

# 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金

## 2018 年年度报告摘要

2018 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：2019 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2019 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金简称       | 华泰柏瑞亚洲领导企业混合(QDII) |
| 基金主代码      | 460010             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2010年12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 | 11,833,644.54份     |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 采取主动精选亚洲地区具有行业领导地位和国际竞争优势的企业，通过区域化分散投资，有效降低投资组合系统性风险，追求基金资产长期稳健增值。   |
| 投资策略   | 本基金投资研究团队将跟踪全球经济的发展趋势，重点研究亚洲地区内的宏观经济变量，采用自上而下的分析方法，以及定性和定量分析模型相结合的手段，确定基金资产在各国家/地区之间的配置。综合分析亚洲地区内的宏观经济指标、公司盈利发展趋势、资金流向、价格变动、社会政治风险、产业结构性风险等要素，采用专有定量模型作为参考工具，以确定各国股市的相对吸引力。通过将市场预期的净资产收益率、市净率及长期债券收益率等多种金融市场变量输入该模型，来确定各个市场的价值中枢，作为估值标准。 |
| 业绩比较基准 | MSCI 亚太综合指数(不含日本)  |
| 风险收益特征 | 本基金为区域性混合型证券投资基金，基金预期投资风险收益水平高于混合型基金和债券型基金。由于投   |

|  |                                    |
|--|------------------------------------|
|  | 资国家与地区市场的分散，长期而言风险应低于投资单一市场的混合型基金。 |
|--|------------------------------------|

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                      | 基金托管人                |
|---------|------|----------------------------|----------------------|
| 名称      |      | 华泰柏瑞基金管理有限公司               | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 陈晖                         | 王永民                  |
|         | 联系电话 | 021-38601777               | 010-66594896         |
|         | 电子邮箱 | cs4008880001@huatai-pb.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-888-0001               | 95566                |
| 传真      |      | 021-38601799               | 010-66594942         |

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目   |    | 境外资产托管人                          |
|------|----|----------------------------------|
| 名称   | 英文 | Bank of China (HongKong) Limited |
|      | 中文 | 中国银行（香港）有限公司                     |
| 注册地址 |    | 香港花园道 1 号中银大厦                    |
| 办公地址 |    | 香港花园道 1 号中银大厦                    |
| 邮政编码 |    | -                                |

### 2.5 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 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                      |

## § 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 | 2018年         | 2017年         | 2016年         |
|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期已实现收益       | 3,591,554.97  | 3,079,031.99  | -1,730,774.27 |
| 本期利润          | -2,035,838.86 | 7,102,237.11  | -668,304.55   |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1438       | 0.2322        | -0.0208       |
| 本期基金份额净值增长率   | -14.64%       | 29.48%        | -2.65%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018年末        | 2017年末        | 2016年末        |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.1489       | -0.3270       | -0.4298       |
| 期末基金资产净值      | 10,071,605.02 | 26,555,615.03 | 24,308,004.18 |
| 期末基金份额净值      | 0.851         | 0.997         | 0.770         |

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

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

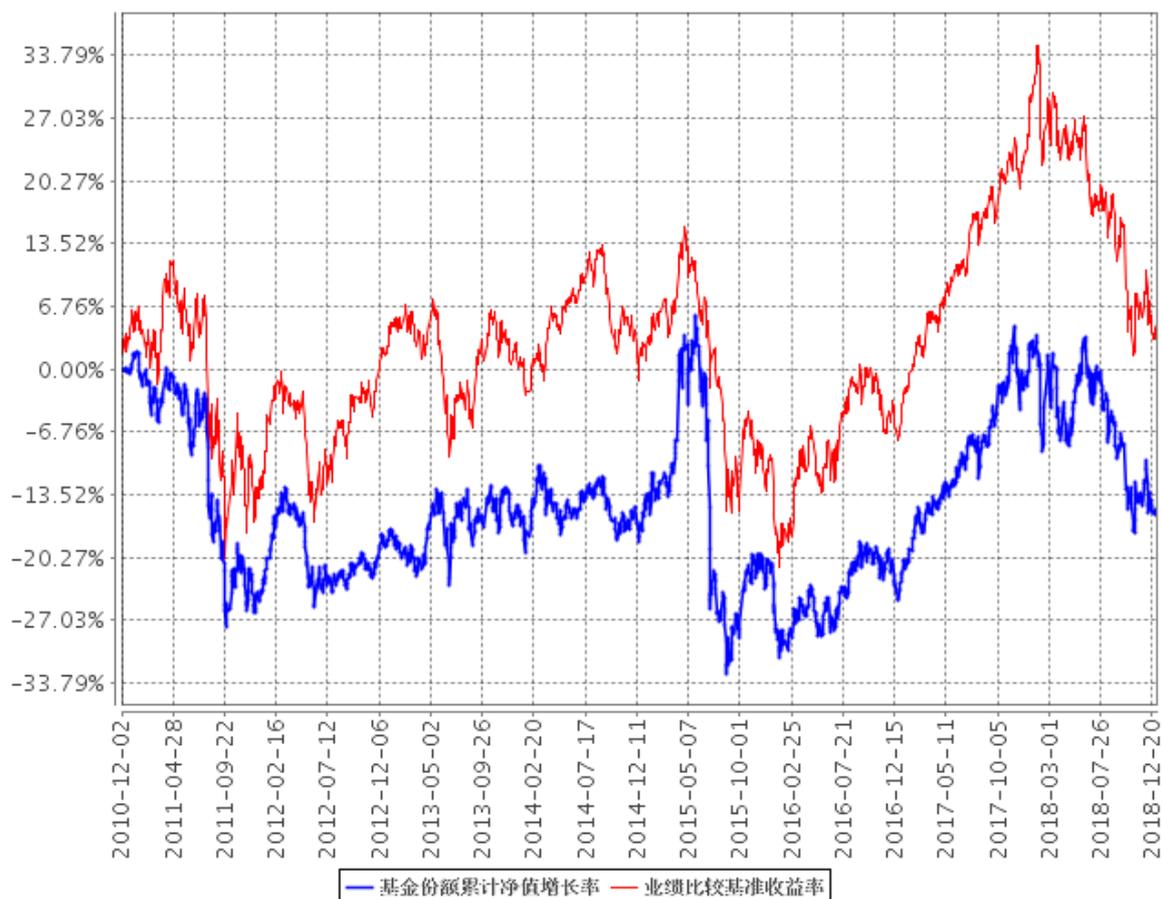
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率基准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率基准差④ | ①—③     | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月      | -7.40%   | 1.32%       | -9.28%     | 1.36%         | 1.88%   | -0.04% |
| 过去六个月      | -14.47%  | 1.09%       | -11.50%    | 1.08%         | -2.97%  | 0.01%  |
| 过去一年       | -14.64%  | 1.23%       | -16.25%    | 0.99%         | 1.61%   | 0.24%  |
| 过去三年       | 7.59%    | 1.02%       | 15.99%     | 0.87%         | -8.40%  | 0.15%  |
| 过去五年       | 0.24%    | 1.08%       | 1.91%      | 0.88%         | -1.67%  | 0.20%  |
| 自基金合同生效起至今 | -14.90%  | 1.03%       | 4.85%      | 0.98%         | -19.75% | 0.05%  |

### 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

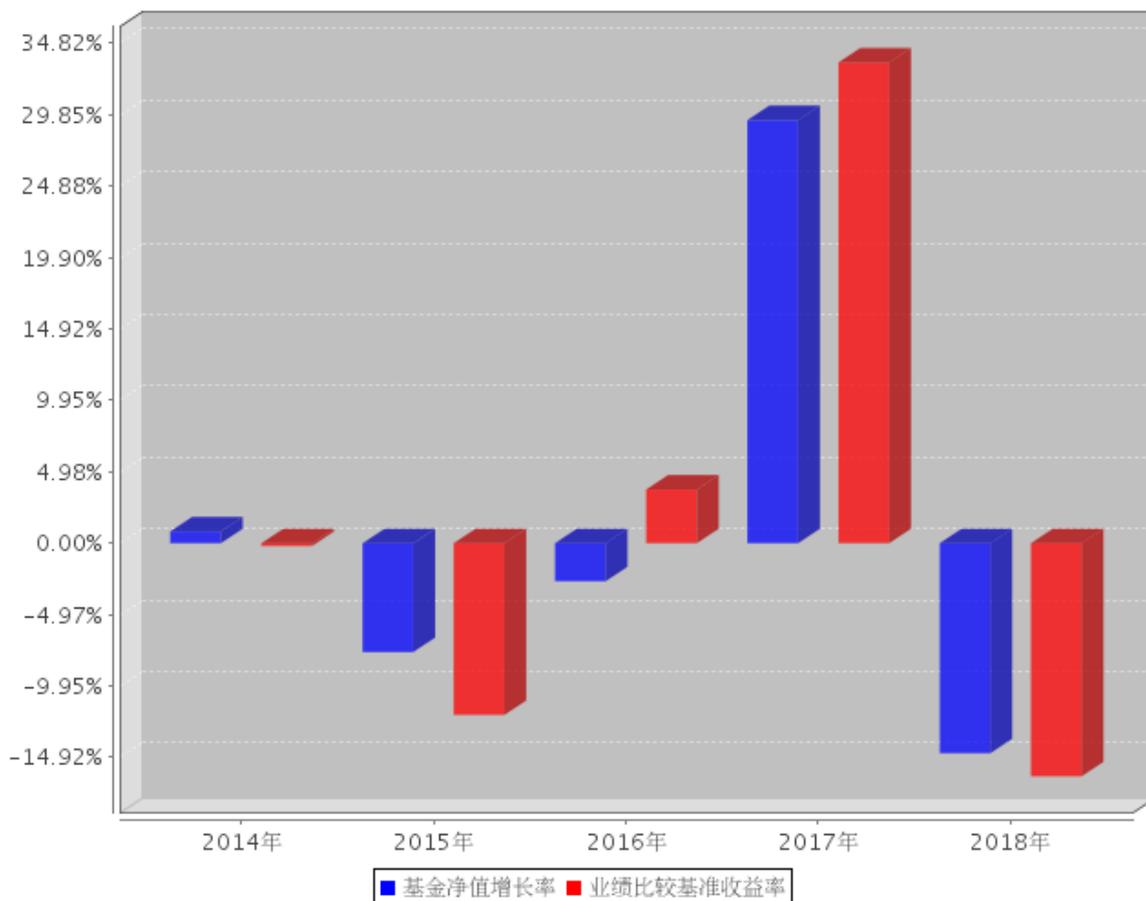
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2010 年 12 月 2 日至 2018 年 12 月 31 日。

### 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



注：基金合同生效日为 2010 年 12 月 2 日，2010 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## §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、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选 30 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、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞现代服务业混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金。截至 2018 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 980.05 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 |        |   |
| 黄明仁 | 海外投资部总监、本基金的基金经理 | 2010 年 12 月 2 日 | -    | 18 年   | 美国西雅图华盛顿大学财务金融专业管理学硕士，具有 17 年以上境外证券投资管理经验。2004-2006 年，任台湾建弘投资信托股份有限公司，建弘泛太平洋基金基金经理；2006-2008 年中，加入英国保诚投资信托股份有限公司，任保诚印度基金基金经理。2008 年加入本公司，2010 年 12 月起任华泰柏瑞亚洲领导企业混合基金基金经理，2015 年 1 月起任海外投资部总监。2016 年 11 月起任华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |

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

## 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金不聘请境外投资顾问，华泰柏瑞基金管理有限公司对全部资产进行自行管理。

## 4.3 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。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 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，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

### 4.4.2 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。

### 4.4.3 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。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2018 年，亚洲与新兴市场的股市都面临较大的回调，A 股的上证指数下跌 24.6%、香港恒生指数去年也下跌了 13.6%，MSCI 亚太不含日本指数去年下跌 16.25%，国内宏观经济数据在去年四季度比较明显走缓，中美贸易战影响了投资情绪，美股在去年 12 月由苹果股票带领科技股大跌使得全球股市的市值跌掉了近 6 万亿美元，损失的股票市值大于美联储帐上的 4 万亿美元债券，美联储表示可能调降加息的次数，而美元的弱势，对新兴市场的股市将是利好。

截至报告期末，本基金份额净值为 0.851 元，累计净值为 0.851 元，本报告期内基金份额净值增长率为-14.64%，同期业绩比较基准 MSCI Asia exJapan Index 收益率为-16.25%，与业绩基准相比取得了 1.61% 的超额收益。

### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.851 元；本报告期基金份额净值增长率为-14.64%，业绩比较基准收益率为-16.25%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，根据 Credit Suisse 的测算 2019 年 A 股整体的盈利增长虽只有 5%，不过从估值角度来看，目前上证指数与香港国企指数的 P/B 已经低于均值一倍的标准差，因此预期亚洲股票市场在 2019 年上半年会有一个估值修复的反弹。

## 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4次；每次基金收益分配比例不低于该次可分配收益的10%；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-1,726,684.58，报告期内基金未实施收益分配。

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

本基金本报告期内连续60个工作日出现基金净值低于五千万元。我司已根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的要求，于2015年3月13日向证监会报告并提交了本基金的转型方案，目前正逐步推进转型的后续事宜。

## §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”）在华泰柏瑞亚洲领导企业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(2019)第 21810 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         | 华泰柏瑞亚洲领导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亚洲领导企业混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞亚洲领导基金”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 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亚洲领导基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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亚洲领导基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>  |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>华泰柏瑞亚洲领导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亚洲领导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亚洲领导基金、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亚洲领导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。</p> |



## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体： 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日               | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日               |
|-----------------|------------|---------------------------------------|--|
| <b>资 产：</b>     |            |                                       |  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 3,508,408.78                          | 3,215,785.05                           |
| 结算备付金           |            | -                                     | -                                      |
| 存出保证金           |            | -                                     | -                                      |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 6,686,543.62                          | 23,499,304.18                          |
| 其中：股票投资         |            | 6,686,543.62                          | 23,499,304.18                          |
| 基金投资            |            | -                                     | -                                      |
| 债券投资            |            | -                                     | -                                      |
| 资产支持证券投资        |            | -                                     | -                                      |
| 贵金属投资           |            | -                                     | -                                      |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                                     | -                                      |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                                     | -                                      |
| 应收证券清算款         |            | 55,527.98                             | 31,694.45                              |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 69.19                                 | 291.84                                 |
| 应收股利            |            | 860.22                                | -                                      |
| 应收申购款           |            | 1,408.82                              | 16,654.07                              |
| 递延所得税资产         |            | -                                     | -                                      |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                                     | 392,294.90                             |
| 资产总计            |            | 10,252,818.61                         | 27,156,024.49                          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末</b><br><b>2018 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末</b><br><b>2017 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       |          | -             | -             |
| 应付赎回款         |          | 16,466.42     | 12,110.34     |
| 应付管理人报酬       |          | 15,537.21     | 40,523.69     |
| 应付托管费         |          | 3,021.12      | 7,879.62      |
| 应付销售服务费       |          | -             | -             |
| 应付交易费用        | 7.4.7.7  | -             | -             |
| 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  | 146,188.84    | 539,895.81    |
| 负债合计          |          | 181,213.59    | 600,409.46    |
| <b>所有者权益：</b> |          |               |               |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 11,833,644.54 | 26,622,776.82 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -1,762,039.52 | -67,161.79    |
| 所有者权益合计       |          | 10,071,605.02 | 26,555,615.03 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 10,252,818.61 | 27,156,024.49 |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.851 元，基金份额总额 11,833,644.54 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|----|-----|-------------------------------------|-------------------------------------|
|    |     | 2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 |
|    |     |                                     |                                     |

|                        |            |               |              |
|------------------------|------------|---------------|--------------|
| <b>一、收入</b>            |            | -1,458,933.10 | 8,155,165.77 |
| 1. 利息收入                |            | 6,927.13      | 8,793.14     |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 6,927.13      | 8,793.14     |
| 债券利息收入                 |            | -             | -            |
| 资产支持证券利息收入             |            | -             | -            |
| 买入返售金融资产收入             |            | -             | -            |
| 其他利息收入                 |            | -             | -            |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 4,125,898.36  | 4,315,442.19 |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | 3,966,596.10  | 3,897,023.38 |
| 基金投资收益                 | 7.4.7.13   | -             | 53,931.75    |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.14   | -             | -            |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.14.5 | -             | -            |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.15   | -             | -            |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.16   | -             | -            |
| 股利收益                   | 7.4.7.17   | 159,302.26    | 364,487.06   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18   | -5,627,393.83 | 4,023,205.12 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | 29,381.76     | -196,911.38  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.19   | 6,253.48      | 4,636.70     |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 576,905.76    | 1,052,928.66 |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 242,186.25    | 495,666.39   |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 47,091.78     | 96,379.67    |
| 3. 销售服务费               | 7.4.10.2.3 | -             | -            |
| 4. 交易费用                | 7.4.7.20   | 139,875.15    | 309,285.19   |
| 5. 利息支出                |            | -             | -            |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | -             | -            |

|                            |          |               |              |
|----------------------------|----------|---------------|--------------|
| 6. 税金及附加                   |          | -             | -            |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.21 | 147,752.58    | 151,597.41   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | -2,035,838.86 | 7,102,237.11 |
| 减：所得税费用                    |          | -             | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | -2,035,838.86 | 7,102,237.11 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期                    |               |                |
|-----------------------------------|-----------------------|---------------|----------------|
|                                   | 2018年1月1日至2018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）                   | 26,622,776.82         | -67,161.79    | 26,555,615.03  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）         | -                     | -2,035,838.86 | -2,035,838.86  |
| 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） | -14,789,132.28        | 340,961.13    | -14,448,171.15 |
| 其中：1. 基金申购款                       | 3,804,401.78          | -33,246.50    | 3,771,155.28   |
| 2. 基金赎回款                          | -18,593,534.06        | 374,207.63    | -18,219,326.43 |
| 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<br>(基金净值)                    | 11,833,644.54                    | -1,762,039.52 | 10,071,605.02  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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<br>(基金净值)                    | 31,588,435.25                    | -7,280,431.07 | 24,308,004.18  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)              | -                                | 7,102,237.11  | 7,102,237.11   |
| 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)      | -4,965,658.43                    | 111,032.17    | -4,854,626.26  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 6,177,797.95                     | -503,281.22   | 5,674,516.73   |
| 2. 基金赎回款                               | -11,143,456.38                   | 614,313.39    | -10,529,142.99 |
| 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<br>(基金净值)                    | 26,622,776.82                    | -67,161.79    | 26,555,615.03  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
韩勇

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
房伟力

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
赵景云

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金(原名为华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第1357号《关于核准华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币290,510,740.98元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第373号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金基金合同》于2010年12月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为290,565,328.80份基金份额,其中认购资金利息折合54,587.82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,境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金于2015年8月6日公告后更名为华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞亚洲领导企业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权益类品种,包括普通股、优先股、全球及美国存托凭证、股票型基金等;固定收益类品种,包括政府债券、公司债券、可转换债券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的固定收益类证券;银行存款、回购协议、短期政府债券与货币市场基金等货币市场工具;经中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品;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。本基金投资于股票的比例为基金资产的60%-100%,债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他证券品种为基金资产的0%-40%,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。此外,本基金不低于80%的权益类资产投资于亚洲领导企业。本基金的业绩比较基准为:MSCI亚太综合指数(不含日本)。

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2019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》、《华泰柏瑞亚洲领导企业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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2018 年 12 月 31 日,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表以持续经营为编制基础。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。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。

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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税率按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 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      |

|                           |                    |
|---------------------------|--------------------|
| 中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)      | 境外资产托管人            |
| 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    |
| PineBridge Investment LLC | 基金管理人的股东           |
| 苏州新区高新技术产业股份有限公司          | 基金管理人的股东           |
| 华泰金融控股(香港)有限公司            | 基金管理人的股东华泰证券的控股子公司 |
| 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 |
| 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。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称                  | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月<br>31日 |                      | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |                  |
|------------------------|---------------------------------|----------------------|----------------------------------|------------------|
|                        | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 华泰金融控<br>股(香港)有<br>限公司 | -                               | -                    | 1,604,674.00                     | 1.41%            |

#### 7.4.8.1.2 权证交易

注：无。

#### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |
|-------|-----------------------------|
|       |                             |

|                        | 当期<br>佣金                         | 占当期佣<br>金总量的<br>比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应<br>付佣金总<br>额的比例 |
|------------------------|----------------------------------|--------------------|----------|----------------------|
| 华泰金融控<br>股(香港)有<br>限公司 | -                                | -                  | -        | -                    |
| 关联方名称                  | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |                    |          |                      |
|                        | 当期<br>佣金                         | 占当期佣<br>金总量的<br>比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应<br>付佣金总<br>额的比例 |
| 华泰金融控<br>股(香港)有<br>限公司 | 1,283.74                         | 0.74%              | -        | -                    |

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目                  | 本期                        | 上年度可比期间                   |
|---------------------|---------------------------|---------------------------|
|                     | 2018年1月1日至2018年<br>12月31日 | 2017年1月1日至2017年12月<br>31日 |
| 当期发生的基金应支付<br>的管理费  | 242,186.25                | 495,666.39                |
| 其中：支付销售机构的<br>客户维护费 | 94,794.19                 | 169,816.67                |

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.8% / 当年天数。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|----------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|                | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年<br>12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月<br>31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 47,091.78                           | 96,379.67                           |

注：支付基金托管人中国银行的托管费(含境外托管人收取的费用)按前一日基金资产净值

0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值× 0.35% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                                      | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|
|   | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年<br>12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月<br>31 日 |
| 基金合同生效日（<br>2010 年 12 月 2 日）持有的<br>基金份额 | 5,001,200.00                        | 5,001,200.00                        |
| 期初持有的基金份额                               | 5,001,200.00                        | 5,001,200.00                        |
| 期间申购/买入总份额                              | 0.00                                | 0.00                                |
| 期间因拆分变动份额                               | 0.00                                | 0.00                                |
| 减：期间赎回/卖出总份额                            | 5,001,200.00                        | 0.00                                |
| 期末持有的基金份额                               | 0.00                                | 5,001,200.00                        |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例                   | 0.0000%                             | 18.7854%                            |

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期及上年度，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.8.5 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<br>2018年1月1日至2018年12月<br>31日 |            | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017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                            | 315,602.13 | 6,927.13                         | 1,304,959.28 |
| 中银香港  | 2,997,572.53                    | -          | 1,361,855.63                     | -            |
| 合计    | 3,313,174.66                    | 6,927.13   | 2,666,814.91                     | 8,793.14     |

注：本基金由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管的银行存款按适用利率或约定利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

#### 7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

##### 7.4.9.2 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 |
|--------|------|----------|--------|--------|------|--------|---------|--------------|------------|----|
| 591 HK | 中国精密 | 2012年12月 | 重大事项未公 | 0.53   | -    | -      | 504,000 | 1,157,443.50 | 269,378.93 | -  |

|  |  |     |   |  |  |  |  |  |  |
|--|--|-----|---|--|--|--|--|--|--|
|  |  | 4 日 | 布 |  |  |  |  |  |  |
|--|--|-----|---|--|--|--|--|--|--|

注：本基金截至 2018 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。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

### 7.4.10 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 2018 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 6,417,164.69 元，属于第三层次的余额为 269,378.93 元，无属于第二层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 22,985,319.84 元，第二层次 513,984.34 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，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

上述第三层次资产变动如下：

|   | 交易性金融资产<br>权益工具投资  |
|---|--------------------|
| 2018 年 1 月 1 日  | -                  |
| 购买  | -                  |
| 出售  | -                  |
| 转入第三层级  | 269,378.93         |
| 转出第三层级  | -                  |
| 当期利得或损失总额   | -                  |
| 计入损益的利得或损失  | -                  |
| 2018 年 12 月 31 日  | <u>269,378.93</u>  |
| 2018 年 12 月 31 日仍持有的资产计入<br>2018 年度损益的未实现利得或损失的变动<br>——公允价值变动损益 | <u>-244,605.41</u> |

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

|                     | 2018 年 12 月<br>31 日公允价值 | 估值技术 | 名称  | 不可观察输入值          |                    |
|---------------------|-------------------------|------|-----|------------------|--------------------|
|                     |                         |      |     | 范围/加<br>权平均<br>值 | 与公允价<br>值之间的<br>关系 |
| 交易性金融资产——<br>权益工具投资 | 269,378.93              | 市场法  | 市净率 | 0.29             | 正相关                |

(a) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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(2017 年 12 月 31 日：

同)。

(b) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 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              | 6,686,543.62  | 65.22         |
|    | 其中：普通股            | 6,686,543.62  | 65.22         |
|    | 存托凭证              | -             | -             |
|    | 优先股               | -             | -             |
|    | 房地产信托凭证           | -             | -             |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -             |
|    | 其中：债券             | -             | -             |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
|    | 其中：远期             | -             | -             |
|    | 期货                | -             | -             |
|    | 期权                | -             | -             |
|    | 权证                | -             | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 6  | 货币市场工具            | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 3,508,408.78  | 34.22         |
| 8  | 其他各项资产            | 57,866.21     | 0.56          |
| 9  | 合计                | 10,252,818.61 | 100.00        |

### 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家(地区) | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|--------|--------------|---------------|
| 香港     | 5,725,498.24 | 56.85         |
| 台湾     | 961,045.38   | 9.54          |
| 合计     | 6,686,543.62 | 66.39         |

### 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币

元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|------|------|---------------|
|------|------|---------------|

|          |              |       |
|----------|--------------|-------|
| 非日常生活消费品 | 878,359.84   | 8.72  |
| 医疗保健     | 396,392.88   | 3.94  |
| 金融       | 1,000,410.11 | 9.93  |
| 信息技术     | 2,622,600.97 | 26.04 |
| 公用事业     | 1,788,779.82 | 17.76 |
| 合计       | 6,686,543.62 | 66.39 |

注：本公司采用的行业分类标准为全球行业分类标准 GICS。

#### 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)                            | 公司名<br>称(中<br>文) | 证券代<br>码   | 所在<br>证券<br>市场 | 所属国<br>家(地<br>区) | 数量(股)  | 公允价值       | 占基金资<br>产净值比<br>例(%) |
|----|-------------------------------------|------------------|------------|----------------|------------------|--------|------------|----------------------|
| 1  | CHINA<br>RESOURCES GAS<br>GROUP LTD | 华润燃<br>气         | 1193<br>HK | 香港<br>交易<br>所  | CH               | 30,000 | 814,866.00 | 8.09                 |
| 2  | TENCENT<br>HOLDINGS LTD             | 腾讯控<br>股         | 700 HK     | 香港<br>交易<br>所  | CH               | 2,500  | 687,817.00 | 6.83                 |
| 3  | AIA GROUP LTD                       | 友邦保<br>险         | 1299<br>HK | 香港<br>交易<br>所  | CH               | 12,000 | 683,436.00 | 6.79                 |
| 4  | CK ASSET<br>HOLDINGS LTD            | 长实集<br>团         | 1113<br>HK | 香港<br>交易<br>所  | CH               | 12,000 | 602,475.12 | 5.98                 |
| 5  | TAIWAN<br>SEMICONDUCTOR<br>MANUFAC  | 台积电              | 2330<br>TT | 台湾<br>亚交<br>易所 | CH               | 10,000 | 506,345.17 | 5.03                 |
| 6  | CATCHER<br>TECHNOLOGY CO<br>LTD     | 可成科<br>技         | 2474<br>TT | 台湾<br>亚交<br>易所 | CH               | 9,000  | 454,700.21 | 4.51                 |

|    |                                    |            |            |               |    |        |            |      |
|----|------------------------------------|------------|------------|---------------|----|--------|------------|------|
| 7  | MELCO<br>INTERNATIONAL<br>DEVELOP. | 新濠国<br>际发展 | 200 HK     | 香港<br>交易<br>所 | CH | 30,000 | 419,524.56 | 4.17 |
| 8  | SSY GROUP LTD                      | 石四药<br>集团  | 2005<br>HK | 香港<br>交易<br>所 | CH | 78,000 | 396,392.88 | 3.94 |
| 9  | HUA HONG<br>SEMICONDUCTOR<br>LTD   | 华虹半<br>导体  | 1347<br>HK | 香港<br>交易<br>所 | CH | 30,000 | 381,147.00 | 3.78 |
| 10 | GUANGDONG<br>INVESTMENT<br>LTD     | 粤海投<br>资   | 270 HK     | 香港<br>交易<br>所 | CH | 28,000 | 371,438.70 | 3.69 |

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

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)                        | 证券代码    | 本期累计买入金额     | 占期初基金<br>资产净值比<br>例(%) |
|----|---------------------------------|---------|--------------|------------------------|
| 1  | GREAT WALL<br>MOTOR COMPANY-H   | 2333 HK | 1,075,374.17 | 4.05                   |
| 2  | LARGAN<br>PRECISION CO<br>LTD   | 3008 TT | 876,980.47   | 3.30                   |
| 3  | CHINA RESOURCES<br>GAS GROUP LT | 1193 HK | 825,418.15   | 3.11                   |
| 4  | MMG LTD                         | 1208 HK | 813,245.69   | 3.06                   |
| 5  | CHINA SOUTHERN                  | 1055 HK | 716,066.74   | 2.70                   |

|    |                                    |         |            |      |
|----|------------------------------------|---------|------------|------|
|    | AIRLINES CO-H                      |         |            |      |
| 6  | AIA GROUP LTD                      | 1299 HK | 681,344.30 | 2.57 |
| 7  | PRESIDENT CHAIN<br>STORE CORP      | 2912 TT | 673,602.76 | 2.54 |
| 8  | SHIMAO PROPERTY<br>HOLDINGS LTD    | 813 HK  | 651,379.94 | 2.45 |
| 9  | CK ASSET<br>HOLDINGS LTD           | 1113 HK | 600,329.94 | 2.26 |
| 10 | CHINA<br>INTERNATIONAL<br>CAPITA-H | 3908 HK | 592,918.38 | 2.23 |
| 11 | MELCO<br>INTERNATIONAL<br>DEVELOP. | 200 HK  | 591,097.29 | 2.23 |
| 12 | KINGDEE<br>INTERNATIONAL<br>SFTWR  | 268 HK  | 560,062.96 | 2.11 |
| 13 | CATCHER<br>TECHNOLOGY CO<br>LTD    | 2474 TT | 544,254.47 | 2.05 |
| 14 | GUANGDONG<br>INVESTMENT LTD        | 270 HK  | 520,332.26 | 1.96 |
| 15 | CHINA CITIC<br>BANK CORP LTD-H     | 998 HK  | 478,935.57 | 1.80 |
| 16 | SUN ART RETAIL<br>GROUP LTD        | 6808 HK | 477,528.65 | 1.80 |
| 17 | ANHUI CONCH<br>CEMENT CO LTD-H     | 914 HK  | 466,860.02 | 1.76 |
| 18 | PETROCHINA CO                      | 857 HK  | 458,662.98 | 1.73 |

|    |                                 |        |            |      |
|----|---------------------------------|--------|------------|------|
|    | LTD-H                           |        |            |      |
| 19 | CHINA OVERSEAS<br>LAND & INVEST | 688 HK | 447,931.79 | 1.69 |
| 20 | CHINA PETROLEUM<br>& CHEMICAL-H | 386 HK | 439,873.73 | 1.66 |

注：不考虑相关交易费用。

### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)                           | 证券代码    | 本期累计卖出金额     | 占期初基金<br>资产净值比<br>例(%) |
|----|------------------------------------|---------|--------------|------------------------|
| 1  | PING AN<br>INSURANCE GROUP<br>CO-H | 2318 HK | 1,558,313.90 | 5.87                   |
| 2  | ANTA SPORTS<br>PRODUCTS LTD        | 2020 HK | 1,555,675.25 | 5.86                   |
| 3  | TENCENT<br>HOLDINGS LTD            | 700 HK  | 1,513,650.09 | 5.70                   |
| 4  | PETROCHINA CO<br>LTD-H             | 857 HK  | 1,387,004.46 | 5.22                   |
| 5  | GEELY<br>AUTOMOBILE<br>HOLDINGS LT | 175 HK  | 1,276,546.17 | 4.81                   |
| 6  | AAC<br>TECHNOLOGIES<br>HOLDINGS IN | 2018 HK | 1,157,201.71 | 4.36                   |
| 7  | TECHTRONIC<br>INDUSTRIES CO<br>LTD | 669 HK  | 1,075,823.53 | 4.05                   |

|    |                                    |         |              |      |
|----|------------------------------------|---------|--------------|------|
| 8  | SUNNY OPTICAL<br>TECH              | 2382 HK | 1,009,398.09 | 3.80 |
| 9  | MMG LTD                            | 1208 HK | 999,163.18   | 3.76 |
| 10 | LARGAN<br>PRECISION CO<br>LTD      | 3008 TT | 980,333.07   | 3.69 |
| 11 | NEXTEER<br>AUTOMOTIVE<br>GROUP LTD | 1316 HK | 933,210.26   | 3.51 |
| 12 | CHINA MEDICAL<br>SYSTEM HOLDING    | 867 HK  | 930,361.66   | 3.50 |
| 13 | IND & COMM BK<br>OF CHINA-H        | 1398 HK | 898,999.00   | 3.39 |
| 14 | GREAT WALL<br>MOTOR COMPANY-H      | 2333 HK | 796,687.84   | 3.00 |
| 15 | NEW CHINA LIFE<br>INSURANCE C-H    | 1336 HK | 790,847.15   | 2.98 |
| 16 | GALAXY<br>ENTERTAINMENT<br>GROUP L | 27 HK   | 756,516.18   | 2.85 |
| 17 | CHINA SOUTHERN<br>AIRLINES CO-H    | 1055 HK | 695,599.67   | 2.62 |
| 18 | WIN<br>SEMICONDUCTORS<br>CORP      | 3105 TT | 691,037.52   | 2.60 |
| 19 | PRESIDENT CHAIN<br>STORE CORP      | 2912 TT | 664,409.75   | 2.50 |
| 20 | CHINA<br>CONSTRUCTION              | 939 HK  | 635,572.11   | 2.39 |

|    |                                    |         |            |      |
|----|------------------------------------|---------|------------|------|
|    | BANK-H                             |         |            |      |
| 21 | CHINA YONGDA<br>AUTOMOBILES SER    | 3669 HK | 573,082.88 | 2.16 |
| 22 | CHINA<br>INTERNATIONAL<br>CAPITA-H | 3908 HK | 546,127.66 | 2.06 |
| 23 | YANGTZE OPTICAL<br>FIBRE AND-H     | 6869 HK | 537,572.54 | 2.02 |
| 24 | CHINA MAPLE<br>LEAF<br>EDUCATIONAL | 1317 HK | 533,916.35 | 2.01 |

注：不考虑相关交易费用。

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

|            |               |
|------------|---------------|
| 买入成本（成交）总额 | 18,769,027.53 |
| 卖出收入（成交）总额 | 33,920,990.36 |

注：不考虑相关交易费用。

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

### 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：无。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

### 8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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况。

### 8.11.3 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   | -         |
| 2  | 应收证券清算款 | 55,527.98 |
| 3  | 应收股利    | 860.22    |
| 4  | 应收利息    | 69.19     |
| 5  | 应收申购款   | 1,408.82  |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 57,866.21 |

### 8.11.4 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。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 787          | 15,036.40     | 0.00  | 0.00%      | 11,833,644.54 | 100.00%    |

### 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<br>持有本基金 | 296,535.28 | 2.5059%  |

### 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<br>部门负责人持有本开放式基金 | 10~50             |
| 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（2010 年 12 月 2 日）基金份额总额 | 139,682,454.14 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 26,622,776.82  |
| 本报告期期间基金总申购份额                  | 3,804,401.78   |
| 减：本报告期期间基金总赎回份额                | 18,593,534.06  |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）     | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 11,833,644.54  |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

2018年8月20日，公司任命李晓西先生为公司副总经理，李晓西先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试，其任命已在中国证券投资基金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2018年8月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。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。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为72,000.00元人民币，该事务所已向本基金提供了8年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 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<br>成交总额的比<br>例 | 佣金        | 占当期佣金<br>总量的比例 |   |
|------------------|----|---------------|----------------------|-----------|----------------|---|
| NOMURA           | -  | 10,722,171.71 | 20.00%               | 16,083.26 | 19.90%         | - |
| SWHYHK           | -  | 9,798,286.52  | 18.28%               | 14,697.46 | 18.19%         | - |
| CREDIT<br>SUISSE | -  | 8,115,057.85  | 15.14%               | 16,230.12 | 20.08%         | - |
| CITI             | -  | 7,286,067.92  | 13.59%               | 10,929.10 | 13.52%         | - |
| DAIWAHK          | -  | 6,785,057.96  | 12.66%               | 6,785.06  | 8.40%          | - |
| MAST             | -  | 3,957,829.76  | 7.38%                | 4,749.14  | 5.88%          | - |
| UOB              | -  | 2,734,863.36  | 5.10%                | 5,469.72  | 6.77%          | - |
| CATHAY           | -  | 1,651,186.04  | 3.08%                | 1,650.08  | 2.04%          | - |
| CICC             | -  | 1,297,981.38  | 2.42%                | 2,336.37  | 2.89%          | - |
| Macquarie        | -  | 1,259,271.69  | 2.35%                | 1,888.91  | 2.34%          | - |

### 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 |                          | 基金交易 |                          |
|------------------|------|--------------------------|--------|----------------------------|------|--------------------------|------|--------------------------|
|                  | 成交金额 | 占当期<br>债券<br>成交总<br>额的比例 | 成交金额   | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额 | 占当期权<br>证<br>成交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期基<br>金<br>成交总额<br>的比例 |
| NOMURA           | -    | -                        | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                        |
| SWHYHK           | -    | -                        | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                        |
| CREDIT<br>SUISSE | -    | -                        | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                        |
| CITI             | -    | -                        | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                        |
| DAIWAHK          | -    | -                        | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                        |

|           |   |   |   |   |   |   |   |   |
|-----------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MAST      | - | - | - | - | - | - | - | - |
| UOB       | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CATHAY    | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CICC      | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Macquarie | - | - | - | - | - | - | - | - |

## §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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019 年 3 月 27 日