

# 华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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。

基金托管人中国工商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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 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.....	41
7.7 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.....	41
7.8 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.....	41
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权证投资明细.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>43</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>43</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	46
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>47</b>
11.1 备查文件目录.....	47
11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞惠利混合	
基金主代码	001340	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 25 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,988,304,837.09 份	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞惠利 A	华泰柏瑞惠利 C
下属分级基金的交易代码:	001340	001341
报告期末下属分级基金的份额总额	3,987,655,357.43 份	649,479.66 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	洪渊
	联系电话	021-38601777	010-66105799
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	(010) 66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区民生路	北京市西城区复兴门内大街

	1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	55 号
邮政编码	200135	100140
法定代表人	齐亮	易会满

## 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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

# §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

基金级别	华泰柏瑞惠利 A	华泰柏瑞惠利 C
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)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	17,470,678.25	1,198.74
本期利润	-12,802,978.79	-6,066.47
加权平均基金份额本期利润	-0.0032	-0.0092
本期加权平均净值利润率	-0.33%	-0.98%
本期基金份额净值增长率	-0.39%	-0.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	53,840,571.88	-17,490.13
期末可供分配基金份额利润	0.0135	-0.0269
期末基金资产净值	4,056,615,368.46	634,307.42
期末基金份额净值	1.017	0.977
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	1.70%	-2.30%

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

要低于所列数字。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞惠利 A

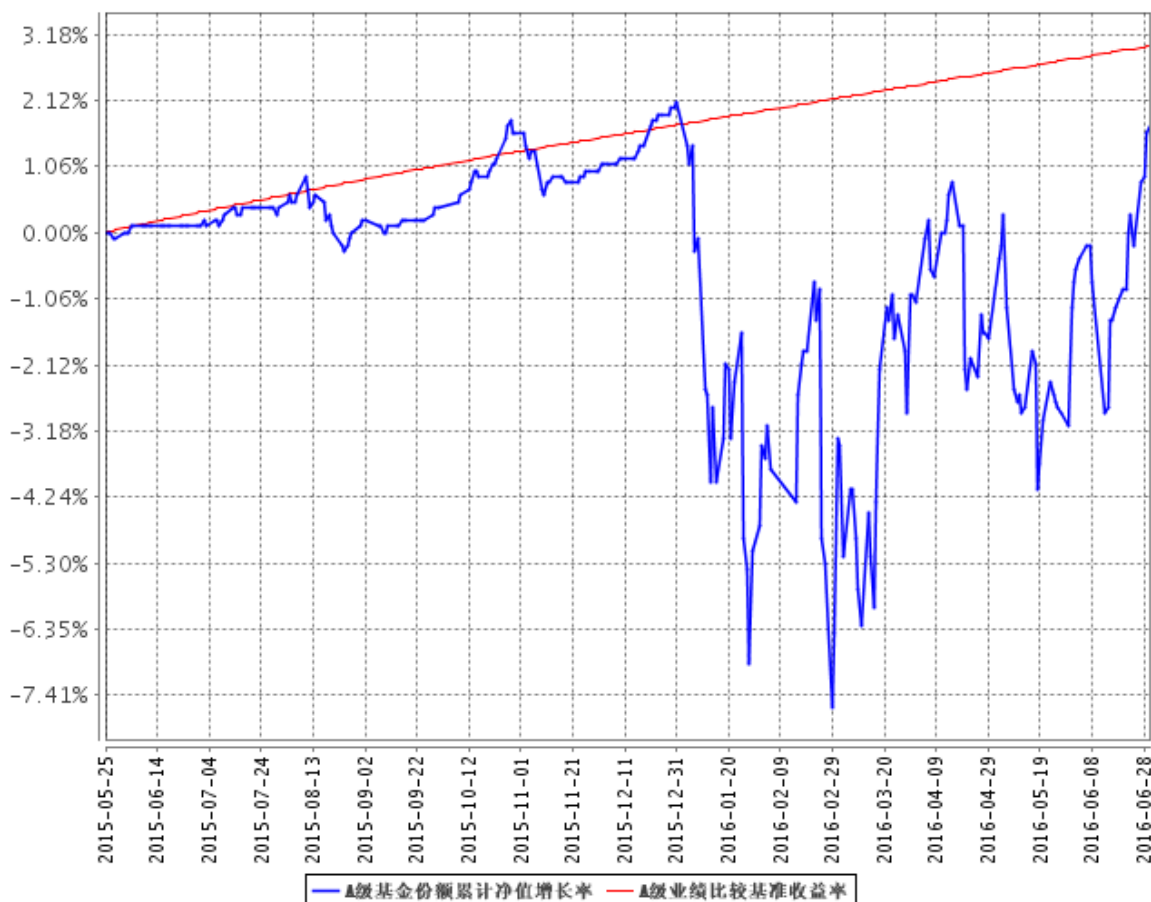
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.94%	0.71%	0.21%	0.01%	2.73%	0.70%
过去三个月	2.73%	0.77%	0.63%	0.01%	2.10%	0.76%
过去六个月	-0.39%	1.10%	1.26%	0.01%	-1.65%	1.09%
过去一年	1.60%	0.77%	2.66%	0.01%	-1.06%	0.76%
自基金合同生效起至今	1.70%	0.73%	2.99%	0.01%	-1.29%	0.72%

华泰柏瑞惠利 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.95%	0.73%	0.21%	0.01%	2.74%	0.72%
过去三个月	2.73%	0.79%	0.63%	0.01%	2.10%	0.78%
过去六个月	-0.51%	1.10%	1.26%	0.01%	-1.77%	1.09%
过去一年	-2.40%	0.80%	2.66%	0.01%	-5.06%	0.79%
自基金合同生效起至今	-2.30%	0.76%	2.99%	0.01%	-5.29%	0.75%

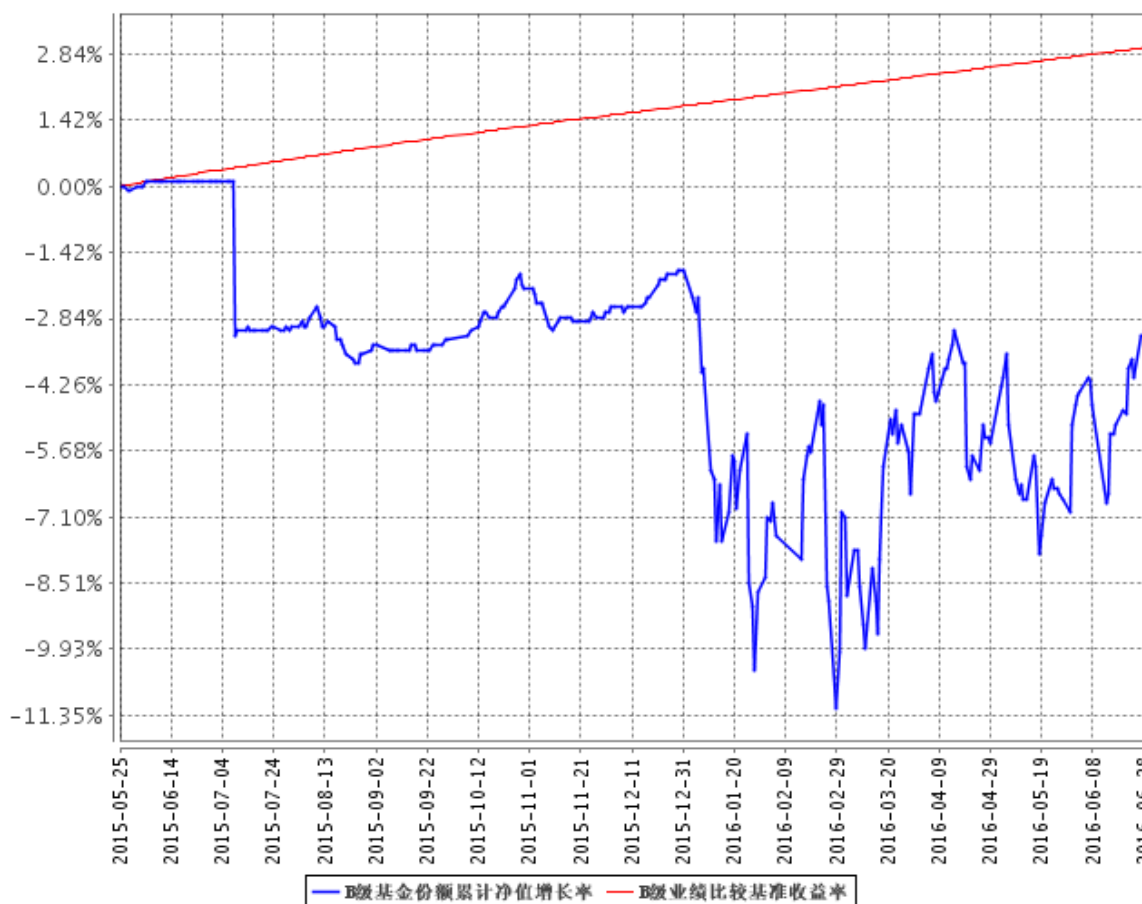
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





**B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



注：1、图示日期为 2015 年 5 月 25 日至 2016 年 6 月 30 日。

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

## §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		
方纬	本基金的基金经理	2015 年 5 月 25 日	-	13	经济学硕士。2003 年 9 月至 2005 年 1 月任上海金信研究所研究员；2005 年 1 月至 2007 年 2 月任万家基金管理有限公司高级研究员；2007 年 2 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2014 年 8 月任华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 4 月起

					<p>任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起任华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 8 月起任华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 3 月起任华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金的基金经理。</p>
杨景涵	本基金基金经理	2015 年 5 月 25 日	-	11	<p>中山大学经济学硕士。特许金融分析师（CFA），金融风险管理师（FRM）。2004 年至 2006 年于平安资产管理有限公司，任投资分析师；2006 年至 2009 年 9 月于生命人寿保险公司，历任投连投资经理、投资经理、基金投资部负责人。2009 年 10 月加入本公司，任专户投资部投资经理。</p> <p>2014 年 6 月至 2015 年 4 月任研究部总监助理。</p> <p>2015 年 4 月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 5 月起任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离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》、《公开募集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《华泰柏瑞惠利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。

#### 4.3.2 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。

#### 4.4 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

2016 年上半年，宏观经济增速下行，A 股市场整体估值水平下移，债券市场在货币政策持续保持实质性宽松和财政政策进取的背景下，年初调整以后走出一轮大的牛市。惠利基金把握住了债券市场的牛市机会和打新市场的套利机会以及定增市场的投资机会，稳步的提升了基金净值。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类和 C 类份额净值分别为 1.017 元和 0.977 元，分别下降 0.39%和 0.51%，同期本基金的业绩比较基准上涨 1.26%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济增速趋向在较低水平上的稳定，货币政策将保持稳健，边际宽松程度可能会有所下降，地产投资增速将下行，基建投资增速将上行，整体宏观环境看，对于股票市场和债券市场将保持中性。投资机会主要来自于细分领域的个券选择。预期下半年整体新股的收益率将有所回落，债券收益率也将稳步下行，定增收益率也将保持平稳。惠利基金将积极优选品种，力争在整体收益率水平下行的环境下，稳步积累投资收益，提升基金净值。

#### 4.6 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，可进行收益分配。本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本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

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞惠利灵活配置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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	115,046,680.58	152,434,464.99
结算备付金		128,553,373.65	14,779,063.16
存出保证金		16,784.79	326,574.36
交易性金融资产	6.4.7.2	3,137,446,923.83	2,484,873,646.02
其中：股票投资		2,667,256,923.83	1,885,689,646.02
基金投资		-	-
债券投资		470,190,000.00	599,184,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	200,000,000.00	600,001,100.00
应收证券清算款		475,101,177.55	811,728,174.08
应收利息	6.4.7.5	3,924,523.93	9,441,511.88
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,060,089,464.33	4,073,584,534.49
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,513.50	62,277.66
应付管理人报酬		1,949,245.24	1,747,245.56
应付托管费		649,748.41	582,415.19
应付销售服务费		254.27	232.08
应付交易费用	6.4.7.7	40,122.87	346,528.03
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	198,904.16	310,000.00
负债合计		2,839,788.45	3,048,698.52
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	3,988,304,837.09	3,988,791,301.59
未分配利润	6.4.7.10	68,944,838.79	81,744,534.38
所有者权益合计		4,057,249,675.88	4,070,535,835.97
负债和所有者权益总计		4,060,089,464.33	4,073,584,534.49

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，华泰柏瑞惠利 A 级份额净值 1.017 元，份额 3,987,655,357.43 份；华泰柏瑞惠利 C 级份额净值 0.977 元，份额 649,479.66 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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5月25日(基金 合同生效日)至2015年

			6 月 30 日
<b>一、收入</b>		3,002,129.91	12,250,388.37
1.利息收入		16,064,481.03	7,555,970.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,431,535.63	2,233,290.60
债券利息收入		7,462,283.37	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,170,662.03	5,322,680.37
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,218,571.13	1,896,006.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	867,798.99	1,045,050.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,831,217.36	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	28,020.00	554,800.00
股利收益	6.4.7.16	13,491,534.78	296,155.79
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-30,280,922.25	2,794,741.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	3,669.45
<b>减：二、费用</b>		15,811,175.17	5,273,911.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,647,409.50	4,037,127.34
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,882,469.84	1,009,281.82
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,545.27	54,854.93
4. 交易费用	6.4.7.19	78,540.91	114,980.57
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	201,209.65	57,667.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-12,809,045.26	6,976,476.69
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-12,809,045.26	6,976,476.69

注：上年可比期间为 2015 年 5 月 25 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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)	3,988,791,301.59	81,744,534.38	4,070,535,835.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-12,809,045.26	-12,809,045.26
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)	-486,464.50	9,349.67	-477,114.83
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-486,464.50	9,349.67	-477,114.83
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)	3,988,304,837.09	68,944,838.79	4,057,249,675.88
项目	上年度可比期间 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)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)	4,208,008,503.97	0.00	4,208,008,503.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	0.00	6,976,476.69	6,976,476.69
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)	1,542,901,757.74	1,542,925.83	1,544,444,683.57
其中：1.基金申购款	1,543,635,101.89	1,543,626.15	1,545,178,728.04
2.基金赎回款	-733,344.15	-700.32	-734,044.47
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)	0.00	0.00	0.00

值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	5,750,910,261.71	8,519,402.52	5,759,429,664.23

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：

<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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞惠利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[2015] 881号《关于准予华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 4,207,599,952.88 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 531 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,208,008,503.97 份基金份额,其中认购资金利息折合 408,551.09 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和最新公布的《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票市值占基金资产净值的 0%-95%。其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率(税后)+1%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2016 年 8 月 27 日批准报出。

#### 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 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

本报告期内本基金采用的会计政策和会计估计与上年度相一致。

## 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 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。

## 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[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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	115,046,680.58
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	115,046,680.58

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,668,484,036.36	2,667,256,923.83	-1,227,112.53	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	464,826,033.80	470,190,000.00	5,363,966.20
	合计	464,826,033.80	470,190,000.00	5,363,966.20
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,133,310,070.16	3,137,446,923.83	4,136,853.67	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	200,000,000.00	-
合计	200,000,000.00	-

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	14,059.29
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	68,918.62
应收债券利息	3,799,540.92
应收买入返售证券利息	41,997.50
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	7.60
合计	3,924,523.93

### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	19,922.87
银行间市场应付交易费用	20,200.00
合计	40,122.87

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	198,904.16
合计	198,904.16

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞惠利 A	
项目	本期

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	3,988,095,880.51	3,988,095,880.51
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-440,523.08	-440,523.08
- 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	3,987,655,357.43	3,987,655,357.43

金额单位：人民币元

华泰柏瑞惠利 C		
项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	695,421.08	695,421.08
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-45,941.42	-45,941.42
- 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	649,479.66	649,479.66

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 5 月 18 日至 2015 年 5 月 21 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 4,207,599,952.88 元。根据《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 408,551.09 元在本基金成立后，折算为 408,551.09 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 2 日止期间暂不向投资人开放基金交易。日常申购业务自 2015 年 6 月 3 日起开始办理。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞惠利 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	36,374,355.41	45,382,593.80	81,756,949.21
本期利润	17,470,678.25	-30,273,657.04	-12,802,978.79
本期基金份额交易	-4,461.78	10,502.39	6,040.61

产生的变动数			
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-4,461.78	10,502.39	6,040.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,840,571.88	15,119,439.15	68,960,011.03

单位：人民币元

华泰柏瑞惠利 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-20,033.77	7,618.94	-12,414.83
本期利润	1,198.74	-7,265.21	-6,066.47
本期基金份额交易产生的变动数	1,344.90	1,964.16	3,309.06
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	1,344.90	1,964.16	3,309.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,490.13	2,317.89	-15,172.24

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	719,369.78
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	694,865.19
其他	17,300.66
合计	1,431,535.63

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	26,484,692.19
减：卖出股票成本总额	25,616,893.20
买卖股票差价收入	867,798.99



### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,831,217.36
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,831,217.36

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	331,674,117.48
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	322,060,282.64
减：应收利息总额	6,782,617.48
买卖债券差价收入	2,831,217.36

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

#### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
权证投资收益	-
股指期货-投资收益	28,020.00

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	13,491,534.78
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,491,534.78

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-30,280,922.25
——股票投资	-23,439,904.89
——债券投资	-6,841,017.36
——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	-30,280,922.25

### 6.4.7.18 其他收入

注：无。

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	76,915.91
银行间市场交易费用	1,625.00
合计	78,540.91

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,178.12
银行划款手续费	2,305.49
合计	201,209.65

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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、基金注册登记机构、基金直销机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本报告期本基金与关联方未进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期本基金与关联方未进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年5月25日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,647,409.50	4,037,127.34
其中：支付销售机构的客户维护费	2,042.86	2,165.76

注：1. 支付基金管理人 华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的适用年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 适用年费率 / 当年天数。2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年11月25日，管理人报酬的适用年费率为0.80%，自2015年11月26日起适用年费率为0.60%。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年5月25日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,882,469.84	1,009,281.82

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞惠利 A	华泰柏瑞惠利 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	441.37	441.37
工商银行股份有限公司	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	441.37	441.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞惠利 A	华泰柏瑞惠利 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	54,861.49	54,861.49
工商银行股份有限公司	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	54,861.49	54,861.49

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

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

H 为每日 C 类基金份额应支付的销售服务费

E 为前一日的 C 类基金份额的基金资产净值

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期与关联方未进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 6.4.10.4.2 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：无。

#### 6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年5月25日(基金合同生效日) 至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	115,046,680.58	719,369.78	1,397,957,598.38	1,276,751.56

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 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。

#### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000926	福星股份	2016年1月22日	2017年1月23日	非公开发行流通受限	12.66	11.73	24,486,571	309,999,988.86	287,227,477.83	-
300083	劲胜精密	2015年12月28日	2016年12月30日	非公开发行流通受限	31.91	8.12	32,591,664	259,999,999.56	264,644,311.68	-
002680	长生生物	2016年1月21日	2017年1月23日	非公开发行流通受限	35.45	38.11	5,641,749	200,000,002.05	215,007,054.39	-
601908	京运通	2015年12月1日	2016年11月26日	非公开发行流通受限	7.88	7.67	27,347,716	215,500,002.08	209,756,981.72	-

600076	康欣新材	2015 年 12 月 9 日	2016 年 12 月 7 日	非公开发 行流 通受限	9.01	12.47	16,648,169	150,000,002.69	207,602,667.43	-
600708	光明地 产	2015 年 11 月 23 日	2016 年 11 月 17 日	非公开发 行流 通受限	10.96	8.39	23,813,868	260,999,993.28	199,798,352.52	-
600823	世茂股 份	2015 年 12 月 29 日	2016 年 12 月 24 日	非公开发 行流 通受限	9.89	6.79	26,895,854	189,999,994.36	182,622,848.66	-
600057	象屿股 份	2016 年 1 月 6 日	2016 年 12 月 31 日	非公开发 行流 通受限	11.15	10.28	15,246,637	170,000,002.55	156,735,428.36	-
002004	华邦健 康	2015 年 12 月 30 日	2016 年 12 月 31 日	非公开发 行流 通受限	12.80	9.13	15,625,000	200,000,000.00	142,656,250.00	-
002157	正邦科 技	2015 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 5 日	非公开发 行流 通受限	17.30	20.32	6,589,595	113,999,993.50	133,900,570.40	-
002467	二六三	2015 年 12 月 28 日	2016 年 12 月 29 日	非公开发 行流 通受限	12.72	14.08	9,433,962	119,999,996.64	132,830,184.96	-
300048	合康变 频	2016 年 1 月 12 日	2017 年 1 月 13 日	非公开发 行流 通受限	15.86	9.70	11,172,762	88,600,002.66	108,375,791.40	-
002596	海南瑞 泽	2015 年 12 月 21 日	2016 年 12 月 16 日	非公开发 行流 通受限	20.11	24.62	4,177,026	83,999,992.86	102,838,380.12	-
603456	九洲药 业	2015 年 12 月 7 日	2016 年 12 月 3 日	非公开发 行流 通受限	58.00	25.82	3,429,310	99,449,990.00	88,544,784.20	-
000010	美丽生 态	2015 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 4 日	非公开发 行流 通受限	7.12	7.47	11,424,157	81,339,997.84	85,338,452.79	-
600891	秋林集 团	2015 年 11 月 23 日	2016 年 11 月 21 日	非公开发 行流 通受限	7.51	10.74	7,000,000	52,570,000.00	75,180,000.00	-
002050	三花股 份	2016 年 1 月 7 日	2017 年 1 月 11 日	非公开发 行流 通受限	8.63	9.11	4,634,994	39,999,998.22	42,224,795.34	-
002085	万丰奥 威	2015 年 12 月 30 日	2016 年 12 月 31 日	非公开发 行流 通受限	33.03	16.85	605,510	9,999,997.65	10,202,843.50	-
601966	玲珑轮 胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新股流 通受限	12.98	12.98	6,574	85,330.52	85,330.52	-

603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流 通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国 创	2016 年 6 月 30 日	2016 年 7 月 8 日	新股流 通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股 份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流 通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

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

#### 6.4.12.2 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
601611	中国 核建	2016 年 6 月 30 日	临时 停牌	20.92	2016 年 7 月 1 日	23.01	18,151	62,983.97	379,718.92	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末银行间市场债券正回购金额为零。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末交易所市场债券正回购金额为零。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中等风险水平的投资品种。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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。本基金通过构建有效的投资组合，在严格控制风险的前提下，力求获得长期稳定的收益。



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。

#### **6.4.13.2 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 工商银行，因而与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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于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，其余亦可在银行间同业市场交易，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 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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，因此账面余额既为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.4 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。

##### **6.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30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
<b>资产</b>							
银行存款	115,046,680.58	-	-	-	-	-	115,046,680.58
结算备付金	128,553,373.65	-	-	-	-	-	128,553,373.65
交易性金融资产	-	-199,960,000.00	-270,230,000.00	-	-	2,667,256,923.83	3,137,446,923.83
买入返售金融资产	200,000,000.00	-	-	-	-	-	200,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	475,101,177.55	475,101,177.55
应收利息	-	-	-	-	-	3,924,523.93	3,924,523.93
其他资产	-	-	-	-	-	16,784.79	16,784.79
资产总计	443,600,054.23	-199,960,000.00	-270,230,000.00	-	-	3,146,299,410.10	4,060,089,464.33
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,513.50	1,513.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,949,245.24	1,949,245.24
应付托管费	-	-	-	-	-	649,748.41	649,748.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-	254.27	254.27
应付交易费用	-	-	-	-	-	40,122.87	40,122.87
其他负债	-	-	-	-	-	198,904.16	198,904.16
负债总计	-	-	-	-	-	2,839,788.45	2,839,788.45
利率敏感度缺口	443,600,054.23	-199,960,000.00	-270,230,000.00	-	-	3,143,459,621.65	4,057,249,675.88
上年度末 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
<b>资产</b>							
银行存款	152,434,464.99	-	-	-	-	-	152,434,464.99
结算备付金	14,779,063.16	-	-	-	-	-	14,779,063.16
交易性金融资产	-	-170,277,000.00	-428,907,000.00	-	-	1,885,689,646.02	2,484,873,646.02
买入返售金融资产	600,001,100.00	-	-	-	-	-	600,001,100.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	811,728,174.08	811,728,174.08
应收利息	-	-	-	-	-	9,441,511.88	9,441,511.88
其他资产	326,574.36	-	-	-	-	-	326,574.36

资产总计	767,541,202.51	-170,277,000.00	-428,907,000.00	2,706,859,331.98	4,073,584,534.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	62,277.66	62,277.66
应付管理人报酬	-	-	-	1,747,245.56	1,747,245.56
应付托管费	-	-	-	582,415.19	582,415.19
应付销售服务费	-	-	-	232.08	232.08
应付交易费用	-	-	-	346,528.03	346,528.03
其他负债	-	-	-	310,000.00	310,000.00
负债总计	-	-	-	3,048,698.52	3,048,698.52
利率敏感度缺口	767,541,202.51	-170,277,000.00	-428,907,000.00	2,703,810,633.46	4,070,535,835.97

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 6 月 30 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 11.59%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票市值占基金资产净值的 0%-95%。其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,667,256,923.83	65.74	1,885,689,646.02	46.33
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	2,667,256,923.83	65.74	1,885,689,646.02	46.33

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”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：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	98,696,000.00	2,390,000.00
2. 沪深 300 指数下降 5%	-98,696,000.00	-2,390,000.00	

## §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	2,667,256,923.83	65.69
	其中：股票	2,667,256,923.83	65.69
2	固定收益投资	470,190,000.00	11.58
	其中：债券	470,190,000.00	11.58
	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	200,000,000.00	4.93
	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	243,600,054.23	6.00
7	其他各项资产	479,042,486.27	11.80
8	合计	4,060,089,464.33	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	1,531,644,995.39	37.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	90,772,171.71	2.24
F	批发和零售业	75,180,000.00	1.85
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	132,900,677.36	3.28
J	金融业	10,354,845.90	0.26
K	房地产业	669,648,679.01	16.50
L	租赁和商务服务业	156,735,428.36	3.86
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	2,667,256,923.83	65.74

### 7.3 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	000926	福星股份	24,486,571	287,227,477.83	7.08
2	300083	劲胜精密	32,591,664	264,644,311.68	6.52
3	002680	长生生物	5,641,749	215,007,054.39	5.30
4	601908	京运通	27,347,716	209,756,981.72	5.17
5	600076	康欣新材	16,648,169	207,602,667.43	5.12
6	600708	光明地产	23,813,868	199,798,352.52	4.92
7	600823	世茂股份	26,895,854	182,622,848.66	4.50
8	600057	象屿股份	15,246,637	156,735,428.36	3.86
9	002004	华邦健康	15,625,000	142,656,250.00	3.52
10	002157	正邦科技	6,589,595	133,900,570.40	3.30
11	002467	二六三	9,433,962	132,830,184.96	3.27
12	300048	合康变频	11,172,762	108,375,791.40	2.67
13	002596	海南瑞泽	4,177,026	102,838,380.12	2.53
14	603456	九洲药业	3,429,310	88,544,784.20	2.18
15	000010	美丽生态	11,424,157	85,338,452.79	2.10
16	600891	秋林集团	7,000,000	75,180,000.00	1.85
17	002050	三花股份	4,634,994	42,224,795.34	1.04
18	002085	万丰奥威	605,510	10,202,843.50	0.25
19	601009	南京银行	558,000	5,239,620.00	0.13
20	000001	平安银行	587,957	5,115,225.90	0.13
21	601668	中国建筑	950,000	5,054,000.00	0.12
22	000625	长安汽车	359,979	4,920,912.93	0.12
23	601611	中国核建	18,151	379,718.92	0.01
24	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
25	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
26	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.00
27	601966	玲珑轮胎	6,574	85,330.52	0.00
28	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
29	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
30	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
31	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
32	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
33	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
34	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
35	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
36	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
37	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	000926	福星股份	309,999,988.86	7.62
2	002680	长生生物	200,000,002.05	4.91
3	600057	象屿股份	170,000,002.55	4.18
4	300048	合康变频	88,600,002.66	2.18
5	002050	三花股份	39,999,998.22	0.98
6	000625	长安汽车	5,798,841.70	0.14
7	601668	中国建筑	5,424,000.00	0.13
8	000001	平安银行	5,328,308.32	0.13
9	601009	南京银行	5,080,699.00	0.12
10	601966	玲珑轮胎	85,330.52	0.00
11	601611	中国核建	62,983.97	0.00
12	601127	小康股份	50,326.22	0.00
13	300516	久之洋	33,142.50	0.00
14	300518	盛讯达	29,019.32	0.00
15	603958	哈森股份	21,703.80	0.00
16	603737	三棵树	21,152.38	0.00
17	002802	洪汇新材	15,508.08	0.00
18	603016	新宏泰	13,600.98	0.00
19	603131	上海沪工	12,743.67	0.00
20	300515	三德科技	11,612.35	0.00

注：不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 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	601939	建设银行	9,545,209.86	0.23
2	000625	长安汽车	8,875,392.41	0.22
3	000333	美的集团	2,026,713.00	0.05
4	601288	农业银行	1,809,600.00	0.04



5	300496	中科创达	1,449,658.20	0.04
6	603996	中新科技	797,100.40	0.02
7	300493	润欣科技	509,097.80	0.01
8	002786	银宝山新	482,751.90	0.01
9	002777	久远银海	346,751.12	0.01
10	002785	万里石	321,616.00	0.01
11	300492	山鼎设计	301,621.50	0.01
12	002778	高科石化	19,180.00	0.00

注：不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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	830,624,075.90
卖出股票收入（成交）总额	26,484,692.19

注：不考虑相关交易费用。

### 7.5 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	153,485,000.00	3.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	316,705,000.00	7.81
	其中：政策性金融债	316,705,000.00	7.81
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	470,190,000.00	11.59

### 7.6 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	160211	16 国开 11	1,500,000	149,970,000.00	3.70
2	150210	15 国开 10	1,000,000	106,430,000.00	2.62
3	150023	15 付息国债	1,000,000	100,880,000.00	2.49

		23			
4	150016	15 付息国债 16	500,000	52,605,000.00	1.30
5	160401	16 农发 01	500,000	49,990,000.00	1.23

### 7.7 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。

### 7.8 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。

### 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1

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

#### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	16,784.79
2	应收证券清算款	475,101,177.55
3	应收股利	-
4	应收利息	3,924,523.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	479,042,486.27

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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	000926	福星股份	287,227,477.83	7.08	非公开发行
2	300083	劲胜精密	264,644,311.68	6.52	非公开发行
3	002680	长生生物	215,007,054.39	5.30	非公开发行
4	601908	京运通	209,756,981.72	5.17	非公开发行
5	600076	康欣新材	207,602,667.43	5.12	非公开发行
6	600708	光明地产	199,798,352.52	4.92	非公开发行
7	600823	世茂股份	182,622,848.66	4.50	非公开发行
8	600057	象屿股份	156,735,428.36	3.86	非公开发行
9	002004	华邦健康	142,656,250.00	3.52	非公开发行
10	002157	正邦科技	133,900,570.40	3.30	非公开发行

## §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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华泰柏瑞惠利 A	114	34,979,432.96	3,986,138,616.90	99.96%	1,516,740.53	0.04%
华泰柏瑞惠利 C	89	7,297.52	-	0.00%	649,479.66	100.00%
合计	203	19,646,821.86	3,986,138,616.90	99.95%	2,166,220.19	0.05%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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

注：本期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞惠利 A	华泰柏瑞惠利 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 25 日）基金份额总额	4,206,769,074.02	1,239,429.95
本报告期期初基金份额总额	3,988,095,880.51	695,421.08
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	440,523.08	45,941.42
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	3,987,655,357.43	649,479.66

## §10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 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。

本报告期内，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

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。

### 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、基金托管人及其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	
招商证券	1	22,656,609.26	47.09%	21,099.65	47.63%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	14,912,771.93	30.99%	13,589.91	30.68%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	10,547,160.02	21.92%	9,611.57	21.70%	-

方正证券	1	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-

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。

### 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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	18,003,200,000.00	72.64%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	6,779,700,000.00	27.36%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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	华泰柏瑞惠利 2016 年一季报	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 4 月 20 日
2	华泰柏瑞惠利 2015 年年度报告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 3 月 29 日
3	-	-	-
4	华泰柏瑞惠利 2015 年年报摘要	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 3 月 29 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司 定增获配公告-福星股份	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 26 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司 定增获配公告-黄海机械	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 23 日
7	华泰柏瑞惠利灵活混合 2015 年第四季度报告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 21 日
8	增加平安证券为旗下部分基金 代销机构同时开通基金转换、 定投业务等的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 15 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司 定增获配公告-合康变频	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 14 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司 定增获配公告-三花股份	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 9 日
11	华泰柏瑞惠利灵活配置混合 型基金招募说明书更新 2016 年 1 号正文	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
12	华泰柏瑞惠利灵活配置混合 型基金招募说明书更新 2016 年 1 号摘要	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司 定增获配公告-深华新、正邦 科技	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 5 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司 定增获配公告-华邦健康、万 丰奥威	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 4 日

## §11 备查文件目录

### 11.1 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

### **11.2 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

### **11.3 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司  
2016 年 8 月 27 日