

# 华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞创新升级混合
基金主代码	000566
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 5 月 6 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	98,509,463.68 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，本基金追求基金资产的长期增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略，精选与经济结构调整与转型主题直接相关，具备长期盈利能力提升的上市公司，力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率×20%+中证新兴产业指数收益率×40%+中债总指数（全价）收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
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

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
--------------------	---

网址	
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	16,851,505.37
本期利润	29,731,046.49
加权平均基金份额本期利润	0.2349
本期基金份额净值增长率	13.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.9136
期末基金资产净值	206,476,968.11
期末基金份额净值	2.096

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

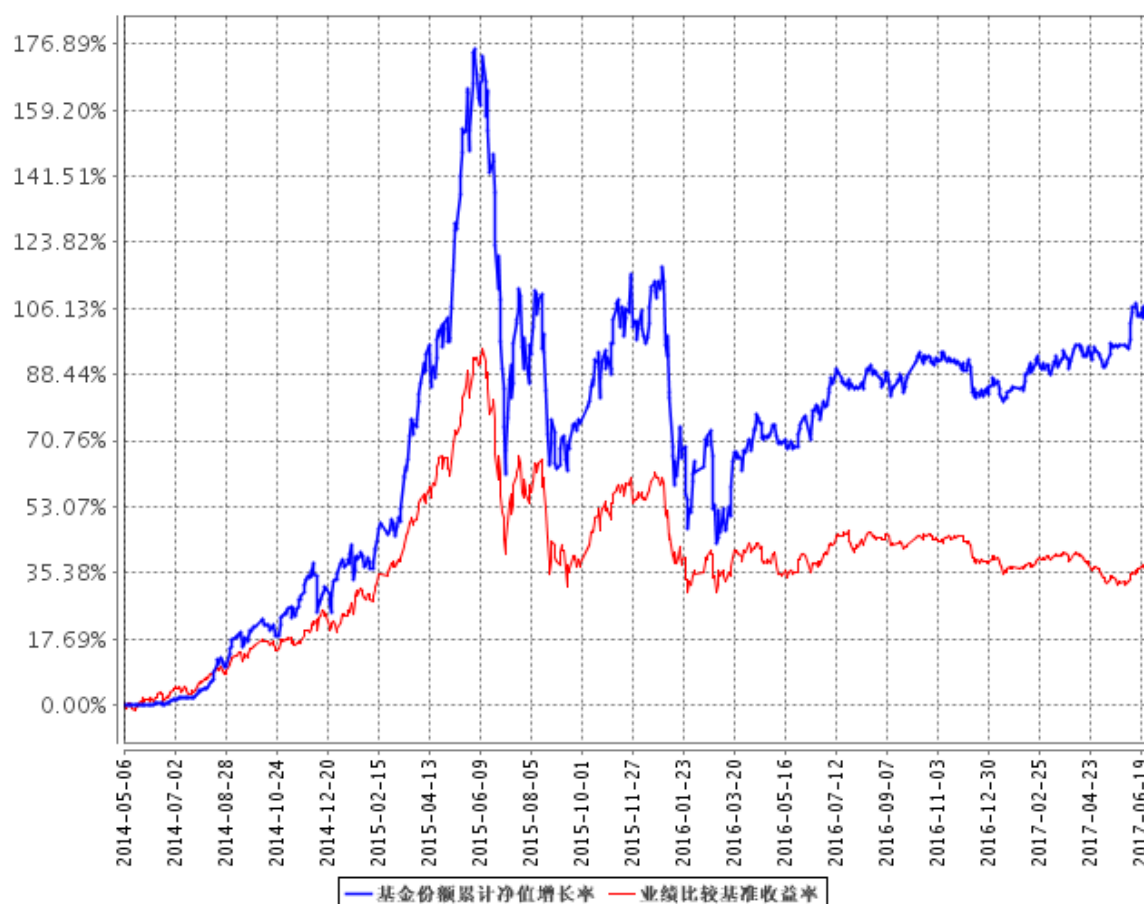
#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.72%	0.91%	4.44%	0.50%	2.28%	0.41%
过去三个月	9.22%	0.76%	-0.17%	0.51%	9.39%	0.25%
过去六个月	13.30%	0.73%	0.33%	0.48%	12.97%	0.25%
过去一年	16.64%	0.75%	-1.39%	0.52%	18.03%	0.23%
过去三年	106.71%	1.93%	33.40%	1.23%	73.31%	0.70%
自基金合同生效起至今	109.60%	1.88%	38.82%	1.21%	70.78%	0.67%

### 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 2014 年 5 月 6 日至 2017 年 6 月 30 日。

2. 按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围的要求，本基金持有的股票占基金资产的比例为 30%–95%，其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%；债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%–70%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会

批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞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、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金。截至 2017 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 916.45 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		
张慧	投资部总监助理、本基金的基金经理	2014年5月6日	-	10	经济学硕士，10年证券从业经历。2007年7月至2010年6月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010年6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，2013年9月起任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理，2014年5月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2015年2月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年1月起任投资部总监助理。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情

况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平，只在少数情况下“存在显著的倾向性”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究表明，交易价差方向没有规律性，即没有明确的利益输送方向。造成少量显著交易价差的原因来自两方面：一是报告期内股票市场的波动幅度较大，为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件；二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异，对证券买卖时点的把握也不同，导致股票买卖存在价差。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 1 次，系因策略调仓需要，后续交易日还有持续卖出。

## 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

17 年上半年市场维持窄幅震荡格局，沪深 300 指数上涨 10.45%，创业板指数下跌 6.45%，中证 500 指数下跌 0.6%。主板和创业板的表现继续维持显著差异，板块内分化也十分明显，龙头公司的表现优于行业中小市值的公司。行业方面，2 季度消费行业的表现相对较好。

自去年年末以来货币政策转向，流动性环境持续维持较为紧张的态势，今年 1 季度在海外资金回流的带动下，指数有小幅反弹。另外，经济复苏的延续对 1 季度市场的风险偏好有一定提升，周期性行业在 1 季度的表现相对亮眼。

但进入 2 季度之后，金融“去杠杆”开始显著加快。一方面，银监会连续发文，要求银行、信托等金融机构对通道业务、多层嵌套、期限错配等违规和风险问题进行自查，对银行同业存单的快速增加也表示关注和需要控制，这些导致市场担心银行委外资金对股票、债券等资产进行



大量赎回和抛售，流动性紧张氛围快速升温。另一方面，6 月份之前央行在公开市场操作上也持紧平衡态度，不断上调 MLF 利率，增加逆回购资金的期限以提高银行间利率成本，导致短端利率快速抬升。

在流动性担忧显著加速的背景下，2 季度市场表现出先抑后扬的走势。自 4 月初至 5 月底，尽管上证综指回落仅 6%，但创业板指下跌超过 10%，多数行业均为负收益。6 月之后，监管部门的态度有所缓和，市场逐渐企稳。

在市场环境较差的情况下，2 季度投资者普遍选择业绩确定性较高的行业。首先是消费类行业受到资金的青睐。高端白酒持续释放提价预期，空调上半年 50% 以上的同比销售增长都带动了消费行业在 2 季度较好的表现。另一类的机会出现在行业龙头上，市场的低波动和低风险偏好下，低估值、大市值类的公司开始获得相对和绝对收益。很多业绩增速一般，但较为平稳，估值相对较低的股票在 5-6 月份表现较好。

本基金在报告期内对仓位方面没有做过多调整，行业结构上向医药、食品饮料、电子这三个行业进行了一定程度的倾斜。目前组合持仓估值控制在今年的 20-25 倍之间，在 2 季度低估值的市场风格下，得到了一定的受益。目前时点，行业配置相对均衡，主要以获取绝对收益思路为主。

净值增长率 13.30%，高于业绩基准 12.97 个百分点。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 2.096 元，本报告期份额净值增长率为 13.30%，同期业绩比较基准增长率为 0.33%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，本基金认为 3 季度的市场环境相对较好，而 4 季度存在较多的不确定性和风险。从流动性上来看，央行表态不紧不松的货币基调，兑现了我们对于流动性边际改善的预期，但我们认为对流动性过于乐观的预期也不可取，4 季度从全球来看仍将面临美联储缩表、加息以及欧洲鹰派的考验。

经济方面，经过 2 季度的库存去化，微观主体在 9-10 月旺季的预期下，回补库存推动了工业品价格的回升，经济数据也好于预期。我们对 3 季度的经济数据较为乐观，但 PPI 在 9-10 月份以后将面临同比基数抬升的情况，名义经济指标或有压力。

市场方面，3 季度仍是反弹较好的时间窗口，预计投资者风险偏好提升的持续度将好于我

们此前的预期。环保高压和冬季限产使得工业品供需紧平衡的时间将长于预期。在投资方向上，周期涨价品行情可能延续到 9 月份。新能源车等部分主题实现了较大涨幅，未来面临基本面的检验。前期抱团的蓝筹白马品种如期分化，相对负收益持续了一段时间，但由于其整体估值不高，绝对收益下行空间有限，有估值优势的品种在等待估值切换的时机。我们维持对指数的上行空间不应过分乐观的看法，在各类资产先后轮动以及两市成交量放大到 5000 多亿水平之后，市场可能再度陷入振幅显著收窄的结构性情中。

操作方面，本基金在消费底仓的配置下，结构趋于均衡化。短期小幅增加投资组合的弹性暴露，并择机兑现这一部分收益。重点将放在挑选具备成长潜力的个股上，近期会较为关注中报超预期的公司和行业，并精选行业未来有空间且估值合理的成长股，不断提升投资组合的性价比，争取创造超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 25%；基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，收益分配基准日可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。截止本报告期末，本基金可分配收益为 90,000,631.11 元。

#### 4.8 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

本基金本报告期内无对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

## § 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”）在华泰柏瑞创新升级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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		17,086,525.02	25,822,990.77

结算备付金		654,372.67	1,540,700.11
存出保证金		103,643.36	237,338.74
交易性金融资产		188,103,987.81	233,607,921.61
其中：股票投资		188,103,987.81	233,607,921.61
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		1,833,258.86	1,883,106.21
应收利息		9,374.18	9,558.40
应收股利		-	-
应收申购款		43,264.02	6,749.98
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		207,834,425.92	263,108,365.82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年6月30日</b>	<b>上年度末 2016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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		141,699.72	339,917.11
应付赎回款		292,988.76	931,494.35
应付管理人报酬		277,522.57	380,318.88
应付托管费		46,253.77	63,386.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		415,061.66	743,108.08
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		183,931.33	372,101.36
负债合计		1,357,457.81	2,830,326.25
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		98,509,463.68	140,699,750.11
未分配利润		107,967,504.43	119,578,289.46
所有者权益合计		206,476,968.11	260,278,039.57
负债和所有者权益总计		207,834,425.92	263,108,365.82

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.096 元，基金份额总额 98,509,463.68 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		33,958,423.62	-115,561,067.07
1.利息收入		126,732.51	394,215.99
其中：存款利息收入		126,697.35	394,215.99
债券利息收入		35.16	-
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）		20,850,564.00	-55,487,941.95
其中：股票投资收益		19,245,178.31	-56,344,820.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益		11,994.84	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,593,390.85	856,878.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		12,879,541.12	-61,056,048.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		101,585.99	588,707.69
<b>减：二、费用</b>		4,227,377.13	7,142,231.10
1.管理人报酬		1,818,319.48	3,128,310.78
2.托管费		303,053.23	521,385.15
3.销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4.交易费用		1,904,124.32	3,287,644.12
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		201,880.10	204,891.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		29,731,046.49	-122,703,298.17
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		29,731,046.49	-122,703,298.17

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	140,699,750.11	119,578,289.46	260,278,039.57
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期净利润)	-	29,731,046.49	29,731,046.49
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)	-42,190,286.43	-41,341,831.52	-83,532,117.95
其中：1.基金申购款	4,926,411.51	4,694,168.18	9,620,579.69
2.基金赎回款	-47,116,697.94	-46,035,999.70	-93,152,697.64
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)	98,509,463.68	107,967,504.43	206,476,968.11
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	295,107,143.56	334,538,734.79	629,645,878.35
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期净利润)	-	-122,703,298.17	-122,703,298.17
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)	-102,225,314.92	-58,014,043.11	-160,239,358.03

其中：1.基金申购款	106,792,401.53	76,562,539.57	183,354,941.10
2.基金赎回款	-209,017,716.45	-134,576,582.68	-343,594,299.13
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）	192,881,828.64	153,821,393.51	346,703,222.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]88号《关于核准华泰柏瑞创新升级混合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《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币267,666,871.23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(2014)第224号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金合同》于2014年5月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为267,739,518.28份基金份额,其中认购资金利息折合72,647.05份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(须符合中国证监会相关规定)。本基金持有的股票占基金资产的比例为30%-95%,其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的80%;债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-70%,其中,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在1年以内的

政府债券。本基金的业绩比较基准为中证 TMT 产业主题指数收益率×20%+中证新兴产业指数收益率×40%+中债总指数（全价）收益率×40%。

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 8 月 26 日批准报出。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.5 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。

## 6.4.6 关联方关系

### 6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	140,211,197.17	11.37%	-	-

#### 6.4.7.1.2 债券交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券交易。

#### 6.4.7.1.3 债券回购交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券回购交易。

#### 6.4.7.1.4 权证交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的权证交易。

#### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券股份有限公司	127,774.05	11.24%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-

#### 6.4.7.2 关联方报酬

##### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,818,319.48
其中：支付销售机构的	476,440.13	537,509.71

客户维护费		
-------	--	--

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 1.5% 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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数。

#### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	303,053.23	521,385.15

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 0.25% 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×0.25% / 当年天数。

#### 6.4.7.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

##### 6.4.7.4.2 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：本报告期及上年度可比期间内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

#### 6.4.7.5 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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	17,086,525.02	115,448.68	85,508,496.19	368,542.78

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

注：本基金报告期末未参与关联方承销证券。

### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.8 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量（股）	期末	期末估值	备注
----	----	----	----	----	----	----	-------	----	------	----

代码	名称	日期	原因	估值单价	日期	开盘单价		成本总额	总额	
300088	长信科技	2017年5月31日	临时停牌	15.75	-	-	1,534	23,536.07	24,160.50	-
300364	中文在线	2017年2月13日	临时停牌	37.28	-	-	514	26,876.54	19,161.92	-
300065	海兰信	2016年12月8日	临时停牌	24.49	-	-	225	4,670.77	5,510.25	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期内无银行间市场债券正回购。

#### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期内无交易所市场债券正回购。

### 6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	188,103,987.81	90.51
	其中：股票	188,103,987.81	90.51
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	17,740,897.69	8.54
7	其他各项资产	1,989,540.42	0.96
8	合计	207,834,425.92	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,268,051.47	0.61
C	制造业	145,851,288.97	70.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	837.40	0.00
E	建筑业	128,420.65	0.06
F	批发和零售业	4,381,307.92	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	42,433.20	0.02
H	住宿和餐饮业	5,606.40	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,718,336.61	1.32
J	金融业	10,981,881.48	5.32
K	房地产业	15,622.80	0.01
L	租赁和商务服务业	6,274,174.72	3.04
M	科学研究和技术服务业	6,627.60	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	16,366,005.61	7.93
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	63,392.98	0.03
S	综合	-	-
	合计	188,103,987.81	91.10

## 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600703	三安光电	582,084	11,467,054.80	5.55
2	000858	五粮液	194,439	10,822,474.74	5.24
3	002507	涪陵榨菜	888,472	9,986,425.28	4.84
4	600056	中国医药	369,441	9,586,993.95	4.64
5	002430	杭氧股份	1,083,785	9,526,470.15	4.61
6	600054	黄山旅游	511,577	8,747,966.70	4.24
7	603816	顾家家居	139,804	8,217,679.12	3.98
8	000423	东阿阿胶	112,300	8,073,247.00	3.91
9	000651	格力电器	190,147	7,828,351.99	3.79
10	002241	歌尔股份	397,800	7,669,584.00	3.71

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www. Huatai-pb.com](http://www.Huatai-pb.com) 网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	15,623,095.30	6.00
2	601398	工商银行	13,192,615.38	5.07
3	600054	黄山旅游	11,639,099.47	4.47
4	601600	中国铝业	11,297,921.00	4.34
5	600703	三安光电	10,977,938.42	4.22
6	600887	伊利股份	10,888,419.00	4.18
7	002507	涪陵榨菜	10,789,319.58	4.15

8	000858	五 粮 液	10,508,581.71	4.04
9	600566	济川药业	9,883,793.10	3.80
10	600056	中国医药	9,641,085.12	3.70
11	300418	昆仑万维	9,531,683.61	3.66
12	600688	上海石化	9,090,088.00	3.49
13	601225	陕西煤业	8,483,270.71	3.26
14	601328	交通银行	8,450,922.41	3.25
15	603816	顾家家居	8,028,489.08	3.08
16	002241	歌尔股份	7,961,162.33	3.06
17	601939	建设银行	7,843,256.20	3.01
18	600518	康美药业	7,559,436.69	2.90
19	000983	西山煤电	7,430,492.76	2.85
20	000423	东阿阿胶	7,426,892.36	2.85
21	600036	招商银行	7,270,294.46	2.79
22	601818	光大银行	7,132,808.79	2.74
23	600029	南方航空	7,010,570.00	2.69
24	002195	二三四五	6,940,736.51	2.67
25	601211	国泰君安	6,861,856.00	2.64
26	600019	宝钢股份	6,663,700.66	2.56
27	000898	鞍钢股份	6,546,574.93	2.52
28	600808	马钢股份	6,534,739.00	2.51
29	002027	分众传媒	6,527,314.58	2.51
30	600104	上汽集团	6,231,054.00	2.39
31	600782	新钢股份	6,206,948.15	2.38
32	601633	长城汽车	6,123,983.21	2.35
33	000709	河钢股份	6,099,329.60	2.34
34	600872	中炬高新	6,045,346.84	2.32
35	000786	北新建材	5,870,740.07	2.26
36	300070	碧水源	5,591,046.80	2.15
37	002078	太阳纸业	5,463,907.00	2.10
38	000739	普洛药业	5,413,810.59	2.08
39	601186	中国铁建	5,412,022.00	2.08
40	002430	杭氧股份	5,295,350.16	2.03
41	000039	中集集团	5,216,644.12	2.00

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细



金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002236	大华股份	19,353,029.76	7.44
2	002239	奥特佳	17,061,109.31	6.56
3	002475	立讯精密	15,716,892.02	6.04
4	002519	银河电子	11,649,829.58	4.48
5	601600	中国铝业	11,433,481.97	4.39
6	600298	安琪酵母	10,140,855.58	3.90
7	600166	福田汽车	10,057,251.14	3.86
8	300232	洲明科技	9,877,835.70	3.80
9	600519	贵州茅台	9,853,798.92	3.79
10	000709	河钢股份	9,378,651.43	3.60
11	601225	陕西煤业	9,222,466.85	3.54
12	002138	顺络电子	9,129,544.89	3.51
13	601398	工商银行	9,054,929.00	3.48
14	000651	格力电器	9,003,158.79	3.46
15	601328	交通银行	8,699,025.00	3.34
16	601939	建设银行	8,000,197.00	3.07
17	600056	中国医药	7,999,966.00	3.07
18	600109	国金证券	7,885,266.25	3.03
19	601377	兴业证券	7,764,545.48	2.98
20	002007	华兰生物	7,685,330.86	2.95
21	600104	上汽集团	7,404,535.43	2.84
22	600036	招商银行	7,398,749.98	2.84
23	601818	光大银行	7,320,090.85	2.81
24	600029	南方航空	7,290,396.10	2.80
25	300418	昆仑万维	7,177,511.76	2.76
26	300115	长盈精密	7,153,524.94	2.75
27	600160	巨化股份	7,125,114.95	2.74
28	000786	北新建材	6,839,619.66	2.63
29	601211	国泰君安	6,733,256.07	2.59
30	002273	水晶光电	6,479,109.43	2.49
31	000501	鄂武商A	6,458,109.59	2.48
32	603868	飞科电器	6,377,481.79	2.45
33	002195	二三四五	6,296,466.60	2.42
34	002415	海康威视	6,089,515.95	2.34
35	600872	中炬高新	6,047,584.21	2.32

36	601633	长城汽车	6,043,535.92	2.32
37	000568	泸州老窖	5,793,714.00	2.23
38	600268	国电南自	5,701,738.77	2.19
39	300070	碧水源	5,684,818.41	2.18
40	000066	中国长城	5,638,514.91	2.17
41	000488	晨鸣纸业	5,474,748.67	2.10
42	600885	宏发股份	5,431,840.38	2.09
43	600511	国药股份	5,338,107.11	2.05
44	601186	中国铁建	5,282,107.09	2.03

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	579,822,690.77
卖出股票收入（成交）总额	657,451,344.00

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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

### 7.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	103,643.36

2	应收证券清算款	1,833,258.86
3	应收股利	-
4	应收利息	9,374.18
5	应收申购款	43,264.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,989,540.42

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
5,275	18,674.78	27,458,492.98	27.87%	71,050,970.70	72.13%

### 8.3 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	522,666.25	0.5300%

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 0~10 万份。  
本基金基金经理持有本开放式基金 50~100 万份。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 5 月 6 日）基金份额总额	267,739,518.28
本报告期期初基金份额总额	140,699,750.11
本报告期基金总申购份额	4,926,411.51
减：本报告期基金总赎回份额	47,116,697.94
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	98,509,463.68

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人及基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	283,654,147.10	23.00%	264,169.92	23.23%	-
长江证券	1	170,041,190.16	13.79%	158,356.71	13.92%	-
华泰证券	3	140,211,197.17	11.37%	127,774.05	11.24%	-
中信建投	3	132,835,728.44	10.77%	121,422.47	10.68%	-
华安证券	2	108,029,452.62	8.76%	98,909.82	8.70%	-
光大证券	2	84,047,720.89	6.81%	76,593.18	6.73%	-
广发证券	2	61,530,459.58	4.99%	57,038.55	5.02%	-
东吴证券	2	60,900,989.75	4.94%	55,499.68	4.88%	-
国泰君安	1	54,298,128.91	4.40%	50,567.78	4.45%	-
东北证券	1	53,860,246.95	4.37%	50,159.73	4.41%	-
兴业证券	1	38,042,063.28	3.08%	34,667.90	3.05%	-
万联证券	2	20,549,350.40	1.67%	18,726.70	1.65%	-
瑞银证券	2	17,488,280.92	1.42%	15,937.29	1.40%	-
恒泰证券	1	7,968,534.64	0.65%	7,421.07	0.65%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-
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	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-
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	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，

并能为基金提供全面的信息服务。

5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	413,030.00	100.00%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-



国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-2-28/2017-6-30	27,458,492.98	-	-	27,458,492.98	27.87
	2	2017-2-28/2017-5-2	26,680,896.48	-	26,680,896.48	-	0.00
个人	-	-	-	-	-	-	-

-	-	-	-	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---	---	---

产品特有风险

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过 20% 的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华泰柏瑞基金管理有限公司  
2017 年 8 月 26 日