002311	海大集团	9,365,946.06	4.09
131	002022	科华生物	9,270,000.00	4.05
132	300273	和佳股份	9,238,648.56	4.04
133	000018	神州长城	9,122,791.90	3.98
134	601390	中国中铁	8,934,500.00	3.90
135	600358	国旅联合	8,648,828.53	3.78
136	300364	中文在线	8,610,230.80	3.76
137	002024	苏宁云商	8,341,900.00	3.64
138	300431	暴风科技	8,262,217.21	3.61
139	002229	鸿博股份	8,199,573.00	3.58
140	300335	迪森股份	8,036,786.40	3.51
141	600485	信威集团	7,957,048.00	3.48
142	600894	广日股份	7,720,150.00	3.37
143	300230	永利股份	6,967,361.45	3.04
144	600415	小商品城	6,678,281.81	2.92
145	600109	国金证券	6,573,890.00	2.87
146	601313	江南嘉捷	6,531,163.00	2.85
147	600820	隧道股份	6,441,862.13	2.81
148	600146	商赢环球	6,274,250.00	2.74
149	600026	中海发展	6,266,612.00	2.74
150	601872	招商轮船	6,259,433.00	2.73
151	600185	格力地产	6,249,563.79	2.73
152	300413	快乐购	6,129,161.00	2.68
153	600398	海澜之家	6,124,775.59	2.68
154	002074	国轩高科	6,120,572.00	2.67
155	002423	中原特钢	6,020,413.70	2.63
156	600617	国新能源	6,000,730.00	2.62
157	600682	南京新百	5,995,780.55	2.62
158	002588	史丹利	5,983,921.00	2.61
159	000669	金鸿能源	5,976,305.20	2.61
160	300065	海兰信	5,950,298.18	2.60
161	300388	国祯环保	5,898,622.00	2.58
162	603000	人民网	5,630,834.65	2.46
163	000593	大通燃气	5,525,746.00	2.41

164	300187	永清环保	5,519,779.00	2.41
165	000738	中航动控	5,497,214.60	2.40
166	300389	艾比森	5,487,184.00	2.40
167	603111	康尼机电	5,484,990.00	2.40
168	600433	冠豪高新	5,478,090.57	2.39
169	002304	洋河股份	5,439,944.00	2.38
170	000958	东方能源	5,427,144.00	2.37
171	002322	理工监测	5,409,595.80	2.36
172	002665	首航节能	5,367,594.00	2.34
173	300237	美晨科技	5,357,231.90	2.34
174	600418	江淮汽车	5,346,637.00	2.34
175	300113	顺网科技	5,324,521.00	2.33
176	002020	京新药业	5,316,643.00	2.32
177	600129	太极集团	5,306,242.00	2.32
178	002367	康力电梯	5,297,901.00	2.31
179	600969	郴电国际	5,270,622.00	2.30
180	002053	云南盐化	5,222,842.92	2.28
181	000768	中航飞机	5,158,561.12	2.25
182	002072	凯瑞德	5,156,156.00	2.25
183	002494	华斯股份	5,113,107.20	2.23
184	300136	信维通信	4,965,540.37	2.17
185	002181	粤传媒	4,926,961.74	2.15
186	000069	华侨城 A	4,885,653.38	2.13
187	600593	大连圣亚	4,875,323.00	2.13
188	002285	世联行	4,808,419.00	2.10
189	601766	中国中车	4,719,800.10	2.06
190	603268	松发股份	4,672,425.00	2.04
191	002565	上海绿新	4,656,310.02	2.03
192	000793	华闻传媒	4,593,774.75	2.01

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

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	600029	南方航空	180,585,845.63	78.88

2	300253	卫宁软件	180,177,856.79	78.70
3	000566	海南海药	147,611,840.53	64.47
4	600594	益佰制药	118,339,560.91	51.69
5	600536	中国软件	106,974,573.29	46.72
6	600061	国投安信	104,493,193.90	45.64
7	002153	石基信息	102,008,723.37	44.55
8	002467	二六三	99,627,030.74	43.51
9	600570	恒生电子	97,355,108.34	42.52
10	002405	四维图新	89,846,922.75	39.24
11	600999	招商证券	79,316,866.52	34.64
12	002081	金螳螂	76,257,775.36	33.31
13	600115	东方航空	76,063,671.99	33.22
14	000709	河北钢铁	74,828,777.87	32.68
15	002612	朗姿股份	65,760,108.74	28.72
16	000166	申万宏源	63,593,540.45	27.78
17	000997	新大陆	62,678,572.22	27.38
18	600198	大唐电信	58,454,526.00	25.53
19	300081	恒信移动	56,606,351.10	24.72
20	601989	中国重工	56,494,395.21	24.68
21	601000	唐山港	56,266,432.44	24.58
22	600559	老白干酒	54,816,277.03	23.94
23	300059	东方财富	54,662,642.95	23.88
24	002344	海宁皮城	54,490,772.69	23.80
25	600895	张江高科	51,608,513.19	22.54
26	601021	春秋航空	50,416,829.04	22.02
27	300011	鼎汉技术	49,442,581.28	21.60
28	000732	泰禾集团	48,797,786.57	21.31
29	601111	中国国航	48,422,506.65	21.15
30	000733	振华科技	47,801,787.00	20.88
31	002183	怡亚通	46,782,956.41	20.43
32	600741	华域汽车	45,841,596.97	20.02
33	002398	建研集团	45,238,419.60	19.76
34	000035	中国天楹	44,652,460.67	19.50
35	600521	华海药业	42,870,631.46	18.72
36	000998	隆平高科	41,580,789.08	18.16
37	600391	成发科技	38,871,816.06	16.98
38	300017	网宿科技	38,089,014.22	16.64
39	000963	华东医药	37,572,420.72	16.41

40	002236	大华股份	35,922,483.10	15.69
41	600446	金证股份	35,896,014.60	15.68
42	600685	中船防务	35,333,163.60	15.43
43	600597	光明乳业	34,880,358.00	15.23
44	600150	中国船舶	34,647,543.99	15.13
45	600005	武钢股份	33,823,202.00	14.77
46	601166	兴业银行	33,602,604.21	14.68
47	300291	华录百纳	32,643,985.15	14.26
48	600409	三友化工	30,975,778.38	13.53
49	002407	多氟多	30,939,418.00	13.51
50	002675	东诚药业	30,652,347.86	13.39
51	002121	科陆电子	30,605,391.40	13.37
52	300234	开尔新材	30,283,014.55	13.23
53	002544	杰赛科技	30,025,554.49	13.11
54	601628	中国人寿	29,644,776.78	12.95
55	600143	金发科技	27,548,994.22	12.03
56	002699	美盛文化	26,287,871.78	11.48
57	600837	海通证券	25,801,703.45	11.27
58	300075	数字政通	25,718,405.16	11.23
59	000024	招商地产	25,454,848.56	11.12
60	002428	云南锗业	24,763,955.27	10.82
61	300038	梅泰诺	24,436,750.00	10.67
62	600376	首开股份	24,379,195.88	10.65
63	600048	保利地产	24,258,528.02	10.60
64	600138	中青旅	24,249,526.88	10.59
65	002400	省广股份	23,793,032.54	10.39
66	600571	信雅达	23,512,808.00	10.27
67	601886	江河创建	23,199,172.06	10.13
68	002251	步步高	23,167,387.70	10.12
69	002616	长青集团	22,529,444.07	9.84
70	002450	康得新	22,367,210.46	9.77
71	600587	新华医疗	21,615,410.46	9.44
72	002589	瑞康医药	20,840,444.37	9.10
73	000902	新洋丰	20,497,459.85	8.95
74	600068	葛洲坝	20,438,432.28	8.93
75	603899	晨光文具	19,902,430.60	8.69
76	000400	许继电气	19,867,728.85	8.68
77	002456	欧菲光	19,488,811.64	8.51

78	600118	中国卫星	19,214,937.72	8.39
79	300104	乐视网	18,603,254.42	8.13
80	300077	国民技术	18,101,521.53	7.91
81	600030	中信证券	17,854,950.40	7.80
82	600651	飞乐音响	17,740,872.33	7.75
83	601601	中国太保	17,629,872.98	7.70
84	601126	四方股份	17,624,877.00	7.70
85	002184	海得控制	17,484,370.83	7.64
86	300431	暴风科技	17,284,759.00	7.55
87	000530	大冷股份	16,387,577.78	7.16
88	002094	青岛金王	16,066,057.30	7.02
89	600406	国电南瑞	16,061,614.45	7.02
90	002657	中科金财	15,522,932.74	6.78
91	002009	天奇股份	15,402,609.00	6.73
92	002546	新联电子	14,912,672.00	6.51
93	002022	科华生物	14,790,531.00	6.46
94	000901	航天科技	14,675,379.40	6.41
95	601607	上海医药	14,665,352.49	6.41
96	000417	合肥百货	14,518,598.87	6.34
97	300083	劲胜精密	14,200,948.45	6.20
98	600674	川投能源	13,954,591.84	6.10
99	600729	重庆百货	13,917,811.19	6.08
100	600718	东软集团	13,736,479.25	6.00
101	601336	新华保险	13,363,660.11	5.84
102	600863	内蒙华电	13,283,259.00	5.80
103	300364	中文在线	13,202,224.49	5.77
104	002271	东方雨虹	13,134,022.18	5.74
105	300336	新文化	12,855,000.00	5.61
106	300286	安科瑞	12,802,610.00	5.59
107	300068	南都电源	12,588,794.99	5.50
108	600519	贵州茅台	12,503,047.83	5.46
109	000971	高升控股	12,495,496.78	5.46
110	002063	远光软件	12,478,643.40	5.45
111	600270	外运发展	11,759,418.00	5.14
112	601058	赛轮金宇	11,637,236.26	5.08
113	002568	百润股份	11,587,600.50	5.06
114	601390	中国中铁	11,560,000.00	5.05
115	000596	古井贡酒	11,554,592.86	5.05

116	603368	柳州医药	11,365,437.00	4.96
117	300267	尔康制药	11,087,356.78	4.84
118	002169	智光电气	11,052,636.10	4.83
119	300144	宋城演艺	10,972,112.75	4.79
120	300356	光一科技	10,949,661.00	4.78
121	300388	国祯环保	10,893,863.00	4.76
122	002273	水晶光电	10,699,996.76	4.67
123	000018	神州长城	10,623,269.30	4.64
124	300273	和佳股份	10,110,346.00	4.42
125	002425	凯撒股份	10,005,493.66	4.37
126	000750	国海证券	9,943,058.21	4.34
127	002375	亚厦股份	9,917,302.85	4.33
128	002250	联化科技	9,913,744.80	4.33
129	000939	凯迪生态	9,561,488.00	4.18
130	002308	威创股份	9,479,953.49	4.14
131	300065	海兰信	9,405,657.24	4.11
132	300404	博济医药	9,289,479.70	4.06
133	002311	海大集团	9,282,443.81	4.05
134	000919	金陵药业	9,164,912.00	4.00
135	002718	友邦吊顶	9,154,115.35	4.00
136	002364	中恒电气	8,834,257.96	3.86
137	600485	信威集团	8,702,363.66	3.80
138	600703	三安光电	8,346,731.47	3.65
139	002024	苏宁云商	8,342,000.00	3.64
140	000738	中航动控	8,222,230.36	3.59
141	600894	广日股份	7,894,034.35	3.45
142	002074	国轩高科	7,744,862.34	3.38
143	600358	国旅联合	7,413,735.41	3.24
144	600109	国金证券	6,870,175.56	3.00
145	600415	小商品城	6,863,530.19	3.00
146	600820	隧道股份	6,642,917.93	2.90
147	300113	顺网科技	6,487,703.25	2.83
148	600185	格力地产	6,360,501.00	2.78
149	002322	理工监测	6,339,455.15	2.77
150	600682	南京新百	6,306,561.00	2.75
151	002519	银河电子	6,305,170.40	2.75
152	300335	迪森股份	6,199,136.20	2.71
153	300413	快乐购	6,178,900.00	2.70

154	601313	江南嘉捷	6,009,409.93	2.62
155	000958	东方能源	5,970,269.36	2.61
156	603111	康尼机电	5,870,257.25	2.56
157	000768	中航飞机	5,868,929.35	2.56
158	300187	永清环保	5,744,725.99	2.51
159	300378	鼎捷软件	5,725,089.00	2.50
160	600129	太极集团	5,654,204.07	2.47
161	002494	华斯股份	5,574,118.29	2.43
162	601872	招商轮船	5,512,054.58	2.41
163	002588	史丹利	5,480,463.54	2.39
164	600026	中海发展	5,448,568.35	2.38
165	600418	江淮汽车	5,397,754.00	2.36
166	300389	艾比森	5,382,888.20	2.35
167	600105	永鼎股份	5,382,012.00	2.35
168	600398	海澜之家	5,333,420.81	2.33
169	600617	国新能源	5,253,080.49	2.29
170	002665	首航节能	5,227,677.26	2.28
171	600969	郴电国际	5,173,072.56	2.26
172	002423	中原特钢	5,154,756.44	2.25
173	000069	华侨城 A	5,035,513.86	2.20
174	002304	洋河股份	5,026,576.00	2.20
175	300237	美晨科技	5,003,192.94	2.19
176	002565	上海绿新	4,894,739.98	2.14
177	600433	冠豪高新	4,861,822.37	2.12
178	002053	云南盐化	4,825,412.66	2.11
179	002037	久联发展	4,810,058.00	2.10
180	300299	富春通信	4,803,207.00	2.10
181	002367	康力电梯	4,713,451.91	2.06
182	000793	华闻传媒	4,712,601.52	2.06
183	002712	思美传媒	4,579,475.34	2.00

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

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	4,794,011,230.39
卖出股票收入（成交）总额	5,097,540,664.49

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	10,007,000.00	4.37
	其中：政策性金融债	10,007,000.00	4.37
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	10,007,000.00	4.37

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	150219	15 国开 19	100,000	10,007,000.00	4.37

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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

8.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	497,688.98
2	应收证券清算款	1,262,957.53
3	应收股利	-
4	应收利息	72,856.84
5	应收申购款	119,220.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,952,723.97

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	002020	京新药业	5,502,200.00	2.40	临时停牌

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,922	61,871.74	4,848,690.59	2.68%	175,940,523.70	97.32%

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	1,009,364.48	0.5600%

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 0 份。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年2月6日）基金份额总额	2,312,980,881.15
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	220,584,301.24
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,352,775,968.10
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）	-
本报告期期末基金份额总额	180,789,214.29

§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 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。

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。

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 90000 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	
齐鲁证券	1	2,186,761,173.93	22.11%	1,990,824.62	22.37%	-
华创证券	1	1,238,799,680.40	12.53%	1,098,715.97	12.35%	-
光大证券	2	1,038,313,501.63	10.50%	925,161.87	10.40%	-
中投证券	1	763,392,277.17	7.72%	675,526.09	7.59%	-
中信证券	1	692,991,955.88	7.01%	619,072.82	6.96%	-
广发证券	1	664,860,604.68	6.72%	608,055.00	6.83%	-
东方证券	1	657,181,294.42	6.64%	587,718.78	6.61%	-
华融证券	1	343,756,480.23	3.48%	304,190.34	3.42%	-
浙商证券	1	338,025,248.33	3.42%	300,943.29	3.38%	-
国元证券	1	312,639,568.58	3.16%	284,624.75	3.20%	-
中银国际	1	233,990,325.86	2.37%	213,073.26	2.39%	-
东吴证券	1	186,094,862.76	1.88%	169,588.25	1.91%	-
国都证券	1	181,188,056.43	1.83%	166,680.12	1.87%	-
兴业证券	1	162,520,267.68	1.64%	144,005.17	1.62%	-
华鑫证券	1	139,775,676.30	1.41%	123,687.48	1.39%	-
国海证券	1	125,386,936.65	1.27%	114,148.02	1.28%	-
安信证券	1	104,759,243.98	1.06%	96,084.35	1.08%	-
海通证券	1	97,973,622.31	0.99%	88,561.24	1.00%	-
恒泰证券	1	96,558,763.81	0.98%	89,924.76	1.01%	-
华安证券	2	81,209,655.86	0.82%	74,329.28	0.84%	-
中信建投	1	76,797,585.92	0.78%	69,915.71	0.79%	-
信达证券	1	67,761,803.29	0.69%	61,751.67	0.69%	-
东北证券	1	36,840,173.71	0.37%	34,309.30	0.39%	-
华泰证券	2	28,121,340.77	0.28%	25,137.15	0.28%	-
国联证券	1	16,180,487.06	0.16%	14,745.33	0.17%	-
西南证券	1	15,918,202.14	0.16%	14,824.47	0.17%	-
万联证券	2	2,185,105.00	0.02%	1,991.31	0.02%	-

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。

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
齐鲁证券	-	-	-2,750,000,000.00	33.05%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-4,000,000,000.00	48.08%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

华鑫证券	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	1,100,000,000.00	13.22%	-
安信证券	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	470,000,000.00	5.65%	-
国联证券	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司参加国都证券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8月28日
2	华泰柏瑞基金关于继续参加天天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8月25日
3	华泰柏瑞基金关于继续参加恒丰银行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8月25日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司参加中金公司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8月17日
5	增加中经北证为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投、费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年8月10日
6	增加泰诚财富为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投、费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年8月10日

7	华泰柏瑞基金管理有限公司参加平安证券开放式基金申购、定期定额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 7 月 18 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司华泰柏瑞基金管理有限公司关于公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 7 日
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资、费率优惠等业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 27 日
16	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合	中国证券报、上海	2015 年 1 月 8 日

	型证券投资基金基金合同	证券报、证券时报	
17	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 1 月 8 日
18	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 1 月 8 日
19	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 1 月 8 日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层
 托管人住所

12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2016 年 3 月 29 日