

华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

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 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

本基金名称自 2015 年 8 月 6 日起，由“华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞盛世中国混合”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司 2015 年 8 月 6 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旗下部分股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	23
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	58
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.....	59
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	61
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69

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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞盛世中国混合
基金主代码	460001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 4 月 27 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	3,394,842,693.71 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	主要通过股票选择，辅以适度的大类资产配置调整，追求管理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；以债券类资产作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的大类资产配置来降低组合的系统性风险。
业绩比较基准	标普中国 A 股 300 指数×70%+中证全债指数×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	53,715,696.86
本期利润	157,198,469.58
加权平均基金份额本期利润	0.0438
本期加权平均净值利润率	9.99%
本期基金份额净值增长率	10.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	64,986,157.33
期末可供分配基金份额利润	0.0191
期末基金资产净值	1,589,110,480.88
期末基金份额净值	0.4681
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	398.58%

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率基准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.51%	0.90%	4.15%	0.48%	2.36%	0.42%

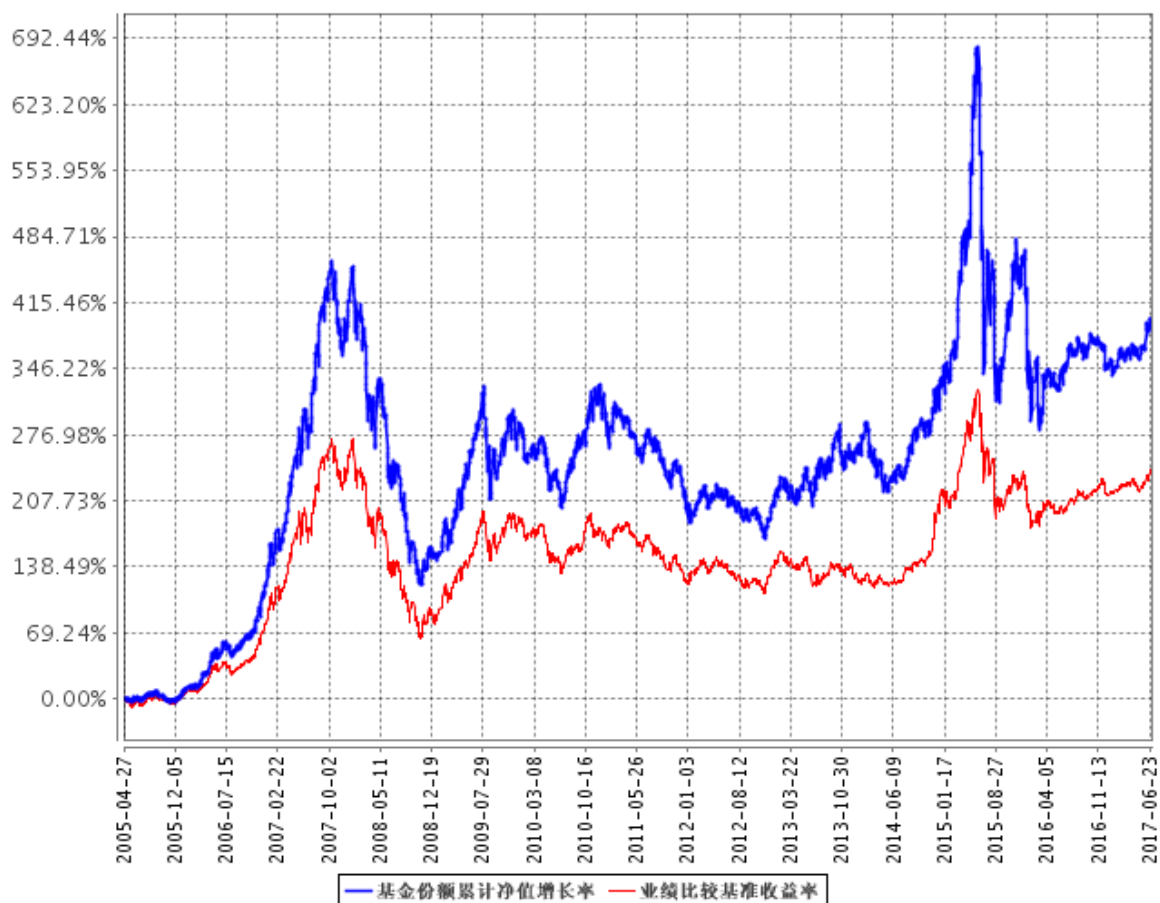
过去三个月	8.23%	0.76%	4.59%	0.45%	3.64%	0.31%
过去六个月	10.54%	0.72%	8.43%	0.41%	2.11%	0.31%
过去一年	11.16%	0.75%	13.11%	0.46%	-1.95%	0.29%
过去三年	45.39%	1.93%	52.39%	1.19%	-7.00%	0.74%
自基金合同 生效起至今	398.58%	1.61%	240.45%	1.25%	158.13%	0.36%

注：本基金的业绩基准由标普中国 A 股 300 指数和中证全债指数按照 70%与 30%之比构建，并每日进行再平衡。

根据本基金的基金管理人于 2015 年 11 月 2 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金业绩比较基准指数更名公告》，自 2015 年 11 月 2 日起，本基金业绩比较基准变更为：标普中国 A 股 300 指数×70%+中证全债指数×30%。

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：图示日期为 2005 年 4 月 27 日至 2017 年 6 月 30 日。

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十三条（二）投资范围、（八）投资组合中规定的各项比例，投资于股票的比例为基金净资产的 60%-90%，债券投资为基金净资产的 0%-40%。

§ 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	2013 年 9 月 16 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》、《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。同时潜在利益输送金额比较小（全部低于基金规模的 0.5%），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。

4.3.2 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长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，监管部门的姿态有所缓和，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 10.54%，高于业绩基准 2.11 个百分点。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.4681 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.54%，业绩比较基准收益率为 8.43%。

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行情中。

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 6 次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的 80%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本期末，基金可供分配利润为 64,986,157.33 元，报告期内基金符合分红条件，于 2017 年 1 月 24 日进行分配，每 10 份基金份额派发现金红利 0.17 元，利润分配合计 62,029,653.73 元，其中现金形式发放总额为 26,553,330.97 元，再投资形式发放总额 35,476,322.76 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”）在对华泰柏瑞盛世中国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：华泰柏瑞盛世中国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	6.4.7.1	113,630,021.05	177,037,637.84
结算备付金		3,847,078.51	7,788,541.10
存出保证金		560,235.22	887,432.95
交易性金融资产	6.4.7.2	1,471,705,896.32	1,413,409,461.03
其中：股票投资		1,412,179,896.32	1,413,409,461.03
基金投资		-	-
债券投资		59,526,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		9,663,587.75	42,400,162.29
应收利息	6.4.7.5	145,111.75	53,762.05
应收股利		-	-
应收申购款		52,237.69	50,910.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,599,604,168.29	1,641,627,908.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,164,810.94	-
应付赎回款		1,239,149.96	1,398,855.23
应付管理人报酬		1,936,662.28	2,124,734.64
应付托管费		322,777.05	354,122.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,555,638.70	3,728,299.90
应交税费		214,950.00	214,950.00
应付利息		-	-
应付利润		-	50,277,454.02
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,059,698.48	1,272,746.80
负债合计		10,493,687.41	59,371,163.07
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,420,635,988.64	1,502,824,140.62
未分配利润	6.4.7.10	168,474,492.24	79,432,604.40
所有者权益合计		1,589,110,480.88	1,582,256,745.02
负债和所有者权益总计		1,599,604,168.29	1,641,627,908.09

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.4681 元，基金份额总额 3,394,842,693.71 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞盛世中国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
一、收入		182,329,508.92	-425,211,622.56
1.利息收入		938,867.03	3,075,945.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	828,071.14	2,883,958.83
债券利息收入		68,510.76	144,934.43
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		42,285.13	47,051.87
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		77,768,116.74	-216,878,066.37
其中：股票投资收益	6.4.7.12	67,198,726.71	-227,430,846.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	78,280.56	5,608,530.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	10,491,109.47	4,944,250.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	103,482,772.72	-221,839,841.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	139,752.43	10,430,339.98
减：二、费用		25,131,039.34	26,932,983.66
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,685,180.78	14,405,660.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,947,530.13	2,400,943.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	11,261,902.29	9,890,674.35
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	6.4.7.20	236,426.14	235,705.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		157,198,469.58	-452,144,606.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		157,198,469.58	-452,144,606.22

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞盛世中国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）	1,502,824,140.62	79,432,604.40	1,582,256,745.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	157,198,469.58	157,198,469.58
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）	-82,188,151.98	-6,126,928.01	-88,315,079.99
其中：1.基金申购款	75,632,895.73	2,143,991.24	77,776,886.97
2.基金赎回款	-157,821,047.71	-8,270,919.25	-166,091,966.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-62,029,653.73	-62,029,653.73

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）	1,420,635,988.64	168,474,492.24	1,589,110,480.88
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）	999,308,449.31	1,299,801,108.85	2,299,109,558.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-452,144,606.22	-452,144,606.22
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）	563,222,300.92	5,754,926,379.79	6,318,148,680.71
其中：1.基金申购款	8,434,446,283.11	6,252,745,598.29	14,687,191,881.40
2.基金赎回款	-7,871,223,982.19	-497,819,218.50	-8,369,043,200.69
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）	-	-6,476,736,915.56	-6,476,736,915.56
五、期末所有者权益（基金净值）	1,562,530,750.23	125,845,966.86	1,688,376,717.09

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

华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金(原友邦华泰盛世中国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”)证监基金字[2005]第 19 号《关于同意友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金设立的批复》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《友邦华泰盛世中国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 900,348,752.84 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(2005)第 48 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》于 2005 年 4 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 900,519,775.77 份基金份额,其中认购资金利息折合 171,022.93 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。

根据本基金招募说明书和《友邦华泰基金管理有限公司关于友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定,本基金于 2007 年 9 月 3 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 2.390029438,并于 2007 年 9 月 4 日进行了变更登记。因基金管理人更名,经中国证监会批准,本基金名称自 2010 年 4 月 30 日起由“友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金”,基金简称为“华泰柏瑞盛世中国股票”,基金代码保持不变。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》的规定,华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞盛世中国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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票的比例为基金净资产的 60%-90%,债券投资为基金净资产的 0%-40%。此外,本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的资产比例合计不低于基金净资产的 5%。自基金合同生效日至 2015 年 11 月 2 日本基金的业绩比较基准为:中信标普 300 指数×70%+中信国债指数×30%。根据本基金的基金管理人于 2015 年 11 月

2 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金业绩比较基准指数更名公告》，自 2015 年 11 月 2 日起，本基金业绩比较基准变更为：标普中国 A 股 300 指数×70%+中证全债指数×30%。

本财务报表由本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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	113,630,021.05
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	113,630,021.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,324,065,531.46	1,412,179,896.32	88,114,364.86	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	59,475,070.00	59,526,000.00	50,930.00
	合计	59,475,070.00	59,526,000.00	50,930.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,383,540,601.46	1,471,705,896.32	88,165,294.86	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末，本基金买入返售金融资产余额为 0。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	35,017.44
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	1,730.12
应收债券利息	108,112.09
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	252.10
合计	145,111.75

6.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,554,531.71
银行间市场应付交易费用	1,106.99
合计	2,555,638.70

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	1,425.40
预提费用	308,273.08
合计	1,059,698.48

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,591,244,889.13	1,502,824,140.62
本期申购	180,739,452.92	75,632,895.73
本期赎回(以“-”号填列)	-377,141,648.34	-157,821,047.71
- 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	3,394,842,693.71	1,420,635,988.64

注： 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	73,714,262.83	5,718,341.57	79,432,604.40
本期利润	53,715,696.86	103,482,772.72	157,198,469.58
本期基金份额交易	-414,148.63	-5,712,779.38	-6,126,928.01

产生的变动数			
其中：基金申购款	1,330,636.04	813,355.20	2,143,991.24
基金赎回款	-1,744,784.67	-6,526,134.58	-8,270,919.25
本期已分配利润	-62,029,653.73	-	-62,029,653.73
本期末	64,986,157.33	103,488,334.91	168,474,492.24

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	771,504.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	50,755.86
其他	5,810.54
合计	828,071.14

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	3,786,572,852.94
减：卖出股票成本总额	3,719,374,126.23
买卖股票差价收入	67,198,726.71

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30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	78,280.56
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	78,280.56

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,695,510.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,617,000.00
减：应收利息总额	229.44
买卖债券差价收入	78,280.56

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	10,491,109.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,491,109.47

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	103,482,772.72

——股票投资	103,431,842.72
——债券投资	50,930.00
——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	103,482,772.72

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	138,740.17
转换费收入	1,012.26
合计	139,752.43

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

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	11,261,452.29
银行间市场交易费用	450.00
合计	11,261,902.29

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	9,553.06
银行间账户服务费	18,600.00
合计	236,426.14

6.4.7.21 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：1、关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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		上年度可比期间 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	975,740,420.17	13.19%	0.00	0.00%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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	889,191.51	13.04%	0.00	0.00%
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	0.00	0.00%	0.00	0.00%

注：上述佣金按股票交易量的千分之一计算，以扣除证管费和经手费后的净额列示。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。

关联方的佣金比率和计算方式与非关联方一致。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	11,685,180.78	14,405,660.16
其中：支付销售机构的客户维护费	1,997,820.27	2,601,909.60

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	1,947,530.13	2,400,943.39

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。

6.4.10.2.3 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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及 2016 年度，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期及 2016 年度，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 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

	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	113,630,021.05	771,504.74	418,228,191.44	2,829,325.09

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2017 年 1 月 24 日	2017 年 1 月 24 日	0.1700	26,553,330.97	35,476,322.76	62,029,653.73	
合计	-	-	0.1700	26,553,330.97	35,476,322.76	62,029,653.73	

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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	备注
002879	长缆	2017 年	2017	新股流	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-

	科技	6月5日	年7月7日	通受限						
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	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票	停牌	停	期末	复牌	复牌	数量（股）	期末	期末估值总	备注
------	----	----	---	----	----	----	-------	----	-------	----

码	名称	日期	牌 原 因	估值单 价	日期	开盘单价		成本总额	额	
600795	国电 电力	2017 年 6 月 5 日	临 时 停 牌	3.60	-	-	111,400	337,541.05	401,040.00	-
300088	长信 科技	2017 年 5 月 31 日	临 时 停 牌	15.75	-	-	8,709	133,656.50	137,166.75	-
300364	中文 在线	2017 年 2 月 13 日	临 时 停 牌	37.28	-	-	2,335	122,283.95	87,048.80	-
300065	海兰 信	2016 年 12 月 8 日	临 时 停 牌	24.49	2017 年 7 月 6 日	23.07	1,714	32,987.49	41,975.86	-

注：1、本基金截至 2017 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末，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余额 0 元，无债券作为质押。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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 0.00 元。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为零。(2016 年 12 月 31 日：同)

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	59,526,000.00	-
合计	59,526,000.00	-

注：未评级的债券包括国债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险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，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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，其余均能及时变现。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。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为三个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有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、结算备付金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	113,630,021.05	-	-	-	-	-	113,630,021.05
结算备付金	3,847,078.51	-	-	-	-	-	3,847,078.51
存出保证金	560,235.22	-	-	-	-	-	560,235.22
交易性金融资产	-	59,526,000.00	-	-	-	1,412,179,896.32	1,471,705,896.32
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,663,587.75	9,663,587.75
应收利息	-	-	-	-	-	145,111.75	145,111.75
应收申购款	-	-	-	-	-	52,237.69	52,237.69
资产总计	118,037,334.78	59,526,000.00	-	-	-	1,422,040,833.51	1,599,604,168.29
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,164,810.94	3,164,810.94
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,239,149.96	1,239,149.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,936,662.28	1,936,662.28
应付托管费	-	-	-	-	-	322,777.05	322,777.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,555,638.70	2,555,638.70
应交税费	-	-	-	-	-	214,950.00	214,950.00
其他负债	-	-	-	-	-	1,059,698.48	1,059,698.48
负债总计	-	-	-	-	-	10,493,687.41	10,493,687.41
利率敏感度缺口	118,037,334.78	59,526,000.00	-	-	-	1,411,547,146.10	1,589,110,480.88
上年度末 2016年12月	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

31 日							
资产							
银行存款	177,037,637.84	-	-	-	-	-	177,037,637.84
结算备付金	7,788,541.10	-	-	-	-	-	7,788,541.10
存出保证金	887,432.95	-	-	-	-	-	887,432.95
交易性金融资 产	-	-	-	-	-	-1,413,409,461.03	1,413,409,461.03
应收证券清算 款	-	-	-	-	-	42,400,162.29	42,400,162.29
应收利息	-	-	-	-	-	53,762.05	53,762.05
应收申购款	-	-	-	-	-	50,910.83	50,910.83
资产总计	185,713,611.89	-	-	-	-	-1,455,914,296.20	1,641,627,908.09
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,398,855.23	1,398,855.23
应付管理人报 酬	-	-	-	-	-	2,124,734.64	2,124,734.64
应付托管费	-	-	-	-	-	354,122.48	354,122.48
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,728,299.90	3,728,299.90
应交税费	-	-	-	-	-	214,950.00	214,950.00
应付利润	-	-	-	-	-	50,277,454.02	50,277,454.02
其他负债	-	-	-	-	-	1,272,746.80	1,272,746.80
负债总计	-	-	-	-	-	59,371,163.07	59,371,163.07
利率敏感度缺 口	185,713,611.89	-	-	-	-	-1,396,543,133.13	1,582,256,745.02

注：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：截至 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.75% (2016 年 12 月 31 日：0%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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；以债券类资产作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的大类资产配置来降低组合的系统性风险。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投资比例为基金净资产的 60%-90%，债券、现金及其它短期金融工具为 0%-40%。此外，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的资产比例合计不低于基金净资产的 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,412,179,896.32	88.87	1,413,409,461.03	89.33
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	1,412,179,896.32	88.87	1,413,409,461.03	89.33

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”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：人民币万元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上涨 5%	增加约 8,127.49	增加约 8,667
	沪深 300 指数下跌 5%	减少约 8,127.49	下降约 8,667

6.4.14 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	1,412,179,896.32	88.28
	其中：股票	1,412,179,896.32	88.28
2	固定收益投资	59,526,000.00	3.72
	其中：债券	59,526,000.00	3.72
	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	117,477,099.56	7.34
7	其他各项资产	10,421,172.41	0.65
8	合计	1,599,604,168.29	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	9,469,546.65	0.60
C	制造业	1,095,914,805.58	68.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,210,862.77	0.08

E	建筑业	490,076.63	0.03
F	批发和零售业	31,724,724.44	2.00
G	交通运输、仓储和邮政业	289,256.92	0.02
H	住宿和餐饮业	37,165.76	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,097,419.69	1.33
J	金融业	81,432,770.59	5.12
K	房地产业	81,369.42	0.01
L	租赁和商务服务业	46,469,157.44	2.92
M	科学研究和技术服务业	61,009.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	123,616,377.01	7.78
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	285,354.22	0.02
S	综合	-	-
	合计	1,412,179,896.32	88.87

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	600703	三安光电	4,384,521	86,375,063.70	5.44
2	000858	五粮液	1,491,065	82,992,677.90	5.22
3	002507	涪陵榨菜	6,712,463	75,448,084.12	4.75

4	600056	中国医药	2,842,507	73,763,056.65	4.64
5	002430	杭氧股份	8,263,809	72,638,881.11	4.57
6	600054	黄山旅游	3,873,058	66,229,291.80	4.17
7	603816	顾家家居	1,071,960	63,009,808.80	3.97
8	000423	东阿阿胶	848,800	61,020,232.00	3.84
9	000651	格力电器	1,456,300	59,955,871.00	3.77
10	002241	歌尔股份	3,036,835	58,550,178.80	3.68
11	000826	启迪桑德	1,631,768	57,307,692.16	3.61
12	600887	伊利股份	2,568,979	55,464,256.61	3.49
13	600566	济川药业	1,351,913	51,413,251.39	3.24
14	002027	分众传媒	3,377,119	46,469,157.44	2.92
15	300232	洲明科技	2,155,058	34,480,928.00	2.17
16	601398	工商银行	6,340,532	33,287,793.00	2.09
17	600688	上海石化	4,929,099	32,581,344.39	2.05
18	601601	中国太保	935,700	31,692,159.00	1.99
19	600518	康美药业	1,439,058	31,285,120.92	1.97
20	000963	华东医药	621,240	30,875,628.00	1.94
21	000739	普洛药业	4,053,026	29,749,210.84	1.87
22	600808	马钢股份	7,317,643	25,904,456.22	1.63
23	600782	新钢股份	6,689,900	24,418,135.00	1.54
24	600019	宝钢股份	3,623,390	24,312,946.90	1.53
25	300418	昆仑万维	885,195	20,244,409.65	1.27
26	603517	绝味食品	543,629	18,956,343.23	1.19
27	002222	福晶科技	1,252,972	17,879,910.44	1.13
28	002460	赣锋锂业	364,100	16,839,625.00	1.06
29	600062	华润双鹤	612,780	16,808,555.40	1.06
30	000999	华润三九	526,122	16,704,373.50	1.05
31	002466	天齐锂业	299,500	16,277,825.00	1.02

32	601318	中国平安	313,200	15,537,852.00	0.98
33	002436	兴森科技	2,437,000	15,353,100.00	0.97
34	000983	西山煤电	1,028,955	9,023,935.35	0.57
35	000898	鞍钢股份	1,532,215	8,672,336.90	0.55
36	002139	拓邦股份	737,400	7,941,798.00	0.50
37	300136	信维通信	116,932	4,679,618.64	0.29
38	002078	太阳纸业	325,087	2,389,389.45	0.15
39	600166	福田汽车	412,398	1,171,210.32	0.07
40	600519	贵州茅台	1,542	727,592.70	0.05
41	600027	华电国际	126,293	609,995.19	0.04
42	601607	上海医药	19,504	563,275.52	0.04
43	300115	长盈精密	19,203	560,343.54	0.04
44	600298	安琪酵母	18,250	472,127.50	0.03
45	002273	水晶光电	20,725	427,556.75	0.03
46	600885	宏发股份	10,317	411,545.13	0.03
47	600160	巨化股份	33,638	404,665.14	0.03
48	600795	国电电力	111,400	401,040.00	0.03
49	002415	海康威视	11,706	378,103.80	0.02
50	603868	飞科电器	6,059	374,688.56	0.02
51	600585	海螺水泥	15,921	361,884.33	0.02
52	600872	中炬高新	19,004	347,773.20	0.02
53	600479	千金药业	19,505	282,237.35	0.02
54	600196	复星医药	8,714	270,046.86	0.02
55	002475	立讯精密	9,017	263,657.08	0.02
56	300207	欣旺达	22,002	259,403.58	0.02
57	600803	新奥股份	18,200	250,068.00	0.02
58	002353	杰瑞股份	13,700	216,734.00	0.01
59	600685	中船防务	7,500	205,350.00	0.01

60	300336	新文化	12,827	198,305.42	0.01
61	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.01
62	600886	国投电力	23,481	185,499.90	0.01
63	300197	铁汉生态	13,950	185,256.00	0.01
64	002425	凯撒文化	20,203	184,655.42	0.01
65	600188	兖州煤业	14,500	177,480.00	0.01
66	000971	高升控股	10,032	168,437.28	0.01
67	000568	泸州老窖	3,308	167,318.64	0.01
68	601288	农业银行	47,000	165,440.00	0.01
69	600525	长园集团	12,020	163,351.80	0.01
70	601333	广深铁路	36,101	163,176.52	0.01
71	601668	中国建筑	16,312	157,900.16	0.01
72	300036	超图软件	9,557	156,256.95	0.01
73	300316	晶盛机电	12,000	149,880.00	0.01
74	002304	洋河股份	1,603	139,156.43	0.01
75	601328	交通银行	22,500	138,600.00	0.01
76	300088	长信科技	8,709	137,166.75	0.01
77	002410	广联达	7,213	135,604.40	0.01
78	600348	阳泉煤业	20,000	135,600.00	0.01
79	600858	银座股份	15,671	129,442.46	0.01
80	002142	宁波银行	6,600	127,380.00	0.01
81	600029	南方航空	14,492	126,080.40	0.01
82	000060	中金岭南	11,136	124,723.20	0.01
83	002174	游族网络	3,888	123,482.88	0.01
84	601225	陕西煤业	16,800	118,776.00	0.01
85	000333	美的集团	2,621	112,807.84	0.01
86	601009	南京银行	10,000	112,100.00	0.01
87	000488	晨鸣纸业	7,974	102,864.60	0.01

88	600036	招商银行	4,195	100,302.45	0.01
89	300166	东方国信	7,040	94,547.20	0.01
90	601689	拓普集团	2,740	91,762.60	0.01
91	601012	隆基股份	5,160	88,236.00	0.01
92	002279	久其软件	7,020	88,101.00	0.01
93	300364	中文在线	2,335	87,048.80	0.01
94	603989	艾华集团	2,064	80,991.36	0.01
95	300070	碧水源	4,257	79,393.05	0.00
96	600104	上汽集团	2,527	78,463.35	0.00
97	000930	中粮生化	6,963	75,061.14	0.00
98	600826	兰生股份	4,100	74,210.00	0.00
99	601818	光大银行	17,213	69,712.65	0.00
100	300113	顺网科技	2,559	68,837.10	0.00
101	002616	长青集团	5,562	62,906.22	0.00
102	603698	航天工程	2,421	61,009.20	0.00
103	300078	思创医惠	5,146	55,216.58	0.00
104	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
105	002236	大华股份	2,078	47,399.18	0.00
106	600507	方大特钢	5,500	46,915.00	0.00
107	002094	青岛金王	2,198	46,883.34	0.00
108	601186	中国铁建	3,853	46,351.59	0.00
109	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
110	600048	保利地产	4,510	44,964.70	0.00
111	601600	中国铝业	9,800	44,296.00	0.00
112	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
113	300065	海兰信	1,714	41,975.86	0.00
114	002277	友阿股份	6,440	41,538.00	0.00
115	000501	鄂武商 A	2,201	40,630.46	0.00

116	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.00
117	300296	利亚德	2,088	39,254.40	0.00
118	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
119	002050	三花智控	2,291	37,389.12	0.00
120	600258	首旅酒店	1,591	37,165.76	0.00
121	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
122	002140	东华科技	2,098	27,588.70	0.00
123	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
124	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
125	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
126	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
127	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
128	600491	龙元建设	1,930	20,708.90	0.00
129	000752	西藏发展	1,601	19,980.48	0.00
130	001979	招商蛇口	924	19,736.64	0.00
131	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
132	002271	东方雨虹	494	18,327.40	0.00
133	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
134	600376	首开股份	1,457	16,668.08	0.00
135	601233	桐昆股份	1,172	16,243.92	0.00
136	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
137	002281	光迅科技	660	14,665.20	0.00
138	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
139	600011	华能国际	1,952	14,327.68	0.00
140	603833	欧派家居	129	14,171.94	0.00
141	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
142	002310	东方园林	807	13,493.04	0.00
143	601166	兴业银行	800	13,488.00	0.00

144	000786	北新建材	841	13,321.44	0.00
145	002068	黑猫股份	1,219	10,251.79	0.00
146	300302	同有科技	561	10,103.61	0.00
147	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
148	002155	湖南黄金	1,000	9,570.00	0.00
149	300370	安控科技	1,920	9,331.20	0.00
150	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
151	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
152	600547	山东黄金	110	3,182.30	0.00
153	002322	理工环科	132	3,162.72	0.00
154	600801	华新水泥	178	1,696.34	0.00
155	603609	禾丰牧业	133	1,271.48	0.00
156	600489	中金黄金	100	1,003.00	0.00

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	108,014,328.85	6.83
2	601398	工商银行	105,258,599.70	6.65
3	600054	黄山旅游	78,922,009.59	4.99
4	600703	三安光电	74,811,811.68	4.73
5	002507	涪陵榨菜	73,430,814.86	4.64
6	600887	伊利股份	70,698,144.75	4.47
7	601600	中国铝业	70,353,375.61	4.45
8	000858	五粮液	70,307,485.90	4.44

9	600056	中国医药	67,730,479.45	4.28
10	600566	济川药业	63,676,135.38	4.02
11	300418	昆仑万维	62,100,548.41	3.92
12	600688	上海石化	60,689,496.66	3.84
13	002241	歌尔股份	59,032,756.87	3.73
14	603816	顾家家居	56,065,471.29	3.54
15	601328	交通银行	52,072,595.30	3.29
16	000423	东阿阿胶	49,885,633.80	3.15
17	601939	建设银行	48,342,385.00	3.06
18	600029	南方航空	47,512,479.00	3.00
19	600518	康美药业	47,118,201.38	2.98
20	002430	杭氧股份	46,784,535.01	2.96
21	000983	西山煤电	46,502,866.00	2.94
22	000826	启迪桑德	45,597,051.14	2.88
23	002195	二三四五	45,029,258.08	2.85
24	600036	招商银行	44,209,452.70	2.79
25	601818	光大银行	44,013,123.99	2.78
26	002027	分众传媒	43,629,122.81	2.76
27	600019	宝钢股份	43,544,555.21	2.75
28	600104	上汽集团	42,172,002.06	2.67
29	000898	鞍钢股份	40,424,365.35	2.55
30	600808	马钢股份	40,293,163.52	2.55
31	601225	陕西煤业	40,243,764.68	2.54
32	600872	中炬高新	38,930,969.83	2.46
33	300070	碧水源	38,029,875.20	2.40
34	000709	河钢股份	36,959,624.86	2.34
35	000739	普洛药业	35,266,407.08	2.23
36	002078	太阳纸业	34,811,559.13	2.20

37	000415	渤海金控	32,575,088.11	2.06
38	002415	海康威视	32,501,621.38	2.05
39	601186	中国铁建	31,952,968.55	2.02
40	601318	中国平安	31,758,386.00	2.01

注：不考虑相关交易费用。

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	129,689,653.23	8.20
2	002475	立讯精密	108,497,146.11	6.86
3	002239	奥特佳	79,004,644.14	4.99
4	002519	银河电子	76,232,283.21	4.82
5	601398	工商银行	74,186,676.30	4.69
6	601600	中国铝业	71,166,902.28	4.50
7	002138	顺络电子	64,528,010.90	4.08
8	600298	安琪酵母	61,784,572.43	3.90
9	600519	贵州茅台	59,501,887.11	3.76
10	600166	福田汽车	59,381,984.98	3.75
11	000709	河钢股份	58,180,493.01	3.68
12	000651	格力电器	56,526,456.55	3.57
13	300232	洲明科技	55,525,058.15	3.51
14	601328	交通银行	53,337,167.16	3.37
15	600056	中国医药	51,533,679.47	3.26
16	600104	上汽集团	50,928,241.76	3.22
17	002007	华兰生物	50,237,174.50	3.18
18	600029	南方航空	49,389,585.98	3.12

19	601939	建设银行	49,177,200.14	3.11
20	601377	兴业证券	47,307,848.43	2.99
21	601818	光大银行	45,286,215.05	2.86
22	600036	招商银行	44,907,368.59	2.84
23	601225	陕西煤业	44,526,611.34	2.81
24	300418	昆仑万维	43,583,863.77	2.75
25	600160	巨化股份	41,955,513.99	2.65
26	603868	飞科电器	41,633,934.86	2.63
27	002273	水晶光电	40,422,589.27	2.55
28	002195	二三四五	40,104,404.16	2.53
29	000501	鄂武商A	39,335,799.00	2.49
30	002415	海康威视	38,976,363.25	2.46
31	600872	中炬高新	38,896,882.16	2.46
32	300070	碧水源	38,743,486.55	2.45
33	600109	国金证券	38,501,828.66	2.43
34	600885	宏发股份	38,264,324.32	2.42
35	600511	国药股份	37,091,827.19	2.34
36	600268	国电南自	35,830,272.23	2.26
37	000066	中国长城	35,198,442.61	2.22
38	300115	长盈精密	34,779,435.57	2.20
39	000488	晨鸣纸业	33,834,604.36	2.14
40	000568	泸州老窖	32,505,963.08	2.05
41	000415	渤海金控	32,018,908.76	2.02

注：不考虑相关交易费用。

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	3,614,712,718.80
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	3,786,572,852.94
--------------	------------------

注：不考虑相关交易费用。

7.5 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	59,526,000.00	3.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,526,000.00	3.75

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

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	179927	17 贴现国债 27	600,000	59,526,000.00	3.75

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

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。

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	560,235.22

2	应收证券清算款	9,663,587.75
3	应收股利	-
4	应收利息	145,111.75
5	应收申购款	52,237.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,421,172.41

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
172,144	19,720.95	217,313,020.01	6.40%	3,177,529,673.70	93.60%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,257.95	0.0001%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本开放式基金。

本基金基金经理未持有本开放式基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005年4月27日）基金份额总额	900,519,775.77
本报告期期初基金份额总额	3,591,244,889.13
本报告期基金总申购份额	180,739,452.92
减：本报告期基金总赎回份额	377,141,648.34
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	3,394,842,693.71

§ 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，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘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

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
银河证券	1	11,720,134,142.20	23.25%	1,601,959.51	23.49%	-
华泰证券	2	975,740,420.17	13.19%	889,191.51	13.04%	-
长江证券	1	909,181,714.95	12.29%	846,717.34	12.42%	-
中信建投	3	819,376,251.01	11.08%	749,176.09	10.99%	-
华安证券	2	626,104,906.35	8.46%	573,518.44	8.41%	-
光大证券	2	520,604,146.01	7.04%	474,427.98	6.96%	-
东吴证券	2	381,984,521.27	5.16%	348,102.93	5.11%	-
广发证券	2	372,625,738.99	5.04%	345,208.59	5.06%	-
东北证券	1	337,673,161.71	4.57%	314,473.99	4.61%	-
国泰君安	1	318,869,751.04	4.31%	296,963.60	4.36%	-
兴业证券	1	233,388,778.54	3.16%	212,688.21	3.12%	-
瑞银证券	2	123,202,961.19	1.67%	112,275.05	1.65%	-
恒泰证券	1	57,986,700.95	0.78%	54,002.96	0.79%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	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	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

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为，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。

3、本报告期内，基金管理人代表基金新增租用了湘财证券股份有限公司的专用交易单元，国元证券有限责任公司的专用交易单元和东吴证券股份有限公司的专用交易单元，国海证券股份有限公司的专用交易单元，国联证券股份有限公司的专用交易单元。

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	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	2,695,510.00	100.00%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 24 日
2	华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 29 日
3	华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 29 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加江苏银行为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 7 日
5	华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金 2016 年第二次分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 20 日
6	华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 19 日

§ 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日