

# 华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资 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、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 3 月 29 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

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》。

## 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>6</b>
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现（转型前）.....	8
3.2 基金净值表现（转型后）.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
4.9 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.....	21
4.10 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.....	22
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>22</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	22
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.....	22
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.....	22
<b>§6 审计报告（转型前）</b> .....	<b>22</b>
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
<b>§6 审计报告（转型后）</b> .....	<b>24</b>
6.1 审计报告基本信息.....	24
6.2 审计报告的基本内容.....	24
<b>§7 年度财务报表(转型前)</b> .....	<b>25</b>
7.1 资产负债表(转型前).....	25
7.2 利润表.....	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	27
7.4 报表附注.....	28

<b>§7 年度财务报表(转型后)</b> .....	<b>53</b>
7.1 资产负债表（转型后） .....	53
7.2 利润表 .....	54
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	55
7.4 报表附注 .....	56
<b>§8 投资组合报告(转型前)</b> .....	<b>80</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	80
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	80
8.3 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 .....	81
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	82
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	84
8.6 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 .....	84
8.7 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 .....	84
8.8 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 .....	84
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权证投资明细 .....	85
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	85
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	85
8.12 投资组合报告附注 .....	85
<b>§8 投资组合报告(转型后)</b> .....	<b>86</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	86
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	86
8.3 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(转型后) .....	87
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	88
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	90
8.6 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 .....	90
8.7 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 .....	91
8.8 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 .....	91
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权证投资明细 .....	91
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	91
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	91
8.12 投资组合报告附注 .....	91
<b>§9 基金份额持有人信息(转型前)</b> .....	<b>92</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	92
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	92
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 .....	93
<b>§9 基金份额持有人信息(转型后)</b> .....	<b>93</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	93
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	93
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 .....	93
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>93</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>94</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	94
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 .....	94
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	94
11.4 基金投资策略的改变 .....	94

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	94
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.....	95
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）.....	95
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）.....	98
11.8 其他重大事件（转型后）.....	100
11.8 其他重大事件（转型前）.....	101
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>102</b>
12.1 备查文件目录.....	102
12.2 存放地点.....	103
12.3 查阅方式.....	103

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中国军工股票
基金主代码	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
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,001,639,894.43 份

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	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	华泰柏瑞精选回报混合
基金主代码	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
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,001,409,994.31 份

### 2.2 基金产品说明（转型前）

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（若有）	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（若有）	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。

### 2.2 基金产品说明（转型后）

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（若有）	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（若有）	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 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 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	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 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（特殊普通合伙）	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 弄上海证大五道口广场 1 号 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3月29日-2016年12月31日	
	转型前	转型后
本期已实现收益	9,647,487.85	8,438,802.54
本期利润	13,520,491.52	-365,906.73
加权平均基金份额本期利润	0.0135	-0.0004
本期加权平均净值利润率	1.34%	-0.04%
本期基金份额净值增长率	1.35%	1.31%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	
期末可供分配利润	9,647,474.11	13,150,083.47
期末可供分配基金份额利润	0.0096	0.0131
期末基金资产净值	1,015,159,795.88	1,014,560,077.78
期末基金份额净值	1.0135	1.0131
3.1.3 累计期末指标	2016年末	
基金份额累计净值增长率	1.35%	1.31%

#### 3.2 基金净值表现（转型前）

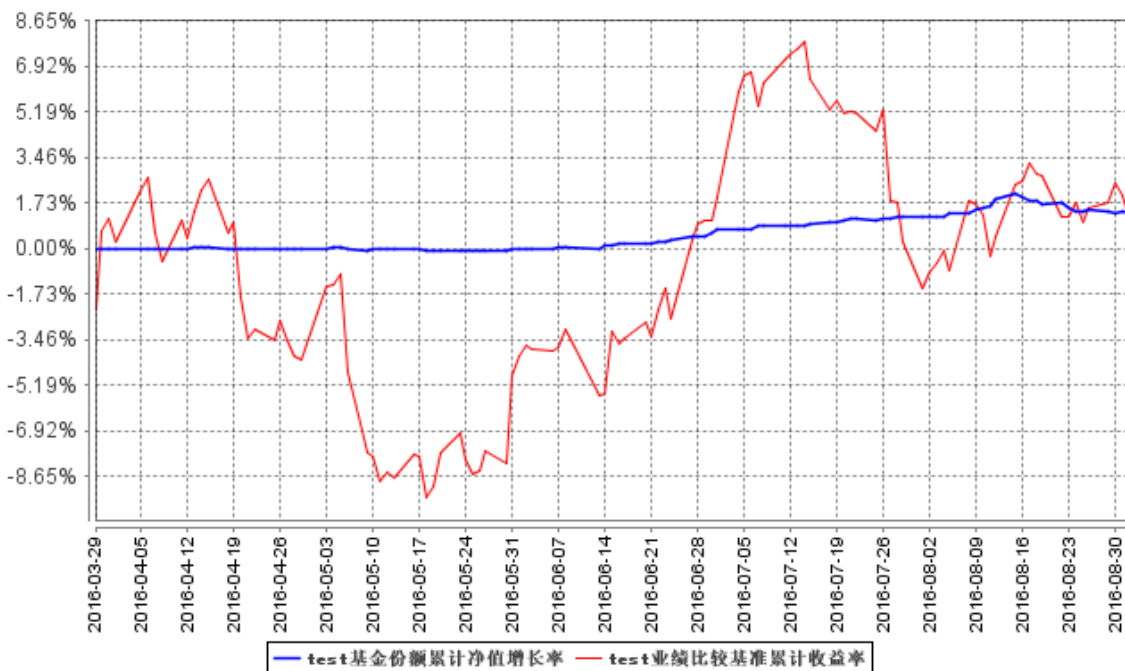
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	转型前					
	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	1.35%	0.07%	5.43%	1.18%	-4.08%	-1.11%
自基金合						



同生效起 至 2016 年 9 月 1 日						
--------------------------------	--	--	--	--	--	--

### 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

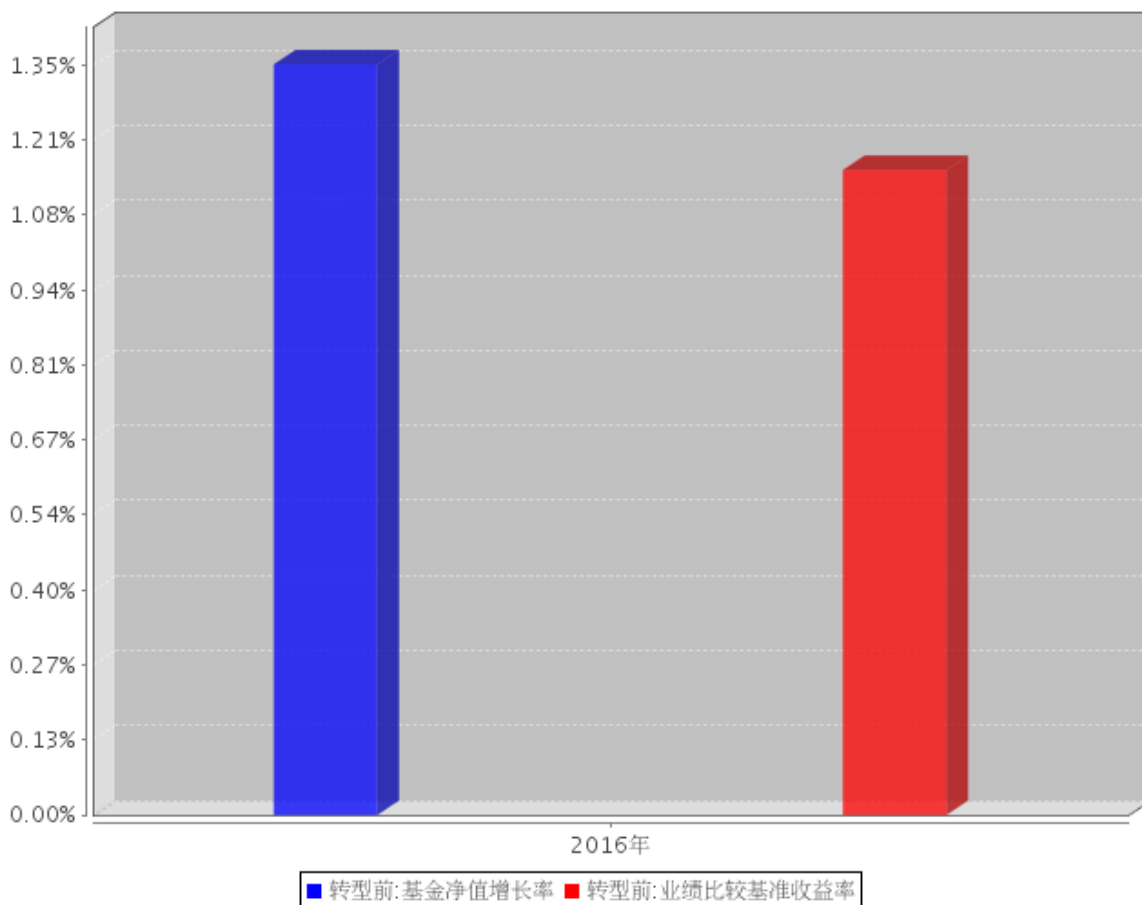


注：1、图示日期为 2016 年 3 月 29 日至 2016 年 9 月 1 日。

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。

### 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

自基金合同生效以来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



注：图为基金合同生效日（2016年3月29日）至基金转型前一日（2016年9月1日）数据。

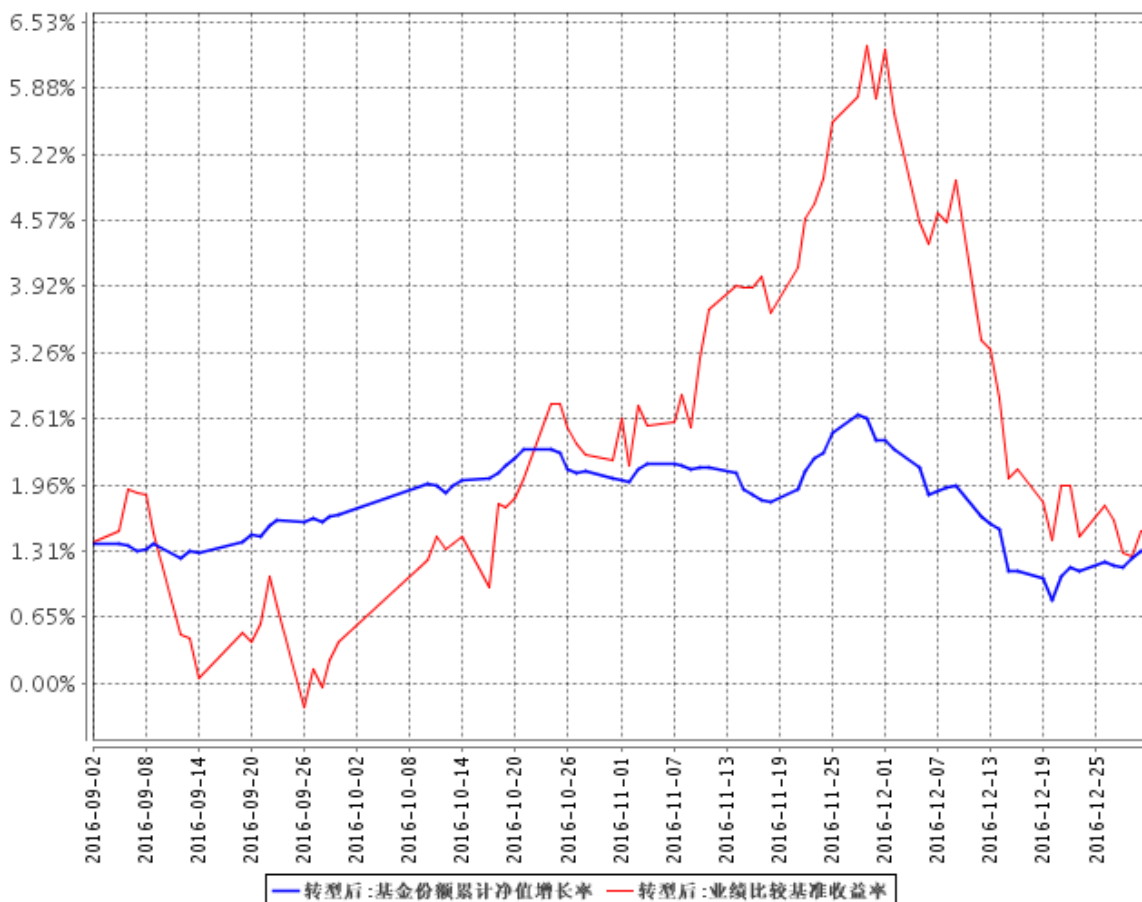
## 3.2 基金净值表现（转型后）

### 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	转型后					
	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	-0.35%	0.12%	1.09%	0.43%	-1.44%	-0.31%
自基金转型日起至2016年12月31日	-0.04%	0.11%	0.34%	0.43%	-0.38%	-0.32%

### 3.2.2 自基金转型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

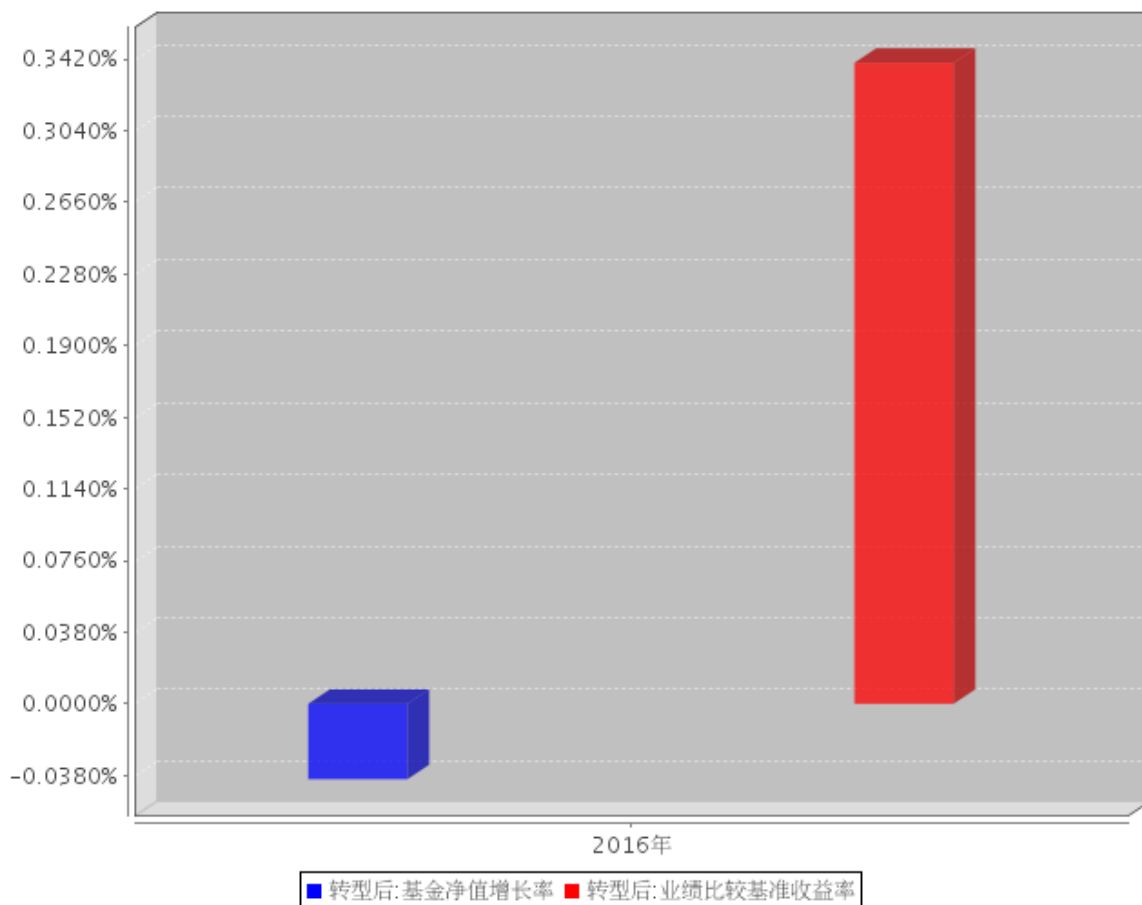


注：1、图示日期为基金转型日（2016年9月2日）至2016年12月31日。

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”。

### 3.2.3 自基金转型以来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

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



注：图为基金转型日（2016年9月2日）至2016年12月31日数据。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

转型前

注：本基金成立以来未进行利润分配。

转型后

注：本基金成立以来未进行利润分配。

## §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（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方纬	本基金的 基金经理	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；

					<p>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。</p> <p>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 月至 2016 年 11 月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</p>

					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。
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），金融风险管理师（FRM）。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>2015 年 4 月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。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。</p> <p>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> <p>2016 年 11 月起任华</p>

					<p>泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2016 年 12 月起任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

**基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）**

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方纬	本基金的基金经理	2016 年 3 月 29 日	-	13	<p>经济学硕士。</p> <p>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。</p> <p>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</p>



					<p>金经理。2015 年 8 月至 2016 年 11 月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），金融风险经理师（FRM）。</p> <p>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</p>

				<p>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。</p> <p>2015 年 4 月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。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。</p> <p>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> <p>2016 年 11 月起任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2016 年 12 月起任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平，只在少数情况下“存在显著的倾向性”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究表明，交易价差方向没有规律性，即没有明确的利益输送方向。同时潜在利益输送金额比较小，因此不构成利益输送。造成少量显著交易价差的原因来自两方面：一是报告期内股票市场的波动幅度较大，为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件；二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异，对证券买卖时点的把握也不同，导致股票买卖存在价差。

#### 4.3.3 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。

#### 4.4 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

本基金 2016 年 3 月 29 成立以来, 采取稳健保守的策略, 保持权益资产的相对低仓位, 运行以固定收益和打新为主要获利手段, 较为成功的取得了一定的绝对收益, 很好的回避了市场下跌的风险。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前, 截至转型前最后一日 (2016 年 9 月 1 日), 本基金份额净值为 1.0135 元。基金合同生效日 (2016 年 3 月 29 日) 至转型前最后一日 (2016 年 9 月 1 日) 期间, 本基金净值增长率为 1.35%, 同期业绩比较基准增长率为 1.16%。

转型后, 截至报告期末, 本基金份额净值为 1.0131 元。基金转型日 (2016 年 9 月 2 日) 至报告期末期间, 本基金净值增长率为-0.04%, 同期业绩比较基准增长率为 0.34%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年的 A 股市场, 市场波动性逐步降低, 市场运行逐步稳定。经济基本面自 2016 年下半年以来, 逐步回升, 供给侧改革正常推进, 货币供给中性, 财政政策积极, 企业盈利有所恢复。我们认为不能排除 2017 年全年市场波动的风险, 但主要指数的估值水平尚在合理水平, 精选个股将成为全年获取权益收益的重要手段。本基金将灵活参与权益市场、新股市场以及固定收益市场, 审慎投资, 精选个股, 降低风险, 努力在 2017 年为投资者带来相对更好的净值表现。

#### 4.6 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进行合规性设置，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。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金成立以来未进行利润分配。

#### 4.9 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。

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

无。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞精选回报灵活配置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（转型前）

#### 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
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21047 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	华泰柏瑞中国军工主题股票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中国军工主题股票型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞中国军工基金”)的财务报表，包括2016年9月1日(基金合同失效前日)的资产负债表、2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年9月1日(基金合同失效前日)止期间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	<p>编制和公允列报财务报表是华泰柏瑞中国军工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：</p> <p>(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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(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。</p>
注册会计师的责任段	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
审计意见段	我们认为，上述华泰柏瑞中国军工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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华泰柏瑞中国军工基金 2016 年 9 月 1 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2016 年 3 月 29 日(基金

	合同生效日)至 2016 年 9 月 1 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	单峰	傅琛慧
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 28 日	

## §6 审计报告（转型后）

### 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
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21054 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	华泰柏瑞精选回报灵活配置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精选回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞精选回报基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 9 月 2 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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精选回报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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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



	<p>报获取合理保证。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
审计意见段	我们认为，上述华泰柏瑞精选回报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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华泰柏瑞精选回报基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 9 月 2 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	单峰   傅琛慧
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 28 日

## §7 年度财务报表(转型前)

### 7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 9 月 1 日

单位：人民币元

资产	附注号	报告期初至转型前
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	75,992,776.62
结算备付金		3,500,329.32
存出保证金		14,388.73
交易性金融资产	7.4.7.2	1,079,151,264.62
其中：股票投资		65,168,264.62
基金投资		-
债券投资		1,013,983,000.00

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		546,579.84
应收利息	7.4.7.5	13,773,446.98
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,172,978,786.11
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>报告期初至转型前</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		145,104,709.95
应付证券清算款		10,875,143.55
应付赎回款		996.29
应付管理人报酬		1,333,941.01
应付托管费		222,323.51
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	55,258.98
应交税费		-
应付利息		12,011.14
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	214,605.80
负债合计		157,818,990.23
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	1,001,639,894.43
未分配利润	7.4.7.10	13,519,901.45
所有者权益合计		1,015,159,795.88
负债和所有者权益总计		1,172,978,786.11

注：报告截止日 2016 年 9 月 1 日，基金份额净值 1.0135 元，基金份额总额 1,001,639,894.43 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 3 月 29 日至 2016 年 9 月 1 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年3月29日至 2016年9月1日
<b>一、收入</b>		22,374,387.13
1. 利息收入		12,538,484.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	556,959.87
债券利息收入		9,867,532.28
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,113,992.59
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,960,200.32
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,752,383.55
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	1,458,916.77
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	748,900.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,873,003.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,698.40
<b>减：二、费用</b>		8,853,895.61
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,437,793.63
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,072,965.63
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	82,727.23
5. 利息支出		1,024,514.26
其中：卖出回购金融资产支出		1,024,514.26
6. 其他费用	7.4.7.20	235,894.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		13,520,491.52
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		13,520,491.52

注：数据期间为基金合同生效日（2016年3月29日）至转型前最后一日（2016年9月1日）。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金

本报告期：2016年3月29日至2016年9月1日

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月29日至2016年9月1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）	1,001,514,242.44	-	1,001,514,242.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,520,491.52	13,520,491.52
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）	125,651.99	-590.07	125,061.92
其中：1. 基金申购款	725,444.70	1,237.82	726,682.52
2. 基金赎回款	-599,792.71	-1,827.89	-601,620.60
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）	1,001,639,894.43	13,519,901.45	1,015,159,795.88

注：数据期间为基金合同生效日（2016年3月29日）至转型前最后一日（2016年9月1日）。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_ 韩勇 \_\_\_\_\_

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_ 房伟力 \_\_\_\_\_

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_ 赵景云 \_\_\_\_\_

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中国军工主题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[2015]1218号文《关于准予华泰柏中国军工主题股票型证券投资基金注册的批复》和机构部函[2016]24号《关于华泰柏瑞中国军工主题股票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《华泰柏瑞中国军工主题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1,001,434,223.72元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第339号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金

基金合同》于 2016 年 3 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,001,514,242.44 份基金份额，其中认购资金利息折合 80,018.72 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据本基金份额持有人大会自 2016 年 8 月 3 日至 2016 年 9 月 1 日以通讯方式审议通过的《关于修改华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金基金合同的议案》，本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2016 年 9 月 6 日发布了《华泰柏瑞基金管理有限公司关于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表决结果暨决议生效的公告》，经中国证监会证监许可[2016]1689 号《关于准予华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金变更注册的批复》核准，上述持有人大会决议生效。根据相关法律法规的规定，并经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金基金合同》修订为《华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，并已报中国证监会备案。《华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2016 年 9 月 2 日起生效，原《华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金基金合同》同日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中国军工主题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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产的投资比例占基金资产的 80-95%，其中，投资于军工主题相关的证券资产比例不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。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%。

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基

本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于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表决结果暨决议生效的公告》，本基金存续期至 2016 年 9 月 1 日终止。本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司将本基金变更注册为华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金，基金为契约型开放式，存续期限不定，因此本基金本年度财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

### 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 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 9 月 1 日(基金合同失效前日)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 9 月 1 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 9 月 1 日(基金合同失效前日)止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 9 月 1 日(基金合同失效前日)止期间。

#### 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、债券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、买入返售金融资产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卖出回购金融资产款和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、债券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 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。



#### 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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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；于处置时，其处置价格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 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前,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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。

## 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 9 月 1 日
活期存款	75,992,776.62
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	75,992,776.62

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 9 月 1 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	61,805,422.80	65,168,264.62	3,362,841.82
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	49,996,350.00	63,650.00
	银行间市场	963,476,488.15	446,511.85
	合计	1,013,472,838.15	510,161.85
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	1,075,278,260.95	1,079,151,264.62	3,873,003.67

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

### 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。

#### 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9月1日
应收活期存款利息	34,258.60
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	16,215.83
应收债券利息	13,722,918.02
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	54.53
合计	13,773,446.98

### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年9月1日
交易所市场应付交易费用	40,428.22
银行间市场应付交易费用	14,830.76
合计	55,258.98

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年9月1日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.50
预提费用	214,603.30
合计	214,605.80

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年3月29日至2016年9月1日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,001,514,242.44	1,001,514,242.44
本期申购	725,444.70	725,444.70
本期赎回（以“-”号填列）	-599,792.71	-599,792.71
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,001,639,894.43	1,001,639,894.43

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2016 年 3 月 24 日至 2016 年 3 月 25 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 1,001,434,223.72 元。根据《华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 80,018.72 元在本基金成立后，折算为 80,018.72 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2016 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 4 月 7 日止期间暂不向投资人开放基金交易。日常申购业务、赎回业务和转换业务自 2016 年 4 月 8 日起开始办理。

### 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	-	-	-
本期利润	9,647,487.85	3,873,003.67	13,520,491.52
本期基金份额交易产生的变动数	-13.74	-576.33	-590.07
其中：基金申购款	1,126.72	111.10	1,237.82
基金赎回款	-1,140.46	-687.43	-1,827.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,647,474.11	3,872,427.34	13,519,901.45

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月29日至2016年 9月1日
活期存款利息收入	455,266.77
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	117.80
结算备付金利息收入	101,575.30
其他	-
合计	556,959.87

#### 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 2016年3月29日至 2016年9月1日
卖出股票成交总额	4,510,545.37
减：卖出股票成本总额	758,161.82
买卖股票差价收入	3,752,383.55

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月29日至2016年 9月1日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期	1,458,916.77

兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,458,916.77

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月29日至2016年 9月1日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	415,687,182.15
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	408,926,118.97
减：应收利息总额	5,302,146.41
买卖债券差价收入	1,458,916.77

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。



**7.4.7.15 衍生工具收益**

**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月29日至2016年 9月1日
股票投资产生的股利收益	748,900.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	748,900.00

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年3月29日至2016年 9月1日
1. 交易性金融资产	3,873,003.67
——股票投资	3,362,841.82
——债券投资	510,161.85
——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	3,873,003.67

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月29日至2016年 9月1日
基金赎回费收入	2,591.63
转换费收入	106.77

合计	2,698.40
----	----------

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金财产。

2. 基金之间的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中赎回费用不低于 25% 的部分归入基金财产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 29 日至 2016 年 9 月 1 日
交易所市场交易费用	71,077.23
银行间市场交易费用	11,650.00
合计	82,727.23

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 29 日至 2016 年 9 月 1 日
审计费用	45,179.89
信息披露费	169,423.41
银行划款手续费	6,291.56
银行间 CFCA 证书费	100.00
其他费用	10,400.00
银行间账户服务费	4,500.00
合计	235,894.86

### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 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、基金注册登记人、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
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
柏瑞投资有限责任公司	基金管理人的股东
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

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。

#### 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

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

注：无。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的交易。

##### 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3月29日至2016年 9月1日
当期发生的基金应支付的管理费	6,437,793.63
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	2,641.53

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

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

H为每日应支付的管理人报酬

E为前一日的基金资产净值

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

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月29日至2016年 9月1日	
	期末余额	当期利息收入
当期发生的基金应支付的托管费	1,072,965.63	

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

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

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

### 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：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 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

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。

#### 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：本基金本报告期末除基金管理人以外的其他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3月29日至2016年9月1日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	75,992,776.62	455,266.77

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

### 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：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

### 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：本基金本报告期内无利润分配。

### 7.4.12 期末（2016 年 9 月 1 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	说明
002807	江阴银行	2016 年 8 月 26 日	2016 年 9 月 2 日	新股流通受限	4.64	4.64	8,977	41,653.28	41,653.28	-
603843	正平股份	2016 年 8 月 26 日	2016 年 9 月 5 日	新股流通受限	5.03	5.03	4,642	23,349.26	23,349.26	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

截至本报告期末 2016 年 9 月 1 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 100,104,709.95 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
160208	16 国开 08	2016 年 9 月 2 日	99.82	1,083,000	108,105,060.00
合计				1,083,000	108,105,060.00

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 9 月 1 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 45,000,000.00 元，于 2016 年 9 月 2 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资。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，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。

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，将风险控制可在承受的范围之内。

### 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，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年9月1日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	371,013,000.00
合计	371,013,000.00

注：未评级的债券均为国债及政策性金融债。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末
--------	-----

	2016 年 9 月 1 日
AAA	
AAA 以下	
未评级	642,970,000.00
合计	642,970,000.00

注：未评级的债券均为国债、政策性金融债及超短期融资券。

### 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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 9 月 1 日(基金合同失效前日)，除卖出回购金融资产款余额中有 145,104,709.95 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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、结算备付金、债券投资及资产支持证券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2016年9月 1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	75,992,776.62	-	-	-	-	-	75,992,776.62
结算备付金	3,500,329.32	-	-	-	-	-	3,500,329.32
存出保证金	14,388.73	-	-	-	-	-	14,388.73
交易性金融资产	-	-270,813,000.00	469,639,000.00	273,531,000.00	65,168,264.62	-	1,079,151,264.62
应收证券清算	-	-	-	-	-	546,579.84	546,579.84

款							
应收利息	-	-	-	-	-13,773,446.98	13,773,446.98	
资产总计	79,507,494.67	-270,813,000.00	469,639,000.00	273,531,000.00	79,488,291.44	1,172,978,786.11	
负债							
卖出回购金融资产款	145,104,709.95	-	-	-	-	145,104,709.95	
应付证券清算款	-	-	-	-	-10,875,143.55	10,875,143.55	
应付赎回款	-	-	-	-	996.29	996.29	
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,333,941.01	1,333,941.01	
应付托管费	-	-	-	-	222,323.51	222,323.51	
应付交易费用	-	-	-	-	55,258.98	55,258.98	
应付利息	-	-	-	-	12,011.14	12,011.14	
其他负债	-	-	-	-	214,605.80	214,605.80	
负债总计	145,104,709.95	-	-	-	-12,714,280.28	157,818,990.23	
利率敏感度缺口	-65,597,215.28	-270,813,000.00	469,639,000.00	273,531,000.00	66,774,011.16	1,015,159,795.88	

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

假设	除市场利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9月1日）	
	1. 市场利率下降25个基点	7,890,000.00	-
	2. 市场利率上升25个基点	-7,720,000.00	

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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

#### 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9月1日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	65,168,264.62	6.42
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	65,168,264.62	6.42

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2016 年 9 月 1 日(基金合同失效前日)，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金

资产净值的比例为 6.42%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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 9 月 1 日(基金合同失效前日)，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 65,103,262.08 元，属于第二层次的余额为 1,014,048,002.54 元，无属于第三层次的余额。

##### (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和债券，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和债券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，确定相关股票和债券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 9 月 1 日(基金合同失效前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资

产。

(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。

## §7 年度财务报表(转型后)

### 7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：华泰柏瑞精选回报灵活配置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	转型后至报告期末
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	13,274,834.70
结算备付金		190,670.11
存出保证金		27,221.39
交易性金融资产	7.4.7.2	769,847,529.55
其中：股票投资		106,233,529.55
基金投资		-
债券投资		663,614,000.00
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	449,351,234.03
应收证券清算款		152,189.46
应收利息	7.4.7.5	12,401,135.30
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,245,244,814.54
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>转型后至报告期末</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		229,340,827.60
应付证券清算款		-
应付赎回款		21,002.13
应付管理人报酬		516,824.71
应付托管费		129,206.17
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	83,349.39
应交税费		-
应付利息		203,447.61
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	390,079.15
负债合计		230,684,736.76
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	1,001,409,994.31
未分配利润	7.4.7.10	13,150,083.47
所有者权益合计		1,014,560,077.78
负债和所有者权益总计		1,245,244,814.54

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0131 元，基金份额总额 1,001,409,994.31 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 9 月 2 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2016 年 9 月 2 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		3,011,547.76
1. 利息收入		10,942,548.57
其中：存款利息收入	7.4.7.11	132,750.23
债券利息收入		10,333,467.84
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		476,330.50
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		873,240.14
其中：股票投资收益	7.4.7.12	9,594,298.42
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-8,971,058.28

资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	250,000.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-8,804,709.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	468.32
<b>减：二、费用</b>		3,377,454.49
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,021,855.65
2. 托管费	7.4.10.2.2	505,463.90
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	97,648.33
5. 利息支出		533,918.86
其中：卖出回购金融资产支出		533,918.86
6. 其他费用	7.4.7.20	218,567.75
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-365,906.73
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-365,906.73

注：数据期间为基金转型日（2016年9月2日）至报告期末（2016年12月31日）。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年9月2日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月2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）	1,001,639,894.43	13,519,901.45	1,015,159,795.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-365,906.73	-365,906.73
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）	-229,900.12	-3,911.25	-233,811.37
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-229,900.12	-3,911.25	-233,811.37
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)	1,001,409,994.31	13,150,083.47	1,014,560,077.78

注：数据期间为基金转型日（2016 年 9 月 2 日）至报告期末（2016 年 12 月 31 日）。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>          韩勇          </u>	<u>          房伟力          </u>	<u>          赵景云          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金(原名为华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)是由华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金转型而来。华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金自 2016 年 8 月 3 日至 2016 年 9 月 1 日以通讯方式召开基金份额持有人大会，根据大会审议通过的《关于修改华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金基金合同的议案》，本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2016 年 9 月 6 日发布了《华泰柏瑞基金管理有限公司关于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表决结果暨决议生效的公告》，经中国证监会证监许可[2016]1689 号《关于准予华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金变更注册的批复》核准，上述持有人大会决议生效。根据相关法律法规的规定，并经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金基金合同》修订为《华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，并已报中国证监会备案。《华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2016 年 9 月 2 日起生效，原《华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金基金合同》同日起失效。本基金为契约型开放式基金，存续期间不定。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞精选回报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，包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴



纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 X60%+上证国债指数收益率 X40%。

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 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 9 月 2 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 9 月 2 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 9 月 2 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

### 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和债券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、买入返售金融资产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卖出回购金融资产款和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债券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 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **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**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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；于处置时，其处置价格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 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于

2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、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) 对于内地投资者持有的基金类别，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, 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。

## 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
活期存款	13,274,834.70
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	13,274,834.70

### 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	估值增值
股票	103,106,754.25	106,233,529.55	3,126,775.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	49,996,350.00	49,935,000.00
	银行间市场	621,676,130.90	613,679,000.00
	合计	671,672,480.90	663,614,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	774,779,235.15	769,847,529.55	-4,931,705.60

### 7.4.7.3 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。

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	449,351,234.03	-
合计	449,351,234.03	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 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
应收活期存款利息	18,099.24
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	94.38
应收债券利息	12,003,479.35
应收买入返售证券利息	379,448.91
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	13.42
合计	12,401,135.30

### 7.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	57,344.12
银行间市场应付交易费用	26,005.27



合计	83,349.39
----	-----------

#### 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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	79.15
预提费用	390,000.00
合计	390,079.15

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 9 月 2 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,001,639,894.43	1,001,639,894.43
- 基金份额折算调整	-	-
- 未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
- 集中申购募集资金本金及利息	-	-
- 基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-229,900.12	-229,900.12
本期末	1,001,409,994.31	1,001,409,994.31

#### 7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	9,647,474.11	3,872,427.34	13,519,901.45
本期利润	8,438,802.54	-8,804,709.27	-365,906.73
本期基金份额交易产生的变动数	-3,296.89	-614.36	-3,911.25
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-3,296.89	-614.36	-3,911.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,082,979.76	-4,932,896.29	13,150,083.47

### 7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2016年9月2日至2016年12月31日
活期存款利息收入	119,820.61
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	160.49
结算备付金利息收入	12,769.13
其他	-
合计	132,750.23

### 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 2016年9月2日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	16,911,131.80
减：卖出股票成本总额	7,316,833.38
买卖股票差价收入	9,594,298.42

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月2日至2016年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-8,971,058.28
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-8,971,058.28

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月2日至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,808,318,954.18
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,788,246,518.00

减：应收利息总额	29,043,494.46
买卖债券差价收入	-8,971,058.28

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：无。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月2日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	250,000.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	250,000.00

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年9月2日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-8,804,709.27
——股票投资	-236,066.52
——债券投资	-8,568,642.75
——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	-8,804,709.27

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月2日至2016年12月31日
基金赎回费收入	356.92
转换费收入	111.40
合计	468.32

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金财产。

2. 基金之间的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中赎回费用不低于 25% 的部分归入基金财产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月2日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	81,473.33

银行间市场交易费用	16,175.00
合计	97,648.33

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月2日至2016年12月31日
审计费用	74,820.11
信息披露费	100,576.59
银行划款手续费	5,871.05
银行间CFCA证书费	-
其他费用	32,500.00
银行间账户服务费	4,800.00
合计	218,567.75

#### 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

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)的有关规定：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。

截止本财务报表批准报出日止，上述税收政策的具体征收管理办法尚未颁布，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、基金注册登记人、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

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
柏瑞投资有限责任公司	基金管理人的股东
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

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。

## 7.4.10 本报告期间的关联方交易

### 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9月2日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	22,655,411.80	17.47%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

注：无。

#### 7.4.10.1.3 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9月2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
华泰证券	20,645.86	17.26%	20,645.86	36.00%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 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9月2日至2016年12月31日
当期应支付的管理费	2,021,855.65

其中：支付销售机构的 客户维护费	834.92
---------------------	--------

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 0.60% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 9 月 2 日至 2016 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	505,463.90

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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。

#### 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

注：无。

##### 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：无。

### 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9月2日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	13,274,834.70	119,820.61

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

### 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

注：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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股/张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新股未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股未上市	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股未上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-



300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新股未上市	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新股未上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

注：无。

#### 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

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 229,340,827.60 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
150213	15 国开 13	2017 年 1 月 6 日	100.55	1,400,000	140,770,000.00
150209	15 国开 09	2017 年 1 月 6 日	102.43	900,000	92,187,000.00
合计				2,300,000	232,957,000.00

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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，但低于股票型基金。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，追求基金资产的长期稳健增值。

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，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016 年 12 月 31 日
A-1	50,040,000.00
A-1 以下	-
未评级	290,176,000.00
合计	340,216,000.00

注：未评级的债券均为国债及政策性金融债。

### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 12 月 31 日
AAA	30,348,000.00
AAA 以下	
未评级	293,050,000.00
合计	323,398,000.00

注：未评级的债券均为国债、政策性金融债及超短期融资券。

### 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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 229,340,827.60 元将在以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产、卖出回购金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：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	13,274,834.70	-	-	-	-	-	13,274,834.70
结算备付金	190,670.11	-	-	-	-	-	190,670.11
存出保证金	27,221.39	-	-	-	-	-	27,221.39
交易性金融资产	150,632,000.00	90,216,000.00	129,716,000.00	171,154,000.00	121,896,000.00	106,233,529.55	769,847,529.55
买入返售金融资产	449,351,234.03	-	-	-	-	-	449,351,234.03
应收证券清算款	-	-	-	-	-	152,189.46	152,189.46
应收利息	-	-	-	-	-	12,401,135.30	12,401,135.30
资产总计	613,475,960.23	90,216,000.00	129,716,000.00	171,154,000.00	121,896,000.00	118,786,854.31	1,245,244,814.54
负债							
卖出回购金融资产款	229,340,827.60	-	-	-	-	-	229,340,827.60
应付赎回款	-	-	-	-	-	21,002.13	21,002.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	516,824.71	516,824.71
应付托管费	-	-	-	-	-	129,206.17	129,206.17
应付交易费用	-	-	-	-	-	83,349.39	83,349.39
应付利息	-	-	-	-	-	203,447.61	203,447.61
其他负债	-	-	-	-	-	390,079.15	390,079.15
负债总计	229,340,827.60	-	-	-	-	1,343,909.16	230,684,736.76
利率敏感度缺口	384,135,132.63	90,216,000.00	129,716,000.00	171,154,000.00	121,896,000.00	117,442,945.15	1,014,560,077.78

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利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）

	1. 市场利率下降 25 个基点	1,600,000.00
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,580,000.00

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	106,233,529.55	10.47

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	769,847,529.55	10.47

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 10.47%(2015 年 12 月 31 日：无)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 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 105,904,988.38 元，属于第二层次的余额为 663,942,541.17 元，无属于第三层次的余额。

##### (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和债券，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和债券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，确定相关股票和债券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。

(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(转型前)

### 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	65,168,264.62	5.56
	其中：股票	65,168,264.62	5.56
2	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	-	-
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	79,493,105.94	6.78
7	其他资产	14,334,415.55	1.22



8	合计	1,172,978,786.11	100.00
---	----	------------------	--------

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	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

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

### 8.3 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	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
11	601595	上海电影	4,500	188,415.00	0.02
12	603515	欧普照明	2,453	124,391.63	0.01
13	300533	冰川网络	889	122,939.81	0.01
14	603986	兆易创新	1,133	98,412.38	0.01
15	603159	上海亚虹	1,438	54,140.70	0.01
16	300532	今天国际	838	51,084.48	0.01
17	002808	苏州恒久	1,128	47,567.76	0.00
18	002807	江阴银行	8,977	41,653.28	0.00
19	603658	安图生物	1,911	40,131.00	0.00
20	603843	正平股份	4,642	23,349.26	0.00
21	002810	山东赫达	957	20,001.30	0.00
22	300537	广信材料	1,024	16,394.24	0.00

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	12,846,000.00	1.28
2	601288	农业银行	7,950,000.00	0.79
3	000895	双汇发展	7,376,656.98	0.74
4	601169	北京银行	7,038,417.20	0.70
5	601668	中国建筑	5,681,958.00	0.57

6	601939	建设银行	5,335,000.00	0.53
7	002142	宁波银行	5,116,669.89	0.51
8	600015	华夏银行	5,020,800.00	0.50
9	000488	晨鸣纸业	5,016,869.89	0.50
10	601997	贵阳银行	137,257.83	0.01
11	600977	中国电影	122,248.60	0.01
12	601966	玲珑轮胎	99,556.60	0.01
13	601611	中国核建	87,478.70	0.01
14	601127	小康股份	50,326.22	0.01
15	601595	上海电影	45,855.00	0.00
16	002807	江阴银行	41,653.28	0.00
17	600908	无锡银行	39,791.94	0.00
18	300512	中亚股份	39,164.43	0.00
19	300527	华舟应急	37,190.64	0.00
20	603515	欧普照明	36,647.82	0.00

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601611	中国核建	555,628.40	0.06
2	600977	中国电影	534,045.01	0.05
3	601127	小康股份	394,431.13	0.04
4	601966	玲珑轮胎	309,714.60	0.03
5	300516	久之洋	256,245.08	0.03
6	300527	华舟应急	226,789.48	0.02
7	300518	盛讯达	220,714.00	0.02
8	300529	健帆生物	169,097.50	0.02
9	300512	中亚股份	156,697.52	0.02
10	300528	幸福蓝海	151,217.82	0.02
11	603737	三棵树	150,712.85	0.02
12	603131	上海沪工	135,204.15	0.01
13	603958	哈森股份	115,279.20	0.01
14	603569	长久物流	113,760.67	0.01
15	002802	洪汇新材	109,315.90	0.01
16	300517	海波重科	100,786.20	0.01

17	300515	三德科技	98,928.55	0.01
18	300520	科大国创	92,738.90	0.01
19	300526	中潜股份	90,528.00	0.01
20	002799	环球印务	88,560.00	0.01

### 8.4.3 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	62,563,584.62
卖出股票收入（成交）总额	4,510,545.37

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	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

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 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。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

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。

#### 8.12.2

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。

#### 8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

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

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 8 投资组合报告(转型后)

#### 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	106,233,529.55	8.53
	其中：股票	106,233,529.55	8.53
2	固定收益投资	663,614,000.00	53.29
	其中：债券	663,614,000.00	53.29
	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	449,351,234.03	36.09
	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	13,465,504.81	1.08
7	其他资产	12,580,546.15	1.01
8	合计	1,245,244,814.54	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	55,020,740.12	5.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	5,270,400.00	0.52
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	6,817.20	0.00
J	金融业	45,919,980.00	4.53
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	106,233,529.55	10.47

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

## 8.3 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(转型后)

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	600438	通威股份	2,110,000	13,440,700.00	1.32
2	000001	平安银行	1,400,000	12,740,000.00	1.26
3	600352	浙江龙盛	1,260,000	11,604,600.00	1.14
4	601169	北京银行	800,000	7,808,000.00	0.77
5	601288	农业银行	2,500,000	7,750,000.00	0.76
6	000059	华锦股份	589,959	7,020,512.10	0.69
7	002142	宁波银行	380,000	6,323,200.00	0.62
8	000895	双汇发展	300,000	6,279,000.00	0.62
9	601939	建设银行	1,100,000	5,984,000.00	0.59
10	000488	晨鸣纸业	559,904	5,800,605.44	0.57
11	000501	鄂武商A	270,000	5,270,400.00	0.52
12	600015	华夏银行	480,000	5,208,000.00	0.51
13	000876	新希望	640,000	5,152,000.00	0.51
14	000625	长安汽车	340,000	5,079,600.00	0.50
15	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
16	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.01
17	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.01
18	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
19	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01
20	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01
21	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.01
22	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
23	603886	元祖股份	2,242	39,683.40	0.00
24	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
25	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
26	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
27	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
28	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
29	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
30	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
31	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
32	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
33	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00



## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600438	通威股份	13,795,884.22	1.36
2	600352	浙江龙盛	12,077,657.00	1.19
3	000625	长安汽车	5,300,600.00	0.52
4	000501	鄂武商 A	5,253,178.00	0.52
5	000059	华锦股份	5,212,234.31	0.51
6	000876	新希望	5,207,700.00	0.51
7	603858	步长制药	244,195.60	0.02
8	601375	中原证券	106,780.00	0.01
9	603556	海兴电力	100,380.24	0.01
10	002831	裕同科技	81,592.63	0.01
11	002818	富森美	72,396.18	0.01
12	002821	凯莱英	70,005.29	0.01
13	603877	太平鸟	67,734.00	0.01
14	300583	赛托生物	63,738.78	0.01
15	603727	博迈科	58,933.92	0.01
16	603298	杭叉集团	46,131.47	0.00
17	002822	中装建设	41,912.31	0.00
18	600908	无锡银行	39,791.94	0.00
19	603218	日月股份	39,482.80	0.00
20	300558	贝达药业	38,162.04	0.00

注：不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601668	中国建筑	10,998,015.40	1.08
2	603858	步长制药	517,901.58	0.05
3	002821	凯莱英	325,480.55	0.03
4	601997	贵阳银行	296,599.56	0.03
5	603556	海兴电力	258,209.39	0.03

6	002818	富森美	241,519.77	0.02
7	601595	上海电影	214,423.29	0.02
8	300558	贝达药业	201,586.84	0.02
9	603986	兆易创新	200,696.16	0.02
10	603727	博迈科	176,832.73	0.02
11	300533	冰川网络	158,280.19	0.02
12	002831	裕同科技	152,189.46	0.01
13	002807	江阴银行	143,116.93	0.01
14	002822	中装建设	130,579.77	0.01
15	603515	欧普照明	128,391.75	0.01
16	300570	太辰光	123,578.83	0.01
17	600908	无锡银行	120,605.68	0.01
18	300568	星源材质	119,734.50	0.01
19	002820	桂发祥	117,010.68	0.01
20	002823	凯中精密	116,323.29	0.01

注：不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 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	48,618,164.83
卖出股票收入（成交）总额	16,911,131.80

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	49,935,000.00	4.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	293,050,000.00	28.88
	其中：政策性金融债	293,050,000.00	28.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	290,281,000.00	28.61
6	中期票据	30,348,000.00	2.99
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	663,614,000.00	65.41

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150213	15 国开 13	1,400,000	140,770,000.00	13.87
2	150209	15 国开 09	900,000	92,187,000.00	9.09
3	011699766	16 中航技 SCP007	500,000	50,140,000.00	4.94
4	071602007	16 国泰君安 CP007	500,000	50,040,000.00	4.93
5	019539	16 国债 11	500,000	49,935,000.00	4.92

## 8.7 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：本基金本报告期期末未持有资产支持证券。

## 8.8 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：本基金本报告期期末未持有贵金属。

## 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权证投资明细

注：本基金本报告期期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

注：金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,221.39
2	应收证券清算款	152,189.46
3	应收股利	-
4	应收利息	12,401,135.30
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,580,546.15

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息(转型前)

### 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
143	7,004,474.79	1,000,080,000.00	99.84%	1,559,894.43	0.16%

## 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	6,929.40	0.00%

## 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 0。

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 基金份额持有人信息(转型后)

## 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
100	10,014,099.94	1,000,080,000.00	99.87%	1,329,994.31	0.13%

## 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	5,941.18	0.00%

## 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

0。

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 ( 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	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	725,444.70
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	829,692.83
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	1,001,409,994.31

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

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。

### 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 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。

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。

### 11.3 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。

### 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。本报告期基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 120,000 元人民币，该事务所已向本基金提供了 1 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

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未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

#### 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	
广发证券	1	36,780,179.41	57.69%	34,253.40	58.15%	-
华泰证券	2	22,655,411.80	35.53%	20,645.86	35.05%	-
银河证券	1	2,224,943.55	3.49%	2,072.11	3.52%	-
齐鲁证券	2	640,111.46	1.00%	596.14	1.01%	-
长江证券	1	348,572.08	0.55%	324.61	0.55%	-
万联证券	2	327,487.08	0.51%	298.43	0.51%	-
华创证券	1	300,655.40	0.47%	273.98	0.47%	-
华安证券	2	259,257.22	0.41%	239.76	0.41%	-
国联证券	2	221,767.33	0.35%	202.10	0.34%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-

长城证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
西藏同信	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的



		例		成交总额 的比例		比例
广发证券	-		-440,000,000.00	35.54%	-	-
华泰证券	-		-	-	-	-
银河证券	-		-128,000,000.00	10.34%	-	-
齐鲁证券	-		-225,000,000.00	18.17%	-	-
长江证券	-		-445,000,000.00	35.95%	-	-
万联证券	-		-	-	-	-
华创证券	-		-	-	-	-
华安证券	-		-	-	-	-
国联证券	-		-	-	-	-
信达证券	-		-	-	-	-
国金证券	-		-	-	-	-
海通证券	-		-	-	-	-
国都证券	-		-	-	-	-
恒泰证券	-		-	-	-	-
长城证券	-		-	-	-	-
民生证券	-		-	-	-	-
财通证券	-		-	-	-	-
国信证券	-		-	-	-	-
东吴证券	-		-	-	-	-
西南证券	-		-	-	-	-
国元证券	-		-	-	-	-
湘财证券	-		-	-	-	-
渤海证券	-		-	-	-	-
安信证券	-		-	-	-	-
光大证券	-		-	-	-	-
西藏同信	-		-	-	-	-
东方证券	-		-	-	-	-
中信建投	-		-	-	-	-
国海证券	-		-	-	-	-
申银万国	-		-	-	-	-
中金公司	-		-	-	-	-
中信证券	-		-	-	-	-
北京高华	-		-	-	-	-
招商证券	-		-	-	-	-
兴业证券	-		-	-	-	-

浙商证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

#### 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	
万联证券	2	20,657,022.88	31.35%	19,237.80	31.68%	-
华鑫证券	1	14,896,656.98	22.61%	13,575.34	22.36%	-
东北证券	1	10,540,552.40	16.00%	9,816.21	16.17%	-
华创证券	1	10,442,669.89	15.85%	9,516.40	15.67%	-
兴业证券	1	5,342,664.91	8.11%	4,868.91	8.02%	-
广发证券	1	1,235,976.53	1.88%	1,151.13	1.90%	-
银河证券	1	551,958.00	0.84%	514.04	0.85%	-
国联证券	2	468,535.30	0.71%	426.99	0.70%	-
华安证券	2	424,993.80	0.64%	395.82	0.65%	-
信达证券	1	330,029.90	0.50%	300.75	0.50%	-
中信建投	3	319,197.47	0.48%	290.88	0.48%	-
华融证券	1	256,245.08	0.39%	233.51	0.38%	-
海通证券	2	187,488.55	0.28%	170.85	0.28%	-
长江证券	1	157,319.70	0.24%	146.51	0.24%	-
齐鲁证券	2	81,605.94	0.12%	76.00	0.13%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

光大证券	2	-	-	-	-	-
西藏同信	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

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	
	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
万联证券	-	-	477,000,000.00	2.90%	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	3,330,000,000.00	20.26%	-	-

华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	280,000,000.00	1.70%	-	-
银河证券	-	-	-5,600,000,000.00	34.06%	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	245,000,000.00	1.49%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	303,000,000.00	1.84%	-	-
齐鲁证券	-	-	-6,205,000,000.00	37.74%	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
西藏同信	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

西部证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 2016 年 1 号	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 11 月 11 日
2	华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金招募书摘要 更新 2016 年 1 号	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 11 月 11 日
3	华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 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
4	华泰柏瑞军工主题股票表决结 果暨决议生效的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 9 月 6 日

### 11.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞中国军工主题股票型 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
2	华泰柏瑞中国军工主题股票型 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
3	关于聘任华泰柏瑞中国军工主 题股票型证券投资基金基金经 理的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 8 月 20 日

4	中国军工主题持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 5 日
5	中国军工主题持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 4 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加懒猫金服为旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 3 日
7	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基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 3 日
8	华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金 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
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞军工主题股票基金开展我司柜台直销交易申购、转换费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 7 日
10	华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资、费率优惠并限制大额申购、定投和转换转入等业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 6 日
11	华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金-基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 30 日

## §12 备查文件目录

### 12.1 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

### 12.2 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

### 12.3 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