

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	51
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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57

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 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
8.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
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 .....	60
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>61</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	65
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>72</b>
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 .....	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	错误！未定义书签。
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>73</b>
13.1 备查文件目录 .....	73
13.2 存放地点 .....	73
13.3 查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞积极成长混合
基金主代码	460002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 5 月 29 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	813,270,327.02 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和风险管理手段，投资于具备持续突出增长能力的优秀企业，辅以特定市场状况下的大类资产配置调整，追求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系统性风险。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	沪深 300 指数 ×60%+ 中信标普国债指数 ×40% (2007/05/29-2015/09/30) 沪深 300 指数 ×60%+ 中债国债总指数 ×40% (2015/10/1-至今)
风险收益特征	较高风险、较高收益

### 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	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	30,907,011.13	-210,995,548.52	906,788,408.15
本期利润	144,545,837.54	-384,702,152.75	427,858,249.64
加权平均基金份额本期利润	0.1583	-0.3228	0.2335
本期加权平均净值利润率	12.46%	-25.06%	13.79%
本期基金份额净值增长率	13.42%	-16.62%	20.73%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	259,529,260.05	238,571,265.30	994,852,166.58
期末可供分配基金份额利润	0.3191	0.2416	0.6798
期末基金资产净值	1,089,440,887.72	1,226,017,568.55	2,472,575,222.13
期末基金份额净值	1.3396	1.2416	1.6896
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	78.55%	57.42%	88.80%

### 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	-1.20%	1.31%	2.62%	0.48%	-3.82%	0.83%
过去六个月	10.96%	1.26%	5.16%	0.42%	5.80%	0.84%
过去一年	13.42%	1.05%	10.42%	0.39%	3.00%	0.66%
过去三年	14.18%	2.06%	9.71%	1.01%	4.47%	1.05%
过去五年	104.85%	1.77%	39.36%	0.93%	65.49%	0.84%
自基金合同生效起至今	78.55%	1.63%	21.35%	1.09%	57.20%	0.54%

注：本基金的业绩基准自成立至 2015 年 9 月 30 日由沪深 300 指数和中信标普国债指数按照 60%与 40%之比构建，并每日进行再平衡；自 2015 年 10 月 1 日起至今由沪深 300 指数和中债国债总指数按照 60%与 40%之比构建，并每日进行再平衡。

### 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

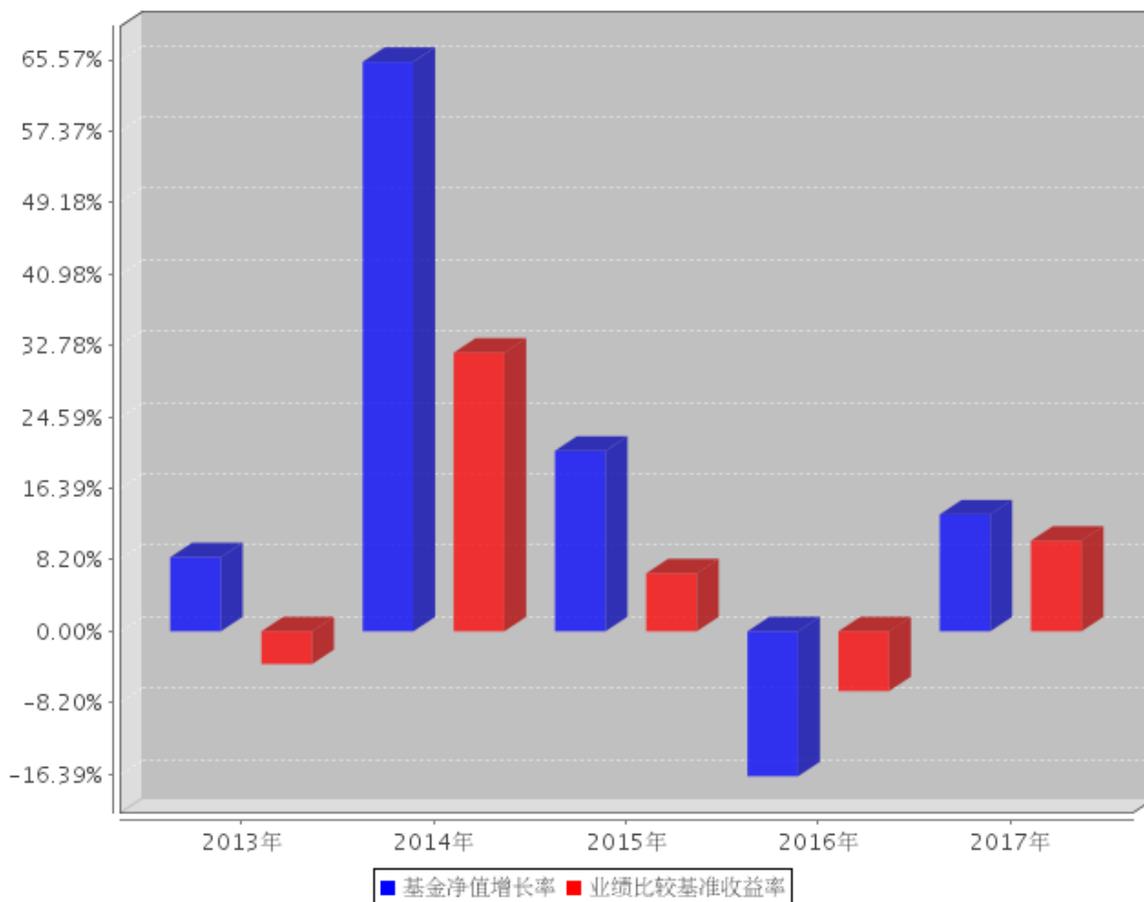


注：图示日期为 2007 年 5 月 29 日至 2017 年 12 月 31 日。

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十四条（二）投资范围、（十）之 2、基金投资组合比例限制中规定的各项比例，投资于股票的比例为基金资产的 30%-95%，现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-70%。

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

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	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	年度利润分配合 计	备注
2017	0.6190	29,239,406.48	30,339,404.65	59,578,811.13	注：-
2016	1.7000	134,263,865.39	83,709,841.99	217,973,707.38	注：-
2015	0.8500	116,881,266.65	85,580,698.69	202,461,965.34	注：-
合计	3.1690	280,384,538.52	199,629,945.33	480,014,483.85	注：-

## § 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		
方伦煜	投资部总监、本基金的基金经理	2012 年 4 月 18 日	-	17 年	管理学硕士，17 年证券从业经历，历任广发证券股份有限公司行业研究员、招商证券有限公司投资经理、巨田基金管理有限公司研究员，广发证券股份有限公司投资经理。2008 年 6 月至 2010 年 2 月任中国人寿资产管理有限公司投资经理，2010 年 2 月至 2012 年 2 月任职于华安基金管理有限公司基金投资部，2012 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2012 年 4 月起担任华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起担任华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起任投资部总监。

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。任职日期和离任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

过去的一年是中国证券市场价值投资理念持续深化的一年。本基金从价值投资的角度出发，重点配置受益“供给侧改革”、业绩出现大幅改善且动态估值较低的周期类个股。与此同时，对于估值与成长性匹配的成长股我们也积极参与并取得不错效果。进入四季度市场对经济前景的担忧加剧，对需求的关注度上升，市场风格再度转向低风险偏好，本基金相应降低周期和非银的配置，增加对消费成长类资产的配置。

##### 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 1.3396 元；本报告期基金份额净值增长率为 13.42%，业绩比较基准收益率为 10.41%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前全球经济正走在复苏的路上，我国经济面临一个较好的外部环境。尽管贸易保护主义局部有所抬头，但“一带一路”得到越来越多国家和地区的响应。随着国内供给侧改革告一段落，其对总量经济的压制作用逐步降低，中下游制造业企业的盈利将得到改善。

目前 A 股剔除金融后估值仍处于历史较低水平，在经济总体趋稳的背景下估值处于合理水平。从结构上看，去年底召开的中央经济工作会议指出了供给侧改革深化的方向，“中国创造”符合当下我国经济转型的实际，今后一批具有核心竞争力的企业不但能够获得政策上有力支持，而且能够凭借自身实力进一步提升市场地位。从投资数据看已有结构转型升级迹象，制造企业的技改投资增速已经处于较高水平，新兴制造类成长股未来几年将有较好表现。与此同时，受益于供给侧改革的深远影响，周期股在相当长时期将内面临较好的竞争环境，且目前普遍估值便宜，仍具配置价值。

#### 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进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

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

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

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

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.7 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

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 259,529,260.05 元。根据基金合同约定，本基金已于 2017 年 3 月对 2016 年度可分配利润实施了分红，每 10 份基金份额派发现金红利 0.619 元。

#### 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

注：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

注：无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞积极成长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 21114 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	华泰柏瑞积极成长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交易型货币市场基金(以下简称“华泰柏瑞交易型货币基金”)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积极成长基金 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积极成长基金,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	<p>华泰柏瑞积极成长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积极成长</p>

	<p>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积极成长基金、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积极成长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>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积极成长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积极成长基金不能持续经营。</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> <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。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>单峰 曹阳</p>

会计师事务所的地址	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2018 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞积极成长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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	20,390,018.50	188,252,266.14
结算备付金		2,420,786.29	3,247,021.53
存出保证金		295,037.06	895,362.82
交易性金融资产	7.4.7.2	1,039,976,094.56	1,055,307,854.62
其中：股票投资		989,348,261.76	995,367,854.62
基金投资		-	-
债券投资		50,627,832.80	59,940,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		29,289,809.84	-
应收利息	7.4.7.5	1,907,931.36	1,154,635.99
应收股利		-	-
应收申购款		99,858.89	71,609.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,094,379,536.50	1,248,928,751.03
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	17,446,907.95
应付赎回款		719,604.13	710,143.33
应付管理人报酬		1,403,267.62	1,695,984.77
应付托管费		233,877.95	282,664.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,581,521.31	1,774,716.59
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,000,377.77	1,000,765.73
负债合计		4,938,648.78	22,911,182.48
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	813,270,327.02	987,446,303.25
未分配利润	7.4.7.10	276,170,560.70	238,571,265.30
所有者权益合计		1,089,440,887.72	1,226,017,568.55
负债和所有者权益总计		1,094,379,536.50	1,248,928,751.03

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.3396 元，基金份额总额 813,270,327.02 份，无 H 类基金份额。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞积极成长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 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		174,826,867.33	-337,538,196.22
1. 利息收入		2,232,004.41	5,417,210.98
其中：存款利息收入	7.4.7.11	476,688.24	3,611,053.52
债券利息收入		1,745,455.06	1,445,052.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,861.11	361,104.70
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		58,896,597.29	-169,748,781.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	45,100,914.90	-179,769,095.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	201,183.20	163,840.00
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	13,594,499.19	9,856,473.95
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	113,638,826.41	-173,706,604.23
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	59,439.22	499,978.71
<b>减：二、费用</b>		30,281,029.79	47,163,956.53
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	17,406,434.00	23,095,066.81

2. 托管费	7.4.10.2.2	2,901,072.30	3,849,177.74
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	9,516,353.58	19,759,042.15
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	457,169.91	460,669.83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		144,545,837.54	-384,702,152.75
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		144,545,837.54	-384,702,152.75

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞积极成长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）	987,446,303.25	238,571,265.30	1,226,017,568.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	144,545,837.54	144,545,837.54
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）	-174,175,976.23	-47,367,731.01	-221,543,707.24
其中：1. 基金申购款	52,899,855.00	13,752,780.92	66,652,635.92
2. 基金赎回款	-227,075,831.23	-61,120,511.93	-288,196,343.16
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）	-	-59,578,811.13	-59,578,811.13
五、期末所有者权益（基金净值）	813,270,327.02	276,170,560.70	1,089,440,887.72
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,463,440,023.34	1,009,135,198.79	2,472,575,222.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-384,702,152.75	-384,702,152.75
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）	-475,993,720.09	-167,888,073.36	-643,881,793.45
其中：1. 基金申购款	132,321,572.24	40,093,885.70	172,415,457.94
2. 基金赎回款	-608,315,292.33	-207,981,959.06	-816,297,251.39
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）	-	-217,973,707.38	-217,973,707.38
五、期末所有者权益（基金净值）	987,446,303.25	238,571,265.30	1,226,017,568.55

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

华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金(原名为友邦华泰积极成长混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]第131号《关于同意友邦华泰积极成长混合型证券投资基金募集的批复》核准,由友邦华泰基金管理有限公司(已自2010年4月30日起更名为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《友邦华泰积极成长混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币8,920,448,257.95元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2007)第065号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《友邦华泰积极成长混合型证券投资基金基金合同》于2007年5月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为8,921,315,668.58份基

金份额，其中认购资金利息折合 867,410.63 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《关于华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金增设 H 类基金份额并相应修改基金合同的公告》，本基金自 2015 年 10 月 14 日起增加 H 类基金份额并相应修改基金合同及托管协议。本基金按照销售区域及费率标准的不同，将本基金分为 A 类基金份额和 H 类基金份额。在本基金的基金份额分类实施后，本基金原有基金份额全部自动划归为 A 类基金份额，A 类基金份额仅在中国大陆地区销售；本基金新增的 H 类基金份额，仅在中国香港地区销售。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、现金、短期金融工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%-95%；现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-70%，其中，本基金持有全部股改权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，本基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。自基金合同生效日至 2015 年 9 月 30 日，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×60%+中信标普国债指数×40%。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 28 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》，自 2015 年 10 月 1 日起，本基金的业绩比较基准变更为：沪深 300 指数×60%+中债国债总指数×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 03 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》、《华泰柏瑞积极成长混合型证券

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。

#### 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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金 A 类基金份额的收益以现金形式分配，但 A 类基金份额的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；H 类基金份额的收益分配仅采用现金方式。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[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[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对于内地投资者持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股

期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50%计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别, 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向该内地基金分配利息时按照 7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得, 应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10%的税率代扣代缴所得税。

(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	20,390,018.50	188,252,266.14
定期存款	-	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计:	20,390,018.50	188,252,266.14

##### 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	917,917,103.15	989,348,261.76	71,431,158.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	596,000.00	632,832.80
	银行间市场	50,069,950.00	49,995,000.00
	合计	50,665,950.00	50,627,832.80
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	968,583,053.15	1,039,976,094.56	71,393,041.41
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	1,037,616,279.62	995,367,854.62	-42,248,425.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	59,937,360.00	59,940,000.00
	合计	59,937,360.00	59,940,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,097,553,639.62	1,055,307,854.62	-42,245,785.00

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	18,376.53	30,795.37
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	1,198.54	1,611.13
应收债券利息	1,888,210.21	1,121,786.30
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	146.08	443.19

合计	1,907,931.36	1,154,635.99
----	--------------	--------------

#### 7.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017年12月31日	2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,581,521.31	1,773,338.95
银行间市场应付交易费用	-	1,377.64
合计	1,581,521.31	1,774,716.59

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017年12月31日	2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	377.77	765.73
预提费用	500,000.00	500,000.00
合计	1,000,377.77	1,000,765.73

#### 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	987,446,303.25	987,446,303.25
本期申购	52,899,855.00	52,899,855.00
本期赎回(以“-”号填列)	-227,075,831.23	-227,075,831.23
- 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	813,270,327.02	813,270,327.02

注：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	338,428,812.27	-99,857,546.97	238,571,265.30
本期利润	30,907,011.13	113,638,826.41	144,545,837.54
本期基金份额交易产生的变动数	-50,227,752.22	2,860,021.21	-47,367,731.01
其中：基金申购款	14,778,020.17	-1,025,239.25	13,752,780.92
基金赎回款	-65,005,772.39	3,885,260.46	-61,120,511.93
本期已分配利润	-59,578,811.13	-	-59,578,811.13
本期末	259,529,260.05	16,641,300.65	276,170,560.70

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	427,086.45	3,492,027.48
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	42,264.28	90,204.74
其他	7,337.51	28,821.30
合计	476,688.24	3,611,053.52

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	3,208,948,687.86	6,739,603,179.01
减：卖出股票成本总额	3,163,847,772.96	6,919,372,274.64
买卖股票差价收入	45,100,914.90	-179,769,095.63

### 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1月1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	201,183.20	163,840.00
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	201,183.20	163,840.00

#### 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1月1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	72,971,954.30	113,012,761.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	71,391,418.30	109,942,260.00
减：应收利息总额	1,379,352.80	2,906,661.20
买卖债券差价收入	201,183.20	163,840.00

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回价差收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购价差收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末无资产支持证券投资收益。

### 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：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14.2 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。

#### 7.4.7.14.3 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。

#### 7.4.7.14.4 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。

#### 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：本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 7.4.7.15.2 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。

#### 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1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	13,594,499.19	9,856,473.95
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	13,594,499.19	9,856,473.95

#### 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1月1日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	113,638,826.41	-173,706,604.23
——股票投资	113,679,583.61	-173,416,504.23
——债券投资	-40,757.20	-290,100.00
——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	113,638,826.41	-173,706,604.23
----	----------------	-----------------

#### 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1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	55,482.47	488,626.60
转换费收入	3,956.75	11,352.11
合计	59,439.22	499,978.71

注：1. 本基金 A 类份额的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产；H 类份额的赎回费率为 0.125%，赎回费全额归入基金资产。

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，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 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1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	9,516,078.58	19,758,467.15
银行间市场交易费用	275.00	575.00
合计	9,516,353.58	19,759,042.15

#### 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1月1日至2016年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行划款手续费	19,969.91	23,469.83
银行间帐户服务费	36,300.00	37,200.00
其他费用	900.00	-
合计	457,169.91	460,669.83

### 7.4.7.21 分部报告

注：本基金本报告期无分部报告。

### 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

注：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

本基金的基金管理人于 2018 年 1 月 25 日宣告 2017 年度第一次分红，向截至 2018 年 1 月 29 日止在本基金注册登记人华泰柏瑞基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.8 元。

### 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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 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	840,790,820.35	13.46%	1,336,192,884.47	10.35%

### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期本基金与关联方未进行权证交易。

### 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	775,381.92	13.48%	151,166.35	9.56%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	1,232,092.24	10.38%	1,232,092.24	69.48%

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1月1日至2016年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	17,406,434.00
其中：支付销售机构的客户维护费	2,844,782.66	3,167,193.51

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 1.50% 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 1.50% / 当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,901,072.30	3,849,177.74

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 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	20,390,018.50	427,086.45	188,252,266.14	3,492,027.48

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期无其他需要说明的关联交易事项。

### 7.4.11 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
		场内	场外					
1	2017 年 3 月 28 日	-	2017 年 3 月 28 日	0.6190	29,239,406.48	30,339,404.65	59,578,811.13	
合计	-	-		0.6190	29,239,406.48	30,339,404.65	59,578,811.13	

注：H 类基金份额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
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	-
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	-

### 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
601600	中国铝业	2017年9月12日	重大资产重组	6.64	2018年2月26日	7.28	1,800,000	11,679,000.00	11,952,000.00	-
600903	贵州燃气	2017年12月28日	股票交易异常波动	16.86	2018年1月2日	16.01	3,928	8,680.88	66,226.08	-
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	-
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	-

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

注：截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购。

#### 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，本基金未持有交易所债券正回购。

### 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同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	632,832.80	-
未评级	49,995,000.00	59,940,000.00
合计	50,627,832.80	59,940,000.00

注：未评级部分为政策性金融债。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、存出保证金及债券投资等。

#### 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	20,390,018.50	-	-	-	-	-	20,390,018.50
结算备付金	2,420,786.29	-	-	-	-	-	2,420,786.29
存出保证金	295,037.06	-	-	-	-	-	295,037.06
交易性金融资产	49,995,000.00	-	-	632,832.80	-	989,348,261.76	1,039,976,094.56
应收证券清算款	-	-	-	-	-	29,289,809.84	29,289,809.84
应收利息	-	-	-	-	-	1,907,931.36	1,907,931.36
应收申购款	198.81	-	-	-	-	99,660.08	99,858.89
资产总计	73,101,040.66	-	-	632,832.80	-	1,020,645,663.04	1,094,379,536.50
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	719,604.13	719,604.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,403,267.62	1,403,267.62
应付托管费	-	-	-	-	-	233,877.95	233,877.95
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,581,521.31	1,581,521.31
其他负债	-	-	-	-	-	1,000,377.77	1,000,377.77
负债总计	-	-	-	-	-	4,938,648.78	4,938,648.78
利率敏感度缺口	73,101,040.66	-	-	632,832.80	-	-1,015,707,014.26	1,089,440,887.72
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			年				
资产							
银行存款	188,252,266.14	-	-	-	-	-	188,252,266.14
结算备付金	3,247,021.53	-	-	-	-	-	3,247,021.53
存出保证金	895,362.82	-	-	-	-	-	895,362.82
交易性金融资产	59,940,000.00	-	-	-	-	995,367,854.62	1,055,307,854.62
应收利息	-	-	-	-	-	1,154,635.99	1,154,635.99
应收申购款	-	-	-	-	-	71,609.93	71,609.93
资产总计	252,334,650.49	-	-	-	-	996,594,100.54	1,248,928,751.03
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	17,446,907.95	17,446,907.95
应付赎回款	-	-	-	-	-	710,143.33	710,143.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,695,984.77	1,695,984.77
应付托管费	-	-	-	-	-	282,664.11	282,664.11
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,774,716.59	1,774,716.59
其他负债	-	-	-	-	-	1,000,765.73	1,000,765.73
负债总计	-	-	-	-	-	22,911,182.48	22,911,182.48
利率敏感度缺口	252,334,650.49	-	-	-	-	973,682,918.06	1,226,017,568.55

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2017 年 12 月 31 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 4.65% (2016 年 12 月 31 日：4.89%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2016 年 12 月 31 日：同)。

#### 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 30%-95%；现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-70%。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	989,348,261.76	90.81	995,367,854.62	81.19
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	989,348,261.76	90.81	995,367,854.62	81.19

#### 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%	5,300.00	4,301.00
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-5,300.00	-4,301.00

#### 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 977,846,683.48 元，属于第二层次的余额为 62,129,411.08 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 964,270,582.52 元，第二层次 91,037,272.10 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	989,348,261.76	90.40
	其中：股票	989,348,261.76	90.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,627,832.80	4.63
	其中：债券	50,627,832.80	4.63
	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	-	-
	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	22,810,804.79	2.08
8	其他各项资产	31,592,637.15	2.89
9	合计	1,094,379,536.50	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	6,947,495.52	0.64
B	采矿业	-	-
C	制造业	726,928,934.38	66.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,705,986.94	1.63
E	建筑业	15,466,356.00	1.42
F	批发和零售业	10,774,141.44	0.99
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,541,864.55	0.60
J	金融业	111,437,969.55	10.23
K	房地产业	26,226,414.48	2.41
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	31,668.04	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	20,460,748.32	1.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	46,291,449.60	4.25
R	文化、体育和娱乐业	517,275.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	989,348,261.76	90.81

### 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：本基金本报告期末通过港股通投资股票。

### 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	600521	华海药业	2,528,223	76,150,076.76	6.99
2	600703	三安光电	2,853,935	72,461,409.65	6.65
3	601628	中国人寿	1,999,999	60,899,969.55	5.59
4	000786	北新建材	2,412,820	54,288,450.00	4.98
5	600887	伊利股份	1,509,981	48,606,288.39	4.46
6	600196	复星医药	1,069,996	47,614,822.00	4.37
7	000636	风华高科	3,272,700	38,879,676.00	3.57
8	601398	工商银行	6,000,000	37,200,000.00	3.41
9	600056	中国医药	1,464,531	36,452,176.59	3.35
10	000932	*ST 华菱	4,439,100	36,001,101.00	3.30
11	600019	宝钢股份	4,099,940	35,423,481.60	3.25
12	600507	方大特钢	2,783,694	35,325,076.86	3.24
13	000717	韶钢松山	3,970,602	35,179,533.72	3.23
14	300015	爱尔眼科	757,827	23,341,071.60	2.14
15	002020	京新药业	2,000,000	22,980,000.00	2.11
16	002044	美年健康	1,049,400	22,950,378.00	2.11
17	600566	济川药业	572,685	21,847,932.75	2.01
18	300070	碧水源	1,177,936	20,460,748.32	1.88
19	300335	迪森股份	1,009,371	17,623,617.66	1.62
20	300065	海兰信	958,000	17,454,760.00	1.60
21	600487	亨通光电	422,738	17,087,069.96	1.57

22	002310	东方园林	766,800	15,466,356.00	1.42
23	000402	金融街	1,286,968	14,298,214.48	1.31
24	601336	新华保险	190,000	13,338,000.00	1.22
25	600062	华润双鹤	499,991	12,374,777.25	1.14
26	600567	山鹰纸业	2,800,000	12,152,000.00	1.12
27	300452	山河药辅	402,279	12,128,711.85	1.11
28	601600	中国铝业	1,800,000	11,952,000.00	1.10
29	600340	华夏幸福	380,000	11,928,200.00	1.09
30	600176	中国巨石	700,000	11,403,000.00	1.05
31	600655	豫园股份	1,000,000	10,740,000.00	0.99
32	300274	阳光电源	500,000	9,385,000.00	0.86
33	300232	洲明科技	640,247	9,155,532.10	0.84
34	002465	海格通信	941,650	9,030,423.50	0.83
35	002139	拓邦股份	748,050	8,849,431.50	0.81
36	002179	中航光电	220,123	8,668,443.74	0.80
37	002714	牧原股份	131,432	6,947,495.52	0.64
38	300310	宜通世纪	500,000	5,795,000.00	0.53
39	002833	弘亚数控	80,000	4,964,000.00	0.46
40	600416	湘电股份	395,800	4,943,542.00	0.45
41	600055	万东医疗	299,911	4,783,580.45	0.44
42	603707	健友股份	105,200	2,969,796.00	0.27
43	300009	安科生物	99,959	2,591,936.87	0.24
44	603626	科森科技	50,000	1,420,500.00	0.13
45	002460	赣锋锂业	10,000	717,500.00	0.07
46	300271	华宇软件	47,900	712,752.00	0.07
47	600519	贵州茅台	1,000	697,490.00	0.06
48	600276	恒瑞医药	10,000	689,800.00	0.06
49	300251	光线传媒	49,500	517,275.00	0.05
50	300136	信维通信	10,000	507,000.00	0.05
51	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.02
52	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.02
53	002918	蒙娜丽莎	1,512	84,218.40	0.01
54	600903	贵州燃气	3,928	66,226.08	0.01
55	000725	京东方A	10,000	57,900.00	0.01
56	603605	珀莱雅	1,909	54,826.48	0.01
57	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.00
58	603890	春秋电子	1,126	47,438.38	0.00
59	300726	宏达电子	1,548	44,737.20	0.00
60	603937	丽岛新材	1,662	43,610.88	0.00

61	603916	苏博特	2,450	42,042.00	0.00
62	300718	长盛轴承	1,017	40,954.59	0.00
63	300713	英可瑞	455	38,629.50	0.00
64	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.00
65	603278	大业股份	1,624	37,498.16	0.00
66	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.00
67	300711	广哈通信	1,347	36,220.83	0.00
68	002917	金奥博	1,090	35,643.00	0.00
69	603711	香飘飘	1,318	35,019.26	0.00
70	002910	庄园牧场	1,696	34,937.60	0.00
71	603912	佳力图	1,227	34,638.21	0.00
72	603970	中农立华	1,046	34,141.44	0.00
73	300730	科创信息	821	34,112.55	0.00
74	603856	东宏股份	1,619	33,302.83	0.00
75	603685	晨丰科技	932	32,769.12	0.00
76	603809	豪能股份	900	32,436.00	0.00
77	300712	永福股份	1,279	31,668.04	0.00
78	603848	好太太	1,377	31,244.13	0.00
79	300731	科创新源	808	30,914.08	0.00
80	603289	泰瑞机器	1,596	30,403.80	0.00
81	300729	乐歌股份	941	30,187.28	0.00
82	603607	京华激光	734	29,873.80	0.00
83	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.00
84	300727	润禾材料	870	28,701.30	0.00
85	603922	金鸿顺	1,023	28,674.69	0.00
86	002909	集泰股份	1,298	28,517.06	0.00
87	300721	怡达股份	745	28,496.25	0.00
88	603722	阿科力	707	27,954.78	0.00
89	300716	国立科技	948	24,572.16	0.00
90	002864	盘龙药业	781	22,375.65	0.00
91	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
92	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.00
93	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.00
94	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00
95	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.00
96	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
97	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00
98	601689	拓普集团	8	197.92	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	600019	宝钢股份	76,349,927.68	6.23
2	600521	华海药业	73,615,057.30	6.00
3	600507	方大特钢	72,191,040.46	5.89
4	000786	北新建材	69,309,017.18	5.65
5	002110	三钢闽光	63,137,444.55	5.15
6	601628	中国人寿	62,286,926.91	5.08
7	600056	中国医药	62,169,973.71	5.07
8	002392	北京利尔	57,377,540.71	4.68
9	000401	冀东水泥	56,974,100.28	4.65
10	000932	*ST 华菱	56,878,676.00	4.64
11	000717	韶钢松山	54,658,794.59	4.46
12	601600	中国铝业	52,627,206.00	4.29
13	600887	伊利股份	46,270,236.81	3.77
14	300070	碧水源	45,610,871.90	3.72
15	600703	三安光电	43,003,019.30	3.51
16	300136	信维通信	41,105,223.45	3.35
17	600196	复星医药	39,851,779.18	3.25
18	000636	风华高科	37,245,390.51	3.04
19	300408	三环集团	36,647,951.88	2.99
20	601398	工商银行	36,554,308.00	2.98
21	600392	盛和资源	35,938,146.18	2.93
22	601336	新华保险	35,598,140.62	2.90
23	600782	新钢股份	35,501,091.70	2.90
24	600487	亨通光电	33,669,268.42	2.75
25	600104	上汽集团	33,527,869.52	2.73
26	000983	西山煤电	32,605,649.08	2.66
27	600516	方大炭素	31,577,129.68	2.58
28	002158	汉钟精机	31,229,474.10	2.55
29	002233	塔牌集团	29,337,590.25	2.39
30	002027	分众传媒	28,101,144.69	2.29

31	300065	海兰信	27,650,230.69	2.26
32	002174	游族网络	27,644,553.76	2.25
33	000402	金融街	27,292,319.33	2.23
34	001979	招商蛇口	27,254,765.64	2.22
35	600340	华夏幸福	25,737,330.48	2.10
36	600879	航天电子	25,323,368.00	2.07
37	601668	中国建筑	25,201,024.00	2.06
38	002456	欧菲科技	24,812,370.40	2.02
39	601058	赛轮金宇	24,647,034.40	2.01

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 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	601336	新华保险	90,476,739.85	7.38
2	002110	三钢闽光	80,358,930.26	6.55
3	600507	方大特钢	70,762,394.03	5.77
4	600782	新钢股份	63,706,631.46	5.20
5	000401	冀东水泥	61,716,200.84	5.03
6	002392	北京利尔	58,554,484.00	4.78
7	000725	京东方 A	54,981,000.00	4.48
8	002236	大华股份	54,429,857.34	4.44
9	300136	信维通信	53,651,397.20	4.38
10	600826	兰生股份	47,469,515.62	3.87
11	600019	宝钢股份	47,189,724.38	3.85
12	601668	中国建筑	41,522,737.98	3.39
13	600392	盛和资源	38,785,462.45	3.16
14	000776	广发证券	38,718,745.96	3.16
15	601600	中国铝业	36,762,276.56	3.00
16	300408	三环集团	36,498,646.78	2.98
17	000983	西山煤电	36,045,883.43	2.94
18	000709	河钢股份	35,807,549.15	2.92
19	000932	*ST 华菱	34,894,964.95	2.85
20	600104	上汽集团	34,500,439.64	2.81
21	300433	蓝思科技	34,181,875.61	2.79
22	002158	汉钟精机	32,684,593.10	2.67

23	600516	方大炭素	32,250,076.72	2.63
24	000717	韶钢松山	31,699,814.14	2.59
25	600999	招商证券	30,600,948.60	2.50
26	600183	生益科技	30,198,779.41	2.46
27	002450	康得新	30,089,363.63	2.45
28	600054	黄山旅游	29,685,707.08	2.42
29	002273	水晶光电	29,642,228.20	2.42
30	300232	洲明科技	29,551,934.08	2.41
31	600079	人福医药	28,874,020.38	2.36
32	600569	安阳钢铁	28,372,314.00	2.31
33	601328	交通银行	28,094,400.00	2.29
34	600056	中国医药	27,338,807.02	2.23
35	002174	游族网络	27,217,395.46	2.22
36	600703	三安光电	26,895,675.12	2.19
37	000786	北新建材	26,769,183.41	2.18
38	002456	欧菲科技	26,519,391.13	2.16
39	001979	招商蛇口	26,306,867.84	2.15
40	002013	中航机电	26,238,903.80	2.14
41	002233	塔牌集团	26,152,956.00	2.13
42	600648	外高桥	25,730,781.45	2.10
43	002475	立讯精密	25,499,247.93	2.08
44	600879	航天电子	25,312,708.00	2.06

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	3,044,148,596.49
卖出股票收入（成交）总额	3,163,847,772.96

### 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	49,995,000.00	4.59
	其中：政策性金融债	49,995,000.00	4.59
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）	632,832.80	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,627,832.80	4.65

### 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	150201	15 国开 01	500,000	49,995,000.00	4.59
2	110038	济川转债	5,960	632,832.80	0.06

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期期末未持有股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期期末未持有国债期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

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

#### 8.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

#### 8.12.3 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	295,037.06
2	应收证券清算款	29,289,809.84
3	应收股利	-
4	应收利息	1,907,931.36
5	应收申购款	99,858.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,592,637.15

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有的前十名股票中未存在流通受限。

## § 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
39,084	20,808.27	4,729,298.63	0.58%	808,541,028.39	99.42%

### 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	1,320,830.67	0.1624%

### 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	>100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2007 年 5 月 29 日 ）基金份额总额	8,921,315,668.58
本报告期期初基金份额总额	987,446,303.25
本报告期基金总申购份额	52,899,855.00
减:本报告期基金总赎回份额	227,075,831.23
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	813,270,327.02

## § 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，吴海云女士成为公司监事会主席。

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

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 100000 元人民币，该事务所已向本基金提供了 11 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其相关高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
广发证券	1	1,173,212,289.03	18.78%	1,092,611.91	18.99%	-
华泰证券	2	840,790,820.35	13.46%	775,381.92	13.48%	-
招商证券	1	792,869,983.14	12.69%	722,544.40	12.56%	-
国金证券	1	559,026,685.22	8.95%	509,442.64	8.86%	-
中信证券	1	529,608,418.78	8.48%	493,222.43	8.57%	-
国信证券	1	520,426,147.90	8.33%	474,265.76	8.24%	-
银河证券	1	342,701,389.23	5.49%	319,158.62	5.55%	-
海通证券	1	331,572,410.26	5.31%	302,162.99	5.25%	-
国泰君安	1	211,138,598.16	3.38%	192,411.47	3.34%	-
西南证券	1	206,040,519.68	3.30%	191,884.59	3.34%	-
中金公司	1	173,374,185.74	2.78%	161,461.90	2.81%	-
东北证券	1	171,260,500.74	2.74%	156,069.96	2.71%	-
太平洋证券	2	125,436,816.50	2.01%	114,311.42	1.99%	-
中原证券	1	90,540,901.57	1.45%	84,320.24	1.47%	-
方正证券	1	83,173,587.88	1.33%	75,796.26	1.32%	-
申银万国	1	76,044,428.15	1.22%	70,820.10	1.23%	-
中信建投	1	18,441,284.06	0.30%	17,174.70	0.30%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	23,056,786.30	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	30,000,000.00	100.00%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-

财达证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

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

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

### 11.8 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参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续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12月30日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加中国工商银行股份有限公司2018倾心回馈基金定期定额投资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12月28日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加浙商银行股份有限公司申购及定期定额投资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12月28日

5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加凤凰金信（银川）基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 28 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加中国邮政储蓄银行股份有限公司个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 28 日
7	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
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加天津万家财富资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换及申购费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 6 日
9	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
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加上海基煜基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 11 月 28 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换及申购费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 11 月 22 日

12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有长期停牌证券估值调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 11 月 21 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加上海挖财金融信息服务有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 11 月 3 日
14	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金 2017 第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 10 月 25 日
15	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
16	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金 2017 半年报	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 26 日
17	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金 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
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通基金定投业务及定投手续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 8 月 18 日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加华泰证券基金认购、申购、定期定额投资手续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 8 月 1 日
20	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 7 月 20 日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2017 年 7 月 14 日

	参加上海汇付金融服务有限公司费率优惠活动的公告	券报、证券时报	
22	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
23	华泰柏瑞积极成长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7月11日
24	华泰柏瑞积极成长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7月11日
25	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
26	华泰柏瑞基金关于参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续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1日
27	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
28	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加联储证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年6月10日
29	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年6月6日

	为代销机构同时开通基金转换业务的公告		
30	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加大有期货有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 5 月 25 日
31	华泰柏瑞基金关于增加伯嘉基金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 5 月 8 日
32	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金在财通证券股份有限公司开通基金定投和申购（含定期定额投资）手续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 5 月 3 日
33	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加金惠家保险代理有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 28 日
34	华泰柏瑞积极成长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
35	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续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 4 月 22 日
36	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构的	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 18 日

	公告		
37	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加广发证券网上、手机委托系统申购（不含定投）手续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3月31日
38	华泰柏瑞基金管理有限公司继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年3月29日
39	华泰柏瑞积极成长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
40	华泰柏瑞积极成长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
41	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年3月23日
42	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
43	华泰柏瑞基金关于增加上海朝阳永续基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换和参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年3月1日
44	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加华西证券股份有限公司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1日
45	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续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2月23日

46	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
47	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
48	华泰柏瑞积极成长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
49	华泰柏瑞基金关于增加新浪仓石为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 12 日
50	华泰柏瑞基金关于增加北京汇成为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 12 日
51	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金招募说明书摘要 2017 年 1 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 11 日
52	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金招募说明书 2017 年 1 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 11 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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

### 13.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2018 年 3 月 28 日