

# 华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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

报告送出日期：2016 年 10 月 25 日

## §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。

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 10 月 24 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。

本报告中的财务资料未经审计。

自 2016 年 8 月 3 日至 2016 年 9 月 1 日华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，自 2016 年 9 月 2 日起，本基金由“华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金”转型为“华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞精选回报混合”，基金代码保持不变。关于转型的详细内容见我公司 2016 年 8 月 3 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于以通讯方式召开华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 2016 年 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

转型后：

基金简称	华泰柏瑞精选回报混合
交易代码	001524
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 2 日
报告期末基金份额总额	1,001,545,806.59 份
投资目标	通过深入研究，本基金对股票、债券等金融资产进行灵活配置，在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，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	本基金以股票类资产为主要投资工具，通过精选个股获取资产的长期增值；通过适度的大类资产配置来降低组合的风险。本基金将“自上而下”

	的趋势投资和“自下而上”的个股选择相结合。投资决策的重点在于寻找具有巨大发展潜力的趋势，发现并投资于有能力把握趋势并在竞争中处于优势的公司。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*60%+上证国债指数收益率*40%
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。
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

转型前：

基金简称	华泰柏瑞中国军工
交易代码	001524
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 29 日
报告期末基金份额总额	1,001,639,894.43 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极挖掘军工主题相关行业所蕴含的投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票类资产为主要投资工具，通过精选个股获取资产的长期增值；通过适度的大类资产配置来降低组合的风险。本基金将“自上而下”的趋势投资和“自下而上”的个股选择相结合。投资决策的重点在于寻找具有巨大发展潜力的趋势，发现并投资于有能力把握趋势并在竞争中处于优势的公司。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中证军工指数收益率×80%+银行人民币活期存款利率（税后）×20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期收益和风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016 年 9 月 2 日 — 2016 年 9 月 30 日）
--------	---------------------------------------

1. 本期已实现收益	3,833,496.08
2. 本期利润	3,246,297.05
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0032
4. 期末基金资产净值	1,018,310,568.26
5. 期末基金份额净值	1.0167

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。

### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月1日—2016年9月1日）
1. 本期已实现收益	6,309,124.64
2. 本期利润	7,747,972.57
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0077
4. 期末基金资产净值	1,015,159,795.88
5. 期末基金份额净值	1.0135

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。

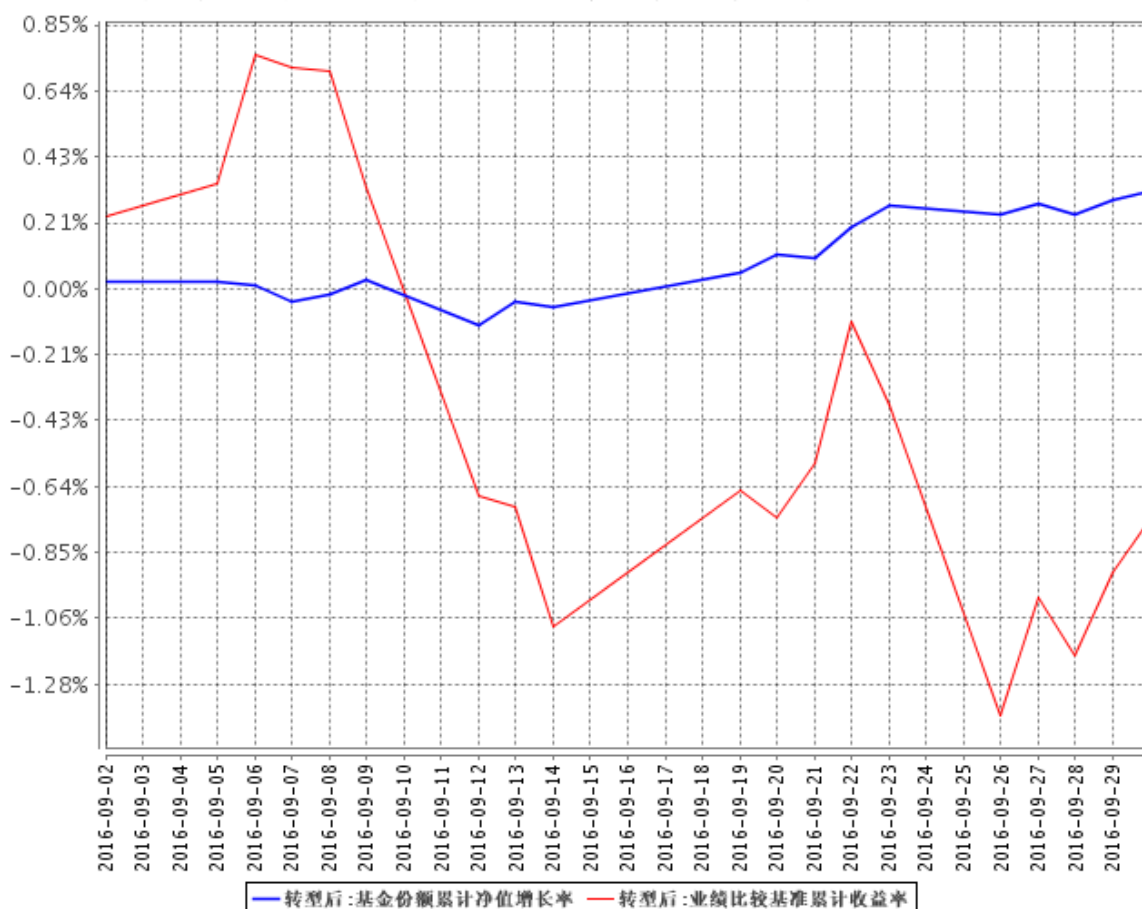
### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 3.2.1 本报告期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	净值增长率 ①	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
2016年 9月2日— 2016年 9月30日	0.32%	0.06%	-0.74%	0.43%	1.06%	-0.37%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



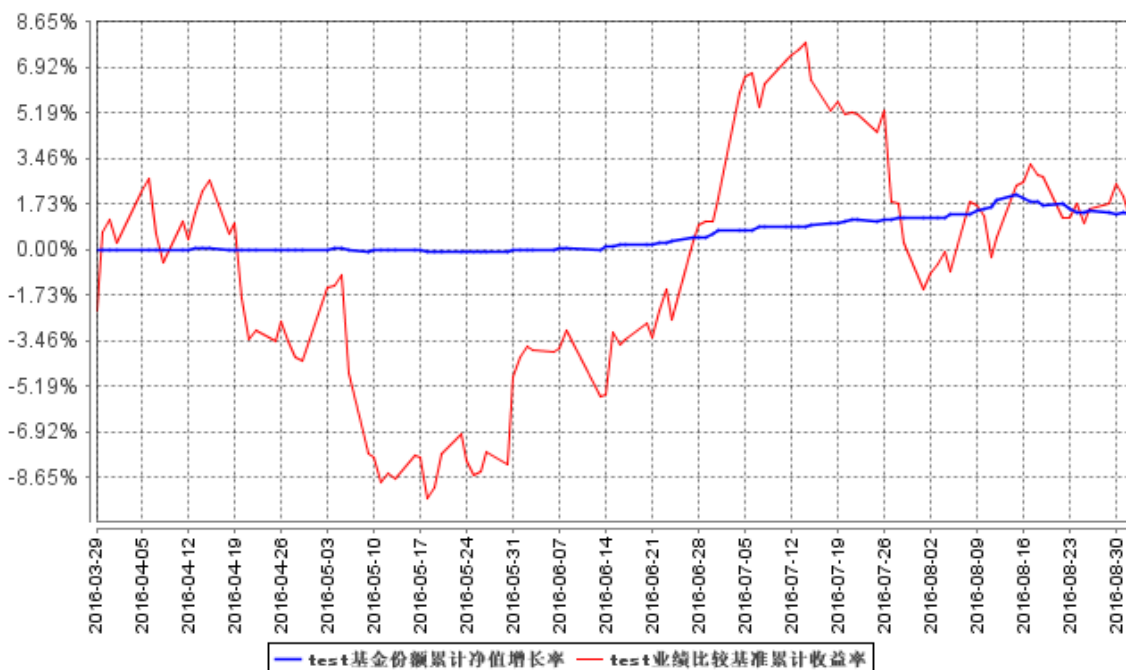
注：图示日期为 2016 年 9 月 2 日至 2016 年 9 月 30 日。本基金自 2016 年 9 月 2 日，由“华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金”转型为“华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金”。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

### 3.2.1 本报告期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	净值增长率 ①	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
2016 年 7 月 1 日 — 2016 年 9 月 1 日	0.77%	0.08%	0.09%	1.17%	0.68%	-1.09%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：1、图示日期为 2016 年 3 月 29 日至 2016 年 9 月 1 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，截至报告日本基金处于建仓期。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2016 年 3 月 29 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

					<p>柏瑞价值增长混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 4 月至 2016 年 8 月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 月起任华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 5 月至 2016 年 8 月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。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。</p> <p>2016 年 3 月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2016 年 9 月起任华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
李灿	本基金的基金经理	2016 年 3 月 29 日	-	6	<p>北京大学西方经济学硕士。2010 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理。</p> <p>2015 年 6 月至 2016 年 8 月任华泰柏瑞盛世中国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 月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合</p>

					型证券投资基金的基金经理。
杨景涵	本基金的基金经理	2016 年 8 月 17 日	-	11	<p>中山大学经济学硕士。特许金融分析师（CFA），金融风险经理师（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。2014 年 6 月至 2015 年 4 月任研究部总监助理。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 月起任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月起任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2016 年 3 月 29 日	-	13	经济学硕士。2003 年 9 月至



					<p>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 月至 2016 年 8 月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，2015 年 5 月至 2016 年 8 月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。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 月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月起任华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
李灿	本基金的基金经理	2016 年 3 月 29 日	-	6	<p>北京大学西方经济学硕士。2010 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理。</p>

					<p>2015 年 6 月至 2016 年 8 月任华泰柏瑞盛世中国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 月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
杨景涵	本基金的基金经理	2016 年 8 月 17 日	-	11	<p>中山大学经济学硕士。特许金融分析师（CFA），金融风险管理者（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。2014 年 6 月至 2015 年 4 月任研究部总监助理。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 月起任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月起任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金</p>

					和华泰柏瑞多策略灵活配置混合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合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，二级市场整体运行平稳，沪深 300 全收益指数上涨 4.49%，但创业板指数小幅下跌 3.5%，显示出风格逐步倾向于价值回归的态势。相比二季度，交易保持了一定的活跃度，各种题材反复炒作。新股上市后涨幅有一定回落，但整体保持平稳。宏观经济运行平稳，房地产市场销售火爆，引发了政策转向。但金融市场的货币政策仍然维持宽松，财政政策积极，以 PPP 为主要稳增长的手段。资金的配置需求仍然十分活跃。展望四季度，随着政策对房地产市场的监管越来越严厉，全年稳增长目标基本完成，上市公司财务数据的逐步披露，资本市场预计会面临一些压力。精选回报基金将尽可能的在契约规定的范围内，运用多种盈利手段，合理寻求稳健可靠的投资机会，尽可能提升基金净值，保护投资者利益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

转型前一日（2016 年 9 月 1 日），本基金份额净值为 1.0135 元，2016 年 7 月 1 日至

2016 年 9 月 1 日期间，基金净值上涨 0.77%，同期本基金的业绩比较基准上涨 0.09%。

本报告期末，本基金份额净值为 1.0167 元，2016 年 9 月 2 日至 2016 年 9 月 30 日期间，基金净值上涨 0.32%，同期本基金的业绩比较基准下跌 0.74%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

转型后：

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	62,770,143.90	5.90
	其中：股票	62,770,143.90	5.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	969,114,000.00	91.05
	其中：债券	969,114,000.00	91.05
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,762,862.37	1.76
8	其他资产	13,722,621.94	1.29
9	合计	1,064,369,628.21	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	12,211,319.68	1.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,194,510.48	0.61

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	-	-
J	金融业	44,364,313.74	4.36
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	62,770,143.90	6.16

### 5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末投资沪港通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	1,400,000	12,698,000.00	1.25
2	601288	农业银行	2,500,000	7,825,000.00	0.77
3	601169	北京银行	800,000	7,280,000.00	0.71
4	000895	双汇发展	300,000	7,077,000.00	0.69
5	601668	中国建筑	1,000,000	6,170,000.00	0.61
6	002142	宁波银行	380,000	5,947,000.00	0.58
7	601939	建设银行	1,100,000	5,698,000.00	0.56
8	000488	晨鸣纸业	559,904	5,134,319.68	0.50
9	600015	华夏银行	480,000	4,824,000.00	0.47
10	600908	无锡银行	8,902	92,313.74	0.01

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	50,050,000.00	4.92
2	央行票据	-	-

3	金融债券	668,239,000.00	65.62
	其中：政策性金融债	668,239,000.00	65.62
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	250,825,000.00	24.63
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	969,114,000.00	95.17

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	160208	16 国开 08	1,400,000	139,874,000.00	13.74
2	150218	15 国开 18	1,000,000	104,390,000.00	10.25
3	150209	15 国开 09	800,000	85,064,000.00	8.35
4	160408	16 农发 08	700,000	71,106,000.00	6.98
5	160303	16 进出 03	600,000	60,780,000.00	5.97

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 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。

#### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	40,090.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,682,531.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,722,621.94

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告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。

转型前:

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	65,168,264.62	6.12
	其中：股票	65,168,264.62	5.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,013,983,000.00	86.45
	其中：债券	1,013,983,000.00	86.45
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	79,493,105.94	6.78
8	其他资产	14,334,415.55	1.22
9	合计	1,172,978,786.11	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	12,590,793.25	1.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,363,349.26	0.63
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	174,024.29	0.02
J	金融业	45,851,682.82	4.52
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	188,415.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	65,168,264.62	6.42

### 5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末投资沪港通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	1,400,000	13,230,000.00	1.30
2	601288	农业银行	2,500,000	7,950,000.00	0.78
3	000895	双汇发展	300,000	7,257,000.00	0.71
4	601169	北京银行	800,000	7,192,000.00	0.71
5	601668	中国建筑	1,000,000	6,340,000.00	0.62
6	002142	宁波银行	380,000	6,281,400.00	0.62
7	601939	建设银行	1,100,000	5,830,000.00	0.57
8	600015	华夏银行	480,000	5,025,600.00	0.50
9	000488	晨鸣纸业	559,904	4,932,754.24	0.49
10	601997	贵阳银行	16,167	301,029.54	0.03

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	50,060,000.00	4.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	642,970,000.00	63.34
	其中：政策性金融债	642,970,000.00	63.34
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	320,953,000.00	31.62
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,013,983,000.00	99.88

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	160208	16 国开 08	3,200,000	319,424,000.00	31.47
2	160408	16 农发 08	700,000	70,805,000.00	6.97
3	160303	16 进出 03	600,000	60,486,000.00	5.96
4	160205	16 国开 05	500,000	52,295,000.00	5.15
5	011699135	16 同方 SCP001	500,000	50,200,000.00	4.95

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 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。

#### 5.9.2 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。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。

#### 5.10.2 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。

#### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	14,388.73
2	应收证券清算款	546,579.84
3	应收股利	-
4	应收利息	13,773,446.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,334,415.55

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告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。

## §6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（ 2016 年 9 月 2 日 ）基金份额总额	1,001,639,894.43
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	94,087.84

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,001,545,806.59

## §7 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

基金合同生效日（2016年3月29日）基金份额总额	1,001,514,242.44
报告期期初基金份额总额	1,001,824,134.15
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	184,239.72
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,001,639,894.43

## §8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

注：无。

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

注：无。

## §9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

### 9.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

注：无。

### 9.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

注：无。

## §10 备查文件目录

### 10.1 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

### 10.2 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

### 10.3 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 10 月 25 日