

华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资 基金 2017 年年度报告

2017 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：2018 年 3 月 28 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 2018 年 3 月 27 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（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 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

| | |
|----------------------------------------------|-----------|
| §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 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 其他指标..... | 9 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况..... | 9 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 15 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 16 |
| 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..... | 17 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 17 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 17 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 18 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 19 |
| 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..... | 19 |
| 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..... | 19 |
| §5 托管人报告 | 20 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 20 |
| 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..... | 20 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 20 |
| §6 审计报告 | 21 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 21 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 21 |
| §7 年度财务报表 | 24 |
| 7.1 资产负债表..... | 24 |
| 7.2 利润表..... | 25 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 26 |
| 7.4 报表附注..... | 27 |
| §8 投资组合报告 | 56 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 56 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 56 |
| 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..... | 57 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 62 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 63 |

| | |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 | 64 |
| 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 | 64 |
| 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 | 64 |
| 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 | 64 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 64 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 65 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 65 |
| §9 基金份额持有人信息..... | 67 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 67 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 67 |
| 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 | 67 |
| §10 开放式基金份额变动..... | 68 |
| § 11 重大事件揭示..... | 69 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 69 |
| 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 | 69 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 69 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 69 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 69 |
| 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 | 69 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 69 |
| 11.8 其他重大事件 | 73 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息..... | 77 |
| 12.1 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 | 77 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 77 |
| §13 备查文件目录..... | 78 |
| 13.1 备查文件目录 | 78 |
| 13.2 存放地点 | 78 |
| 13.3 查阅方式 | 78 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------------|
| 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 | 500,693,656.32份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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 | 中证军工指数收益率×80%+银行人民币活期存款利率（税后）×20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，预期收益和风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 |

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 | 陈四清 |

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 | http://www.huatai-pb.com |
| 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） | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 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 | 2017 年 | 2016 年 9 月 2 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日 |
| 本期已实现收益 | 25,499,858.63 | 8,438,802.54 |
| 本期利润 | 45,152,963.68 | -365,906.73 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0785 | -0.0004 |
| 本期加权平均净值利润率 | 7.46% | -0.04% |
| 本期基金份额净值增长率 | 8.15% | 1.31% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末 | 2016 年末 |
| 期末可供分配利润 | 34,188,981.18 | 13,150,083.47 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0683 | 0.0131 |
| 期末基金资产净值 | 548,593,222.12 | 1,014,560,077.78 |
| 期末基金份额净值 | 1.0957 | 1.0131 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2017 年末 | 2016 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 9.57% | 1.31% |

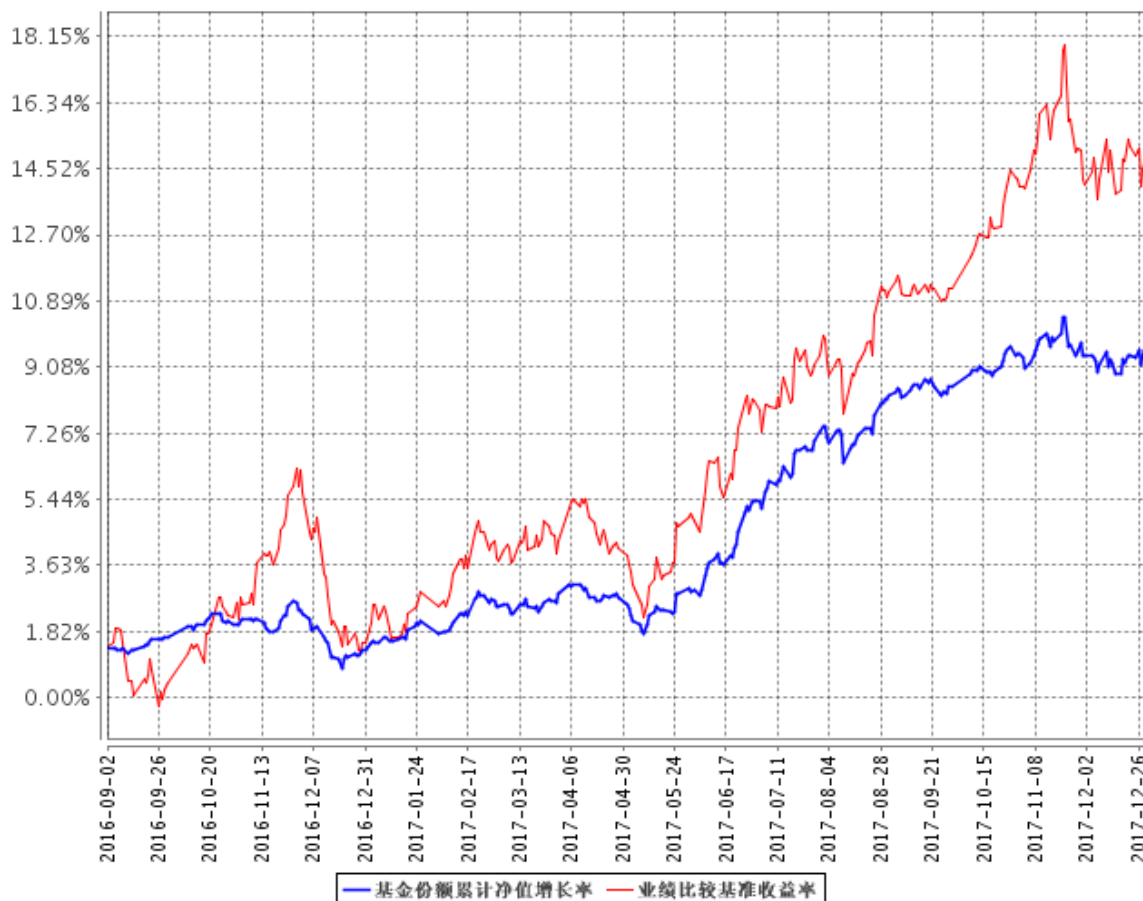
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.96% | 0.20% | 3.10% | 0.48% | -2.14% | -0.28% |
| 过去六个月 | 3.96% | 0.19% | 6.04% | 0.42% | -2.08% | -0.23% |
| 过去一年 | 8.15% | 0.17% | 12.98% | 0.38% | -4.83% | -0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.57% | 0.14% | 14.68% | 0.75% | -5.11% | -0.61% |

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

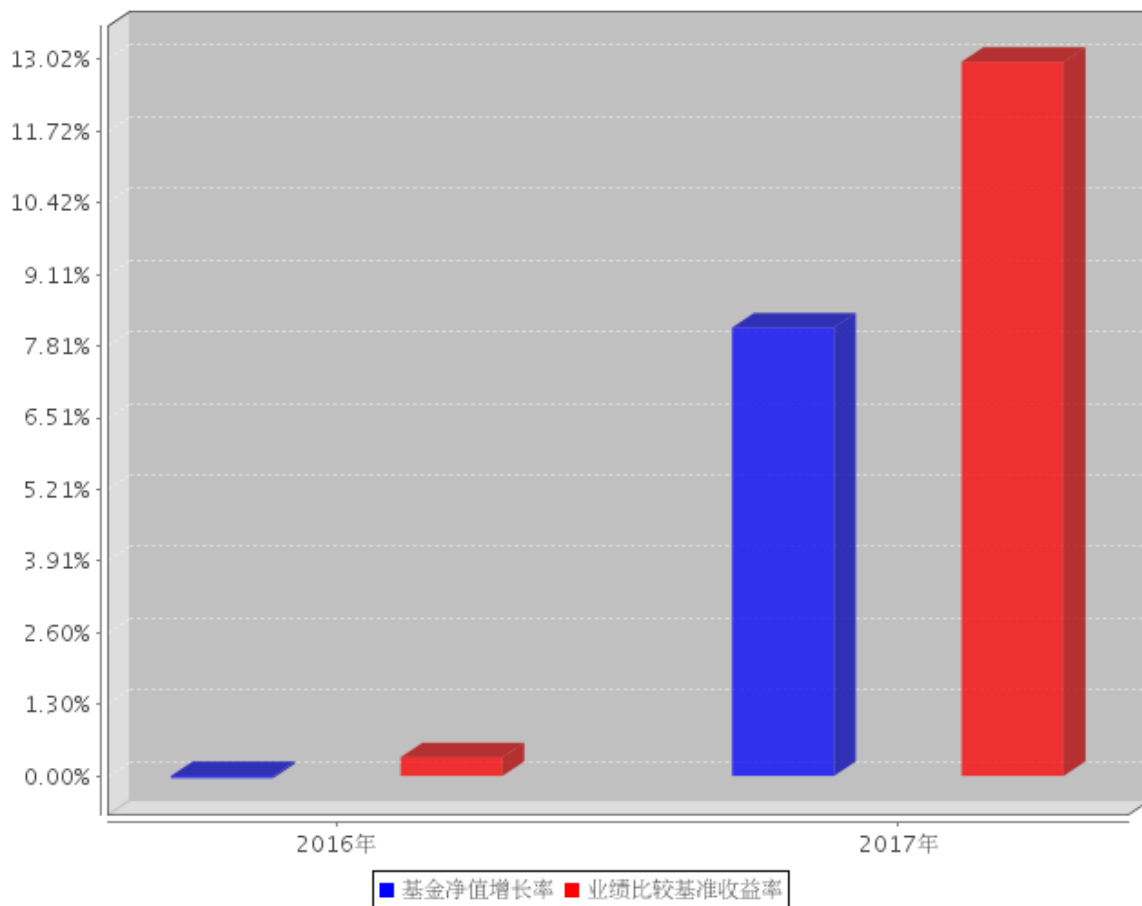
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为基金转型日（2016年9月2日）至2017年12月31日。

3.2.3 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：2016 年为基金转型日（2016 年 9 月 2 日）至 2016 年 12 月 31 日数据。

3.3 其他指标

注：无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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发起式证券投资基金、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、华泰柏瑞亨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、华泰柏瑞嘉利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、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金。截至 2017 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 826.34 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 | | |
| 罗远航 | 本基金的基金经理 | 2017 年 3 月 24 日 | - | 6 年 | 清华大学应用经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司交易员、研究员、基金经理。2017 年 1 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2017 年 3 月起任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报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、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴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、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |

| | | | | |
|-----------|-----------------------------|------------------|----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>盛豪</p> | <p>量化投资部 副 总 监、本基金的基金经理</p> | <p>2017年6月2日</p> | <p>-</p> | <p>9 年</p> <p>英国剑桥大学数学系硕士。2007年10月至2010年3月任 Wilshire Associates 量化研究员,2010年11月至2012年8月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。2012年9月加入华泰柏瑞基金管理有限公司, 历任量化投资部研究员、基金经理助理。2015年1月起任量化投资部副总监, 2015年10月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起任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和华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年4月起任华泰柏瑞泰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、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年6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。2017年9月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证</p> |
|-----------|-----------------------------|------------------|----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

| | | | | | |
|----|----------|-----------------|----------------|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | | 券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 方纬 | 本基金的基金经理 | 2016 年 3 月 29 日 | 2017 年 6 月 2 日 | 14 年 | 经济学硕士。2003 年 9 月至 2005 年 1 月任上海金信研究所研究员；2005 年 1 月至 2007 年 2 月任万家基金管理有限公司高级研究员；2007 年 2 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2014 年 8 月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 月至 2017 年 6 月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。 |
| 李灿 | 本基金的基金经理 | 2016 年 3 月 29 日 | 2017 年 6 月 2 日 | 7 年 | 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；2015 年 3 月至 |

| | | | | | |
|-----|----------|-----------------|-----------------|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | | <p>6 月任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理助理。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 月至 2017 年 6 月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 | 2017 年 12 月 5 日 | 13 年 | <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）。2004 年至 2006 年于平安资产管理有限公司，任投资分析师；2006 年至 2009 年 9 月于生命人寿保险公司，历任投连投资经理、投资经理、基金投资部负责人。2009 年 10 月加入本公司，任专户投资部投资经理。2014 年 6 月至 2015 年 4 月任研究部总监助理。2015 年 4 月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月至 2017 年 12 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。2016 年 8 月至 2017 年 12 月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月起任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | <p>2017年12月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。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、华泰柏瑞享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。2017年1月起任华泰柏瑞泰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和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月起任华泰柏瑞价值精选30灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年9月起任华泰柏瑞富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，对于场内交易的非组合指令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）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。

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。

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。

本报告期本基金与公司所管理的其他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

2017 年全年 A 股市场大盘指数在白马蓝筹股带领下震荡上行，而中小盘指数则表现不佳。全年万德全 A 指数和上证综指分别上涨 4.93% 和 6.56%。以大盘蓝筹股为代表的沪深 300 全收益指数 17 年全年上涨 24.25%，以中盘股为代表的中证 500 全收益指数同期仅上涨 0.61%，而以中小盘股为代表的中证 1000 全收益指数则下跌了 16.89%。这种市场结构分化行情在四季度表现尤为明显，全市场剔除停牌股和 IPO 股票，共 2969 只股票，四季度取得正回报的股票有 594 只，占比 20.0%。四季度正回报超过沪深 300 指数回报（约 5%）的股票有 400 只，占比 13.5%。

因为担心市场风险，基金经理在将股票仓位控制在 50% 以下，其余资金趁着年末高利率主要在做现金管理，择机加仓。

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 1.0957 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.15%，业绩比较基准收益率为 12.98%。

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 2018 年，我们认为在不发生系统风险的前提下，A 股市场可以预期正收益。

2018 年境外境内的不确定性因素仍然存在。境外面临全球央行进一步收紧流动性对各类资产价格的影响，以及国家之间可能的经济上和政治上的摩擦；境内面临金融去杠杆和监管趋严的影响。但我们认为在不发生系统风险的前提下，A 股市场在经历了 2015 年以来的调整之后，估值趋向合理，向下风险应该有限，全年录得正收益的可能性较大。其中的一个主要驱动因素是：在债市低迷，房市和境外投资受限，资金成本高企的情况下，大量资金依然缺少更好的投资方向，考虑风险与收益，A 股市场会是一个不错的选择。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017 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

报告期内，因赎回等原因，本基金存在连续 60 个工作日基金份额持有人数量低于 200 人的情形，但无基金资产净值低于 5000 万元的情形。本基金管理人已于 2017 年 7 月 19 日将《关于华泰柏瑞旗下基金出现基金份额持有人连续 60 个工作日少于 200 人情形及相关解决方案的报告》上报中国证监会。截止本报告期末，本基金份额持有人数量已满 200 人。

§ 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

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2018)第 21087 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： |
| 审计意见 | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了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 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附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,公允反映了华泰柏瑞精选回报基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞精选回报基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p> |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | - |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 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(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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 |

| | |
|------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | <p>作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞精选回报基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞精选回报基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞精选回报基金的财务报告过程。</p> |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>四、注册会计师对财务报表审计的责任</p> <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞精选回报基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞精选回报基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> |

| | | |
|-----------|-------------------------------------------------------------------|----|
| | 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 | |
| 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) | |
| 注册会计师的姓名 | 单峰 | 曹阳 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼 | |
| 审计报告日期 | 2018 年 3 月 26 日 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

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

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017 年 12 月 31 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 49,593,862.43 | 13,274,834.70 |
| 结算备付金 | | 6,198,603.22 | 190,670.11 |
| 存出保证金 | | 7,137.90 | 27,221.39 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 193,001,256.89 | 769,847,529.55 |
| 其中：股票投资 | | 173,093,009.69 | 106,233,529.55 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 19,908,247.20 | 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 | 299,290,418.94 | 449,351,234.03 |
| 应收证券清算款 | | 708,425.66 | 152,189.46 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 609,654.56 | 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 | | 549,409,359.60 | 1,245,244,814.54 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 12 月 31 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 | 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 | | 278,783.59 | 516,824.71 |
| 应付托管费 | | 69,695.87 | 129,206.17 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 104,658.02 | 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 | 363,000.00 | 390,079.15 |
| 负债合计 | | 816,137.48 | 230,684,736.76 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 500,693,656.32 | 1,001,409,994.31 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 47,899,565.80 | 13,150,083.47 |
| 所有者权益合计 | | 548,593,222.12 | 1,014,560,077.78 |
| 负债和所有者权益总计 | | 549,409,359.60 | 1,245,244,814.54 |

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0957 元，基金份额总额 500,693,656.32 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2016 年 9 月 2 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|-------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| 一、收入 | | 51,017,877.92 | 3,011,547.76 |
| 1. 利息收入 | | 15,039,279.66 | 10,942,548.57 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 936,384.08 | 132,750.23 |
| 债券利息收入 | | 6,605,186.89 | 10,333,467.84 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 7,497,708.69 | 476,330.50 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 15,813,891.52 | 873,240.14 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 24,667,044.15 | 9,594,298.42 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | -12,376,363.11 | -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 | 3,523,210.48 | 250,000.00 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 19,653,105.05 | -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 | 511,601.69 | 468.32 |
| 减：二、费用 | | 5,864,914.24 | 3,377,454.49 |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|--------------|
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 3,645,644.93 | 2,021,855.65 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 911,411.18 | 505,463.90 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 676,468.81 | 97,648.33 |
| 5. 利息支出 | | 223,365.36 | 533,918.86 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 223,365.36 | 533,918.86 |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.20 | 408,023.96 | 218,567.75 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 45,152,963.68 | -365,906.73 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 45,152,963.68 | -365,906.73 |

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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） | 1,001,409,994.31 | 13,150,083.47 | 1,014,560,077.78 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 45,152,963.68 | 45,152,963.68 |
| 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） | -500,716,337.99 | -10,403,481.35 | -511,119,819.34 |
| 其中：1. 基金申购款 | 232,895.19 | 19,118.80 | 252,013.99 |
| 2. 基金赎回款 | -500,949,233.18 | -10,422,600.15 | -511,371,833.33 |
| 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） | 500,693,656.32 | 47,899,565.80 | 548,593,222.12 |
| 项目 | 上年度可比期间 2016 年 9 月 2 日(基金合同生效日)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 | -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 |

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》,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》自同日起失效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。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 2018 年 3 月 26 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

-

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

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[2017]13 号《中国证监会关于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) 于 2017 年 12 月 26 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 26 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的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

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自2017年12月26日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

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[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)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 | |
|----------------|------------------|---------------|
| | 2017 年 12 月 31 日 | |
| | 上年度末 | |
| | 2016 年 12 月 31 日 | |
| 活期存款 | 49,593,862.43 | 13,274,834.70 |
| 定期存款 | - | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合计： | 49,593,862.43 | 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 | | |
|----|------------------|----------------|---------------|
| | 2017 年 12 月 31 日 | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 158,334,917.44 | 173,093,009.69 | 14,758,092.25 |

| | | | | |
|---------------|---------------------|----------------|----------------|---------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 4,000.00 | 4,247.20 | 247.20 |
| | 银行间市场 | 19,940,940.00 | 19,904,000.00 | -36,940.00 |
| | 合计 | 19,944,940.00 | 19,908,247.20 | -36,692.80 |
| 资产支持证券 | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | |
| 合计 | 178,279,857.44 | 193,001,256.89 | 14,721,399.45 | |
| 项目 | 上年度末 2016年12月31日 | | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 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 | -61,350.00 |
| | 银行间市场 | 621,676,130.90 | 613,679,000.00 | -7,997,130.90 |
| | 合计 | 671,672,480.90 | 663,614,000.00 | -8,058,480.90 |
| 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：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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年12月31日 | |
|------------|---------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_交易所 | 100,000,000.00 | - |
| 买入返售证券_银行间 | 199,290,418.94 | - |
| 合计 | 299,290,418.94 | - |
| 项目 | 上年度末 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：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年12月31日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 20,549.45 | 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 | 3,068.23 | 94.38 |
| 应收债券利息 | 336,559.76 | 12,003,479.35 |
| 应收买入返售证券利息 | 249,473.60 | 379,448.91 |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 其他 | 3.52 | 13.42 |
| 合计 | 609,654.56 | 12,401,135.30 |

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年12月31日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 104,039.08 | 57,344.12 |
| 银行间市场应付交易费用 | 618.94 | 26,005.27 |
| 合计 | 104,658.02 | 83,349.39 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年12月31日 | 上年度末 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 | 363,000.00 | 390,000.00 |
| 合计 | 363,000.00 | 390,079.15 |

7.4.7.9 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12月31日 | |
|---------------|-----------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,001,409,994.31 | 1,001,409,994.31 |
| 本期申购 | 232,895.19 | 232,895.19 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -500,949,233.18 | -500,949,233.18 |
| - 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 | 500,693,656.32 | 500,693,656.32 |

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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 | 18,082,979.76 | -4,932,896.29 | 13,150,083.47 |
| 本期利润 | 25,499,858.63 | 19,653,105.05 | 45,152,963.68 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -9,393,857.21 | -1,009,624.14 | -10,403,481.35 |
| 其中：基金申购款 | 10,579.59 | 8,539.21 | 19,118.80 |
| 基金赎回款 | -9,404,436.80 | -1,018,163.35 | -10,422,600.15 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 34,188,981.18 | 13,710,584.62 | 47,899,565.80 |

7.4.7.11 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12月 31日 | 上年度可比期间 2016年9月2日(基金合同生效日) 至2016年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|-----------------------------------------------|
| | 活期存款利息收入 | 876,543.11 |
| 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 | 59,325.38 | 12,769.13 |
| 其他 | 515.59 | 160.49 |

| | | |
|----|------------|------------|
| 合计 | 936,384.08 | 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 2017年1月1日至2017 年12月31日 | 上年度可比期间 2016年9月2日(基金合 同生效日)至2016年12月31 日 |
|------------|---------------------------------|---------------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 213,421,001.03 | 16,911,131.80 |
| 减：卖出股票成本总额 | 188,753,956.88 | 7,316,833.38 |
| 买卖股票差价收入 | 24,667,044.15 | 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 2017年1月1日至2017 年12月31日 | 上年度可比期间 2016年9月2日(基金合 同生效日)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 | -12,376,363.11 | -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 | -12,376,363.11 | -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 2017年1月1日至2017 年12月31日 | 上年度可比期间 2016年9月2日(基金合 同生效日)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 | 1,073,415,999.20 | 1,808,318,954.18 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,063,420,962.68 | 1,788,246,518.00 |
| 减：应收利息总额 | 22,371,399.63 | 29,043,494.46 |
| 买卖债券差价收入 | -12,376,363.11 | -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 2017年1月1日至2017年12月31日 | 上年度可比期间 2016年9月2日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
|-------------|-----------------------------|-------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 3,523,210.48 | 250,000.00 |

| | | |
|-------------|--------------|------------|
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 3,523,210.48 | 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 2017年1月1日至2017 年12月31日 | 上年度可比期间 2016年9月2日(基金合同 生效日)至2016年12月31日 |
|------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 19,653,105.05 | -8,804,709.27 |
| ——股票投资 | 11,631,316.95 | -236,066.52 |
| ——债券投资 | 8,021,788.10 | -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 | 19,653,105.05 | -8,804,709.27 |

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年12 月31日 | 上年度可比期间 2016年9月2日(基金合同生效日) 至2016年12月31日 |
|---------|---------------------------------|-----------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 511,563.29 | 356.92 |
| 转换费收入 | 38.40 | 111.40 |
| 合计 | 511,601.69 | 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. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于 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 2017年1月1日至2017年12 月31日 | 上年度可比期间 2016年9月2日(基金合同生效 日)至2016年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|-----------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 668,118.81 | 81,473.33 |
| 银行间市场交易费用 | 8,350.00 | 16,175.00 |

| | | |
|----|------------|-----------|
| 合计 | 676,468.81 | 97,648.33 |
|----|------------|-----------|

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年 12月31日 | 上年度可比期间 2016年9月2日(基金合同生 效日)至2016年12月31日 |
|------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|
| 审计费用 | 63,000.00 | 74,820.11 |
| 信息披露费 | 300,000.00 | 100,576.59 |
| 银行划款手续费 | 7,823.96 | 5,871.05 |
| 银行间CFCA证书费 | - | - |
| 银行间账户服务费 | 36,300.00 | 4,800.00 |
| 其他费用 | 900.00 | 32,500.00 |
| 合计 | 408,023.96 | 218,567.75 |

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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(“华泰柏瑞基金”) | 基金管理人、登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| PineBridge Investment LLC | 基金管理人的股东 |
| 华泰证券股份有限公司(“华泰证券”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 苏州新区高新技术产业股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”) | 基金管理人的股东华泰证券的控股子公司、基金销售机构 |
| 柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司 | 基金管理人的控股子公司 |

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 | | 上年度可比期间 2016年9月2日(基金合同生效日)至2016年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|----------------------|-------------------------------------------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比 例 |
| 华泰证券 | 14,156,673.80 | 3.15% | 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 2017年1月1日至2017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 | 12,901.13 | 3.11% | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2016年9月2日(基金合同生效日)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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2016 年 9 月 2 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|----------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,645,644.93 | 2,021,855.65 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,223.32 | 834.92 |

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%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 X 0.60% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2016 年 9 月 2 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 911,411.18 | 505,463.90 |

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 0.15%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 X 0.15% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

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：本报告期及 2016 年度，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：本报告期及 2016 年度，除基金管理人之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 2017年1月1日至2017年12月31日 | | 上年度可比期间 2016年9月2日(基金合同生效日)至2016年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|------------|-------------------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行 | 49,593,862.43 | 876,543.11 | 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

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

注：本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2017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) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 603080 | 新疆火炬 | 2017年12月25日 | 2018年1月3日 | 新股未上市 | 13.60 | 13.60 | 1,187 | 16,143.20 | 16,143.20 | - |
| 603161 | 科华控股 | 2017年12月28日 | 2018年1月5日 | 新股未上市 | 16.75 | 16.75 | 1,239 | 20,753.25 | 20,753.25 | - |
| 002923 | 润都股份 | 2017年12月28日 | 2018年1月5日 | 新股未上市 | 17.01 | 17.01 | 954 | 16,227.54 | 16,227.54 | - |
| 600057 | 象屿股份 | 2017年12月28日 | 2018年1月8日 | 新股流通受限 | 6.10 | 8.09 | 16,850 | 102,785.00 | 136,316.50 | - |

7.4.12.2 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 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|-------------|--------|--------|------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 600332 | 白云山 | 2017年10月31日 | 重大资产重组 | 32.14 | 2018年1月8日 | 30.15 | 3,900 | 113,022.00 | 125,346.00 | - |
| 600525 | 长园集团 | 2017年12月25日 | 重大事项 | 15.79 | 2018年1月10日 | 17.30 | 2,400 | 37,436.00 | 37,896.00 | - |
| 600664 | 哈药股份 | 2017年9月28日 | 重大资产重组 | 6.11 | 2018年2月27日 | 6.00 | 296,700 | 1,697,492.00 | 1,812,837.00 | - |
| 000688 | 建新矿业 | 2017年9月6日 | 重大事项 | 10.13 | 2018年2月7日 | 9.86 | 34,700 | 248,774.91 | 351,511.00 | - |
| 002122 | 天马股份 | 2017年12月19日 | 重大事项 | 8.49 | - | - | 95,200 | 963,180.00 | 808,248.00 | - |
| 002507 | 涪陵榨菜 | 2017年12月4日 | 重大事项 | 17.95 | - | - | 128,200 | 1,701,994.02 | 2,301,190.00 | - |
| 002919 | 名臣健康 | 2017年12月28日 | 重大事项 | 35.26 | 2018年1月2日 | 38.79 | 821 | 10,311.76 | 28,948.46 | - |
| 300730 | 科创信息 | 2017年12月25日 | 重大事项 | 41.55 | 2018年1月2日 | 45.71 | 821 | 6,863.56 | 34,112.55 | - |

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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为零。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为零。

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，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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相对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。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和法律监察部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；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 2017年12月31日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | - | 50,040,000.00 |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 19,904,000.00 | 290,176,000.00 |
| 合计 | 19,904,000.00 | 340,216,000.00 |

注：未评级债券为国债、政策性金融债和超短期融资债券。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2 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 2017 年 12 月 31 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA | - | 30,348,000.00 |
| AAA 以下 | 4,247.20 | - |
| 未评级 | - | 293,050,000.00 |
| 合计 | 4,247.20 | 323,398,000.00 |

注：未评级债券为政策性金债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

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。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行

持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

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、债券投资及买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2017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 | 49,593,862.43 | - | - | - | - | - | 49,593,862.43 |
| 结算备付金 | 6,198,603.22 | - | - | - | - | - | 6,198,603.22 |
| 存出保证金 | 7,137.90 | - | - | - | - | - | 7,137.90 |
| 交易性金融资产 | - | - | 19,904,000.00 | 4,247.20 | - | -173,093,009.69 | 193,001,256.89 |
| 买入返售金融资产 | 299,290,418.94 | - | - | - | - | - | 299,290,418.94 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 708,425.66 | 708,425.66 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 609,654.56 | 609,654.56 |
| 资产总计 | 355,090,022.49 | - | 19,904,000.00 | 4,247.20 | - | -174,411,089.91 | 549,409,359.60 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 278,783.59 | 278,783.59 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 69,695.87 | 69,695.87 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 104,658.02 | 104,658.02 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 363,000.00 | 363,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 816,137.48 | 816,137.48 |
| 利率敏感度缺口 | 355,090,022.49 | - | 19,904,000.00 | 4,247.20 | - | -173,594,952.43 | 548,593,222.12 |
| 上年度末 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 |

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

| 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12月31日） | 上年度末（2016年12月31日） |
| | | 1. 市场利率下降 25 个基点 | 2.61 |
| 2. 市场利率上升 25 个基点 | -2.60 | -158.00 | |

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%。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 2017 年 12 月 31 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 | 173,093,009.69 | 31.55 | 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 | 173,093,009.69 | 31.55 | 106,233,529.55 | 10.47 |

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日） | 上年度末（2016 年 12 月 31 日） |
| | 1. 沪深 300 指数上升 5% | | 857.00 |
| 2. 沪深 300 指数下降 5% | | -857.00 | - |

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

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 2017 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 167,407,727.39 元，属于第二层次的余额为 25,593,529.50 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 105,904,988.38 元，第二层次 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 2017 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(2016 年 12 月 31

日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 173,093,009.69 | 31.51 |
| | 其中：股票 | 173,093,009.69 | 31.51 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 19,908,247.20 | 3.62 |
| | 其中：债券 | 19,908,247.20 | 3.62 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 299,290,418.94 | 54.47 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 55,792,465.65 | 10.15 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,325,218.12 | 0.24 |
| 9 | 合计 | 549,409,359.60 | 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 | 4,793,383.00 | 0.87 |
| C | 制造业 | 78,408,922.68 | 14.29 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,707,153.20 | 0.68 |
| E | 建筑业 | 4,795,722.00 | 0.87 |
| F | 批发和零售业 | 1,967,852.00 | 0.36 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,673,110.94 | 1.03 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,925,723.95 | 0.72 |
| J | 金融业 | 57,820,778.16 | 10.54 |
| K | 房地产业 | 7,442,515.26 | 1.36 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业 | 3,556,214.50 | 0.65 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 17,160.00 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 904,185.00 | 0.16 |
| 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 | 80,289.00 | 0.01 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 173,093,009.69 | 31.55 |

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资的股票。

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 | 601318 | 中国平安 | 153,900 | 10,769,922.00 | 1.96 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 9,700 | 6,765,653.00 | 1.23 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 180,800 | 5,246,816.00 | 0.96 |
| 4 | 600030 | 中信证券 | 244,300 | 4,421,830.00 | 0.81 |
| 5 | 601288 | 农业银行 | 1,143,900 | 4,381,137.00 | 0.80 |
| 6 | 601006 | 大秦铁路 | 379,200 | 3,439,344.00 | 0.63 |
| 7 | 600383 | 金地集团 | 269,702 | 3,406,336.26 | 0.62 |
| 8 | 601601 | 中国太保 | 82,000 | 3,396,440.00 | 0.62 |
| 9 | 000651 | 格力电器 | 77,300 | 3,378,010.00 | 0.62 |
| 10 | 002449 | 国星光电 | 185,900 | 3,219,788.00 | 0.59 |
| 11 | 000002 | 万科A | 101,100 | 3,140,166.00 | 0.57 |
| 12 | 601939 | 建设银行 | 346,000 | 2,657,280.00 | 0.48 |
| 13 | 600016 | 民生银行 | 316,600 | 2,656,274.00 | 0.48 |
| 14 | 002334 | 英威腾 | 311,600 | 2,648,600.00 | 0.48 |
| 15 | 601398 | 工商银行 | 377,900 | 2,342,980.00 | 0.43 |
| 16 | 002507 | 涪陵榨菜 | 128,200 | 2,301,190.00 | 0.42 |
| 17 | 601186 | 中国铁建 | 205,000 | 2,283,700.00 | 0.42 |
| 18 | 600518 | 康美药业 | 101,200 | 2,262,832.00 | 0.41 |
| 19 | 601166 | 兴业银行 | 126,500 | 2,149,235.00 | 0.39 |
| 20 | 000338 | 潍柴动力 | 254,400 | 2,121,696.00 | 0.39 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 21 | 601328 | 交通银行 | 326,400 | 2,026,944.00 | 0.37 |
| 22 | 002195 | 二三四五 | 342,760 | 2,001,718.40 | 0.36 |
| 23 | 002677 | 浙江美大 | 117,000 | 1,983,150.00 | 0.36 |
| 24 | 600219 | 南山铝业 | 506,500 | 1,863,920.00 | 0.34 |
| 25 | 600741 | 华域汽车 | 61,500 | 1,825,935.00 | 0.33 |
| 26 | 601628 | 中国人寿 | 59,700 | 1,817,865.00 | 0.33 |
| 27 | 600664 | 哈药股份 | 296,700 | 1,812,837.00 | 0.33 |
| 28 | 002536 | 西泵股份 | 124,200 | 1,802,142.00 | 0.33 |
| 29 | 000415 | 渤海金控 | 304,500 | 1,753,920.00 | 0.32 |
| 30 | 002385 | 大北农 | 287,600 | 1,742,856.00 | 0.32 |
| 31 | 000528 | 柳 工 | 193,700 | 1,652,261.00 | 0.30 |
| 32 | 000488 | 晨鸣纸业 | 95,904 | 1,598,719.68 | 0.29 |
| 33 | 000413 | 东旭光电 | 168,600 | 1,581,468.00 | 0.29 |
| 34 | 002078 | 太阳纸业 | 162,700 | 1,509,856.00 | 0.28 |
| 35 | 000426 | 兴业矿业 | 152,800 | 1,502,024.00 | 0.27 |
| 36 | 300274 | 阳光电源 | 78,673 | 1,476,692.21 | 0.27 |
| 37 | 002142 | 宁波银行 | 81,370 | 1,449,199.70 | 0.26 |
| 38 | 600023 | 浙能电力 | 264,400 | 1,409,252.00 | 0.26 |
| 39 | 600276 | 恒瑞医药 | 20,400 | 1,407,192.00 | 0.26 |
| 40 | 601225 | 陕西煤业 | 170,200 | 1,388,832.00 | 0.25 |
| 41 | 002283 | 天润曲轴 | 238,100 | 1,361,932.00 | 0.25 |
| 42 | 000750 | 国海证券 | 273,475 | 1,340,027.50 | 0.24 |
| 43 | 601818 | 光大银行 | 326,900 | 1,323,945.00 | 0.24 |
| 44 | 000776 | 广发证券 | 78,000 | 1,301,040.00 | 0.24 |
| 45 | 600029 | 南方航空 | 107,100 | 1,276,632.00 | 0.23 |
| 46 | 000876 | 新 希 望 | 166,100 | 1,237,445.00 | 0.23 |
| 47 | 000703 | 恒逸石化 | 56,500 | 1,218,705.00 | 0.22 |
| 48 | 600688 | 上海石化 | 185,300 | 1,172,949.00 | 0.21 |
| 49 | 600585 | 海螺水泥 | 38,600 | 1,132,138.00 | 0.21 |
| 50 | 600019 | 宝钢股份 | 130,900 | 1,130,976.00 | 0.21 |
| 51 | 600015 | 华夏银行 | 121,160 | 1,090,440.00 | 0.20 |
| 52 | 300136 | 信维通信 | 21,500 | 1,090,050.00 | 0.20 |
| 53 | 000030 | 富奥股份 | 133,800 | 1,085,118.00 | 0.20 |
| 54 | 000725 | 京东方 A | 186,200 | 1,078,098.00 | 0.20 |
| 55 | 601390 | 中国中铁 | 126,200 | 1,058,818.00 | 0.19 |
| 56 | 002496 | 辉丰股份 | 191,800 | 1,010,786.00 | 0.18 |
| 57 | 601668 | 中国建筑 | 111,500 | 1,005,730.00 | 0.18 |
| 58 | 600900 | 长江电力 | 63,300 | 986,847.00 | 0.18 |
| 59 | 000768 | 中航飞机 | 55,900 | 944,151.00 | 0.17 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|------------|------|
| 60 | 000581 | 威孚高科 | 39,300 | 943,200.00 | 0.17 |
| 61 | 000921 | 海信科龙 | 67,500 | 939,600.00 | 0.17 |
| 62 | 002320 | 海峡股份 | 43,300 | 939,177.00 | 0.17 |
| 63 | 600028 | 中国石化 | 151,000 | 925,630.00 | 0.17 |
| 64 | 000069 | 华侨城 A | 106,500 | 904,185.00 | 0.16 |
| 65 | 601997 | 贵阳银行 | 67,600 | 903,136.00 | 0.16 |
| 66 | 000166 | 申万宏源 | 160,500 | 861,885.00 | 0.16 |
| 67 | 600999 | 招商证券 | 49,800 | 854,568.00 | 0.16 |
| 68 | 600755 | 厦门国贸 | 82,600 | 834,260.00 | 0.15 |
| 69 | 601009 | 南京银行 | 106,800 | 826,632.00 | 0.15 |
| 70 | 000333 | 美的集团 | 14,900 | 825,907.00 | 0.15 |
| 71 | 000425 | 徐工机械 | 176,000 | 814,880.00 | 0.15 |
| 72 | 002122 | 天马股份 | 95,200 | 808,248.00 | 0.15 |
| 73 | 603369 | 今世缘 | 49,496 | 767,682.96 | 0.14 |
| 74 | 601991 | 大唐发电 | 184,200 | 764,430.00 | 0.14 |
| 75 | 600487 | 亨通光电 | 18,600 | 751,812.00 | 0.14 |
| 76 | 000596 | 古井贡酒 | 11,400 | 748,638.00 | 0.14 |
| 77 | 002402 | 和而泰 | 79,570 | 730,452.60 | 0.13 |
| 78 | 601169 | 北京银行 | 101,800 | 727,870.00 | 0.13 |
| 79 | 000063 | 中兴通讯 | 19,700 | 716,292.00 | 0.13 |
| 80 | 600409 | 三友化工 | 73,000 | 700,070.00 | 0.13 |
| 81 | 600057 | 象屿股份 | 84,250 | 681,582.50 | 0.12 |
| 82 | 002440 | 闰土股份 | 34,263 | 674,638.47 | 0.12 |
| 83 | 600104 | 上汽集团 | 20,700 | 663,228.00 | 0.12 |
| 84 | 000728 | 国元证券 | 59,000 | 649,000.00 | 0.12 |
| 85 | 000858 | 五粮液 | 7,900 | 631,052.00 | 0.12 |
| 86 | 601211 | 国泰君安 | 33,100 | 613,012.00 | 0.11 |
| 87 | 000783 | 长江证券 | 77,800 | 612,286.00 | 0.11 |
| 88 | 600050 | 中国联通 | 95,800 | 606,414.00 | 0.11 |
| 89 | 300178 | 腾邦国际 | 45,200 | 601,160.00 | 0.11 |
| 90 | 000157 | 中联重科 | 131,400 | 587,358.00 | 0.11 |
| 91 | 002024 | 苏宁云商 | 46,000 | 565,340.00 | 0.10 |
| 92 | 601088 | 中国神华 | 24,200 | 560,714.00 | 0.10 |
| 93 | 600837 | 海通证券 | 43,000 | 553,410.00 | 0.10 |
| 94 | 600438 | 通威股份 | 45,500 | 551,005.00 | 0.10 |
| 95 | 300118 | 东方日升 | 44,000 | 533,720.00 | 0.10 |
| 96 | 002587 | 奥拓电子 | 77,146 | 533,078.86 | 0.10 |
| 97 | 002027 | 分众传媒 | 36,900 | 519,552.00 | 0.09 |
| 98 | 002635 | 安洁科技 | 19,700 | 513,973.00 | 0.09 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 99 | 000050 | 深天马 A | 26,000 | 512,460.00 | 0.09 |
| 100 | 601788 | 光大证券 | 37,700 | 506,311.00 | 0.09 |
| 101 | 002555 | 三七互娱 | 24,600 | 505,284.00 | 0.09 |
| 102 | 300158 | 振东制药 | 36,600 | 505,080.00 | 0.09 |
| 103 | 000591 | 太阳能 | 82,100 | 473,717.00 | 0.09 |
| 104 | 000066 | 中国长城 | 64,400 | 469,476.00 | 0.09 |
| 105 | 002244 | 滨江集团 | 58,900 | 468,255.00 | 0.09 |
| 106 | 000563 | 陕国投 A | 107,400 | 456,450.00 | 0.08 |
| 107 | 002736 | 国信证券 | 41,600 | 451,360.00 | 0.08 |
| 108 | 002001 | 新和成 | 11,700 | 445,302.00 | 0.08 |
| 109 | 601607 | 上海医药 | 18,400 | 445,096.00 | 0.08 |
| 110 | 601231 | 环旭电子 | 27,700 | 436,829.00 | 0.08 |
| 111 | 002304 | 洋河股份 | 3,700 | 425,500.00 | 0.08 |
| 112 | 300418 | 昆仑万维 | 20,300 | 417,571.00 | 0.08 |
| 113 | 000726 | 鲁泰 A | 37,800 | 413,910.00 | 0.08 |
| 114 | 000822 | 山东海化 | 45,300 | 409,965.00 | 0.07 |
| 115 | 600816 | 安信信托 | 30,000 | 392,400.00 | 0.07 |
| 116 | 603766 | 隆鑫通用 | 54,400 | 381,888.00 | 0.07 |
| 117 | 002146 | 荣盛发展 | 39,600 | 377,388.00 | 0.07 |
| 118 | 000688 | 建新矿业 | 34,700 | 351,511.00 | 0.06 |
| 119 | 002636 | 金安国纪 | 20,500 | 324,515.00 | 0.06 |
| 120 | 002354 | 天神娱乐 | 18,740 | 320,454.00 | 0.06 |
| 121 | 601555 | 东吴证券 | 30,218 | 293,718.96 | 0.05 |
| 122 | 002029 | 七匹狼 | 35,100 | 289,926.00 | 0.05 |
| 123 | 601336 | 新华保险 | 4,000 | 280,800.00 | 0.05 |
| 124 | 002916 | 深南电路 | 3,068 | 267,621.64 | 0.05 |
| 125 | 002675 | 东诚药业 | 22,100 | 260,559.00 | 0.05 |
| 126 | 600705 | 中航资本 | 46,900 | 258,888.00 | 0.05 |
| 127 | 002648 | 卫星石化 | 15,400 | 255,640.00 | 0.05 |
| 128 | 002734 | 利民股份 | 9,300 | 233,337.00 | 0.04 |
| 129 | 000898 | 鞍钢股份 | 36,600 | 232,410.00 | 0.04 |
| 130 | 000498 | 山东路桥 | 34,600 | 231,128.00 | 0.04 |
| 131 | 000060 | 中金岭南 | 20,500 | 228,985.00 | 0.04 |
| 132 | 600362 | 江西铜业 | 11,000 | 221,870.00 | 0.04 |
| 133 | 601179 | 中国西电 | 50,700 | 221,559.00 | 0.04 |
| 134 | 600502 | 安徽水利 | 31,400 | 216,346.00 | 0.04 |
| 135 | 600507 | 方大特钢 | 16,900 | 214,461.00 | 0.04 |
| 136 | 601636 | 旗滨集团 | 30,900 | 192,816.00 | 0.04 |
| 137 | 000902 | 新洋丰 | 18,900 | 184,842.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 138 | 002920 | 德赛西威 | 4,569 | 178,784.97 | 0.03 |
| 139 | 000959 | 首钢股份 | 24,500 | 146,510.00 | 0.03 |
| 140 | 002025 | 航天电器 | 6,300 | 142,191.00 | 0.03 |
| 141 | 600566 | 济川药业 | 3,700 | 141,155.00 | 0.03 |
| 142 | 002152 | 广电运通 | 18,900 | 140,616.00 | 0.03 |
| 143 | 000936 | 华西股份 | 20,800 | 140,400.00 | 0.03 |
| 144 | 600563 | 法拉电子 | 2,500 | 127,025.00 | 0.02 |
| 145 | 600332 | 白云山 | 3,900 | 125,346.00 | 0.02 |
| 146 | 300450 | 先导智能 | 2,100 | 119,637.00 | 0.02 |
| 147 | 600479 | 千金药业 | 8,100 | 113,562.00 | 0.02 |
| 148 | 002562 | 兄弟科技 | 6,700 | 109,612.00 | 0.02 |
| 149 | 600000 | 浦发银行 | 8,400 | 105,756.00 | 0.02 |
| 150 | 601377 | 兴业证券 | 14,000 | 101,920.00 | 0.02 |
| 151 | 002419 | 天虹股份 | 6,600 | 100,716.00 | 0.02 |
| 152 | 002918 | 蒙娜丽莎 | 1,512 | 84,218.40 | 0.02 |
| 153 | 601928 | 凤凰传媒 | 9,900 | 80,289.00 | 0.01 |
| 154 | 600308 | 华泰股份 | 11,600 | 72,848.00 | 0.01 |
| 155 | 002599 | 盛通股份 | 6,000 | 70,860.00 | 0.01 |
| 156 | 300233 | 金城医药 | 3,700 | 68,931.00 | 0.01 |
| 157 | 603993 | 洛阳钼业 | 9,400 | 64,672.00 | 0.01 |
| 158 | 002563 | 森马服饰 | 8,100 | 63,666.00 | 0.01 |
| 159 | 000825 | 太钢不锈 | 12,100 | 60,016.00 | 0.01 |
| 160 | 002737 | 葵花药业 | 1,900 | 58,558.00 | 0.01 |
| 161 | 600011 | 华能国际 | 9,200 | 56,764.00 | 0.01 |
| 162 | 300735 | 光弘科技 | 3,764 | 54,163.96 | 0.01 |
| 163 | 600606 | 绿地控股 | 6,900 | 50,370.00 | 0.01 |
| 164 | 600808 | 马钢股份 | 11,500 | 47,495.00 | 0.01 |
| 165 | 002601 | 龙蟠佰利 | 2,900 | 46,458.00 | 0.01 |
| 166 | 002279 | 久其软件 | 3,900 | 40,170.00 | 0.01 |
| 167 | 002915 | 中欣氟材 | 1,085 | 38,181.15 | 0.01 |
| 168 | 600525 | 长园集团 | 2,400 | 37,896.00 | 0.01 |
| 169 | 603477 | 振静股份 | 1,955 | 37,027.70 | 0.01 |
| 170 | 002013 | 中航机电 | 3,400 | 36,686.00 | 0.01 |
| 171 | 300730 | 科创信息 | 821 | 34,112.55 | 0.01 |
| 172 | 600282 | 南钢股份 | 6,600 | 31,944.00 | 0.01 |
| 173 | 002919 | 名臣健康 | 821 | 28,948.46 | 0.01 |
| 174 | 601678 | 滨化股份 | 3,000 | 24,360.00 | 0.00 |
| 175 | 600859 | 王府井 | 1,100 | 22,440.00 | 0.00 |
| 176 | 002922 | 伊戈尔 | 1,245 | 22,248.15 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 177 | 603161 | 科华控股 | 1,239 | 20,753.25 | 0.00 |
| 178 | 603329 | 上海雅仕 | 1,183 | 17,957.94 | 0.00 |
| 179 | 603018 | 中设集团 | 600 | 17,160.00 | 0.00 |
| 180 | 002923 | 润都股份 | 954 | 16,227.54 | 0.00 |
| 181 | 603080 | 新疆火炬 | 1,187 | 16,143.20 | 0.00 |
| 182 | 300684 | 中石科技 | 827 | 11,528.38 | 0.00 |
| 183 | 603655 | 朗博科技 | 881 | 8,193.30 | 0.00 |
| 184 | 000666 | 经纬纺机 | 100 | 1,942.00 | 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 | 600398 | 海澜之家 | 8,463,635.60 | 0.83 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 8,171,705.00 | 0.81 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 6,585,796.00 | 0.65 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 6,254,259.96 | 0.62 |
| 5 | 600741 | 华域汽车 | 5,398,682.28 | 0.53 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 5,047,857.00 | 0.50 |
| 7 | 002142 | 宁波银行 | 4,954,870.00 | 0.49 |
| 8 | 600066 | 宇通客车 | 4,636,116.00 | 0.46 |
| 9 | 600036 | 招商银行 | 4,604,564.00 | 0.45 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 4,137,095.00 | 0.41 |
| 11 | 000498 | 山东路桥 | 3,415,081.44 | 0.34 |
| 12 | 000069 | 华侨城 A | 3,185,095.93 | 0.31 |
| 13 | 600383 | 金地集团 | 3,160,420.99 | 0.31 |
| 14 | 601006 | 大秦铁路 | 3,146,822.27 | 0.31 |
| 15 | 000625 | 长安汽车 | 3,073,258.29 | 0.30 |
| 16 | 002449 | 国星光电 | 3,038,377.00 | 0.30 |
| 17 | 601601 | 中国太保 | 3,017,390.00 | 0.30 |
| 18 | 000002 | 万科 A | 2,933,480.07 | 0.29 |
| 19 | 002334 | 英威腾 | 2,626,578.00 | 0.26 |
| 20 | 600016 | 民生银行 | 2,605,735.00 | 0.26 |

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超初期基金资产净值 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 | 600438 | 通威股份 | 13,477,180.93 | 1.33 |
| 2 | 000001 | 平安银行 | 12,881,510.46 | 1.27 |
| 3 | 002142 | 宁波银行 | 12,197,674.70 | 1.20 |
| 4 | 600352 | 浙江龙盛 | 12,067,354.34 | 1.19 |
| 5 | 000488 | 晨鸣纸业 | 8,346,443.31 | 0.82 |
| 6 | 600398 | 海澜之家 | 7,437,597.78 | 0.73 |
| 7 | 000625 | 长安汽车 | 7,386,817.26 | 0.73 |
| 8 | 601169 | 北京银行 | 7,045,523.30 | 0.69 |
| 9 | 000895 | 双汇发展 | 6,102,566.66 | 0.60 |
| 10 | 000059 | 华锦股份 | 5,943,989.98 | 0.59 |
| 11 | 601288 | 农业银行 | 5,926,904.26 | 0.58 |
| 12 | 600741 | 华域汽车 | 5,584,162.59 | 0.55 |
| 13 | 000501 | 鄂武商 A | 5,498,664.15 | 0.54 |
| 14 | 000876 | 新希望 | 5,214,266.00 | 0.51 |
| 15 | 601939 | 建设银行 | 4,782,831.00 | 0.47 |
| 16 | 600066 | 宇通客车 | 4,290,598.36 | 0.42 |
| 17 | 600015 | 华夏银行 | 4,159,921.38 | 0.41 |
| 18 | 601166 | 兴业银行 | 3,783,016.30 | 0.37 |
| 19 | 000498 | 山东路桥 | 2,642,385.73 | 0.26 |
| 20 | 000069 | 华侨城 A | 2,625,299.00 | 0.26 |

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 | 243,982,120.07 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 213,421,001.03 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 19,904,000.00 | 3.63 |
| | 其中：政策性金融债 | 19,904,000.00 | 3.63 |
| 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） | 4,247.20 | 0.00 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 19,908,247.20 | 3.63 |

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 | 170207 | 17 国开 07 | 200,000 | 19,904,000.00 | 3.63 |
| 2 | 110038 | 济川转债 | 40 | 4,247.20 | 0.00 |

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

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

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

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

本基金本报告期末投资的前十名证券中，中信证券（600030）于 2017 年 5 月 24 日公告收到中国证监会处罚事前告知书。因公司在司度（上海）贸易有限公司从事证券交易时间连续计算不足半年的情况下，为其提供融资融券服务，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项“未按照规定与客户签订业务合同”所述行为。拟对中信证券责令改正，给予警告，没收违法所得 61,655,849.78 元，并处以 308,279,248.90 元罚款；对直接负责人笪新亚、宋成给予警告，并分别处以人民币 10 万元罚款。在监管机构的指导下，公司持续完善相关内控机制，依法依规地开展各项业务，目前公司的经营情况正常。

对该股票投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，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 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 | 7,137.90 |
| 2 | 应收证券清算款 | 708,425.66 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 609,654.56 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,325,218.12 |

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

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 |
| 225 | 2, 225, 305. 14 | 500, 080, 000. 00 | 99. 88% | 613, 656. 32 | 0. 12% |

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 | 3, 487. 73 | 0. 0007% |

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

| 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 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2016年9月2日）基金份额总额 | 1,001,629,904.41 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,001,409,994.31 |
| 本报告期基金总申购份额 | 232,895.19 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 500,949,233.18 |
| 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 | 500,693,656.32 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017 年 7 月 12 日，经公司股东会批准吴海云女士为公司监事会主席。

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 63,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 2 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|------|------|-----------|----|
| | | | | |

| | 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 | |
|------|----|----------------|----------------------|------------|----------------|---|
| 银河证券 | 1 | 141,343,304.57 | 31.40% | 131,629.09 | 31.74% | - |
| 广发证券 | 2 | 76,052,042.63 | 16.90% | 69,352.97 | 16.72% | - |
| 兴业证券 | 1 | 55,099,150.85 | 12.24% | 50,212.10 | 12.11% | - |
| 国泰君安 | 1 | 27,274,679.99 | 6.06% | 25,400.96 | 6.13% | - |
| 光大证券 | 2 | 25,948,521.32 | 5.77% | 23,647.34 | 5.70% | - |
| 华鑫证券 | 1 | 25,765,641.51 | 5.72% | 23,480.04 | 5.66% | - |
| 东方证券 | 2 | 22,530,206.55 | 5.01% | 20,981.65 | 5.06% | - |
| 长江证券 | 1 | 17,665,950.04 | 3.92% | 16,452.09 | 3.97% | - |
| 瑞银证券 | 2 | 14,789,489.18 | 3.29% | 13,478.62 | 3.25% | - |
| 华泰证券 | 2 | 14,156,673.80 | 3.15% | 12,901.13 | 3.11% | - |
| 方正证券 | 2 | 12,587,501.73 | 2.80% | 11,722.73 | 2.83% | - |
| 中信建投 | 3 | 11,251,175.24 | 2.50% | 10,255.24 | 2.47% | - |
| 华安证券 | 2 | 3,266,463.76 | 0.73% | 2,999.68 | 0.72% | - |
| 东北证券 | 1 | 903,309.81 | 0.20% | 841.30 | 0.20% | - |
| 东吴证券 | 2 | 796,697.93 | 0.18% | 726.02 | 0.18% | - |
| 安信证券 | 2 | 233,043.34 | 0.05% | 217.03 | 0.05% | - |
| 中信证券 | 1 | 150,431.22 | 0.03% | 137.08 | 0.03% | - |
| 华融证券 | 1 | 147,960.55 | 0.03% | 134.84 | 0.03% | - |
| 恒泰证券 | 1 | 132,574.88 | 0.03% | 123.46 | 0.03% | - |
| 国海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 北京高华 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 西藏同信 | 1 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国都证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 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；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。

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 |
| 银河证券 | - | - | 3,157,900,000.00 | 34.75% | - | - |
| 广发证券 | 51,093,884.33 | 93.28% | 540,000,000.00 | 5.94% | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 3,603,970.00 | 6.58% | 91,000,000.00 | 1.00% | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | 205,000,000.00 | 2.26% | - | - |
| 长江证券 | - | - | 1,712,000,000.00 | 18.84% | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 77,704.60 | 0.14% | 710,000,000.00 | 7.81% | - | - |
| 中信建投 | - | - | 465,000,000.00 | 5.12% | - | - |
| 华安证券 | - | - | 836,800,000.00 | 9.21% | - | - |
| 东北证券 | - | - | 830,000,000.00 | 9.13% | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | 540,000,000.00 | 5.94% | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西藏同信 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|------|--------|--------|
|----|------|--------|--------|

| | | | |
|----|------------------------------------------------------|------------------|------------------|
| 1 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金实施增值税政策的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 12 月 30 日 |
| 2 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 12 月 26 日 |
| 3 | 华泰柏瑞精选回报关于基金经理变更的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 12 月 6 日 |
| 4 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加上海好买基金销售有限公司转换业务费率优惠的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 12 月 1 日 |
| 5 | 华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（正文）2017 年第 2 号 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 11 月 11 日 |
| 6 | 华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（摘要）2017 年第 2 号 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 11 月 11 日 |
| 7 | 华泰柏瑞精选回报 2017 年三季度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 10 月 25 日 |
| 8 | 华泰柏瑞基金管理公司关于旗下部分基金在上海大智慧财富管理有限公司开通基金定投业务及参加费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 9 月 9 日 |
| 9 | 华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年报 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 8 月 26 日 |
| 10 | 华泰柏瑞精选回报混合型基金 2017 年半年度报告摘要 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 8 月 26 日 |
| 11 | 华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金恢复申购（含转换转入、定期定额投资）并限制 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 7 月 25 日 |

| | | | |
|----|-----------------------------------------------------|------------------|-----------------|
| | 大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告 | | |
| 12 | 华泰柏瑞精选回报混合型证券投资基金 2017 年第二季度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 7 月 20 日 |
| 13 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加上海汇付金融服务有限公司费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 7 月 14 日 |
| 14 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加佳泓(北京)基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 7 月 14 日 |
| 15 | 华泰柏瑞基金关于执行《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 7 月 1 日 |
| 16 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司定投及转换费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 6 月 22 日 |
| 17 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 6 月 3 日 |
| 18 | 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（更新）摘要 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 5 月 11 日 |
| 19 | 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（更新）正文 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 5 月 11 日 |
| 20 | 华泰柏瑞精选回报 2017 年一季 | 中国证券报、上海证 | 2017 年 4 月 24 日 |

| | 度报告 | 券报、证券时报 | |
|----|----------------------------------------------|------------------|-----------------|
| 21 | 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 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 3 月 29 日 |
| 22 | 华泰柏瑞精选回报混合型基金 2016 年年报摘要 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 3 月 29 日 |
| 23 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合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 | 2017 年 3 月 25 日 |
| 24 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司费率优惠的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 3 月 8 日 |
| 25 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更旗下基金产品转换补差费计算方式的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 2 月 23 日 |
| 26 | 华泰柏瑞基金关于上海华信证券有限责任公司开通基金定投并参加费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 1 月 19 日 |
| 27 | 华泰柏瑞精选回报 2016 年第四季度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2017 年 1 月 19 日 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 | 2017.01.01-2017.12.31 | 1,000,080,000.00 | 0.00 | 500,000,000.00 | 500,080,000.00 | 97.91% |
| 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费）021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2018 年 3 月 28 日