

华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金 2016 年半年度报告 摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 26 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金简称 | 华泰柏瑞亚洲领导企业混合(QDII) |
| 基金主代码 | 460010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年12月2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 | 32,811,941.90份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 采取主动精选亚洲地区具有行业领导地位和国际竞争优势的企业，通过区域化分散投资，有效降低投资组合系统性风险，追求基金资产长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金投资研究团队将跟踪全球经济的发展趋势，重点研究亚洲地区内的宏观经济变量，采用自上而下的分析方法，以及定性和定量分析模型相结合的手段，确定基金资产在各国家/地区之间的配置。综合分析亚洲地区内的宏观经济指标、公司盈利发展趋势、资金流向、价格变动、社会政治风险、产业结构性风险等要素，采用专有定量模型作为参考工具，以确定各国股市的相对吸引力。通过将市场预期的净资产收益率、市净率及长期债券收益率等多种金融市场变量输入该模型，来确定各个市场的价值中枢，作为估值标准。 |
| 业绩比较基准 | MSCI 亚太综合指数(不含日本) |
| 风险收益特征 | 本基金为区域性股票型证券投资基金，基金预期投资风险收益水平高于混合型基金和债券型基金。由于投资国家与地区市场的分散，长期而言风险应低于投资单一市场的股票型基金。 |

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 | 姓名 | 陈晖 | 王永民 |

| | | | |
|--------|------|----------------------------|----------------------|
| 人 | 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 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外资产托管人 |
|------|----|----------------------------------|
| 名称 | 英文 | Bank of China (HongKong) Limited |
| | 中文 | 中国银行（香港）有限公司 |
| 注册地址 | | 香港花园道1号中银大厦 |
| 办公地址 | | 香港花园道1号中银大厦 |

注：本基金不聘请境外投资顾问，华泰柏瑞基金管理有限公司对全部资产进行自行管理。

2.5 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.huatai-pb.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层及基金托管人住所 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | -1,960,298.74 |
| 本期利润 | -1,717,648.12 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0534 |
| 本期基金份额净值增长率 | -6.83% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.4368 |
| 期末基金资产净值 | 24,193,524.69 |
| 期末基金份额净值 | 0.737 |

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

要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

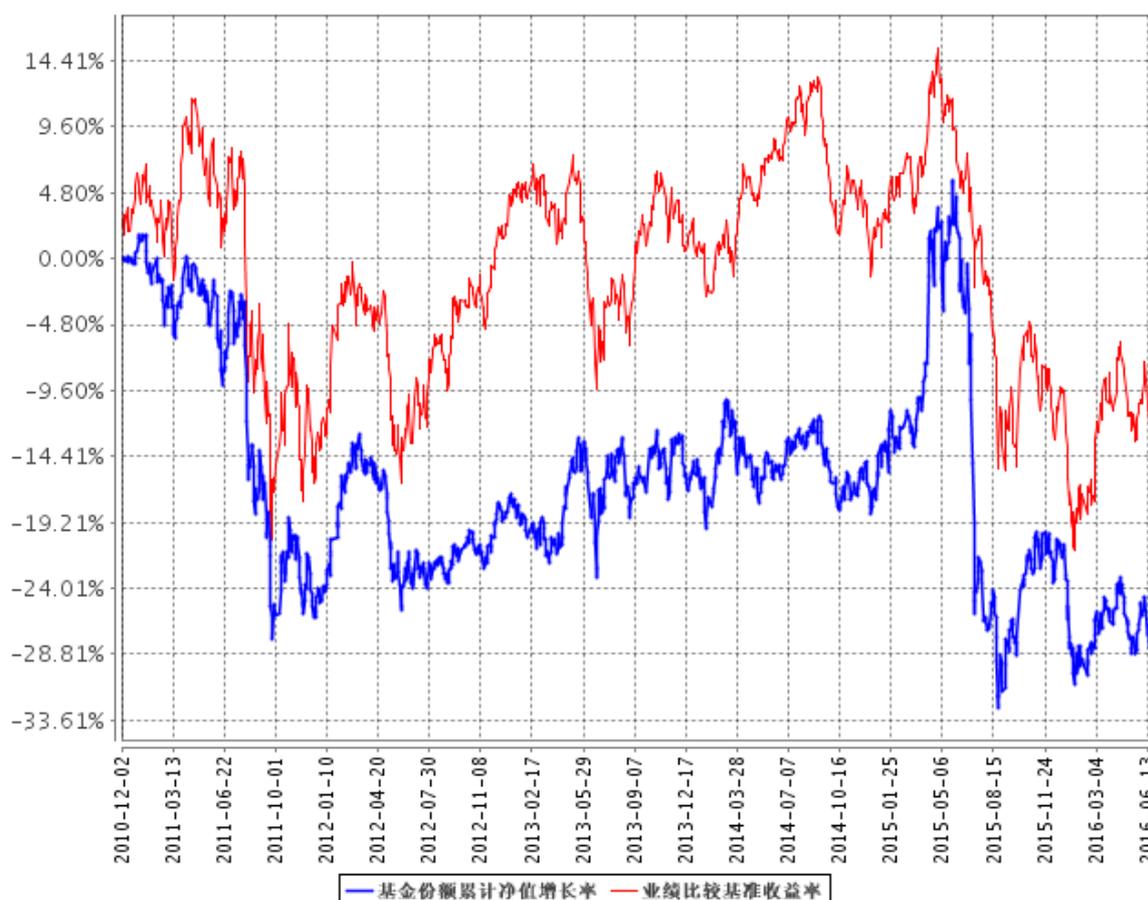
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月 | -1.60% | 1.22% | 1.47% | 1.39% | -3.07% | -0.17% |
| 过去三个月 | -0.94% | 0.94% | -0.67% | 1.02% | -0.27% | -0.08% |
| 过去六个月 | -6.83% | 1.06% | 0.73% | 1.18% | -7.56% | -0.12% |
| 过去一年 | -28.10% | 1.37% | -16.86% | 1.23% | -11.24% | 0.14% |
| 过去三年 | -14.99% | 1.12% | -10.19% | 0.94% | -4.80% | 0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | -26.30% | 1.04% | -8.94% | 1.05% | -17.36% | -0.01% |

注：本基金的业绩比较基准为：MSCI 亚太综合指数(不含日本)。

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2010年12月2日至2016年6月30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十四条（三）投资范围中基金投资组合比例限制中规定的各项比例，股票占基金资产的比例不低于60%；债券、货币市场工具、现金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比例不高于40%，其中，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金不低于80%的权益类资产将投资于亚洲领导企业。

§ 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、华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金和华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金。截至 2016 年 6 月 30 日，公司的公募基金管理规模为 876.50 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 | | |
| 黄明仁 | 本基金的基金经理、海外投资部总监 | 2010 年 12 月 2 日 | - | 16 | 黄明仁先生, 美国西雅图华盛顿大学财务金融专业管理学硕士, 具有 16 年以上境外证券投资管理经验。2004-2006 年, 任台湾建弘投资信托股份有限公司, 建弘泛太平洋基金基金经理; 2006-2008 年中, 加入英国保诚投资信托股份有限公司, 任保诚印度基金基金经理。 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 2008年加入本公司，2010年12月起任华泰柏瑞亚洲领导企业混合基金经理。2015年1月起任海外投资部总监。 |
|--|--|--|--|--|---|

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金不聘请境外投资顾问，华泰柏瑞基金管理有限公司对全部资产进行自行管理。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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（全部低于基金规模的0.5%），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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 上半年亚洲市场走势分化, 东南亚的印度尼西亚与泰国及印度股市上半年相对较好, 印度尼西亚股市上涨超过 9%, 港股与国企股指数表现落后, 香港国企指数下跌 9.8%。一季度美联储加息概率降低, 国际资金回流新兴市场, 催化大宗商品价格跌深反弹; 二季度英国公投脱欧的黑天鹅事件导致英镑剧贬, 全球股市总市值蒸发了 3.3 万亿美元, 给全球市场带来了巨大的冲击。

上半年的投资仓位 82%, 持仓主要集中在港股及国企股占 64.5%, 使得基金业绩受到拖累落后基准指标。

4.5.2 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 0.737 元, 本报告期份额净值下跌 6.83%。同期基准 MSCI Asia ex-Japan 亚太(不含日本)指数上涨 0.734%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年亚洲股市, 英国脱离欧盟的问题将持续影响市场信心, 预期美联储的加息步伐将放缓至年底, 而欧洲央行将持续维持货币宽松, 以因应市场的波动。由于港股通额度逐步用尽, 市场预期在下半年将宣布深港通的政策实施, 对港股也将带来短期流动性增加的利好, 尤其在美股频创新高将带动亚洲股市反弹, 对下半年股市的走势审慎乐观。

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4次；每次基金收益分配比例不低于该次可分配收益的10%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本报告期内基金未实施收益分配。

4.9 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

本基金本报告期内连续六十个工作日出现基金净值低于五千万元。我司已根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的要求，于2015年3月13日向证监会报告并提交了华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金的转型方案，目前正逐步推进转型的后续事宜。

§ 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”）在华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 6,875,647.62 | 4,741,099.98 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | | 19,961,110.20 | 21,123,665.71 |
| 其中：股票投资 | | 19,704,199.87 | 20,836,061.05 |
| 基金投资 | | 256,910.33 | 287,604.66 |
| 债券投资 | | - | - |
| 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 | | 49,985.29 | - |
| 应收利息 | | 211.00 | 111.54 |
| 应收股利 | | 108,140.81 | 10,499.76 |
| 应收申购款 | | 197,665.17 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | 942,436.49 | - |
| 资产总计 | | 28,135,196.58 | 25,875,376.99 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 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 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 2,746,674.65 | - |
| 应付赎回款 | | 57,540.76 | 15,441.09 |
| 应付管理人报酬 | | 34,897.04 | 39,838.94 |
| 应付托管费 | | 6,785.52 | 7,746.48 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 1,095,773.92 | 255,392.87 |
| 负债合计 | | 3,941,671.89 | 318,419.38 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 32,811,941.90 | 32,320,387.76 |
| 未分配利润 | | -8,618,417.21 | -6,763,430.15 |
| 所有者权益合计 | | 24,193,524.69 | 25,556,957.61 |
| 负债和所有者权益总计 | | 28,135,196.58 | 25,875,376.99 |

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2016年1月1日至 2016年6月30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日 |
|-------------------|-----|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、收入 | | - 1,150,286.58 | -4,426,219.12 |
| 1. 利息收入 | | 2,383.40 | 16,374.91 |
| 其中：存款利息收入 | | 2,383.40 | 16,374.91 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | - 1,451,642.84 | 3,537,538.80 |
| 其中：股票投资收益 | | - 1,908,887.62 | 2,100,357.43 |

| | | | |
|----------------------------|-----------|---------------|---------------|
| 基金投资收益 | | 179,415.98 | -97,254.84 |
| 债券投资收益 | | - | - |
| 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 | | 277,828.80 | 1,534,436.21 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | 242,650.62 | -6,461,568.85 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | 55,390.33 | -1,544,879.06 |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | | 931.91 | 26,315.08 |
| 减：二、费用 | | 567,361.54 | 1,452,703.85 |
| 1. 管理人报酬 | | 210,650.24 | 699,304.84 |
| 2. 托管费 | | 40,959.66 | 135,975.94 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.8.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | | 185,759.78 | 481,205.59 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | | 129,991.86 | 136,217.48 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | - | -5,878,922.97 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -1,717,648.12 | -5,878,922.97 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | | |
|---------------------------|----------------------------|---------------|---------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 32,320,387.76 | -6,763,430.15 | 25,556,957.61 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | -1,717,648.12 | -1,717,648.12 |
| 三、本期基金份额交易 | 491,554.14 | -137,338.94 | 354,215.20 |

| | | | |
|--|---------------------------------|---------------|----------------|
| 产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列) | | | |
| 其中: 1.基金申购款 | 1,861,430.23 | -500,617.88 | 1,360,812.35 |
| 2.基金赎回款 | -1,369,876.09 | 363,278.94 | -1,006,597.15 |
| 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) | 32,811,941.90 | -8,618,417.21 | 24,193,524.69 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 30,137,164.88 | -4,347,331.08 | 25,789,833.80 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | -5,878,922.97 | -5,878,922.97 |
| 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) | 108,925,013.20 | 2,573,877.69 | 111,498,890.89 |
| 其中: 1.基金申购款 | 141,682,225.04 | 2,041,998.50 | 143,724,223.54 |
| 2.基金赎回款 | -32,757,211.84 | 531,879.19 | -32,225,332.65 |
| 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) | 139,062,178.08 | -7,652,376.36 | 131,409,801.72 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____ 韩勇 _____

基金管理人负责人

_____ 房伟力 _____

主管会计工作负责人

_____ 赵景云 _____

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞亚洲领导企业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[2010]第1357号《关于核准华泰柏瑞亚洲领导企业股票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《华泰柏瑞亚洲领导企业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人民币290,510,740.98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(2010)第373号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金基金合同》于2010年12月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为290,565,328.80份基金份额,其中认购资金利息折合54,587.82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《华泰柏瑞亚洲领导企业股票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:权益类品种,包括普通股、优先股、全球及美国存托凭证、股票型基金等;固定收益类品种,包括政府债券、公司债券、可转换债券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的固定收益类证券;银行存款、回购协议、短期政府债券与货币市场基金等货币市场工具;经中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品;以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资的股票占基金资产的比例不低于60%;债券、货币市场工具、现金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比例不高于40%,其中,现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金不低于80%的权益类资产将投资于亚洲领导企业。亚洲领导企业是指在亚洲地区证券市场进行交易或至少50%的主营业务收入来自于亚洲地区而在亚洲以外交易所上市的企业,同时具有较高的市场占有率和盈利能力、卓越的研发和生产能力、先进的市场营销手段和网络、核心的品牌优势和资源储备、科学的公司治理、创新的商业模式、良好的企业管理团队等要素的,能够为股东带来超额收益的上市公司。本基金的业绩比较基准为:MSCI亚太综合指数(不含日本)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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。
- (2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------|----------------------|
| 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构 |

| | |
|------------|--------------|
| 中国银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
|------------|--------------|

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注：本报告期本基金与关联方未进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券回购交易。

6.4.8.1.4 基金交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的基金交易。

6.4.8.1.5 权证交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的权证交易。

6.4.8.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本期与上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 210,650.24 | 699,304.84 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 73,096.03 | 118,114.63 |

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1.80%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.80\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人次月首日起5个工作日内将上月基金管理费的计算结果通知基金托管人并发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 40,959.66 | 135,975.94 |

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0.35%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人应于次月首日起5个工作日内将上月基金托管费的计算结果书面通知基金托管人并发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

6.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 基金合同生效日（2010年12月2日）持有的基金份额 | 5,001,200.00 | 5,001,200.00 |
| 期初持有的基金份额 | 5,001,200.00 | 5,001,200.00 |

| | | |
|-----------------------|--------------|--------------|
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 5,001,200.00 | 5,001,200.00 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 15.2420% | 3.6000% |

注：基金管理人投资本基金的费用均参照本基金公布的费率收取。

6.4.8.4.2 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2015年度，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有流通受限的证券。

6.4.9.2 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 |
|-------|---------------------------------------|------|----------------------|----------------|----------|----------------|---------|---------------------|-------------------|----|
| 591HK | CHINA HIGH PRECISION AUTOMAT | - | 【停牌】 (2012-12-04) | HKD 1.22 | - | - | 504,000 | HKD 1,417,046.40 | HKD 614,880.00 | - |

注：1、本基金截至2016年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期内无银行间市场债券正回购。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期内无交易所市场债券正回购

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 19,704,199.87 | 70.03 |
| | 其中：普通股 | 19,500,209.11 | 69.31 |
| | 存托凭证 | 203,990.76 | 0.73 |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 256,910.33 | 0.91 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 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 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 6,875,647.62 | 24.44 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,298,438.76 | 4.61 |
| 9 | 合计 | 28,135,196.58 | 100.00 |

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家(地区) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|--------|---------------|---------------|
| 香港 | 15,708,363.67 | 64.93 |
| 韩国 | 949,293.10 | 3.92 |
| 台湾 | 2,842,552.34 | 11.75 |
| 美国 | 203,990.76 | 0.84 |
| 合计 | 19,704,199.87 | 81.44 |

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----------|---------------|---------------|
| 能源 | 756,417.14 | 3.13 |
| 工业 | 1,302,837.59 | 5.39 |
| 非日常生活消费品 | 6,386,892.32 | 26.40 |
| 日常消费品 | 483,828.69 | 2.00 |
| 医疗保健 | 1,762,919.26 | 7.29 |
| 金融 | 3,084,965.55 | 12.75 |
| 信息技术 | 5,926,339.32 | 24.50 |
| 合计 | 19,704,199.87 | 81.44 |

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------------------|----------|---------|--------|----------|---------|--------------|---------------|
| 1 | TENCENT HOLDINGS LTD | 腾讯控股 | 700 HK | 香港交易所 | CH | 11,200 | 1,685,682.73 | 6.97 |
| 2 | ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 安踏体育 | 2020 HK | 香港交易所 | CH | 85,000 | 1,126,027.73 | 4.65 |
| 3 | CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING | 康哲药业 | 867 HK | 香港交易所 | CH | 105,000 | 1,058,936.13 | 4.38 |
| 4 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 台积电 | 2330 TT | 台湾亚交易所 | CH | 30,000 | 1,005,211.17 | 4.15 |
| 5 | SUNNY OPTICAL TECH | 舜宇光学科技 | 2382 HK | 香港交易所 | CH | 42,000 | 974,580.20 | 4.03 |
| 6 | WYNN MACAU LTD | 永利澳门 | 1128 HK | 香港交易所 | CH | 97,600 | 929,251.92 | 3.84 |
| 7 | DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 东风集团股份 | 489 HK | 香港交易所 | CH | 122,000 | 842,499.50 | 3.48 |
| 8 | HAITONG SECURITIES CO LTD-H | 海通证券 | 6837 HK | 香港交易所 | CH | 70,000 | 780,142.78 | 3.22 |

| | | | | | | | | |
|----|----------------------------|------------|---------|--------|----|--------|------------|------|
| 9 | CNOOC LTD | 中国海洋石油 | 883 HK | 香港交易所 | CH | 92,000 | 756,417.14 | 3.13 |
| 10 | HOTA INDUSTRIAL MFG CO LTD | 和大工业股份有限公司 | 1536 TT | 台湾亚交易所 | CH | 24,000 | 742,309.79 | 3.07 |

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网站的年度报告正文。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文) | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|------------------------------|---------|--------------|----------------|
| 1 | TUNG THIH ELECTRONIC CO LTD | 3552 TT | 1,414,662.28 | 5.54 |
| 2 | CAR INC | 699 HK | 1,315,784.62 | 5.15 |
| 3 | ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 2020 HK | 1,232,864.78 | 4.82 |
| 4 | WYNN MACAU LTD | 1128 HK | 1,216,348.38 | 4.76 |
| 5 | HENGAN INTL GROUP CO LTD | 1044 HK | 1,177,198.05 | 4.61 |
| 6 | GLOBALWAFERS CO LTD | 6488 TT | 1,143,227.65 | 4.47 |
| 7 | MERIDA INDUSTRY CO LTD | 9914 TT | 1,065,155.83 | 4.17 |
| 8 | MEDIATEK INC | 2454 TT | 1,035,841.70 | 4.05 |
| 9 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 2330 TT | 975,450.35 | 3.82 |
| 10 | BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS | 1880 HK | 958,036.00 | 3.75 |
| 11 | BYD CO LTD-H | 1211 HK | 951,055.50 | 3.72 |
| 12 | SUNNY OPTICAL TECH | 2382 HK | 932,083.87 | 3.65 |
| 13 | DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 489 HK | 841,126.84 | 3.29 |
| 14 | FENG TAY | 9910 TT | 802,037.63 | 3.14 |

| | | | | |
|----|------------------------------------|------------|------------|------|
| | ENTERPRISE CO LTD | | | |
| 15 | ECLAT TEXTILE COMPANY LTD | 1476 TT | 762,341.29 | 2.98 |
| 16 | LEES PHARMACEUTICAL HLDGS | 950 HK | 751,375.55 | 2.94 |
| 17 | CHINA AGRI- INDUSTRIES HLDGS | 606 HK | 728,480.73 | 2.85 |
| 18 | HOTA INDUSTRIAL MFG CO LTD | 1536 TT | 720,791.04 | 2.82 |
| 19 | GOURMET MASTER CO LTD | 2723 TT | 707,968.93 | 2.77 |
| 20 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 939 HK | 668,278.37 | 2.61 |
| 21 | MELCO INTERNATIONAL DEVELOP. | 200 HK | 667,384.68 | 2.61 |
| 22 | SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS | 460 HK | 661,396.84 | 2.59 |
| 23 | PAX GLOBAL TECHNOLOGY LTD | 327 HK | 637,411.62 | 2.49 |
| 24 | HSBC HOLDINGS PLC | 5 HK | 586,879.10 | 2.30 |
| 25 | PTT EXPLORATION & PROD-FOR | PTTEP/F TB | 568,724.51 | 2.23 |
| 26 | ADVANCED CERAMIC X CORP | 3152 TT | 565,098.11 | 2.21 |
| 27 | SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 1918 HK | 537,101.04 | 2.10 |
| 28 | PEOPLES INSURANCE CO GROU-H | 1339 HK | 529,785.29 | 2.07 |
| 29 | POU SHENG INTL HOLDINGS LTD | 3813 HK | 515,046.52 | 2.02 |

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 公司名称(英文) | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金 |
|----|----------|------|----------|-------|
|----|----------|------|----------|-------|

| | | | | 资产净值比例 (%) |
|----|------------------------------------|------------|--------------|------------|
| 1 | LARGAN PRECISION CO LTD | 3008 TT | 1,708,107.13 | 6.68 |
| 2 | TUNG THIH ELECTRONIC CO LTD | 3552 TT | 1,603,219.31 | 6.27 |
| 3 | HENGAN INTL GROUP CO LTD | 1044 HK | 1,240,820.01 | 4.86 |
| 4 | CAR INC | 699 HK | 1,177,214.88 | 4.61 |
| 5 | GLOBALWAFERS CO LTD | 6488 TT | 1,011,151.15 | 3.96 |
| 6 | MERIDA INDUSTRY CO LTD | 9914 TT | 976,107.67 | 3.82 |
| 7 | MEDIATEK INC | 2454 TT | 969,455.33 | 3.79 |
| 8 | BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS | 1880 HK | 951,863.07 | 3.72 |
| 9 | SAMSUNG SDI CO LTD | 006400 KS | 918,344.49 | 3.59 |
| 10 | TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD- H | 696 HK | 880,846.63 | 3.45 |
| 11 | TENCENT HOLDINGS LTD | 700 HK | 812,814.59 | 3.18 |
| 12 | PTT EXPLORATION & PROD-FOR | PTTEP/F TB | 740,037.43 | 2.90 |
| 13 | NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 1336 HK | 728,717.11 | 2.85 |
| 14 | BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY | 963 HK | 718,284.54 | 2.81 |
| 15 | ECLAT TEXTILE COMPANY LTD | 1476 TT | 700,238.10 | 2.74 |
| 16 | IMAX CHINA HOLDING INC | 1970 HK | 696,472.92 | 2.73 |
| 17 | BYD CO LTD-H | 1211 HK | 675,816.03 | 2.64 |
| 18 | ON-BRIGHT ELECTRONICS INC | 4947 TT | 665,620.37 | 2.60 |
| 19 | CHAOWEI POWER HOLDINGS LTD | 951 HK | 642,342.79 | 2.51 |
| 20 | STANDARD CHARTERED PLC | 2888 HK | 632,494.03 | 2.47 |
| 21 | CHINA AGRI- | 606 HK | 612,987.11 | 2.40 |

| | | | | |
|----|------------------------------------|-----------|------------|------|
| | INDUSTRIES HLDGS | | | |
| 22 | GOURMET MASTER CO LTD | 2723 TT | 604,217.49 | 2.36 |
| 23 | CHINA LILANG LTD | 1234 HK | 600,162.24 | 2.35 |
| 24 | ADVANCED CERAMIC X CORP | 3152 TT | 596,516.01 | 2.33 |
| 25 | GREAT WALL MOTOR COMPANY-H | 2333 HK | 549,216.36 | 2.15 |
| 26 | SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS | 460 HK | 543,681.52 | 2.13 |
| 27 | MEDY-TOX INC | 086900 KS | 533,705.60 | 2.09 |
| 28 | MELCO INTERNATIONAL DEVELOP. | 200 HK | 529,746.14 | 2.07 |

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

| | |
|------------|---------------|
| 买入成本（成交）总额 | 32,486,849.91 |
| 卖出收入（成交）总额 | 31,983,168.42 |

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------------------------|--------|--------------------|-----------------------------------|------------|---------------|
| 1 | KRANESHARES CSI CHINA INTERN | ETF 基金 | 交易性开 放式指数 基金 | Krane Funds Advisors LLC | 256,910.33 | 1.06 |

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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况，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2

-

7.11.3 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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 49,985.29 |
| 3 | 应收股利 | 108,140.81 |
| 4 | 应收利息 | 211.00 |
| 5 | 应收申购款 | 197,665.17 |
| 6 | 其他应收款 | 942,436.49 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 1,298,438.76 |
|---|----|--------------|

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 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。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

截止2016年6月30日，本基金持有中国高精密（591HK）504,000股，占基金资产净值比例为2.17%。中国高精密（591HK）自2012年8月22日开始停牌。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|--------------|------------|---------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 1,093 | 30,020.07 | 5,001,200.00 | 15.24% | 27,810,741.90 | 84.76% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 296,523.34 | 0.9037% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2010年12月2日）基金份额总额 | 139,682,454.14 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 32,320,387.76 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,861,430.23 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 1,369,876.09 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 32,811,941.90 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---------------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| CREDIT SUISSE | - | 14,727,116.95 | 22.60% | 33,284.94 | 31.13% | - |
| CIMB | - | 9,584,676.17 | 14.71% | 15,065.32 | 14.09% | - |
| MAST | - | 8,995,415.61 | 13.80% | 10,793.31 | 10.10% | - |
| CITI | - | 7,366,909.60 | 11.30% | 12,466.92 | 11.66% | - |
| SWHYHK | - | 7,323,385.14 | 11.24% | 10,985.06 | 10.27% | - |
| ICBCI | - | 3,414,475.73 | 5.24% | 6,218.13 | 5.82% | - |
| CESHK | - | 3,347,628.13 | 5.14% | 3,347.63 | 3.13% | - |
| Daewoo | - | 2,375,553.85 | 3.65% | 2,375.47 | 2.22% | - |
| CICC | - | 1,982,672.02 | 3.04% | 3,568.80 | 3.34% | - |
| CATHAY | - | 1,954,644.41 | 3.00% | 1,950.97 | 1.82% | - |
| UOB | - | 1,130,316.27 | 1.73% | 3,000.66 | 2.81% | - |
| CITICHK | - | 1,084,740.08 | 1.66% | 1,627.11 | 1.52% | - |
| DSHN | - | 887,745.12 | 1.36% | 887.68 | 0.83% | - |
| HSBC | - | 294,738.82 | 0.45% | 294.74 | 0.28% | - |

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
|---------------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|--------------|--------------|
| | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| CREDIT SUISSE | - | - | - | - | - | - | 1,915,347.98 | 48.36% |
| CITI | - | - | - | - | - | - | 944,369.56 | 23.84% |
| ICBCI | - | - | - | - | - | - | 730,950.58 | 18.46% |
| UOB | - | - | - | - | - | - | 370,016.10 | 9.34% |

华泰柏瑞基金管理有限公司
2016年8月27日