

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 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：2017 年 3 月 29 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 2017 年 3 月 28 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，投资者在做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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 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

基金名称	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 500ETF
基金主代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 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	266,429,801.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015-06-12

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

传真	021-38601799	010-66594942
----	--------------	--------------

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§ 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	2016 年	2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-59,715,972.50	-8,737,929.63
本期利润	-75,320,257.10	-80,084,658.96
加权平均基金份额本期利润	-0.2525	-0.2127
本期基金份额净值增长率	-15.93%	-24.47%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.7342	-0.4921
期末基金资产净值	340,291,455.37	483,789,562.68
期末基金份额净值	1.2772	1.5193

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.02%	0.82%	-1.02%	0.83%	1.04%	-0.01%
过去六个月	3.88%	0.92%	2.29%	0.92%	1.59%	0.00%
过去一年	-15.93%	1.88%	-17.78%	1.90%	1.85%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-36.50%	2.47%	-28.38%	2.52%	-8.12%	-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

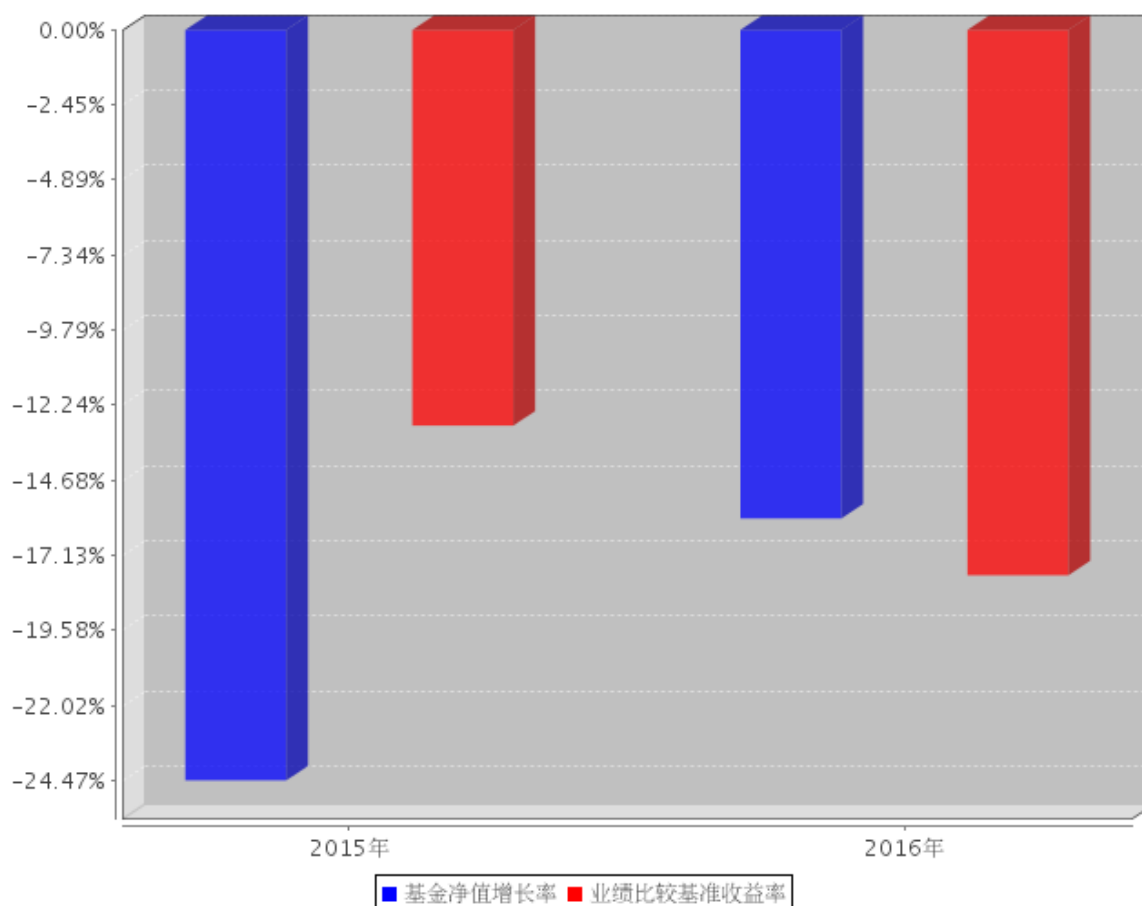


注：1、图示日期为 2015 年 5 月 13 日至 2016 年 12 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分（四）投资范围中规定的比例，即投资于指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效日为 2015 年 5 月 13 日，2015 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、华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金。截至 2016 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 974.88 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		
柳军	指数投资部总监、本基金的基金经理	2015 年 5 月 13 日	-	15 年	柳军，15 年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士，2000 年至 2001 年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作，2001 年至 2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月起加入本公司，

					历任基金事务部总监、基金经理助理。2009 年 6 月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010 年 10 月 1 日起任华泰柏瑞指数投资部副总监。2011 年 1 月起担任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 及华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起担任华泰柏瑞沪深 300ETF 及华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金基金经理。2015 年 2 月起任华泰柏瑞指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 ETF 及华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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）下进行分析，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。

4.3.2 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，只在少数情况下“存在显著的倾向性”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究表明，交易价差方向没有规律性，即没有明确的利益输送方向。造成少量显著交易价差的原因来自两方面：一是报告期内股票市场的波动幅度较大，为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件；二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异，对证券买卖时点的把握也不同，导致股票买卖存在价差。

4.3.3 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。本报告期公司旗下基金所管理的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

2016 年海内外资本市场均可谓多事之秋。年初，受“熔断”和汇率政策不确定性的影响，A 股大幅下挫。上半年市场并无明确方向，但受到一季度房地产和汽车超预期、商品价格上涨和国际政治环境震动等因素影响，市场结构性机会频现。下半年市场的核心驱动力是供给侧改革推动下的商品周期复苏，而特朗普美国大选获胜后，市场对于其后期财政和基建政策的乐观预期，带动市场对于经济复苏的信心，相关板块表现亮眼。全年看，2016 是“价值”因子回归的一年。主要指数中，上证 50 和上证红利相对表现最佳，年涨跌幅为-2.72%和-4.04%，而创业板跌幅最深，为-27.71%。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的累计跟踪偏离为 1.847%，日均绝对跟踪偏离度为 0.027%，期间日跟踪误差为 0.035%，较好地实现了本基金的投资目标。

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 1.2772 元，累计净值为 1.2772 元，本报告期内基金份额净值下跌 15.93%，本基金的业绩比较基准下跌 17.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于 2017 年投资我们谨慎乐观。考虑商品周期性复苏和房地产调控影响之后反映等因素以及十九大情绪推动，A 股上半年投资机会较为确定。但“盈利增速”和“利率上行”两者的相对走势仍需观察。相对而言，对于下半年投资我们倾向于更具有确定性因素的国企混改、新型基建（如环保）、军工等板块，以及可能超预期的一带一路主题。

从风格来看，预期 17 年价值因子将继续有效。叠加本轮增量资金以保险、银行为主，从其投资偏好来看，高股息率、低估值组合可能有超额收益。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 4 次；每次分配比例不低于基金期末可分配利润的 10%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。报告期内基金未实施收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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”）在华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（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

普华永道会计师事务所对本基金的年度报告出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2017)第 21065 号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	5,795,897.60	7,432,887.53
结算备付金		7,621.87	136,780.55
存出保证金		24,029.30	306,080.35
交易性金融资产	7.4.7.2	335,335,336.76	477,173,431.87

其中：股票投资		335,335,336.76	477,173,431.87
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		-	247,231.55
应收利息	7.4.7.5	1,323.60	2,273.60
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		341,164,209.13	485,298,685.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		194,335.86	92,288.48
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		146,620.06	207,092.66
应付托管费		29,324.00	41,418.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	92,473.84	335,620.97
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	410,000.00	832,702.15
负债合计		872,753.76	1,509,122.77
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	535,901,783.09	640,495,535.73
未分配利润	7.4.7.10	-195,610,327.72	-156,705,973.05
所有者权益合计		340,291,455.37	483,789,562.68
负债和所有者权益总计		341,164,209.13	485,298,685.45

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 13 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-71,998,888.94	-75,473,986.21
1.利息收入		27,877.21	643,171.08
其中：存款利息收入	7.4.7.11	27,754.38	584,559.94
债券利息收入		122.83	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	58,611.14
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-56,441,485.58	-6,923,140.46
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-59,156,757.58	-8,743,838.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	86,736.75	-
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	2,628,535.25	1,820,697.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-15,604,284.60	-71,346,729.33
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	19,004.03	2,152,712.50
减：二、费用		3,321,368.16	4,610,672.75
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,853,772.75	1,689,802.70
2.托管费	7.4.10.2.2	370,754.52	337,960.45
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.交易费用	7.4.7.19	459,862.43	2,095,474.42
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	636,978.46	487,435.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-75,320,257.10	-80,084,658.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-75,320,257.10	-80,084,658.96

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	640,495,535.73	-156,705,973.05	483,789,562.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-75,320,257.10	-75,320,257.10
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）	-104,593,752.64	36,415,902.43	-68,177,850.21
其中：1.基金申购款	108,616,589.37	-44,042,968.09	64,573,621.28
2.基金赎回款	-213,210,342.01	80,458,870.52	-132,751,471.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	535,901,783.09	-195,610,327.72	340,291,455.37
项目	上年度可比期间 2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 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）	873,820,061.00	-	873,820,061.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-80,084,658.96	-80,084,658.96
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）	-233,324,525.27	-76,621,314.09	-309,945,839.36
其中：1.基金申购款	470,671,887.07	-96,613,595.35	374,058,291.72
2.基金赎回款	-703,996,412.34	19,992,281.26	-684,004,131.08
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	640,495,535.73	-156,705,973.05	483,789,562.68

金净值)			
------	--	--	--

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(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[2015]508 号《关于核准华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》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《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,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 873,771,921.00 元(含募集股票市值),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(2015)第 460 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 873,820,061.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 48,140.00 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《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金于 2015 年 6 月 3 日进行了基金份额折算,折算比例为 0.49716235,并于 2015 年 6 月 4 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2015]236 号文审核同意,本基金 434,429,801.00 份基金份额于 2015 年 6 月 12 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,于 2015 年 5 月 13 日募集成立了华泰柏瑞

中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2017 年 3 月 29 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞行业领先股票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发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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

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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

7.4.7 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	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、一级交易商
柏瑞投资有限责任公司	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
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（“中证 500ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例

华泰证券	-	-	14,691,700.17	0.91%
------	---	---	---------------	-------

7.4.8.1.2 债券交易

注：无。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.8.1.4 权证交易

注：无。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
关联方名称	上年度可比期间 2015年5月13日(基金合同生效日)至2015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	13,000.61	0.89%	13,000.61	3.87%

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,853,772.75	1,689,802.70
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应支付的管理人报酬 E 为前一日的基金资产净值 基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内

从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	370,754.52	337,960.45

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应支付的托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

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固有资金投资本基金的情况

注：无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
中证 500ETF 联接基金	143,646,934.00	53.9155%	171,414,112.00	53.8311%

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 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
中国银行股份有限公司	5,795,897.60	25,104.02	7,432,887.53	561,672.02

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金报告期末未参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

7.4.9 期末（2016 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

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
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	23.16	23.16	1,455	33,697.80	33,697.80	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁	2016 年	2017 年	新股流	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-

	股份	12 月 28 日	1 月 5 日	通受限						
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603032	德新交运	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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
000887	中鼎股份	2016 年 11 月 18 日	重大资产重组	25.94	2017 年 2 月 15 日	23.99	54,348	1,490,931.18	1,409,787.12	-
601168	西部矿业	2016 年 12 月 19 日	重大资产重组	7.83	-	-	164,212	1,169,299.77	1,285,779.96	-
000748	长城信息	2016 年 11 月 1 日	重大资产重组	20.31	-	-	60,142	1,968,387.88	1,221,484.02	-

000547	航天发 展	2016 年 4 月 19 日	重大资 产重组	15.36	2017 年 1 月 3 日	16.90	78,854	2,159,572.57	1,211,197.44	-
300088	长信科 技	2016 年 9 月 12 日	重大资 产重组	15.80	-	-	75,400	1,095,712.93	1,191,320.00	-
002400	省广股 份	2016 年 11 月 28 日	发行股 份购买 资产	13.79	-	-	83,350	1,791,874.24	1,149,396.50	-
600673	东阳光 科	2016 年 11 月 15 日	重大资 产重组	7.29	-	-	152,600	1,368,941.42	1,112,454.00	-
600655	豫园商 城	2016 年 12 月 20 日	重大资 产重组	11.42	-	-	87,703	1,662,132.88	1,001,568.26	-
000050	深天马 A	2016 年 9 月 12 日	重大资 产重组	18.82	2017 年 3 月 23 日	20.70	51,402	1,041,749.80	967,385.64	-
000697	炼石有 色	2016 年 11 月 17 日	重大资 产重组	23.51	-	-	39,898	892,561.86	938,001.98	-
600161	天坛生 物	2016 年 12 月 6 日	重大资 产重组	39.40	2017 年 3 月 24 日	43.34	22,057	847,726.77	869,045.80	-
000563	陕国投 A	2016 年 10 月 14 日	重大资 产重组	7.48	2017 年 1 月 18 日	6.73	114,834	777,293.64	858,958.32	-
002491	通鼎互 联	2016 年 12 月 22 日	发行股 份购买 资产	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	54,600	894,886.00	848,484.00	-
600151	航天机 电	2016 年 11 月 11 日	重大资 产重组	10.97	-	-	76,594	1,203,992.98	840,236.18	-
002602	世纪华 通	2016 年 12 月 15 日	重大资 产重组	46.89	2017 年 1 月 9 日	50.00	17,400	357,884.33	815,886.00	-
000727	华东科 技	2016 年 11 月 17 日	重大资 产重组	3.37	2017 年 2 月 15 日	3.47	235,700	789,307.62	794,309.00	-

600687	刚泰控股	2016 年 7 月 25 日	重大资产重组	16.42	2017 年 1 月 18 日	16.38	45,800	755,478.23	752,036.00	-
600645	中源协和	2016 年 12 月 13 日	重大资产重组	26.80	-	-	26,100	1,316,522.50	699,480.00	-
002440	闰土股份	2016 年 10 月 24 日	重大资产重组	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	42,300	995,724.46	691,182.00	-
600171	上海贝岭	2016 年 12 月 14 日	发行股份购买资产	14.05	2017 年 2 月 16 日	14.90	46,400	1,046,819.40	651,920.00	-
000829	天音控股	2016 年 9 月 29 日	重大事项	11.28	-	-	53,301	955,874.01	601,235.28	-
002396	星网锐捷	2016 年 9 月 12 日	发行股份购买资产	19.70	2017 年 2 月 21 日	18.35	30,168	842,109.21	594,309.60	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	重大资产重组	25.20	-	-	23,384	648,021.24	589,276.80	-
002635	安洁科技	2016 年 11 月 8 日	重大资产重组	36.40	2017 年 2 月 8 日	33.50	14,200	355,015.30	516,880.00	-
600537	亿晶光电	2016 年 12 月 27 日	重大事项	7.43	2017 年 1 月 13 日	8.17	68,100	585,314.15	505,983.00	-
600859	王府井	2016 年 9 月 27 日	重大资产重组	16.28	-	-	27,342	598,803.92	445,127.76	-
002681	奋达科技	2016 年 12 月 19 日	重大资产重组	12.93	-	-	32,237	630,553.05	416,824.41	-
002727	一心堂	2016 年 12 月 28 日	非公开发行股票	21.20	2017 年 1 月 5 日	21.66	19,627	578,763.26	416,092.40	-
601005	重庆钢铁	2016 年 6 月 2 日	重大资产重组	2.52	-	-	159,800	722,178.61	402,696.00	-

600551	时代出版	2016 年 11 月 28 日	重大资产重组	20.32	-	-	18,496	438,579.50	375,838.72	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大资产重组	12.50	-	-	28,100	668,553.37	351,250.00	-
603169	兰石重装	2016 年 11 月 24 日	重大资产重组	13.36	2017 年 3 月 21 日	14.32	24,200	471,515.06	323,312.00	-
603555	贵人鸟	2016 年 12 月 12 日	重大资产重组	30.76	-	-	10,400	449,602.61	319,904.00	-
002745	木林森	2016 年 7 月 18 日	重大资产重组	36.49	-	-	6,880	243,270.89	251,051.20	-
603986	兆易创新	2016 年 9 月 19 日	重大资产重组	177.97	2017 年 3 月 13 日	195.77	1,133	26,353.58	201,640.01	-
300518	盛讯达	2016 年 12 月 13 日	重大资产重组	113.46	-	-	1,306	29,019.32	148,178.76	-
300526	中潜股份	2016 年 12 月 7 日	重大资产重组	107.03	-	-	984	10,332.00	105,317.52	-
002798	帝王洁具	2016 年 11 月 2 日	重大资产重组	67.00	2017 年 1 月 17 日	60.34	1,056	11,161.92	70,752.00	-
300537	广信材料	2016 年 10 月 12 日	重大资产重组	48.79	2017 年 1 月 13 日	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96	-

注：本基金截至 2016 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

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) 基金申购款

于 2016 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 374,058,291.72 元，其中包括以股票支付的申购款 162,192,627.16 元和以现金支付的申购款 211,865,664.56 元。

(2) 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 2016 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 308,907,327 元，属于第二层次的余额为 26,428,010.01 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 429,239,338.13 元，属于第二层次的余额为 47,934,093.74 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 2016 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(2015 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) 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	335,335,336.76	98.29
	其中：股票	335,335,336.76	98.29
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	5,803,519.47	1.70
7	其他各项资产	25,352.90	0.01
8	合计	341,164,209.13	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	4,356,967.91	1.28
B	采矿业	13,369,668.21	3.93
C	制造业	207,262,509.18	60.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,277,126.23	3.02
E	建筑业	9,682,049.66	2.85
F	批发和零售业	20,279,989.63	5.96
G	交通运输、仓储和邮政业	9,459,761.06	2.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,917,533.64	5.85
J	金融业	2,884,711.45	0.85
K	房地产业	21,019,105.92	6.18
L	租赁和商务服务业	5,127,211.97	1.51
M	科学研究和技术服务业	961,585.00	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	1,651,939.12	0.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	173,591.00	0.05
Q	卫生和社会工作	913,728.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	4,975,178.18	1.46
S	综合	3,022,680.60	0.89
	合计	335,335,336.76	98.54

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

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

8.3.1 期末指数投资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	600522	中天科技	157,413	1,657,558.89	0.49
2	600201	生物股份	51,389	1,623,378.51	0.48

3	000656	金科股份	305,949	1,603,172.76	0.47
4	600682	南京新百	42,800	1,595,156.00	0.47
5	600584	长电科技	89,276	1,575,721.40	0.46
6	600079	人福医药	77,542	1,546,962.90	0.45
7	300136	信维通信	51,900	1,479,150.00	0.43
8	600643	爱建集团	115,993	1,439,473.13	0.42
9	002405	四维图新	74,250	1,436,737.50	0.42
10	600487	亨通光电	75,871	1,415,752.86	0.42

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。

8.4 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	300113	顺网科技	1,816,145.46	0.38
2	002572	索菲亚	1,588,099.18	0.33
3	002426	胜利精密	1,531,679.62	0.32
4	300136	信维通信	1,433,569.00	0.30
5	002131	利欧股份	1,415,896.04	0.29
6	600682	南京新百	1,330,646.00	0.28
7	002038	双鹭药业	1,295,743.00	0.27
8	600166	福田汽车	1,281,762.00	0.26
9	000983	西山煤电	1,271,151.00	0.26
10	002310	东方园林	1,259,626.20	0.26
11	300156	神雾环保	1,199,047.80	0.25
12	002368	太极股份	1,196,130.00	0.25
13	002407	多氟多	1,176,858.50	0.24
14	002460	赣锋锂业	1,161,145.00	0.24
15	300296	利亚德	1,154,396.00	0.24
16	002422	科伦药业	1,151,782.44	0.24
17	600266	北京城建	1,142,417.00	0.24
18	600315	上海家化	1,097,617.65	0.23
19	002074	国轩高科	1,089,378.00	0.23
20	300266	兴源环境	1,079,423.80	0.22

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	300072	三聚环保	3,208,831.79	0.66
2	002466	天齐锂业	2,988,077.45	0.62
3	002085	万丰奥威	2,211,192.47	0.46
4	002310	东方园林	1,896,805.57	0.39
5	000983	西山煤电	1,638,736.00	0.34
6	600654	中安消	1,633,711.00	0.34
7	600816	安信信托	1,626,757.34	0.34
8	002426	胜利精密	1,526,467.00	0.32
9	002131	利欧股份	1,462,413.00	0.30
10	600074	保千里	1,423,943.43	0.29
11	002049	紫光国芯	1,422,286.00	0.29
12	002714	牧原股份	1,409,339.43	0.29
13	002299	圣农发展	1,368,791.54	0.28
14	600376	首开股份	1,318,304.89	0.27
15	600498	烽火通信	1,315,912.31	0.27
16	300182	捷成股份	1,283,970.72	0.27
17	002174	游族网络	1,281,430.20	0.26
18	000671	阳光城	1,257,601.59	0.26
19	600482	中国动力	1,203,331.88	0.25
20	300122	智飞生物	1,169,117.98	0.24

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	132,368,091.54
卖出股票收入（成交）总额	165,122,178.43

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

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所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

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。

8.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	24,029.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,323.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,352.90

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：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

9.1.1 本基金的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
3,755	70,953.34	6,211,484.00	2.33%	116,571,383.00	43.75%

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
本基金的联接基金	143,646,934.00	53.92%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额
----	-------	---------	--------

			比例
1	赵熙逸	48,360,678.00	18.15%
2	方正证券股份有限公司	3,185,837.00	1.20%
3	北京安瑞祥和资产管理有限公司	2,982,974.00	1.12%
4	周志军	972,100.00	0.36%
5	张维昌	725,911.00	0.27%
6	赵洪维	592,134.00	0.22%
7	屠伍伦	580,100.00	0.22%
8	秦向平	580,000.00	0.22%
9	程社明	497,162.00	0.19%
10	虞衡	497,162.00	0.19%

注：前十名持有人为除华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金之外的前十名持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 13 日）基金份额总额	873,820,061.00
本报告期期初基金份额总额	318,429,801.00
本报告期基金总申购份额	54,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	106,000,000.00
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	266,429,801.00

§ 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

2016 年 11 月 24 日，经公司股东会批准贾波先生、翟军先生、文光伟先生、沈志群先生、李亦宜女士为公司董事。

2016 年 11 月 24 日，经公司董事会选举贾波先生为公司董事长，任职时间自 2016 年 12 月 14 日起。

2016 年 11 月 24 日，经公司股东会批准何雅茵女士、刘晓冰先生为公司监事。

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。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（特殊普通合伙）的报酬为 60,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 2 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	122,670,502.89	41.83%	111,789.89	41.60%	-
光大证券	2	91,740,472.14	31.28%	83,603.92	31.11%	-

浙商证券	2	43,084,184.20	14.69%	40,124.86	14.93%	-
安信证券	2	30,073,466.19	10.25%	28,007.64	10.42%	-
东方证券	1	5,404,933.47	1.84%	4,925.65	1.83%	-
国泰君安	1	281,911.20	0.10%	262.53	0.10%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
西藏同信	1	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-

华鑫证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
 - 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
 - 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
 - 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
 - 5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。
- 2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。
- 3、上述交易单元均系本报告期内租用。

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
长城证券	168,537.88	28.18%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	429,621.70	71.82%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
西藏同信	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-

华泰柏瑞基金管理有限公司
2017 年 3 月 29 日