

# 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 29 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2017年3月28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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.10 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	14
4.11 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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	44
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	45

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	45
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	48
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	54
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	54
8.8 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.....	54
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细.....	54
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	54
8.11 投资组合报告附注.....	54
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
9.3 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.....	55
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	56
11.2 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.....	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
11.4 基金投资策略的改变.....	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
11.8 其他重大事件.....	59
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>60</b>
13.1 备查文件目录.....	60
13.2 存放地点.....	60
13.3 查阅方式.....	60

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞亚洲领导企业混合(QDII)
基金主代码	460010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月2日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	31,588,435.25份

### 2.2 基金产品说明

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

### 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 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
邮政编码	200135	100818
法定代表人	贾波	田国立

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

## 2.5 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金年度报告备置地点	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

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-1,730,774.27	-27,490,159.29	3,951,710.05
本期利润	-668,304.55	-30,014,262.12	312,468.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0208	-0.4882	0.0076
本期加权平均净值利润率	-2.74%	-53.45%	0.89%
本期基金份额净值增长率	-2.65%	-7.59%	0.82%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配利润	-13,577,099.26	-12,153,050.05	-4,347,331.08
期末可供分配基金份额利润	-0.4298	-0.3760	-0.1443
期末基金资产净值	24,308,004.18	25,556,957.61	25,789,833.80
期末基金份额净值	0.770	0.791	0.856
3.1.3 累计期末指标	2016年末	2015年末	2014年末
基金份额累计净值增长率	-23.00%	-20.90%	-14.40%

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。

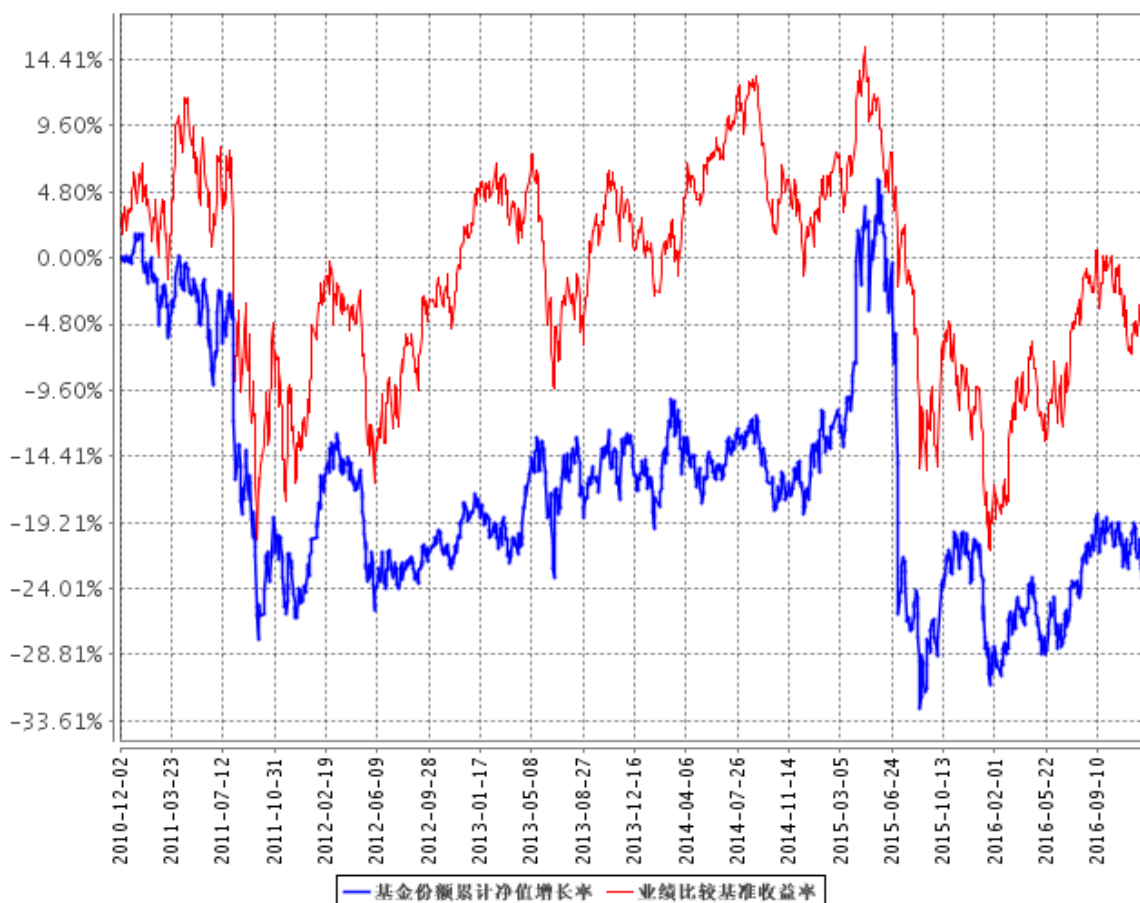
#### 3.2 基金净值表现

##### 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
过去三个月	-3.87%	0.79%	-5.37%	0.77%	1.50%	0.02%
过去六个月	4.48%	0.84%	2.98%	0.80%	1.50%	0.04%
过去一年	-2.65%	0.96%	3.74%	1.00%	-6.39%	-0.04%
过去三年	-9.31%	1.10%	-8.86%	0.92%	-0.45%	0.18%
过去五年	2.53%	1.00%	8.63%	0.91%	-6.10%	0.09%
自基金合同生效起至今	-23.00%	1.02%	-6.23%	1.03%	-16.77%	-0.01%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



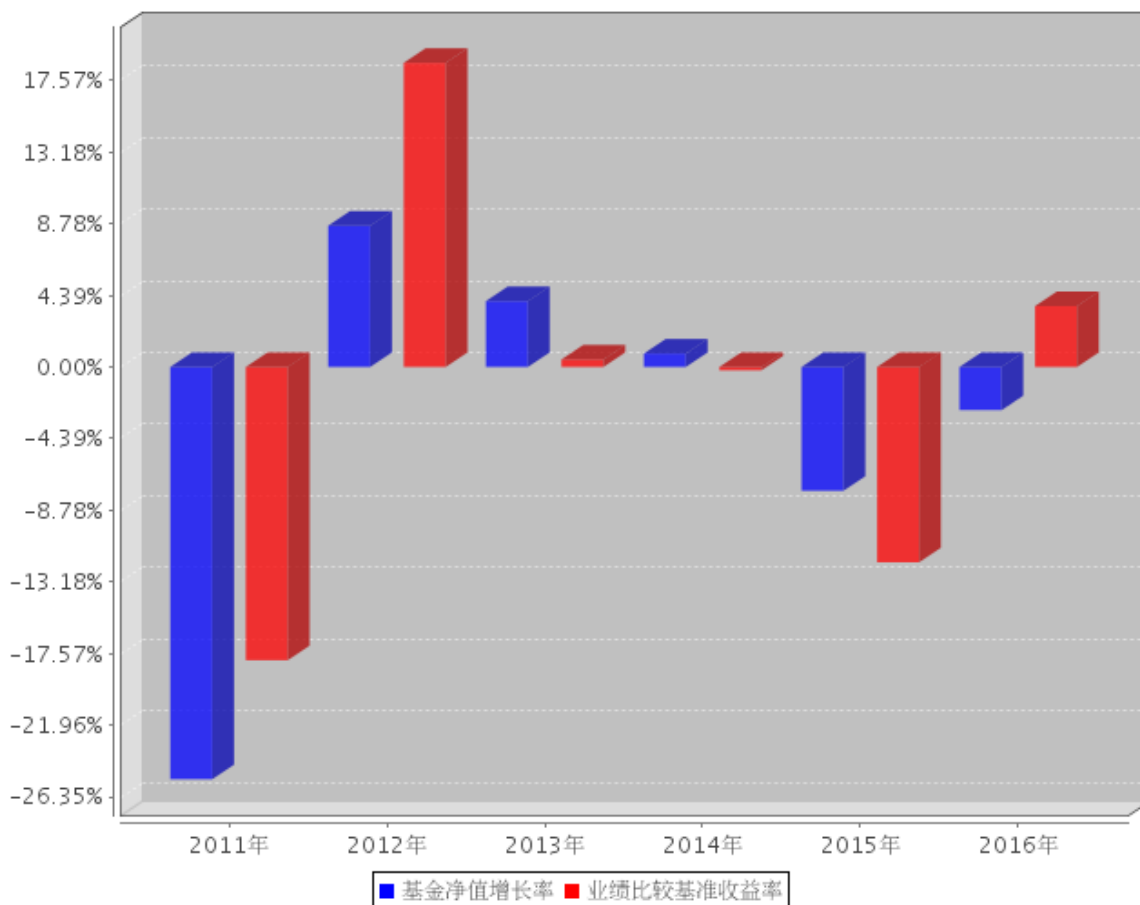
注：1、图示日期为 2010 年 12 月 2 日至 2016 年 12 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（三）投资范围中基金投资组合比例限制中规定的各项比例，股票占基金资产的比例不低于 60%；债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例不高于 40%，其中，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金不低于 80%的权益类资产将投资于亚洲领导企业。



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## §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、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金。截至 2016 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 974.88 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄明仁	本基金的基金经理、海外投资部总监	2010 年 12 月 2 日	-	16	黄明仁先生, 美国西雅图华盛顿大学财务金融专业管理学硕士, 具有 16 年以上境外证券投资管理经验。2004-2006 年, 任台湾建弘投资信托股份有限

					公司，建弘泛太平洋基金基金经理；2006-2008 年中，加入英国保诚投资信托股份有限公司，任保诚印度基金基金经理。2008 年加入本公司，2010 年 12 月起任华泰柏瑞亚洲领导企业混合基金基金经理。2015 年 1 月起任海外投资部总监。
--	--	--	--	--	--

## 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

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

## 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 公平交易制度和控制方法

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，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。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，对于场内交易启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

### 4.4.2 公平交易制度的执行情况

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，因此不构成利益输送。造成少量显著交易价差的原因来自两方面：一是报告期内股票市场的波动幅度较大，为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件；二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异，对证券买卖时点的把握也不同，导致股票买卖存在价差。

#### 4.4.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期公司旗下基金所管理的投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年全年亚洲股市呈现大幅波动。前两个月，在人民币大幅贬值的影响下，亚洲主要股指大幅下挫，港股更是创出了自 2008 以来的最低市场估值，全市场市盈率仅 8 倍，之后市场止跌企稳。而 6 月份的英国脱欧的公投，又引发了市场大幅震荡，但出乎意料的是，经过三天，市场预期又突然反转，不仅收复了之前的失地，在之后的很短时间内更是创出了 2016 年以来的新高，而年底特朗普意外当选美国总统，以及年底美联储的加息，使得市场波澜不惊，在这么一个急剧动荡的市场，市场方向极度不明，对投资产生了很大的困扰和难度。上半年我们由于价值股的配置不够，因此落后于指数，而下半年我们预判到了英国脱欧发生的概率较大，因为之前大幅降低了仓位，挽回了不少损失，但在市场大幅反弹上行过程中，错失了一些最低点买入机会。而美联储在年底预期中的加息，给市场了一个较为不错获利回吐的借口，而我们也顺势而为，降低了股票仓位，卖掉了一些今

年大幅获利的股票。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.770 元，累计净值为 0.770 元，本报告期内基金份额净值增长率为-2.65%，同期业绩比较基准收益率为 3.74%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，美联储加息时点仍是全球市场关注的焦点，中国及美国的经济复苏的持续性也还有待观察，而欧洲各国的选举更是各种黑天鹅的发源地。香港市场在深港通开通后，逐渐成为中国资金的追逐点，加上自身估值较低，今年或许会有不错的表现。

#### 4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

##### (1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

##### (2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

##### (3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

#### (4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.8 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。

#### 4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多4次；每次基金收益分配比例不低于该次可分配收益的10%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本期末，基金可供分配利润为-13,577,099.26，报告期内基金未实施收益分配。

#### 4.10 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞亚洲领导企业混

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

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

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

## 5.3 托管人对本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 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21063 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞亚洲领导混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金（以下简称“华泰柏瑞亚洲领导企业基金”）的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是华泰柏瑞亚洲领导企业基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：  (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作

	编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述华泰柏瑞亚洲领导企业基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了华泰柏瑞亚洲领导企业基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2017 年 3 月 31 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体： 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	6,255,622.26	4,741,099.98
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-



交易性金融资产	7.4.7.2	18,331,246.45	21,123,665.71
其中：股票投资		17,469,940.66	20,836,061.05
基金投资		861,305.79	287,604.66
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	141.36	111.54
应收股利		7,460.71	10,499.76
应收申购款		9,941.65	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		24,604,412.43	25,875,376.99
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,687.42	15,441.09
应付管理人报酬		37,352.48	39,838.94
应付托管费		7,262.95	7,746.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	249,105.40	255,392.87
负债合计		296,408.25	318,419.38
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	31,588,435.25	32,320,387.76
未分配利润	7.4.7.10	-7,280,431.07	-6,763,430.15
所有者权益合计		24,308,004.18	25,556,957.61
负债和所有者权益总计		24,604,412.43	25,875,376.99

注：1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.770 元，基金份额总额 31,588,435.25 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		480,813.91	- 27,685,837.24
1. 利息收入		5,986.26	24,552.58
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,986.26	24,552.58
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）		-764,904.45	- 25,186,120.18
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,349,436.91	- 24,714,743.22
基金投资收益	7.4.7.13	153,256.03	-2,230,965.44
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	431,276.43	1,759,588.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,062,469.72	-2,524,102.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		173,995.36	-127,801.42
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	3,267.02	127,634.61
<b>减：二、费用</b>		1,149,118.46	2,328,424.88
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	438,388.26	986,677.50
2. 托管费	7.4.10.2.2	85,242.05	191,853.99
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	372,432.42	877,606.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	253,055.73	272,287.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-668,304.55	- 30,014,262.12
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-668,304.55	-30,014,262.12
-------------------	--	-------------	----------------

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	32,320,387.76	-6,763,430.15	25,556,957.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-668,304.55	-668,304.55
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）	-731,952.51	151,303.63	-580,648.88
其中：1. 基金申购款	4,172,413.76	-995,151.38	3,177,262.38
2. 基金赎回款	-4,904,366.27	1,146,455.01	-3,757,911.26
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）	31,588,435.25	-7,280,431.07	24,308,004.18
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	30,137,164.88	-4,347,331.08	25,789,833.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-30,014,262.12	-30,014,262.12
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）	2,183,222.88	27,598,163.05	29,781,385.93
其中：1. 基金申购款	143,746,000.01	1,539,273.93	145,285,273.94

2. 基金赎回款	-141,562,777.13	26,058,889.12	-115,503,888.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	32,320,387.76	-6,763,430.15	25,556,957.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金（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[2010]第1357号《关于核准华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币290,510,740.98元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第373号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金基金合同》于2010年12月2日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为290,565,328.80份基金份额，其中认购资金利息折合54,587.82份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为权益类品种，包括普通股、优先股、全球及美国存托凭证、股票型基金等；固定收益类品种，包括政府债券、公司债券、可转换债券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的固定收益类证券；银行存款、回购协议、短期政府债券与货币市场基金等货币市场工具；经中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品；以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票的比例为基金资产的60%-100%，债券、货币市场工具、现金及中国证监

会允许基金投资的其他证券品种为基金净资产的 0%-40%，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金不低于 80%的权益类资产投资于亚洲领导企业。本基金的业绩比较基准为：MSCI 亚太综合指数(不含日本)。

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 2017 年 3 月 29 日批准报出。

## 7.4.2 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》、《华泰柏瑞亚洲领导企业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。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资(包括股票存托凭证)和基金投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和基金投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资和基金投资在持有期间应取得的现金股利及基金分红收益扣除股票和基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为



人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### **7.4.4.13 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

无。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 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。

#### **7.4.5.2 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。

#### **7.4.5.3 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。

### **7.4.6 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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	6,255,622.26	4,741,099.98
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	6,255,622.26	4,741,099.98

注：于2016年12月31日，活期存款包括人民币活期存款594,479.09元，港币活期存款306,180.10元(折合人民币273,881.16元)、澳币活期存款7,557.59元(折合人民币37,906.60元)、台币活期存款3,350,742.00元(折合人民币719,032.90元)和美元活期存款667,481.98元(折合人民币4,630,322.50元)。(于2015年12月31日，活期存款包括人民币活期存款477,282.26元，港币活期存款2,118,898.10元(折合人民币1,775,170.45元)、澳币活期存款2,197.25元(折合人民币10,387.72元)、台币活期存款2,565,764.00元(折合人民币507,528.76元)和美元活期存款303,488.17元(折合人民币1,970,730.79元)

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	16,447,211.21	17,469,940.66	1,022,729.45
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	889,992.06	861,305.79	-28,686.27

其他	-	-	-
合计	17,337,203.27	18,331,246.45	994,043.18
项目	上年度末		
	2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	20,909,908.73	20,836,061.05	-73,847.68
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	282,183.52	287,604.66	5,421.14
其他	-	-	-
合计	21,192,092.25	21,123,665.71	-68,426.54

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	141.36	111.54
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	-	-
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	-	-
合计	141.36	111.54

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金报告期末与上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

注：无。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	9.48	28.87
预提费用	249,095.92	255,364.00
合计	249,105.40	255,392.87

#### 7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,320,387.76	32,320,387.76
本期申购	4,172,413.76	4,172,413.76
本期赎回（以“-”号填列）	-4,904,366.27	-4,904,366.27
- 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	31,588,435.25	31,588,435.25

#### 7.4.7.10 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	-12,153,050.05	5,389,619.90	-6,763,430.15
本期利润	-1,730,774.27	1,062,469.72	-668,304.55
本期基金份额交易产生的变动数	306,725.06	-155,421.43	151,303.63
其中：基金申购款	-1,796,269.66	801,118.28	-995,151.38

基金赎回款	2,102,994.72	-956,539.71	1,146,455.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,577,099.26	6,296,668.19	-7,280,431.07

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	5,985.71	19,824.62
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	-	-
其他	0.55	4,727.96
合计	5,986.26	24,552.58

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	68,593,331.90	143,365,123.21
减：卖出股票成本总额	69,942,768.81	168,079,866.43
买卖股票差价收入	-1,349,436.91	-24,714,743.22

#### 7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	2,326,073.66	8,973,509.52
减：卖出/赎回基金成本总额	2,172,817.63	11,204,474.96
基金投资收益	153,256.03	-2,230,965.44

**7.4.7.14 债券投资收益**

**7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

注：无。

**7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：无。

**7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益**

注：无。

**7.4.7.15 贵金属投资收益**

**7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

**7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**7.4.7.16 衍生工具收益**

**7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**7.4.7.16.2 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 12月31日	上年度可比期间收益金 额 2015年1月1日至 2015年12月31日

权证投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-	-

注：无。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
股票投资产生的股利收益	431,276.43	1,659,837.47
基金投资产生的股利收益	-	99,751.01
合计	431,276.43	1,759,588.48

#### 7.4.7.18 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
1. 交易性金融资产	1,062,469.72	-2,524,102.83
——股票投资	1,096,577.13	-2,529,523.97
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-34,107.41	5,421.14
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	1,062,469.72	-2,524,102.83

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
基金赎回费收入	3,267.02	127,634.61
合计	3,267.02	127,634.61

### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
交易所市场交易费用	372,432.42	877,606.02
银行间市场交易费用	-	-
合计	372,432.42	877,606.02

### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
审计费用	72,000.00	80,000.00
信息披露费	150,000.00	150,000.00
银行汇划费	5,128.49	23,511.36
税务顾问费	25,927.24	18,776.01
合计	253,055.73	272,287.37

### 7.4.7.22 分部报告

无。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，2017年7月1日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在



2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

### 7.4.9 关联方关系

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国银行(香港)有限公司（“中银香港”）	境外资产托管人
PineBridge Investment LLC（“PB Investment”）	基金管理人的股东
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰金融控股(香港)有限公司	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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
华泰金融控股(香港)有限公司	0.00	0.00%	9,079,244.46	2.74%

##### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

### 7.4.10.1.4 基金交易

注：无。

### 7.4.10.1.5 权证交易

注：无。

### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31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
华泰金融控股	0.00	0.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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
华泰金融控股	7,263.38	1.39%	0.00	0.00%

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
	当期发生的基金应支付的管理费	438,388.26
其中：支付销售机构的客户维护费	153,131.64	206,855.50

注：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 1.8%的费率计提，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× 1.8% / 当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	85,242.05	191,853.99

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.35%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 × 0.35% / 当年天数。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金合同生效日（2010年12月2日）持有的基金份额	5,001,200.00	5,001,200.00
期初持有的基金份额	5,001,200.00	5,001,200.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	5,001,200.00	5,001,200.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.8324%	15.4738%

注：基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司在 2010 年认购本基金的交易委托华泰证券办理，投资本基金的费用均参照本基金公布的费率收取。

#### 7.4.10.4.2 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：本报告期间，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

**7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	594,648.91	5,985.71	477,439.15
中银香港	4,941,940.44	-	3,756,132.07	-

注：本基金由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管的银行存款按适用利率或约定利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：无。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

**7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

注：无。

**7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额：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
591 HK	CHINA HIGH PRECISION AUTOMAT	-	【停牌】 (2012-12-04)	HKD 1.22	-	-	504,000	1,157,443.50	HKD 614,880.00	-
005930 KS	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	-	【停牌】 (2016-12-29)	KRW 1,802,000.00	-	-	72	589,631.14	KRW 129,744,000.00	-

注：1、本基金截至2016年12月31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。

### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

注：无。

#### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

注：无。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为区域性混合型证券投资基金，由于投资国家与地区市场的分散，长期而言风险应低于投资单一市场的混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及基金投资等。本基金通过区域化分散投资，有效降低投资组合系统性风险，追求基金资产长期稳健增值。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”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。

### 7.4.13.2 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、境外次托管行中银香港以及其他信誉良好的外资银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的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12月31日，本基金未持有信用类债券(2015年12月31日：同)。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

### 7.4.13.3 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%。本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 10%，持有货币市场基金可以不受上述限制。本基金所持所有证券均在证券交易所上市，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，其余均能以合理价格适时变现。

于 2016 年 12 月 31 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。

### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	594,479.09	-	-	-	-	5,661,143.17	6,255,622.26

交易性金融资产	-	-	-	-	-	-18,331,246.45	18,331,246.45
应收利息	-	-	-	-	-	141.36	141.36
应收股利	-	-	-	-	-	7,460.71	7,460.71
应收申购款	-	-	-	-	-	9,941.65	9,941.65
资产总计	594,479.09	-	-	-	-	-24,009,933.34	24,604,412.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,687.42	2,687.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	37,352.48	37,352.48
应付托管费	-	-	-	-	-	7,262.95	7,262.95
其他负债	-	-	-	-	-	249,105.40	249,105.40
负债总计	-	-	-	-	-	296,408.25	296,408.25
利率敏感度缺口	594,479.09	-	-	-	-	-23,713,525.09	24,308,004.18
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	477,282.26	-	-	-	-	-4,263,817.72	4,741,099.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-21,123,665.71	21,123,665.71
应收利息	-	-	-	-	-	111.54	111.54
应收股利	-	-	-	-	-	10,499.76	10,499.76
资产总计	477,282.26	-	-	-	-	-25,398,094.73	25,875,376.99
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	15,441.09	15,441.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	39,838.94	39,838.94
应付托管费	-	-	-	-	-	7,746.48	7,746.48
其他负债	-	-	-	-	-	255,392.87	255,392.87
负债总计	-	-	-	-	-	318,419.38	318,419.38
利率敏感度缺口	477,282.26	-	-	-	-	-25,079,675.35	25,556,957.61

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2016年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2015年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。



7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	4,630,322.51	273,881.16	756,939.50	5,661,143.17
交易性金融资产	-	13,699,090.58	4,632,155.87	18,331,246.45
应收股利	-	-	7,460.71	7,460.71
资产合计	4,630,322.51	13,972,971.74	5,396,556.08	23,999,850.33
以外币计价的负债				
其它负债	27,095.92	-	-	27,095.92
负债合计	27,095.92	-	-	27,095.92
资产负债表外汇风险敞口净额	4,603,226.59	13,972,971.74	5,396,556.08	23,972,754.41
项目	上年度末 2015年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	1,970,730.79	1,775,170.45	517,916.48	4,263,817.72
交易性金融资产	591,193.38	15,531,481.96	5,000,990.37	21,123,665.71
应收股利	-	-	10,499.76	10,499.76
资产合计	2,561,924.17	17,306,652.41	5,529,406.61	25,397,983.19
以外币计价的负债				
其它负债	25,364.00	-	-	25,364.00
负债合计	25,364.00	-	-	25,364.00
资产负债表外汇风险敞口净额	2,536,560.17	17,306,652.41	5,529,406.61	25,372,619.19

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	1,200,000.00	1,270,000.00
	所有外币相对人民币贬值5%	-1,200,000.00	-1,270,000.00

### 7.4.13.4.3 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的股票，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市场价格风险。股票资产占基金资产的 60%-100%，债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 0%-40%。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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	17,469,940.66	71.87	20,836,061.05	81.53
交易性金融资产-基金投资	861,305.79	3.54	287,604.66	1.13
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	18,331,246.45	75.41	21,123,665.71	82.65

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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 12 月 31 日)	上年度末(2015 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	950,000.00	1,270,000.00

	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-950,000.00	-1,270,000.00
--	--------------------------	-------------	---------------

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 17,880,413 元，属于第二层次的余额为 450,833.45 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 20,608,531.54 元，第二层次 515,134.17 元，无三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。(2015 年 12 月

31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	17,469,940.66	71.00
	其中：普通股	17,469,940.66	71.00
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	861,305.79	3.50
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,255,622.26	25.42
8	其他各项资产	17,543.72	0.07
9	合计	24,604,412.43	100.00

### 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币

元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
--------	------	---------------

香港	12,837,784.79	52.81
澳大利亚	656,527.84	2.70
印尼	970,820.90	3.99
韩国	746,900.01	3.07
台湾	2,257,907.12	9.29
合计	17,469,940.66	71.87

### 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币

元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
能源	462,461.67	1.90
原材料	1,178,868.01	4.85
工业	721,583.33	2.97
非日常生活消费品	2,591,968.62	10.66
日常消费品	1,907,462.32	7.85
医疗保健	1,373,752.67	5.65
金融	1,723,318.25	7.09
信息技术	6,775,238.57	27.87
电信业务	735,287.22	3.02
合计	17,469,940.66	71.87

注：本公司采用的行业分类标准为全球行业分类标准 GICS。

### 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币

元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港交易所	CH	11,200	1,900,511.73	7.82
2	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	香港交易所	CH	112,000	1,230,273.27	5.06
3	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育	2020 HK	香港交易所	CH	53,000	1,097,519.04	4.52
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台积电	2330 TT	台湾亚交易所	CH	28,000	1,090,542.10	4.49
5	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	瑞声科技	2018 HK	香港交易所	CH	17,000	1,071,309.90	4.41
6	MATAHARI	太阳百货	LPPF IJ	印尼交	Indonesia	124,200	970,820.90	3.99

	DEPARTMENT STORE TB	股份有限 公司		易所				
7	FAIRWOOD HOLDINGS LTD	FAIRWOOD HOLD	52 HK	香港交 易所	CH	37,000	936,641.42	3.85
8	MACAUTO INDUSTRIAL CO LTD	皇田工业	9951 TT	台湾亚 交易所	CH	19,000	782,821.25	3.22
9	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	三星电子 有限公司	005930 KS	韩国交 易所	KS	72	746,900.01	3.07
10	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香港交 易所	CH	10,000	735,287.22	3.02
11	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广汽集团	2238 HK	香港交 易所	CH	86,000	721,583.33	2.97
12	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	新华保险	1336 HK	香港交 易所	CH	20,700	659,182.31	2.71
13	ST BARBARA LTD	St Barbara 有限公司	SBM AU	澳大利 亚交易 所	AU	64,164	656,527.84	2.70
14	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学 科技	2382 HK	香港交 易所	CH	21,000	637,740.90	2.62
15	CHINA HIGH PRECISION AUTOMAT	中国高精 密	591 HK	香港交 易所	CH	504,000	550,016.31	2.26
16	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	理文造纸	2314 HK	香港交 易所	CH	97,000	522,340.17	2.15
17	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国石化	386 HK	香港交 易所	CH	94,000	462,461.67	1.90
18	BYD CO LTD-H	比亚迪	1211 HK	香港交 易所	CH	11,500	420,218.44	1.73
19	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航 信息网络	696 HK	香港交 易所	CH	27,000	393,673.85	1.62
20	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	可成科技	2474 TT	台湾亚 交易所	CH	8,000	384,543.77	1.58
21	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交易 所	388 HK	香港交 易所	CH	2,100	344,135.89	1.42
22	WYNN MACAU	永利澳门	1128 HK	香港交	CH	26,400	291,409.89	1.20

	LTD			易所				
23	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安	2318 HK	香港交易所	CH	7,000	242,948.92	1.00
24	CHINA VANKE CO LTD-H	万科	2202 HK	香港交易所	CH	15,300	242,242.25	1.00
25	AIA GROUP LTD	友邦保险	1299 HK	香港交易所	CH	6,000	234,808.88	0.97
26	GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARM-H	白云山	874 HK	香港交易所	CH	8,000	143,479.40	0.59

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币

元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	WYNN MACAU LTD	1128 HK	1,474,734.90	5.77
2	TUNG THIH ELECTRONIC CO LTD	3552 TT	1,414,662.28	5.54
3	COWELL E HOLDINGS INC	1415 HK	1,320,696.52	5.17
4	CAR INC	699 HK	1,315,784.62	5.15
5	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	9910 TT	1,291,731.16	5.05
6	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	2020 HK	1,232,864.78	4.82
7	BYD CO LTD-H	1211 HK	1,192,249.22	4.67
8	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 HK	1,177,198.05	4.61
9	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	285 HK	1,171,778.58	4.58
10	GLOBALWAFERS CO LTD	6488 TT	1,143,227.65	4.47
11	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	2018 HK	1,142,776.84	4.47
12	ECLAT TEXTILE	1476 TT	1,114,130.03	4.36

	COMPANY LTD			
13	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	489 HK	1,099,678.53	4.30
14	MERIDA INDUSTRY CO LTD	9914 TT	1,065,155.83	4.17
15	ADVANCED CERAMIC X CORP	3152 TT	1,047,141.87	4.10
16	MEDIATEK INC	2454 TT	1,035,841.70	4.05
17	FAIRWOOD HOLDINGS LTD	52 HK	1,021,900.18	4.00
18	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	999,822.71	3.91
19	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2330 TT	975,450.35	3.82
20	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	967,481.32	3.79
21	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	1880 HK	958,036.00	3.75
22	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	LPPF IJ	952,755.83	3.73
23	SINOTRANS LIMITED-H	598 HK	934,431.77	3.66
24	MIRLE AUTOMATION CORP	2464 TT	929,429.56	3.64
25	ST BARBARA LTD	SBM AU	894,408.08	3.50
26	HANSSEM CO LTD	009240 KS	834,485.83	3.27
27	LEES PHARMACEUTICAL HLDGS	950 HK	751,375.55	2.94
28	CHINA MOBILE LTD	941 HK	734,092.51	2.87
29	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	731,636.08	2.86
30	CHINA AGRI- INDUSTRIES HLDGS	606 HK	728,480.73	2.85
31	HOTA INDUSTRIAL MFG CO LTD	1536 TT	720,791.04	2.82
32	BLACKMORES LTD	BKL AU	714,511.51	2.80



33	MACAUTO INDUSTRIAL CO LTD	9951 TT	712,507.98	2.79
34	GOURMET MASTER CO LTD	2723 TT	707,968.93	2.77
35	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD- H	696 HK	696,530.32	2.73
36	REGIS RESOURCES LTD	RRL AU	674,605.29	2.64
37	MELCO INTERNATIONAL DEVELOP.	200 HK	667,384.68	2.61
38	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	460 HK	661,396.84	2.59
39	PAX GLOBAL TECHNOLOGY LTD	327 HK	637,411.62	2.49
40	CHINA GAS HOLDINGS LTD	384 HK	635,350.97	2.49
41	TTET UNION CORPORATION	1232 TT	633,719.86	2.48
42	CHINA SINGYES SOLAR TECH	750 HK	619,350.88	2.42
43	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	3898 HK	611,899.92	2.39
44	FLEXIUM INTERCONNECT INC	6269 TT	609,967.77	2.39
45	SHENWAN HONGYUAN HK LTD	218 HK	603,812.30	2.36
46	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	005930 KS	589,631.14	2.31
47	HSBC HOLDINGS PLC	5 HK	586,879.10	2.30
48	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	573,972.36	2.25
49	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	PTTEP/F TB	568,724.51	2.23
50	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1055 HK	550,605.76	2.15
51	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	537,101.04	2.10

52	PEOPLES INSURANCE CO GROU-H	1339 HK	529,785.29	2.07
53	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	322 HK	523,796.55	2.05
54	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	1788 HK	520,288.27	2.04
55	POU SHENG INTL HOLDINGS LTD	3813 HK	515,046.52	2.02
56	SINMAG EQUIPMENT CORP	1580 TT	513,276.46	2.01

注：不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币

元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金 资产净值比 例(%)
1	LARGAN PRECISION CO LTD	3008 TT	1,708,107.13	6.68
2	TUNG THIH ELECTRONIC CO LTD	3552 TT	1,603,219.31	6.27
3	MERIDA INDUSTRY CO LTD	9914 TT	1,435,627.52	5.62
4	WYNN MACAU LTD	1128 HK	1,432,991.96	5.61
5	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	9910 TT	1,317,200.20	5.15
6	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	6837 HK	1,261,561.65	4.94
7	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 HK	1,240,820.01	4.86
8	ADVANCED CERAMIC X CORP	3152 TT	1,204,822.01	4.71
9	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD- H	696 HK	1,189,116.18	4.65
10	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	285 HK	1,188,490.67	4.65

11	CAR INC	699 HK	1,177,214.88	4.61
12	CHINA AGRI- INDUSTRIES HLDGS	606 HK	1,134,077.20	4.44
13	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	489 HK	1,124,671.56	4.40
14	COWELL E HOLDINGS INC	1415 HK	1,103,352.86	4.32
15	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	1,076,939.35	4.21
16	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1476 TT	1,065,766.83	4.17
17	GLOBALWAFERS CO LTD	6488 TT	1,011,151.15	3.96
18	SINOTRANS LIMITED-H	598 HK	1,010,713.37	3.95
19	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1055 HK	1,002,653.45	3.92
20	MIRLE AUTOMATION CORP	2464 TT	985,241.21	3.86
21	MEDIATEK INC	2454 TT	969,455.33	3.79
22	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	1880 HK	951,863.07	3.72
23	IMAX CHINA HOLDING INC	1970 HK	950,903.86	3.72
24	SAMSUNG SDI CO LTD	006400 KS	918,344.49	3.59
25	HANSSEM CO LTD	009240 KS	890,301.28	3.48
26	BYD CO LTD-H	1211 HK	813,966.73	3.18
27	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	812,814.59	3.18
28	CHINA SINGYES SOLAR TECH	750 HK	802,691.79	3.14
29	CNOOC LTD	883 HK	764,147.78	2.99
30	HOTA INDUSTRIAL MFG CO LTD	1536 TT	763,027.38	2.99
31	LEES PHARMACEUTICAL HLDGS	950 HK	759,122.41	2.97
32	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	PTTEP/F TB	740,037.43	2.90
33	NEW CHINA LIFE	1336 HK	728,717.11	2.85

	INSURANCE C-H			
34	BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY	963 HK	718,284.54	2.81
35	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	688,587.66	2.69
36	ON-BRIGHT ELECTRONICS INC	4947 TT	665,620.37	2.60
37	REGIS RESOURCES LTD	RRL AU	657,610.39	2.57
38	TTET UNION CORPORATION	1232 TT	651,349.25	2.55
39	CHAOWEI POWER HOLDINGS LTD	951 HK	642,342.79	2.51
40	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	3898 HK	635,815.84	2.49
41	STANDARD CHARTERED PLC	2888 HK	632,494.03	2.47
42	PAX GLOBAL TECHNOLOGY LTD	327 HK	630,165.99	2.47
43	CHINA GAS HOLDINGS LTD	384 HK	614,165.76	2.40
44	BLACKMORES LTD	BKL AU	605,633.59	2.37
45	GOURMET MASTER CO LTD	2723 TT	604,217.49	2.36
46	CHINA LILANG LTD	1234 HK	600,162.24	2.35
47	HSBC HOLDINGS PLC	5 HK	596,181.32	2.33
48	FLEXIUM INTERCONNECT INC	6269 TT	593,403.22	2.32
49	SHENWAN HONGYUAN HK LTD	218 HK	579,824.11	2.27
50	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1 HK	555,613.77	2.17
51	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	549,216.36	2.15
52	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	460 HK	543,681.52	2.13
53	MERRY ELECTRONICS CO LTD	2439 TT	543,212.90	2.13
54	MEDY-TOX INC	086900 KS	533,705.60	2.09

55	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	322 HK	533,218.08	2.09
56	SFA ENGINEERING CORP	056190 KS	530,293.02	2.07
57	MELCO INTERNATIONAL DEVELOP.	200 HK	529,746.14	2.07
58	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	528,050.55	2.07
59	SINMAG EQUIPMENT CORP	1580 TT	523,313.27	2.05
60	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	511,641.36	2.00

注：不考虑相关交易费用。

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	65,480,071.29
卖出收入（成交）总额	68,593,331.9

注：不考虑相关交易费用。

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.8 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。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

### 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币

元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	HANG SENG H-SHARE	-	-	-	861,305.79	3.54

	IND ETF- HK					
--	----------------	--	--	--	--	--

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

注：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。

### 8.11.2

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况。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	7,460.71
4	应收利息	141.36
5	应收申购款	9,941.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,543.72

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.11.5 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	005930 KS	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	746,900.01	3.07	临时停牌

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
970	32,565.40	5,001,200.00	15.83%	26,587,235.25	84.17%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	296,523.34	0.9387%

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10万份至50万份。

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0。

### 9.3 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10万份至50万份。

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0。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年12月2日）基金份额总额	139,682,454.14
本报告期期初基金份额总额	32,320,387.76
本报告期基金总申购份额	4,172,413.76
减：本报告期基金总赎回份额	4,904,366.27
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	31,588,435.25

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2016 年 11 月 24 日，经公司股东会批准贾波先生、翟军先生、文光伟先生、沈志群先生、李亦宜女士为公司董事。

2016 年 11 月 24 日，经公司董事会选举贾波先生为公司董事长，任职时间自 2016 年 12 月 14 日起。

2016 年 11 月 24 日，经公司股东会批准何雅茵女士、刘晓冰先生为公司监事。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 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。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 72,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 6 年的审计服务。

### 11.6 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，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元



券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
CREDIT SUISSE	-	32,130,116.24	23.51%	68,090.90	31.37%	-
CITI	-	19,202,279.78	14.05%	30,219.97	13.92%	-
MAST	-	18,931,916.25	13.85%	22,714.08	10.46%	-
SWHYHK	-	13,055,205.22	9.55%	20,071.07	9.25%	-
CIMB	-	10,537,432.00	7.71%	17,923.59	8.26%	-
CATHAY	-	6,049,958.54	4.43%	6,039.47	2.78%	-
ICBCI	-	5,821,206.43	4.26%	9,828.21	4.53%	-
CESHK	-	5,719,015.64	4.19%	5,719.01	2.63%	-
DAIWAHK	-	5,329,816.72	3.90%	5,370.09	2.47%	-
Daewoo	-	4,740,704.38	3.47%	4,740.53	2.18%	-
CICC	-	4,030,061.90	2.95%	7,254.11	3.34%	-
UOB	-	3,328,712.25	2.44%	7,499.61	3.45%	-
NOMURA	-	3,196,121.05	2.34%	5,564.26	2.56%	-
DSHN	-	1,356,327.41	0.99%	1,356.23	0.62%	-
CITICHK	-	1,084,740.08	0.79%	1,627.11	0.75%	-
DAIWA	-	624,131.04	0.46%	624.13	0.29%	-
HSBC	-	294,738.82	0.22%	294.74	0.14%	-
Morgan Stanley	-	-	-	307.64	0.14%	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务

指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国

银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具

备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需

要，并能为本基金提供全面的信息服

务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-	1,915,347.98	37.51%
CITI	-	-	-	-	-	-	944,369.56	18.49%
MAST	-	-	-	-	-	-	-	-
SWHYHK	-	-	-	-	-	-	325,522.86	6.37%
CIMB	-	-	-	-	-	-	-	-
CATHAY	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBCI	-	-	-	-	-	-	730,950.58	14.31%
CESHK	-	-	-	-	-	-	-	-
DAIWAHK	-	-	-	-	-	-	-	-
Daewoo	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-	-	-	-	-
UOB	-	-	-	-	-	-	421,096.90	8.25%
NOMURA	-	-	-	-	-	-	513,388.40	10.05%
DSHN	-	-	-	-	-	-	-	-
CITICHK	-	-	-	-	-	-	-	-
DAIWA	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	256,023.56	5.01%

**11.8 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	华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金 2017 年香港市场节假日暂停申购赎回的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 28 日
2	华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 10 月 25 日
3	华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 27 日

4	华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金 2016 年半年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 27 日
5	华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 7 月 21 日
6	华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金（正文）2016 年 2 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 7 月 15 日
7	华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金（摘要）2016 年 2 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 7 月 15 日
8	华泰柏瑞亚洲领导企业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
9	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
10	华泰柏瑞亚洲领导企业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
11	华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金 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
12	华泰柏瑞亚洲领导企业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
13	华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金（摘要）2016 年 1 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 13 日
14	华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金（正文）2016 年 1 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 13 日

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

-
---

## §13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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

### 13.3 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  
2017 年 3 月 29 日