

华泰柏瑞消费成长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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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、净值表现和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。

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
§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.....	6
§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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
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.....	34
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.....	35
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.....	35
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.....	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	35
7.12 投资组合报告附注.....	35
§8 基金份额持有人信息	36
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	37

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.....	37
§9 开放式基金份额变动.....	37
§10 重大事件揭示.....	37
10.1 基金份额持有人大会决议.....	37
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.....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4 基金投资策略的改变.....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	38
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.....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	38
10.8 其他重大事件.....	39
§11 备查文件目录.....	40
11.1 备查文件目录.....	40
11.2 存放地点.....	41
11.3 查阅方式.....	41

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞消费成长混合
基金主代码	001069
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 20 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	766,541,221.73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过深入研究，本基金投资于消费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	本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合方法来构建投资组合。通过定量和定性分析，对宏观经济、市场环境、行业估值等因素做深入系统研究，分析比较股票和债券预期收益率变化，优化股票和债券的投资比例从而确定大类资产配置。
业绩比较基准	申银万国消费品指数*80%+中证全债指数*20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	田青
	联系电话	021-38601777	010-67595096
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	010-67595096
传真		021-38601799	010-66275853
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	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码		200135	100033

法定代表人	齐亮	王洪章
-------	----	-----

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

§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	-146,519,775.46
本期利润	-128,685,174.57
加权平均基金份额本期利润	-0.1590
本期加权平均净值利润率	-14.05%
本期基金份额净值增长率	-12.46%
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	137,673,043.78
期末可供分配基金份额利润	0.1796
期末基金资产净值	904,214,265.51
期末基金份额净值	1.180
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	18.00%

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

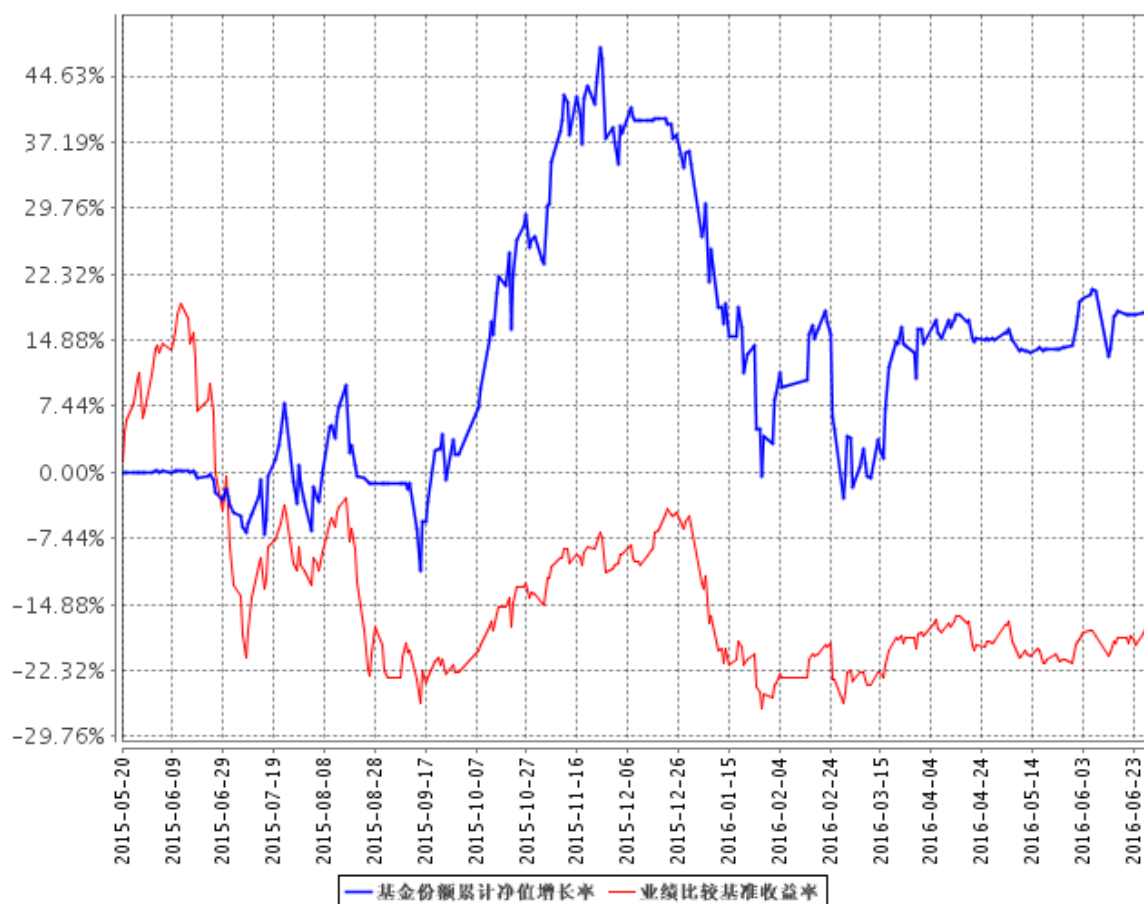
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.55%	1.65%	2.93%	1.08%	-1.38%	0.57%
过去三个月	1.55%	1.11%	1.21%	1.18%	0.34%	-0.07%

过去六个月	-12.46%	2.47%	-11.39%	1.80%	-1.07%	0.67%
过去一年	20.16%	2.56%	-16.27%	2.07%	36.43%	0.49%
自基金合同生效日起至 今	18.00%	2.43%	-16.63%	2.14%	34.63%	0.29%

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 2015 年 5 月 20 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十二部分（二）投资范围中规定的各项比例：本基金持有的股票占基金资产的比例为 0%-95%，投资于消费相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券。

§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	基金经 理	2015 年 5 月 20 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 月起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。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。
----	----------	--------------------	---	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《华泰柏瑞量化指数增强股票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

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通

过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

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，沪深 300 指数下跌 15.46%，中证 500 指数下跌 19.61%，创业板指数下跌 17.92%。本基金净值小幅度跑赢基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.180 元，本报告期份额净值增长率为-12.46%，同期业绩比较基准增长率为-11.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度，市场信心逐步恢复，黄金、新能源、智能汽车、区块链等主题投资异常活跃。创业板为代表的成长股估值水平溢价幅度继续提升，市场风险偏好处在历史高位。

展望三季度，我们相对更加看好蓝筹股的投资机会，相比成长类股票，蓝筹股估值安全边际非常高，适合长线投资。

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

本报告期内基金未实施收益分配。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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：华泰柏瑞消费成长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	613,357,358.22	55,570,667.30
结算备付金		6,938,170.92	7,707,089.88
存出保证金		1,447,609.00	1,102,368.73

交易性金融资产	6.4.7.2	27,609,121.48	935,015,040.78
其中：股票投资		27,609,121.48	935,015,040.78
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		261,532,686.78	-
应收利息	6.4.7.5	164,192.65	54,358.32
应收股利		-	-
应收申购款		3,915,197.92	52,991,628.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		914,964,336.97	1,052,441,153.44
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		-	-
应付赎回款		6,670,187.53	10,246,669.65
应付管理人报酬		1,045,900.12	1,373,775.92
应付托管费		174,316.69	228,962.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,653,820.46	6,379,604.14
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	205,846.66	311,337.94
负债合计		10,750,071.46	18,540,350.30
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	766,541,221.73	766,870,085.81
未分配利润	6.4.7.10	137,673,043.78	267,030,717.33
所有者权益合计		904,214,265.51	1,033,900,803.14
负债和所有者权益总计		914,964,336.97	1,052,441,153.44

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.180 元，基金份额总额 766,541,221.73 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞消费成长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 20 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-110,072,265.75	-23,255,721.92
1.利息收入		1,162,488.60	2,626,793.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,127,345.50	856,001.23
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		35,143.10	1,770,792.70
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-133,584,260.33	-6,980,461.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-134,277,721.01	-7,067,008.35
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	693,460.68	86,546.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	17,834,600.89	-19,346,130.34
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	4,514,905.09	444,075.91
减：二、费用		18,612,908.82	3,615,990.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,855,953.72	2,576,106.08
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,142,658.95	429,351.03
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	10,401,926.58	545,650.92
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	212,369.57	64,882.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-128,685,174.57	-26,871,712.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-128,685,174.57	-26,871,712.03

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞消费成长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)	766,870,085.81	267,030,717.33	1,033,900,803.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-128,685,174.57	-128,685,174.57
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)	-328,864.08	-672,498.98	-1,001,363.06
其中：1.基金申购款	834,901,305.39	103,297,734.73	938,199,040.12
2.基金赎回款	-835,230,169.47	-103,970,233.71	-939,200,403.18
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)	766,541,221.73	137,673,043.78	904,214,265.51
项目	上年度可比期间 2015 年 5 月 20 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)	1,549,036,076.82	-	1,549,036,076.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-26,871,712.03	-26,871,712.03
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)	-85,179,381.32	765,388.03	-84,413,993.29
其中：1.基金申购款	5,428,749.77	-11,113.63	5,417,636.14

2. 基金赎回款	-90,608,131.09	776,501.66	-89,831,629.43
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）	1,463,856,695.50	-26,106,324.00	1,437,750,371.50

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 房伟力 赵景云
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]579号《关于核准华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》和证券基金机构监管部部函[2015]371号《关于华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,548,732,917.36 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2015)第 491 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,549,036,076.82 份基金份额，其中认购资金利息折合 303,159.46 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货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(须符合中国证监会相关规定)。本基金持有的股票占基金资产的比例为 0%-95%，投资于消费相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资

产净值 5%的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为申银万国消费品指数*80%+中证全债指数*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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞消费成长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	613,357,358.22
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	613,357,358.22

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	27,241,955.31	27,609,121.48	367,166.17
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	27,241,955.31	27,609,121.48	367,166.17

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券

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	160,419.05
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	3,122.20
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	651.40
合计	164,192.65

6.4.7.6 其他资产

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	2,653,522.46
银行间市场应付交易费用	298.00
合计	2,653,820.46

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	16,886.98
预提费用	188,959.68
合计	205,846.66

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	766,870,085.81	766,870,085.81
本期申购	834,901,305.39	834,901,305.39
本期赎回(以“-”号填列)	-835,230,169.47	-835,230,169.47
- 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	766,541,221.73	766,541,221.73

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	301,354,810.10	-34,324,092.77	267,030,717.33
本期利润	-146,519,775.46	17,834,600.89	-128,685,174.57

本期基金份额交易产生的变动数	18,873,269.67	-19,545,768.65	-672,498.98
其中：基金申购款	168,326,518.68	-65,028,783.95	103,297,734.73
基金赎回款	-149,453,249.01	45,483,015.30	-103,970,233.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	173,708,304.31	-36,035,260.53	137,673,043.78

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	1,053,852.23
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	52,274.72
其他	21,218.55
合计	1,127,345.50

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	3,892,179,835.45
减：卖出股票成本总额	4,026,457,556.46
买卖股票差价收入	-134,277,721.01

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：本基金本报告期末未持有债券投资收益项目。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期末未持有债券投资收益项目。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期末未持有债券投资收益项目。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期末未持有债券投资收益项目。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末未持有债券投资收益项目。

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：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益

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	693,460.68
基金投资产生的股利收益	-
合计	693,460.68

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	17,834,600.89
——股票投资	17,834,600.89
——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	17,834,600.89

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	4,285,342.94
转换费收入	229,562.15
合计	4,514,905.09

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

2、本基金的转换费由基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用中的 25% 归入基金财产。

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	10,401,926.58
银行间市场交易费用	-
合计	10,401,926.58

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	39,781.56
信息披露费	149,178.12
银行划款手续费	14,409.89
银行间账户服务费	9,000.00
合计	212,369.57

6.4.7.21 分部报告

注：本基金本报告期无分部报告。

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，本基金无其它需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、基金注册登记人、基金直销机构
中国建设银行股份有限公司	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：1、关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

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

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20日(基金合同生效日)至 2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券股份有 限公司	-	-	461,521,333.81	100%

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内通过关联方交易单元未进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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20日(基金合同生效日)至 2015年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	-	-	4,650,000,000.00	100%

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内通过关联方交易单元未进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年5月20日(基金合同生效日)至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券股份 有限公司	413,398.83	100%	413,398.83	100%

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20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	6,855,953.72
其中：支付销售机构的 客户维护费	5,254,981.43	-

注1：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5月20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	1,142,658.95	429,351.03

注 1：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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内通过关联方交易单元未进行银行间债券（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：本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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：本基金本报告期内除基金管理人外无其他关联方投资本基金。

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 5 月 20 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
中国建设银行股份有限公司	613,357,358.22	1,053,852.23	1,253,605,461.47	837,404.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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：本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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

本基金本报告期末未持有因认购/增发证券而流通受限的证券。

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
300142	沃森生物	2016 年 3 月 22 日	重大资产重组	11.16	-	-	588,315	5,921,971.70	6,565,595.40	-
300299	富春通信	2016 年 2 月 29 日	重大资产重组	27.51	-	-	200,700	6,638,160.24	5,521,257.00	-
300166	东方国信	2016 年 6 月 8 日	重大资产重组	27.47	-	-	180,100	4,644,031.00	4,947,347.00	-
300427	红相电力	2016 年 6 月 13 日	重大资产重组	21.89	-	-	207,900	3,997,392.77	4,550,931.00	-

300292	吴通 控股	2016 年 1月 25日	拟披 露重 大事 项	33.26	2016-7-20	36.48	135,458	4,615,878.60	4,505,333.08	-
300265	通光 线缆	2016 年 3月 24日	拟披 露重 大事 项	12.38	2016-7-21	12.55	99,500	1,123,607.00	1,231,810.00	-
002373	千方 科技	2016 年 5月 12日	重大 资产 重组	14.94	-	-	19,200	300,914.00	286,848.00	-

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

注：本基金本报告期末未持有银行间市场正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有交易所市场正回购。

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。本公司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建设银行，因而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，因此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，本基金未持有信用类债券（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有债券。

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主要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。针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 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。此外，由于本基金的申购赎回采

用股票交付方式进行，申购赎回对本基金的流动性风险影响小。 本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为三个月以内且不计息，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，适用于本基金的市场风险包括利率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。

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	613,357,358.22	-	-	-	-	-	613,357,358.22
结算备付金	6,938,170.92	-	-	-	-	-	6,938,170.92
存出保证金	1,447,609.00	-	-	-	-	-	1,447,609.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	27,609,121.48	27,609,121.48
应收证券清算款	-	-	-	-	-	261,532,686.78	261,532,686.78
应收利息	-	-	-	-	-	164,192.65	164,192.65
应收申购款	-	-	-	-	-	3,915,197.92	3,915,197.92
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	621,743,138.14	-	-	-	-	293,221,198.83	914,964,336.97
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,670,187.53	6,670,187.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,045,900.12	1,045,900.12
应付托管费	-	-	-	-	-	174,316.69	174,316.69
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,653,820.46	2,653,820.46
其他负债	-	-	-	-	-	205,846.66	205,846.66

负债总计	-	-	-	-	-	10,750,071.46	10,750,071.46
利率敏感度缺口	621,743,138.14	-	-	-	-	282,471,127.37	904,214,265.51
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	55,570,667.30	-	-	-	-	-	55,570,667.30
结算备付金	7,707,089.88	-	-	-	-	-	7,707,089.88
存出保证金	1,102,368.73	-	-	-	-	-	1,102,368.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	935,015,040.78	935,015,040.78
应收利息	-	-	-	-	-	54,358.32	54,358.32
应收申购款	51,446,906.60	-	-	-	-	1,544,721.83	52,991,628.43
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	115,827,032.51	-	-	-	-	936,614,120.93	1,052,441,153.44
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,246,669.65	10,246,669.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,373,775.92	1,373,775.92
应付托管费	-	-	-	-	-	228,962.65	228,962.65
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,379,604.14	6,379,604.14
其他负债	-	-	-	-	-	311,337.94	311,337.94
负债总计	-	-	-	-	-	18,540,350.30	18,540,350.30
利率敏感度缺口	115,827,032.51	-	-	-	-	918,073,770.63	1,033,900,803.14

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：截至 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 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（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 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。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，包括跟踪误差等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。 本基金投资组合中股票投资比例为不低于基金资产的 95%。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.2.1 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	27,609,121.48	3.05	935,015,040.78	90.44
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	27,609,121.48	3.05	935,015,040.78	90.44

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除申银万国消费品指数外的其它市场变量保持不变		
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）
	申银万国消费品指数上升 5%	51,476,996.19	25,350,000.00
申银万国消费品指数下降 5%	-51,476,996.19	-25,350,000.00	

§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	27,609,121.48	3.02

	其中：股票	27,609,121.48	3.02
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	620,295,529.14	67.79
7	其他各项资产	267,059,686.35	29.19
8	合计	914,964,336.97	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,853,669.48	1.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	10,755,452.00	1.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	27,609,121.48	3.05

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

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	300142	沃森生物	588,315	6,565,595.40	0.73
2	300299	富春通信	200,700	5,521,257.00	0.61
3	300166	东方国信	180,100	4,947,347.00	0.55
4	300427	红相电力	207,900	4,550,931.00	0.50
5	300292	吴通控股	135,458	4,505,333.08	0.50
6	300265	通光线缆	99,500	1,231,810.00	0.14
7	002373	千方科技	19,200	286,848.00	0.03

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	300059	东方财富	40,421,531.17	3.91
2	601088	中国神华	30,128,553.28	2.91
3	300136	信维通信	29,543,553.58	2.86
4	300310	宜通世纪	22,285,775.15	2.16
5	300166	东方国信	22,078,283.89	2.14
6	300253	卫宁健康	20,785,709.84	2.01
7	000971	高升控股	20,163,813.00	1.95
8	300170	汉得信息	19,196,962.95	1.86
9	300178	腾邦国际	19,130,514.53	1.85
10	300130	新国都	18,265,605.48	1.77
11	600395	盘江股份	18,257,100.77	1.77

12	300252	金信诺	17,522,768.11	1.69
13	600667	太极实业	17,425,901.70	1.69
14	300159	新研股份	17,322,929.11	1.68
15	300190	维尔利	17,112,773.09	1.66
16	300316	晶盛机电	17,103,627.57	1.65
17	002640	跨境通	17,072,791.70	1.65
18	300204	舒泰神	17,016,744.99	1.65
19	300232	洲明科技	16,839,164.53	1.63
20	300009	安科生物	16,827,392.14	1.63

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300059	东方财富	40,921,049.43	3.96
2	300136	信维通信	32,301,330.55	3.12
3	601288	农业银行	31,795,000.00	3.08
4	601398	工商银行	31,470,000.00	3.04
5	601328	交通银行	30,903,566.70	2.99
6	600019	宝钢股份	28,397,532.49	2.75
7	600048	保利地产	27,964,684.88	2.70
8	601088	中国神华	27,121,264.23	2.62
9	601999	出版传媒	21,800,163.45	2.11
10	600519	贵州茅台	20,676,665.79	2.00
11	300310	宜通世纪	20,547,158.87	1.99
12	300232	洲明科技	19,941,111.22	1.93
13	300253	卫宁健康	19,390,757.26	1.88
14	600667	太极实业	19,232,335.00	1.86
15	000971	高升控股	18,869,363.67	1.83
16	300252	金信诺	18,491,598.22	1.79
17	300170	汉得信息	18,277,331.15	1.77
18	300316	晶盛机电	18,259,971.80	1.77
19	300130	新国都	18,190,207.55	1.76
20	600395	盘江股份	17,765,458.64	1.72

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	3,101,217,036.27
卖出股票收入（成交）总额	3,892,179,835.45

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

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。

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	1,447,609.00
2	应收证券清算款	261,532,686.78
3	应收股利	-
4	应收利息	164,192.65
5	应收申购款	3,915,197.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	267,059,686.35

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	300142	沃森生物	6,565,595.40	0.73	重大资产重组
2	300299	富春通信	5,521,257.00	0.61	重大资产重组
3	300166	东方国信	4,947,347.00	0.55	重大资产重组
4	300427	红相电力	4,550,931.00	0.50	重大资产重组
5	300292	吴通控股	4,505,333.08	0.50	拟披露重大事项

6	300265	通光线缆	1,231,810.00	0.14	拟披露重大事项
7	002373	千方科技	286,848.00	0.03	重大资产重组

§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

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
20,331.00	37,703.08	135,024,527.14	17.61%	631,516,694.59	82.39%

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	1,349,467.20	0.18%

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 50 至 100 万份。

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 50 至 100 万份

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年5月20日)基金份额总额	1,549,036,076.82
本报告期期初基金份额总额	766,870,085.81
本报告期基金总申购份额	834,901,305.39

减:本报告期基金总赎回份额	835,230,169.47
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	766,541,221.73

§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	

国信证券	1	2,561,244,870.88	36.62%	1,826,295.52	31.01%	-
爱建证券	1	723,716,416.57	10.35%	673,993.50	11.44%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	1,615,610,341.39	23.10%	1,472,308.57	25.00%	-
华创证券	2	349,261,689.69	4.99%	325,267.54	5.52%	-
万联证券	2	1,743,444,022.28	24.93%	1,591,461.95	27.02%	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-

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
国信证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-

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	华泰柏瑞消费成长 2016 年 1 季报	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 20 日
2	华泰柏瑞基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 31 日
3	华泰柏瑞消费成长 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
4	华泰柏瑞消费成长混合证券投资基金 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
5	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
6	华泰柏瑞消费成长混合型证券投资基金 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
7	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
8	华泰柏瑞消费成长基金恢复大额申购等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
9	华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型基金限制大额申购等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 4 日
10	华泰柏瑞消费成长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 2 日
11	华泰柏瑞消费成长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 2 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

华泰柏瑞基金管理有限公司
2016 年 8 月 27 日