

华泰柏瑞健康生活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

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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

| | |
|--|-----------|
| §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 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §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..... | 10 |
| 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..... | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 12 |
| §5 托管人报告 | 13 |
| 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真实、准确和完整发表意见..... | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表..... | 13 |
| 6.2 利润表..... | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 15 |
| 6.4 报表附注..... | 17 |
| §7 投资组合报告 | 33 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 33 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 34 |
| 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..... | 34 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 36 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 38 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 38 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 38 |
| §8 基金份额持有人信息 | 39 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 39 |

| | |
|--|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 39 |
| 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..... | 39 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 40 |
| §10 重大事件揭示..... | 40 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 40 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 40 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 41 |
| 10.8 其他重大事件..... | 43 |
| §11 备查文件目录..... | 44 |
| 11.1 备查文件目录..... | 44 |
| 11.2 存放地点..... | 44 |
| 11.3 查阅方式..... | 44 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------------|
| 基金名称 | 华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 华泰柏瑞健康生活 |
| 基金主代码 | 001398 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 6 月 18 日 |
| 基金管理人 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,494,156,285.77 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 通过深入研究，本基金投资于健康生活相关行业优质的成长性公司，在有效控制风险的前提下，力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金为灵活配置混合型基金，基金管理人将跟踪宏观经济变量和国家财政、税收和货币政策等指标，判断经济周期的阶段和未来经济发展的趋势，研究预测宏观经济和国家政策等因素对证券市场的影响，分析比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，估计各子资产类的相关性矩阵，并在此基础上确定基金资产在各类别资产间的分配比例。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数×20% |
| 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 | 北京市西城区复兴门内大街 1 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 | 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 层及托管人住所 |

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 弄证大五道口广场 1 号楼 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

| 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 | -121,230,906.11 |
| 本期利润 | -165,606,459.45 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1058 |
| 本期加权平均净值利润率 | -15.45% |
| 本期基金份额净值增长率 | -12.11% |
| 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 | -440,997,284.00 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2951 |
| 期末基金资产净值 | 1,095,045,866.62 |
| 期末基金份额净值 | 0.733 |
| 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 | -26.70% |

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。

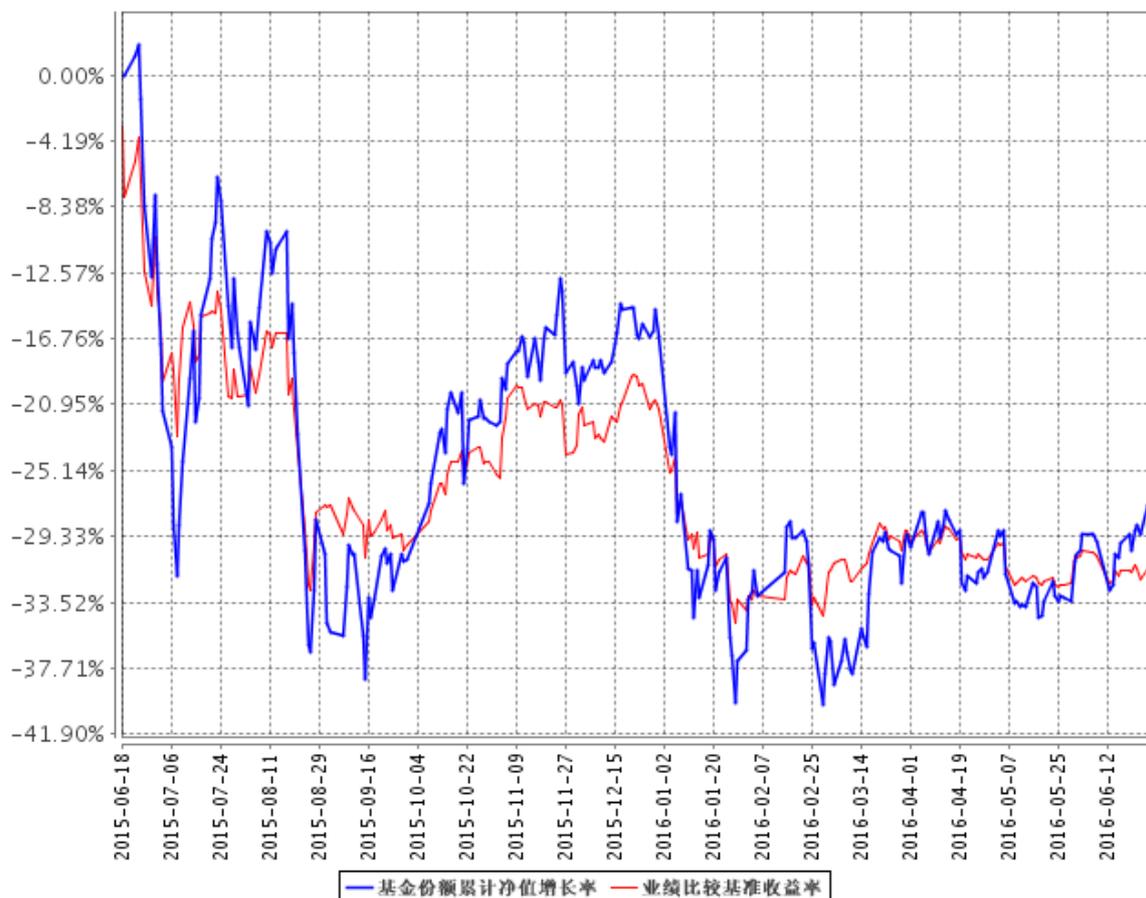
3.2 基金净值表现

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 |
|----------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 6.08% | 1.58% | -0.32% | 0.78% | 6.40% | 0.80% |
| 过去三个月 | 3.53% | 1.77% | -1.42% | 0.81% | 4.95% | 0.96% |
| 过去六个月 | -12.11% | 2.75% | -11.93% | 1.47% | -0.18% | 1.28% |
| 过去一年 | -20.59% | 3.17% | -22.77% | 1.84% | 2.18% | 1.33% |
| 自合同生效日至今 | -26.70% | 3.19% | -30.75% | 1.94% | 4.05% | 1.25% |

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 6 月 18 日至 2016 年 6 月 30 日。

§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 | | |
| 吕慧建 | 本基金基金经理、投资部总监 | 2015 年 6 月 18 日 | - | 18 年 | 吕慧建先生，新加坡国立大学 MBA。历任中大投资管理有限公司行业研究员及中信基金管理有限公司的行业研究员。2007 年 6 月加入本公司，任高级行业研究员，2007 年 11 月起担任基金经理助理，自 2009 年 11 月起担任华泰柏瑞（原友邦华泰）行业领先混合基金基金经理。2015 年 6 月起任投资部总监与华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 徐晓杰 | 本基金 | 2015 年 6 月 | - | 10 | 博士研究生，10 年证券 |

| | | | | |
|--|----------|------|--|--|
| | 基金经 理 | 18 日 | | (基金)从业经历。 2006 年 7 月至 2007 年 9 月任邦联资产管理有限 公司研究员; 2007 年 9 月加入华泰柏瑞基金管 理有限公司, 历任研究员、 高级研究员、基金经理助 理。2014 年 4 月至 2015 年 5 月任研究部总 监助理。2015 年 5 月起 任华泰柏瑞行业领先混合 型证券投资基金的基金经 理。2015 年 6 月起任华 泰柏瑞健康生活灵活配置 混合型证券投资基金的基 金经理。2015 年 10 月起 任华泰柏瑞激励动力灵活 配置混合型证券投资基金 的基金经理。 |
|--|----------|------|--|--|

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、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定, 在严格控制风险的基础上, 忠实履行基金管理职责, 为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内, 基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内, 公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离, 实行集中交易制度, 由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务, 为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况, 不同业务类别的投资经理之间互不干扰, 独立做出投资决策。公司机构设置合理, 公平交易的相关管理制度健全, 投资决策流程完善, 各项制度执行情况良好。 交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待, 不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相

同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平，只在少数情况下“存在显著的倾向性”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究表明，交易价差方向没有规律性，即没有明确的利益输送方向。造成少量显著交易价差的原因来自两方面：一是报告期内股票市场的波动幅度较大，为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件；二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异，对证券买卖时点的把握也不同，导致股票买卖存在价差。

4.3.2 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，中国经济继续回落筑底。受产能过剩、制造业固定资产投资持续低迷影响，虽然房地产投资在 15 年底见底后有所反弹，但固定资产投资增速整体仍然在 6 月回落到 9% 的低位。消费也相对较弱，在 10% 的低位波动。在 PPI 指数负增长收缩拉动，工业增加值在 6% 以上的水平企稳，上半年 GDP 增速连续两个季度都保持在 6.7% 的水平。

面对经济下行压力，中国政府保持定力，货币政策相对稳定，刺激经济的发力点主要在于放松管制、激发民间投资，和积极的财政政策上，宏观政策保持稳定。

和相对平稳的实体经济运行状态不同，资本市场的情绪在上半年出现了巨大波动。年初，全球资产价格都出现了一轮暴跌。A 股市场在熔断机制的放大效应影响下，上证指数暴跌超过 25%，创业板跌幅超过 30%。

A 股市场随后进入窄幅波动阶段，市场出现了一些结构性行情，热点有新能源汽车、量子通信、车联网等主题投资，煤炭、钢铁去产能主题等。另外，家电、白酒、医药等部分白马消费股也走出了独立的上涨行情。

虽然我们对市场出现调整有一定预期，但熔断机制造成的放大效应认识不足，在下跌过程中未及时减仓，净值损失巨大。在市场底部，我们坚持选股为主的投资策略，布局部分优质成长股、

消费股，但在选股方面有得有失，整体难以令人满意。

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 0.733 元，本报告期份额净值增长率为-12.11%，同期业绩比较基准增长率为-11.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们仍然认为中国经济继续处在探底回稳的过程中，断崖式下跌的可能性不大，快速回升的概率也较小。另一方面，经济政策方面也会保持相对稳定，大幅转向的可能性不大。

影响 A 股市场走势的另一个重要因素是大量资本存在配置需求。平淡的基本面、流动性过剩的综合作用下，预计 A 股市场将继续延续上下两难、窄幅波动的走势，市场情绪波动和市场内在的波动节奏对短期走势影响较大。

所以，我们认为 A 股市场操作策略的重点在于努力捕捉结构性、阶段性行情，我们将主要关注两个方面：一个是绩优股、消费股的估值修复行情，另一个是主题炒作。上半年部分白马个股已经取得一定涨幅，一些主题炒作透支了部分股价，展望下半年，我们将采取相对保守的操作策略，把风险控制放在一个更重要的位置，争取较好表现。

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、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。

4.7 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，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。截止本报告期末，本基金可分配收益为 0 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”）在华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金（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：华泰柏瑞健康生活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 |
|------------|---------|-------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 68,371,752.24 | 99,912,485.61 |
| 结算备付金 | | 1,426,600.73 | 9,265,862.33 |
| 存出保证金 | | 214,860.19 | 1,259,779.19 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,031,781,357.61 | 1,238,384,036.96 |
| 其中：股票投资 | | 1,031,781,357.61 | 1,238,384,036.96 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 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 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 400,251.17 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 13,053.32 | 30,703.39 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 186,421.13 | 128,793.45 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,102,394,296.39 | 1,348,981,660.93 |
| 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 3,875,663.90 |
| 应付赎回款 | | 4,705,404.11 | 2,792,575.91 |
| 应付管理人报酬 | | 1,315,343.52 | 1,715,270.64 |
| 应付托管费 | | 219,223.92 | 285,878.43 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 905,590.53 | 5,930,458.67 |
| 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 | 202,867.69 | 280,241.81 |
| 负债合计 | | 7,348,429.77 | 14,880,089.36 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,494,156,285.77 | 1,599,156,286.10 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -399,110,419.15 | -265,054,714.53 |
| 所有者权益合计 | | 1,095,045,866.62 | 1,334,101,571.57 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,102,394,296.39 | 1,348,981,660.93 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，华泰柏瑞健康生活基金份额净值 0.733 元，基金份额总额 1,494,156,285.77 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞健康生活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6月18日(基 金合同生效日)至 2015年6月30日 |
|----------------------------|------------|--------------------------------|---|
| 一、收入 | | -153,184,099.89 | -144,491,690.21 |
| 1.利息收入 | | 245,376.79 | 344,703.35 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 245,376.79 | 344,703.35 |
| 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） | | -109,238,923.43 | 426,328.27 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -113,056,314.88 | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 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 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 3,817,391.45 | 426,328.27 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -44,375,553.34 | -145,262,721.83 |
| 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 | 185,000.09 | - |
| 减：二、费用 | | 12,422,359.56 | 2,713,466.75 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 8,011,985.11 | 910,419.34 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,335,330.92 | 151,736.55 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 2,864,247.91 | 1,628,854.06 |
| 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 | 210,795.62 | 22,456.80 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -165,606,459.45 | -147,205,156.96 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -165,606,459.45 | -147,205,156.96 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞健康生活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) | 1,599,156,286.10 | -265,054,714.53 | 1,334,101,571.57 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -165,606,459.45 | -165,606,459.45 |
| 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) | -105,000,000.33 | 31,550,754.83 | -73,449,245.50 |
| 其中：1.基金申购款 | 45,167,590.57 | -14,261,621.63 | 30,905,968.94 |
| 2.基金赎回款 | -150,167,590.90 | 45,812,376.46 | -104,355,214.44 |
| 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) | 1,494,156,285.77 | -399,110,419.15 | 1,095,045,866.62 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015 年 6 月 18 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) | 1,903,644,804.44 | - | 1,903,644,804.44 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -147,205,156.96 | -147,205,156.96 |
| 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) | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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) | 1,903,644,804.44 | -147,205,156.96 | 1,756,439,647.48 |
|---------------------|------------------|-----------------|------------------|

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

华泰柏瑞健康生活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] 920号《关于准予华泰柏瑞健康生活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》和《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞健康生活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1,903,380,770.67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784号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年6月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,903,644,804.44份基金份额,其中认购资金利息折合264,033.77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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和最新公布的《华泰柏瑞健康生活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%;其中其中投资于健康生活主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的80%;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：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数×20%。

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》、《华泰柏瑞健康生活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 7.4.4 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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 | 68,371,752.24 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 68,371,752.24 |

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 | 1,004,667,059.70 | 1,031,781,357.61 | 27,114,297.91 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 1,004,667,059.70 | 1,031,781,357.61 | 27,114,297.91 |

6.4.7.3 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。

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

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

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 | 12,316.80 |
| 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 | 639.92 |
| 应收债券利息 | - |
| 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 | 96.60 |
| 合计 | 13,053.32 |

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

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 | 905,590.53 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 905,590.53 |

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 | 8,935.77 |
| 预提费用 | 193,931.92 |
| 合计 | 202,867.69 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 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 | 1,599,156,286.10 | 1,599,156,286.10 |
| 本期申购 | 45,167,590.57 | 45,167,590.57 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -150,167,590.90 | -150,167,590.90 |
| - 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 | 1,494,156,285.77 | 1,494,156,285.77 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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 |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末 | -349,369,897.14 | 84,315,182.61 | -265,054,714.53 |
| 本期利润 | -121,230,906.11 | -44,375,553.34 | -165,606,459.45 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 29,603,519.25 | 1,947,235.58 | 31,550,754.83 |
| 其中：基金申购款 | -11,485,501.79 | -2,776,119.84 | -14,261,621.63 |
| 基金赎回款 | 41,089,021.04 | 4,723,355.42 | 45,812,376.46 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -440,997,284.00 | 41,886,864.85 | -399,110,419.15 |

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 | 222,399.70 |
| 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 | 17,373.43 |
| 其他 | 5,603.66 |
| 合计 | 245,376.79 |

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 | 969,188,654.18 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,082,244,969.06 |
| 买卖股票差价收入 | -113,056,314.88 |

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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期末无衍生工具收益。

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 | 3,817,391.45 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 3,817,391.45 |

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 | -44,375,553.34 |
| ——股票投资 | -44,375,553.34 |
| ——债券投资 | - |
| ——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 | -44,375,553.34 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 170,409.80 |
| 转换费收入 | 14,590.29 |
| 合计 | 185,000.09 |

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 | 2,864,247.91 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 2,864,247.91 |

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 | 44,753.80 |
| 信息披露费 | 149,178.12 |
| 银行划款手续费 | 9,363.70 |
| 银行间账户服务费 | 7,500.00 |
| 合计 | 210,795.62 |

6.4.7.21 分部报告

注：无。

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

截止资产负债表日，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

截止资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表或有事项。

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 |

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。

6.4.10 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：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的股票交易。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方佣金。

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6月18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 | 8,011,985.11 | 910,419.34 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,766,116.46 | 436,209.50 |

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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6月18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 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | | 1,335,330.92 | | 151,736.55 |

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本期无发生关联方销售服务费。

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。

6.4.10.4 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：本报告期基金管理人未投资本基金。

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：本报告期基金管理人之外其他关联方未投资本基金。

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6月18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 |
| 中国银行股份有限公司 | 68,371,752.24 | 222,399.70 | 280,804,919.79 | 344,703.35 |

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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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 |
| 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 | - |

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 |
|--------|------|-------|------|--------|-------|--------|-----------|---------------|---------------|----|
| 002672 | 东江环保 | 2016年 | 临时停牌 | 17.33 | 2016年 | 19.06 | 2,100,012 | 32,723,432.38 | 36,393,207.96 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|----------|------------------------|----------|-------|-----------------------|-------|---------|--------------|--------------|---|
| | | 5月 23日 | | | 7月 15日 | | | | | |
| 300351 | 永贵 电器 | 2016 年 6月 29日 | 临时 停牌 | 33.93 | 2016 年 7月 4日 | 33.30 | 284,929 | 7,505,111.35 | 9,667,640.97 | - |
| 000932 | 华菱 钢铁 | 2016 年 3月 28日 | 临时 停牌 | 3.95 | 2016 年 8月 8日 | 4.35 | 250,000 | 980,000.00 | 987,500.00 | - |
| 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 | 25,210 | 87,478.70 | 527,393.20 | - |

注：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。

6.4.12.3 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

本基金本报告期内无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 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。

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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.3 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发行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 2016 年 6 月 30 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。

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。

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 |
|-----------------------------|---------------|--------|--------------|-------|-----------|-------------------|-------------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 68,371,752.24 | - | - | - | - | - | 68,371,752.24 |
| 结算备付金 | 1,426,600.73 | - | - | - | - | - | 1,426,600.73 |
| 存出保证金 | 214,860.19 | - | - | - | - | - | 214,860.19 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -1,031,781,357.61 | -1,031,781,357.61 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 400,251.17 | 400,251.17 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 13,053.32 | 13,053.32 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 186,421.13 | 186,421.13 |
| 资产总计 | 70,013,213.16 | - | - | - | - | -1,032,381,083.23 | 1,102,394,296.39 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 4,705,404.11 | 4,705,404.11 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,315,343.52 | 1,315,343.52 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 219,223.92 | 219,223.92 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 905,590.53 | 905,590.53 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 202,867.69 | 202,867.69 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 7,348,429.77 | 7,348,429.77 |
| 利率敏感度缺口 | 70,013,213.16 | - | - | - | - | -1,025,032,653.46 | 1,095,045,866.62 |
| 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 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 99,912,485.61 | - | - | - | - | - | 99,912,485.61 |
| 结算备付金 | 9,265,862.33 | - | - | - | - | - | 9,265,862.33 |
| 存出保证金 | 1,259,779.19 | - | - | - | - | - | 1,259,779.19 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -1,238,384,036.96 | -1,238,384,036.96 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 30,703.39 | 30,703.39 |

| | | | | | | |
|---------|----------------|---|---|---|-------------------|------------------|
| 应收申购款 | - | - | - | - | 128,793.45 | 128,793.45 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 110,438,127.13 | - | - | - | 1,238,543,533.80 | 1,348,981,660.93 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | 3,875,663.90 | 3,875,663.90 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 2,792,575.91 | 2,792,575.91 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 1,715,270.64 | 1,715,270.64 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 285,878.43 | 285,878.43 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 5,930,458.67 | 5,930,458.67 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 280,241.81 | 280,241.81 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 14,880,089.36 | 14,880,089.36 |
| 利率敏感度缺口 | 110,438,127.13 | - | - | - | -1,223,663,444.44 | 1,334,101,571.57 |

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，其中投资于健康生活主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。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 | 1,031,781,357.61 | 94.22 | 1,238,384,036.96 | 92.83 |
| 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 | 1,031,781,357.61 | 94.22 | 1,238,384,036.96 | 92.83 |

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：人民币万元） | |
| | | 本期末（2016年6月30日） | 上年度末（2015年12月31日） |
| | 沪深 300 指数上涨 5% | 增加 7,202 | 增加 5,474 |
| | 沪深 300 指数下跌 5% | 减少 7,202 | 减少 5,474 |

§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 | 1,031,781,357.61 | 93.59 |
| | 其中：股票 | 1,031,781,357.61 | 93.59 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 69,798,352.97 | 6.33 |
| 7 | 其他各项资产 | 814,585.81 | 0.07 |
| 8 | 合计 | 1,102,394,296.39 | 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 | 40,424,000.00 | 3.69 |
| B | 采矿业 | 2,880,000.00 | 0.26 |
| C | 制造业 | 467,423,168.10 | 42.69 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 527,393.20 | 0.05 |
| F | 批发和零售业 | 25,765,336.80 | 2.35 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 237,534,378.48 | 21.69 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 2,969,536.68 | 0.27 |
| L | 租赁和商务服务业 | 67,893,992.36 | 6.20 |
| 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 | 89,489,805.71 | 8.17 |
| 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 | 96,853,620.18 | 8.84 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,031,781,357.61 | 94.22 |

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 | 300310 | 宜通世纪 | 2,100,000 | 80,199,000.00 | 7.32 |
| 2 | 300017 | 网宿科技 | 1,000,000 | 67,200,000.00 | 6.14 |
| 3 | 300144 | 宋城演艺 | 2,599,973 | 64,765,327.43 | 5.91 |
| 4 | 002001 | 新和成 | 2,996,003 | 63,305,543.39 | 5.78 |
| 5 | 002183 | 怡亚通 | 4,200,134 | 60,145,918.88 | 5.49 |
| 6 | 600054 | 黄山旅游 | 3,299,975 | 53,096,597.75 | 4.85 |
| 7 | 002236 | 大华股份 | 3,900,113 | 51,091,480.30 | 4.67 |
| 8 | 300065 | 海兰信 | 1,300,083 | 50,287,210.44 | 4.59 |
| 9 | 002008 | 大族激光 | 1,800,000 | 41,112,000.00 | 3.75 |
| 10 | 002714 | 牧原股份 | 800,000 | 40,424,000.00 | 3.69 |
| 11 | 600485 | 信威集团 | 2,100,000 | 37,464,000.00 | 3.42 |
| 12 | 002672 | 东江环保 | 2,100,012 | 36,393,207.96 | 3.32 |
| 13 | 002517 | 恺英网络 | 800,000 | 35,264,000.00 | 3.22 |
| 14 | 002624 | 完美环球 | 850,021 | 32,088,292.75 | 2.93 |
| 15 | 000971 | 高升控股 | 1,200,000 | 29,904,000.00 | 2.73 |
| 16 | 603866 | 桃李面包 | 650,000 | 29,094,000.00 | 2.66 |
| 17 | 002475 | 立讯精密 | 1,300,088 | 25,546,729.20 | 2.33 |
| 18 | 600887 | 伊利股份 | 1,500,050 | 25,005,833.50 | 2.28 |
| 19 | 002157 | 正邦科技 | 1,000,000 | 23,460,000.00 | 2.14 |
| 20 | 300113 | 顺网科技 | 610,748 | 23,183,994.08 | 2.12 |
| 21 | 600521 | 华海药业 | 897,000 | 21,815,040.00 | 1.99 |
| 22 | 300267 | 尔康制药 | 1,499,981 | 21,479,727.92 | 1.96 |
| 23 | 002572 | 索菲亚 | 206,166 | 11,549,419.32 | 1.05 |
| 24 | 300026 | 红日药业 | 600,000 | 10,434,000.00 | 0.95 |
| 25 | 600713 | 南京医药 | 1,200,040 | 10,104,336.80 | 0.92 |
| 26 | 300351 | 永贵电器 | 284,929 | 9,667,640.97 | 0.88 |
| 27 | 000568 | 泸州老窖 | 320,249 | 9,511,395.30 | 0.87 |
| 28 | 002589 | 瑞康医药 | 300,000 | 9,213,000.00 | 0.84 |
| 29 | 600138 | 中青旅 | 401,039 | 7,748,073.48 | 0.71 |
| 30 | 002124 | 天邦股份 | 700,057 | 7,455,607.05 | 0.68 |
| 31 | 000078 | 海王生物 | 750,000 | 5,572,500.00 | 0.51 |
| 32 | 300285 | 国瓷材料 | 123,800 | 4,938,382.00 | 0.45 |
| 33 | 300296 | 利亚德 | 150,000 | 4,749,000.00 | 0.43 |
| 34 | 002100 | 天康生物 | 500,000 | 4,495,000.00 | 0.41 |
| 35 | 000488 | 晨鸣纸业 | 500,000 | 3,970,000.00 | 0.36 |
| 36 | 000671 | 阳光城 | 499,922 | 2,969,536.68 | 0.27 |
| 37 | 002554 | 惠博普 | 400,000 | 2,880,000.00 | 0.26 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 38 | 002470 | 金正大 | 244,000 | 1,964,200.00 | 0.18 |
| 39 | 300182 | 捷成股份 | 100,000 | 1,711,000.00 | 0.16 |
| 40 | 002108 | 沧州明珠 | 50,700 | 1,313,130.00 | 0.12 |
| 41 | 300011 | 鼎汉技术 | 51,500 | 1,208,705.00 | 0.11 |
| 42 | 002643 | 万润股份 | 21,500 | 1,093,920.00 | 0.10 |
| 43 | 000932 | 华菱钢铁 | 250,000 | 987,500.00 | 0.09 |
| 44 | 600998 | 九州通 | 50,000 | 875,500.00 | 0.08 |
| 45 | 000807 | 云铝股份 | 131,500 | 861,325.00 | 0.08 |
| 46 | 600172 | 黄河旋风 | 45,000 | 829,350.00 | 0.08 |
| 47 | 000902 | 新洋丰 | 66,000 | 825,660.00 | 0.08 |
| 48 | 002616 | 长青集团 | 35,400 | 732,780.00 | 0.07 |
| 49 | 600872 | 中炬高新 | 50,000 | 617,000.00 | 0.06 |
| 50 | 601611 | 中国核建 | 25,210 | 527,393.20 | 0.05 |
| 51 | 601127 | 小康股份 | 8,662 | 206,761.94 | 0.02 |
| 52 | 601966 | 玲珑轮胎 | 6,574 | 85,330.52 | 0.01 |
| 53 | 603131 | 上海沪工 | 1,263 | 76,664.10 | 0.01 |
| 54 | 300515 | 三德科技 | 1,355 | 63,508.85 | 0.01 |
| 55 | 300518 | 盛讯达 | 1,306 | 61,186.10 | 0.01 |
| 56 | 002799 | 环球印务 | 1,080 | 47,131.20 | 0.00 |
| 57 | 603958 | 哈森股份 | 2,372 | 34,394.00 | 0.00 |
| 58 | 002802 | 洪汇新材 | 1,629 | 24,565.32 | 0.00 |
| 59 | 603909 | 合诚股份 | 1,095 | 20,126.10 | 0.00 |
| 60 | 603016 | 新宏泰 | 1,602 | 13,600.98 | 0.00 |
| 61 | 300520 | 科大国创 | 926 | 9,306.30 | 0.00 |
| 62 | 002805 | 丰元股份 | 971 | 5,631.80 | 0.00 |
| 63 | 300271 | 华宇软件 | 100 | 1,892.00 | 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 | 002001 | 新和成 | 61,674,975.56 | 4.62 |
| 2 | 002183 | 怡亚通 | 51,565,972.01 | 3.87 |
| 3 | 600054 | 黄山旅游 | 49,570,598.30 | 3.72 |
| 4 | 002714 | 牧原股份 | 43,695,993.40 | 3.28 |
| 5 | 603866 | 桃李面包 | 42,090,176.30 | 3.15 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 6 | 002640 | 跨境通 | 39,947,709.78 | 2.99 |
| 7 | 000971 | 高升控股 | 39,823,830.15 | 2.99 |
| 8 | 300498 | 温氏股份 | 37,027,359.48 | 2.78 |
| 9 | 002624 | 完美环球 | 34,213,080.21 | 2.56 |
| 10 | 002672 | 东江环保 | 32,723,432.38 | 2.45 |
| 11 | 002475 | 立讯精密 | 32,701,232.32 | 2.45 |
| 12 | 300113 | 顺网科技 | 27,483,175.56 | 2.06 |
| 13 | 600887 | 伊利股份 | 25,716,754.00 | 1.93 |
| 14 | 600521 | 华海药业 | 18,411,828.64 | 1.38 |
| 15 | 600115 | 东方航空 | 16,943,325.68 | 1.27 |
| 16 | 300031 | 宝通科技 | 14,982,461.00 | 1.12 |
| 17 | 002589 | 瑞康医药 | 13,947,617.00 | 1.05 |
| 18 | 000983 | 西山煤电 | 13,794,573.53 | 1.03 |
| 19 | 002643 | 万润股份 | 13,779,600.50 | 1.03 |
| 20 | 000028 | 国药一致 | 12,738,362.40 | 0.95 |

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。

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 | 300367 | 东方网力 | 82,404,808.03 | 6.18 |
| 2 | 300285 | 国瓷材料 | 62,070,448.48 | 4.65 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 54,873,207.23 | 4.11 |
| 4 | 002640 | 跨境通 | 44,502,515.70 | 3.34 |
| 5 | 300310 | 宜通世纪 | 36,928,117.48 | 2.77 |
| 6 | 002517 | 恺英网络 | 36,560,788.00 | 2.74 |
| 7 | 300113 | 顺网科技 | 33,264,495.00 | 2.49 |
| 8 | 300136 | 信维通信 | 32,366,760.96 | 2.43 |
| 9 | 002667 | 鞍重股份 | 32,140,381.88 | 2.41 |
| 10 | 300498 | 温氏股份 | 31,905,050.45 | 2.39 |
| 11 | 600703 | 三安光电 | 31,554,997.09 | 2.37 |
| 12 | 002172 | 澳洋科技 | 31,538,161.10 | 2.36 |
| 13 | 002714 | 牧原股份 | 29,417,538.73 | 2.21 |
| 14 | 000971 | 高升控股 | 27,285,578.26 | 2.05 |
| 15 | 002183 | 怡亚通 | 24,203,834.90 | 1.81 |
| 16 | 600276 | 恒瑞医药 | 23,125,556.12 | 1.73 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 17 | 300017 | 网宿科技 | 20,539,280.53 | 1.54 |
| 18 | 000078 | 海王生物 | 20,378,616.88 | 1.53 |
| 19 | 600115 | 东方航空 | 18,831,638.87 | 1.41 |
| 20 | 603866 | 桃李面包 | 18,646,871.22 | 1.40 |

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。

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 | 920,017,843.05 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 969,188,654.18 |

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

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

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

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情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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情形。

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 | 214,860.19 |
| 2 | 应收证券清算款 | 400,251.17 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 13,053.32 |
| 5 | 应收申购款 | 186,421.13 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 814,585.81 |

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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 |
| 14,044 | 106,391.08 | 1,684,023.10 | 0.11% | 1,492,472,262.67 | 99.89% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，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：1、期末基金从业人员持有本基金份额为 0。
- 2、本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。
- 3、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。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2015 年 6 月 18 日）基金份额总额 | 1,903,644,804.44 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,599,156,286.10 |
| 本报告期基金总申购份额 | 45,167,590.57 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 150,167,590.90 |
| 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 | 1,494,156,285.77 |

§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，基金管理人及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

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 | |
| 华创证券 | 1 | 325,114,416.51 | 17.22% | 296,277.25 | 17.15% | - |
| 兴业证券 | 1 | 324,594,219.72 | 17.20% | 295,802.66 | 17.12% | - |
| 中信建投 | 2 | 190,097,934.05 | 10.07% | 173,236.80 | 10.03% | - |
| 华安证券 | 2 | 176,793,701.53 | 9.37% | 161,234.69 | 9.33% | - |
| 海通证券 | 1 | 150,476,207.32 | 7.97% | 137,129.01 | 7.94% | - |
| 万联证券 | 2 | 138,262,871.69 | 7.32% | 126,354.74 | 7.31% | - |
| 东吴证券 | 1 | 132,773,931.95 | 7.03% | 120,997.43 | 7.00% | - |
| 齐鲁证券 | 1 | 114,021,561.45 | 6.04% | 106,187.11 | 6.15% | - |
| 银河证券 | 2 | 88,608,189.72 | 4.69% | 82,520.76 | 4.78% | - |
| 信达证券 | 1 | 60,245,190.22 | 3.19% | 54,901.56 | 3.18% | - |
| 国金证券 | 1 | 50,549,112.72 | 2.68% | 47,076.07 | 2.72% | - |
| 长江证券 | 1 | 37,780,172.26 | 2.00% | 35,184.42 | 2.04% | - |
| 东北证券 | 1 | 35,240,261.36 | 1.87% | 32,819.70 | 1.90% | - |
| 浙商证券 | 1 | 31,861,552.75 | 1.69% | 29,035.30 | 1.68% | - |
| 广发证券 | 1 | 21,398,097.37 | 1.13% | 19,928.04 | 1.15% | - |
| 华融证券 | 1 | 9,781,024.05 | 0.52% | 8,913.51 | 0.52% | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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 |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 4 月 20 日 |
| 2 | 华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金 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 | 华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 3 月 29 日 |
| 4 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于北京钱景财富投资管理有限公司新增旗下基金代销的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 3 月 17 日 |

| | | | |
|---|--|----------------------|-----------------|
| 5 | 华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要 2016 年 1 号 | 中国证券报、上海 证券报、证券时报 | 2016 年 1 月 29 日 |
| 6 | 华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书正文 2016 年 1 号 | 中国证券报、上海 证券报、证券时报 | 2016 年 1 月 29 日 |
| 7 | 华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告 | 中国证券报、上海 证券报、证券时报 | 2016 年 1 月 21 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 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层及托管人住所

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

华泰柏瑞基金管理有限公司
2016 年 8 月 27 日