

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2017 年年度报告 摘要

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(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。

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 | 206,429,801.00 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 | 2017 年 | 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 | -18,852,060.35 | -59,715,972.50 | -8,737,929.63 |
| 本期利润 | 13,472,150.27 | -75,320,257.10 | -80,084,658.96 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0576 | -0.2525 | -0.2127 |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.50% | -15.93% | -24.47% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末 | 2016 年末 | 2015 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.7148 | -0.7342 | -0.4921 |
| 期末基金资产净值 | 267,666,144.50 | 340,291,455.37 | 483,789,562.68 |
| 期末基金份额净值 | 1.2966 | 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

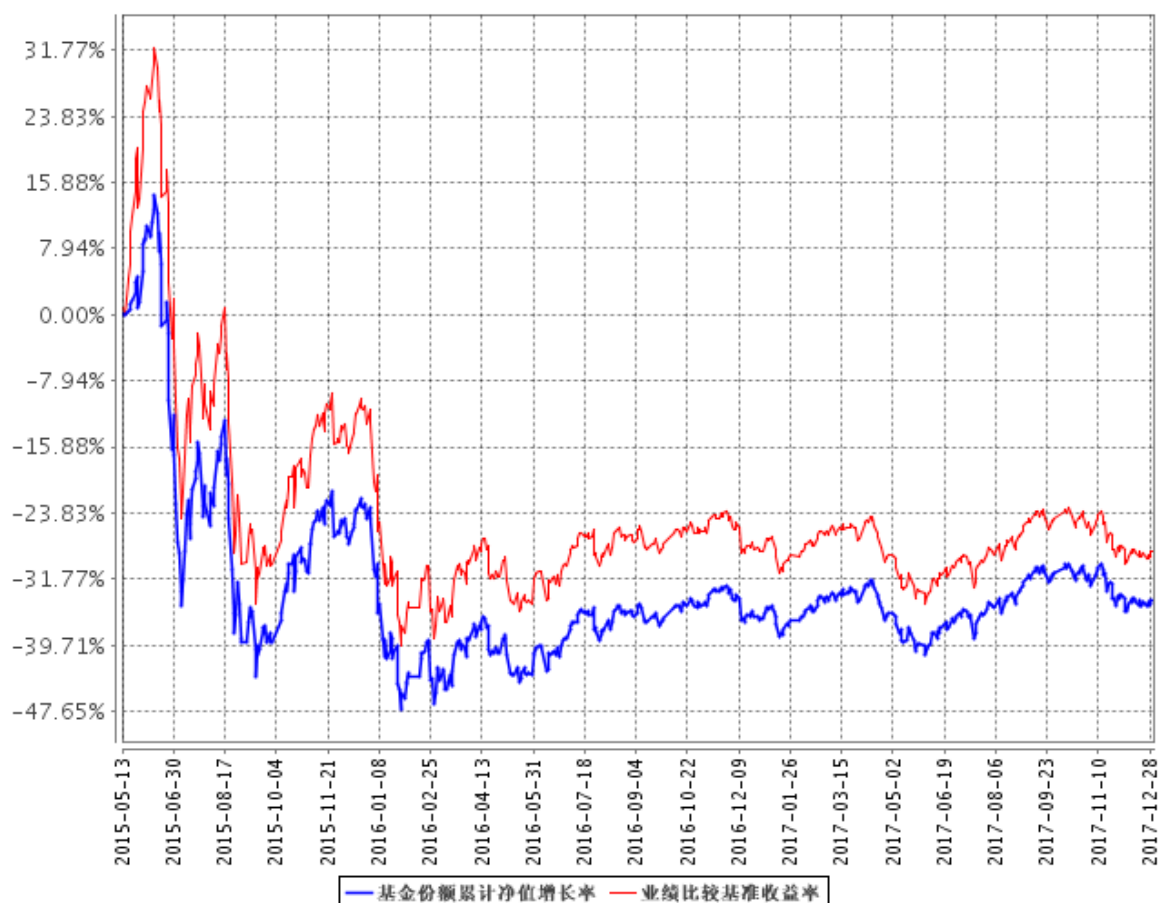
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | -4.68% | 0.97% | -5.34% | 0.98% | 0.66% | -0.01% |
| 过去六个月 | 3.22% | 0.94% | 1.84% | 0.96% | 1.38% | -0.02% |
| 过去一年 | 3.50% | 0.92% | -0.20% | 0.93% | 3.70% | -0.01% |

| | | | | | | |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 自基金合同 生效起至今 | -34.28% | 2.03% | -28.53% | 2.07% | -5.75% | -0.04% |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|--------|

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

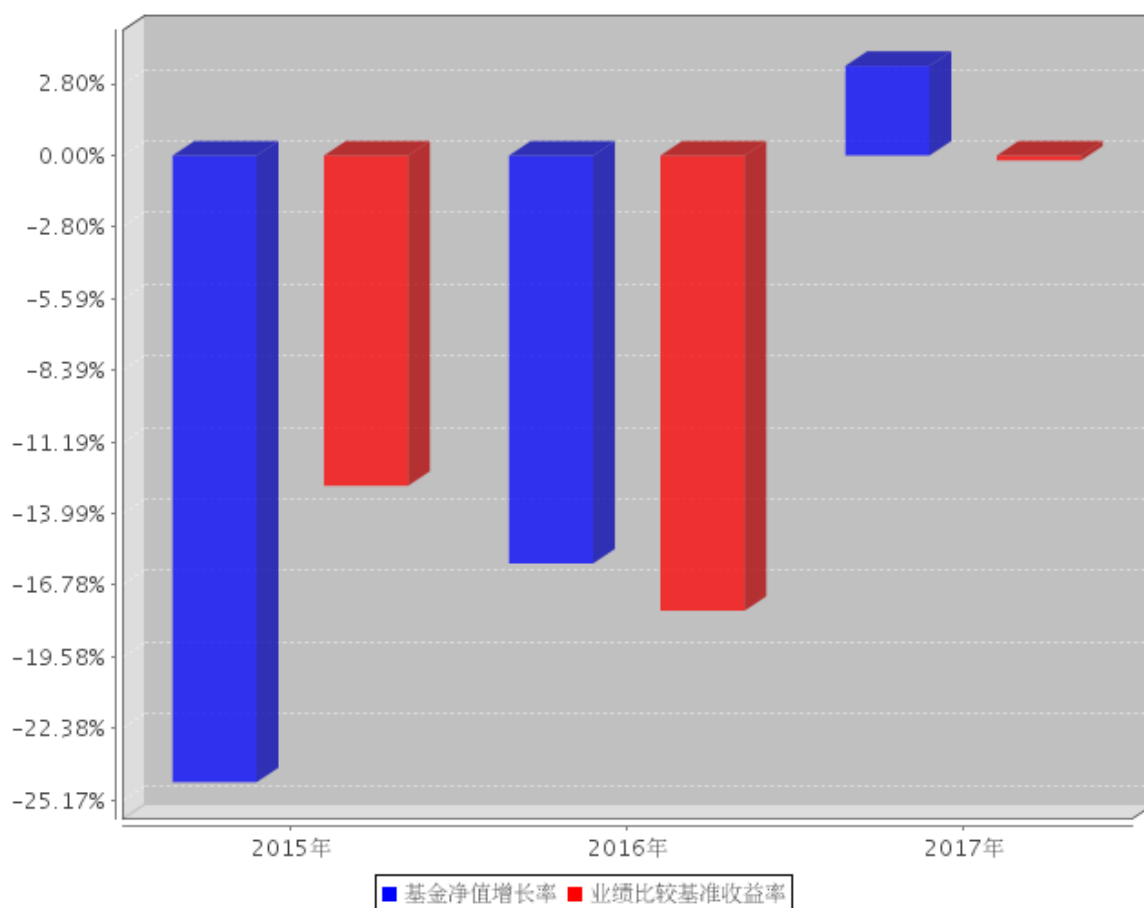


注：1、图示日期为 2015 年 5 月 13 日至 2017 年 12 月 31 日。

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

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 | 0.2400 | 6,394,315.13 | - | 6,394,315.13 | 注：- |
| 2016 | - | - | - | - | 注：- |
| 2015 | - | - | - | - | 注：- |
| 合计 | 0.2400 | 6,394,315.13 | - | 6,394,315.13 | 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发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞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 | | |
| 柳军 | 指数投资部总监、本基金的基金经理 | 2015 年 5 月 13 日 | - | 16 年 | 16 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 月起任指数投资部副总监。2011 年 1 月起担任上证中小盘 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，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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5%的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年市场延续 16 年的走势和风格趋势，以上证 50 和沪深 300 为代表的大盘蓝筹股继续上行，涨幅均较为可观，这也是股票市场大幅波动以来，大盘价值风格连续第二年跑盈市场。随着《上市公司重大资产重组管理办法》的修订，以及去年以来的严监管措施，加上 17 年市场资金面总体偏紧，市场利率有所上升，市场投机气氛明显降温，市场总体呈现大小盘结构性行情，行业龙头股获得资金青睐，涨幅更为可观。我们认为，2017 年市场是在资金偏紧、不确定增加、外部风险开始显现、风险偏好下降的背景下，资金对于业绩相对确定资产的再配置主导的结构性行情。

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 3.716%，日均绝对跟踪偏离度为 0.023%，期间日跟踪误差为 0.025%，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 1.2966 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.50%，业绩比较基准收益率为-0.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018，根据中央经济工作会议精神，防范化解重大风险，重点是防控金融风险是 2018 年的三大攻坚战之一，政策方面将延续去年的严监管思路，维护市场稳定，慢牛行情可期。央行的定向降准改善了国内流动性预期，而 PMI 稳定将继续修复基本面预期，企业盈利增速平稳，支撑去年以来上涨行情的逻辑尚未发生变化，我们对于 2018 年上半年的走势相对乐观。从市场风格来看，我们认为大盘价值股仍具有一定的配置价值，同时以中证 500 为代表的二线蓝筹板块横向和历史对比已进入相对低估区间。

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。本报告期内 1 月 23 日本基金进行收益分配，每份额分红 0.0240 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

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 21108 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 | 华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数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中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞中证 500ETF”)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中证 500ETF2017 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中证 500ETF,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>华泰柏瑞中证 500ETF 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中证 500ETF 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中证 500ETF、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中证 500ETF 的财务报告过程。</p> |
| 注册会计师对财务报表审计的 | 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 |

| | |
|-----------|--|
| 责任 | <p>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中证 500ETF 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中证 500ETF 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> |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) |
| 注册会计师的姓名 | 单峰曹阳 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼 |
| 审计报告日期 | 2018 年 3 月 26 日 |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2017 年 12 月 31 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 3,519,943.15 | 5,795,897.60 |
| 结算备付金 | | 9,048.65 | 7,621.87 |
| 存出保证金 | | 15,012.80 | 24,029.30 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 264,585,100.33 | 335,335,336.76 |
| 其中：股票投资 | | 264,585,100.33 | 335,335,336.76 |
| 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 | | 168,934.31 | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 528.59 | 1,323.60 |
| 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 | | 268,298,567.83 | 341,164,209.13 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 12 月 31 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 194,335.86 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 113,442.18 | 146,620.06 |
| 应付托管费 | | 22,688.46 | 29,324.00 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 75,395.49 | 92,473.84 |
| 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 | 420,897.20 | 410,000.00 |
| 负债合计 | | 632,423.33 | 872,753.76 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 415,216,683.82 | 535,901,783.09 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -147,550,539.32 | -195,610,327.72 |
| 所有者权益合计 | | 267,666,144.50 | 340,291,455.37 |
| 负债和所有者权益总计 | | 268,298,567.83 | 341,164,209.13 |

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2966 元，基金份额总额 206,429,801 份。

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：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 |
|-----------------------|------------|---|--|
| 一、收入 | | 16,306,468.22 | -71,998,888.94 |
| 1.利息收入 | | 24,732.56 | 27,877.21 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 24,664.70 | 27,754.38 |
| 债券利息收入 | | 67.86 | 122.83 |
| 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） | | -16,215,396.51 | -56,441,485.58 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | -18,642,782.54 | -59,156,757.58 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 46,861.99 | 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 | 2,380,524.04 | 2,628,535.25 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 32,324,210.62 | -15,604,284.60 |
| 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 | 172,921.55 | 19,004.03 |
| 减：二、费用 | | 2,834,317.95 | 3,321,368.16 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 1,510,707.38 | 1,853,772.75 |

| | | | |
|---------------------|------------|------------------|-------------------|
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 302, 141. 56 | 370, 754. 52 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 379, 439. 50 | 459, 862. 43 |
| 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 | 642, 029. 51 | 636, 978. 46 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 13, 472, 150. 27 | -75, 320, 257. 10 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 13, 472, 150. 27 | -75, 320, 257. 10 |

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：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） | 535, 901, 783. 09 | -195, 610, 327. 72 | 340, 291, 455. 37 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 13, 472, 150. 27 | 13, 472, 150. 27 |
| 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） | -120, 685, 099. 27 | 40, 981, 953. 26 | -79, 703, 146. 01 |
| 其中：1.基金申购款 | 44, 251, 203. 08 | -16, 568, 255. 48 | 27, 682, 947. 60 |
| 2. 基金赎回款 | -164, 936, 302. 35 | 57, 550, 208. 74 | -107, 386, 093. 61 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -6, 394, 315. 13 | -6, 394, 315. 13 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 415, 216, 683. 82 | -147, 550, 539. 32 | 267, 666, 144. 50 |
| 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） | 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 |

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《关于准予华泰柏瑞中证 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。本基金为契约型的交易型开放式基金，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(特殊普通合伙)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(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、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%，且不低于基金非现金资产的 80%。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的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数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 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

本基金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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

7.4.7 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、注册登记机构、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 |
| 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 |
| 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间与关联方未进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金与关联方未进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 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 | 1,510,707.38 | 1,853,772.75 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - | - |

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%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 × 0.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2016 年 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 | 302,141.56 | 370,754.52 |

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 0.10%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 × 0.10% / 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：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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：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。

7.4.8.4.2 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 2017 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2016 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 |
| 华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金 | 102,805,231.00 | 49.8016% | 143,646,934.00 | 53.9155% |

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 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 | |
|-------|--|-----------|---|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行 | 3,519,943.15 | 23,070.34 | 5,795,897.60 | 25,104.02 |

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：本基金本报告期及上年度可比期间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：本基金本报告期无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.9 期末（2017 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 |
| 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 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--|--|---|---|--|--|--|--|--|--|--|
| | | 日 | 日 | | | | | | | |
|--|--|---|---|--|--|--|--|--|--|--|

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 |
|--------|------|------------------|--------|--------|-----------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 600525 | 长园集团 | 2017 年 12 月 25 日 | 重大事项 | 15.79 | 2018 年 1 月 10 日 | 17.30 | 84,318 | 1,474,049.20 | 1,331,381.22 | - |
| 300156 | 神雾环保 | 2017 年 7 月 17 日 | 重大资产重组 | 24.16 | 2018 年 1 月 17 日 | 21.74 | 44,965 | 1,167,668.59 | 1,086,354.40 | - |
| 002168 | 深圳惠程 | 2017 年 12 月 19 日 | 重大资产重组 | 13.76 | - | - | 67,600 | 1,013,881.03 | 930,176.00 | - |
| 002366 | 台海核电 | 2017 年 12 月 6 日 | 重大资产重组 | 26.45 | - | - | 34,390 | 866,602.81 | 909,615.50 | - |
| 000930 | 中粮生化 | 2017 年 10 月 24 日 | 重大资产重组 | 13.34 | - | - | 65,711 | 1,025,547.39 | 876,584.74 | - |
| 300383 | 光环新网 | 2017 年 11 月 7 日 | 重大事项 | 13.19 | 2018 年 3 月 19 日 | 14.51 | 59,440 | 743,234.70 | 784,013.60 | - |
| 000547 | 航天发展 | 2017 年 10 月 30 日 | 重大事项 | 10.83 | - | - | 66,454 | 1,709,435.13 | 719,696.82 | - |
| 600614 | 鹏起科技 | 2017 年 12 月 26 日 | 重大资产重组 | 10.16 | - | - | 67,754 | 851,592.82 | 688,380.64 | - |
| 000566 | 海南海药 | 2017 年 11 月 22 日 | 重大资产重组 | 12.89 | - | - | 52,624 | 1,115,460.82 | 678,323.36 | - |
| 000979 | 中弘股份 | 2017 年 9 月 7 日 | 重大资产重组 | 1.94 | 2018 年 2 月 14 日 | 1.75 | 348,487 | 899,458.33 | 676,064.78 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|-------|------------------|--------|-------|-----------------|-------|---------|--------------|------------|---|
| 000031 | 中粮地产 | 2017 年 7 月 24 日 | 重大资产重组 | 8.00 | - | - | 80,127 | 1,057,481.52 | 641,016.00 | - |
| 000006 | 深振业 A | 2017 年 9 月 11 日 | 重大资产重组 | 9.85 | 2018 年 3 月 8 日 | 8.87 | 64,866 | 807,898.85 | 638,930.10 | - |
| 002745 | 木林森 | 2017 年 12 月 28 日 | 重大事项 | 45.50 | 2018 年 1 月 5 日 | 46.50 | 13,500 | 618,650.00 | 614,250.00 | - |
| 002004 | 华邦健康 | 2017 年 12 月 14 日 | 重大事项 | 6.73 | 2018 年 3 月 14 日 | 7.30 | 91,171 | 1,218,190.47 | 613,580.83 | - |
| 000592 | 平潭发展 | 2017 年 8 月 9 日 | 重大资产重组 | 5.75 | 2018 年 1 月 29 日 | 5.70 | 105,762 | 1,365,385.48 | 608,131.50 | - |
| 000401 | 冀东水泥 | 2017 年 11 月 21 日 | 重大资产重组 | 13.79 | 2018 年 1 月 15 日 | 15.17 | 42,468 | 630,707.57 | 585,633.72 | - |
| 600664 | 哈药股份 | 2017 年 9 月 28 日 | 重大资产重组 | 5.81 | 2018 年 2 月 27 日 | 6.00 | 98,171 | 954,908.36 | 570,373.51 | - |
| 002512 | 达华智能 | 2017 年 12 月 6 日 | 重大事项 | 18.07 | 2018 年 3 月 6 日 | 16.26 | 30,900 | 579,201.65 | 558,363.00 | - |
| 600645 | 中源协和 | 2017 年 10 月 9 日 | 重大资产重组 | 28.40 | 2018 年 1 月 19 日 | 25.56 | 19,500 | 946,333.06 | 553,800.00 | - |
| 000926 | 福星股份 | 2017 年 12 月 26 日 | 重大事项 | 10.89 | 2018 年 1 月 10 日 | 11.98 | 47,983 | 643,509.73 | 522,534.87 | - |
| 000939 | 凯迪生态 | 2017 年 11 月 16 日 | 重大资产重组 | 4.99 | - | - | 103,870 | 763,354.74 | 518,311.30 | - |
| 300159 | 新研股份 | 2017 年 11 月 23 日 | 重大资产重组 | 10.40 | 2018 年 3 月 22 日 | 9.36 | 48,700 | 796,205.96 | 506,480.00 | - |
| 000806 | 银河生物 | 2017 年 7 月 18 日 | 重大资产重组 | 10.76 | 2018 年 1 月 18 日 | 10.01 | 47,000 | 805,287.56 | 505,720.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|--------|------------------|--------|-------|-----------------|-------|--------|------------|------------|---|
| 300116 | 坚瑞沃能 | 2017 年 12 月 18 日 | 重大资产重组 | 7.62 | - | - | 55,100 | 526,747.11 | 419,862.00 | - |
| 000156 | 华数传媒 | 2017 年 12 月 26 日 | 重大事项 | 11.40 | - | - | 36,700 | 476,137.99 | 418,380.00 | - |
| 600187 | 国中水务 | 2017 年 11 月 9 日 | 重大资产重组 | 4.68 | 2018 年 3 月 20 日 | 4.21 | 86,479 | 637,211.39 | 404,721.72 | - |
| 300134 | 大富科技 | 2017 年 12 月 18 日 | 重大资产重组 | 16.45 | 2018 年 3 月 19 日 | 14.81 | 24,376 | 872,359.82 | 400,985.20 | - |
| 002122 | 天马股份 | 2017 年 12 月 19 日 | 重大事项 | 8.49 | - | - | 44,294 | 447,581.96 | 376,056.06 | - |
| 002358 | 森源电气 | 2017 年 12 月 7 日 | 重大资产重组 | 14.86 | 2018 年 3 月 7 日 | 15.05 | 24,551 | 494,646.35 | 364,827.86 | - |
| 000693 | *ST 华泽 | 2016 年 3 月 1 日 | 重大事项 | 12.50 | 2018 年 3 月 21 日 | 11.88 | 28,100 | 668,553.37 | 351,250.00 | - |
| 000766 | 通化金马 | 2017 年 11 月 24 日 | 重大资产重组 | 13.60 | - | - | 25,686 | 439,163.93 | 349,329.60 | - |
| 300010 | 立思辰 | 2017 年 11 月 17 日 | 重大事项 | 11.17 | 2018 年 2 月 22 日 | 10.05 | 29,000 | 538,359.92 | 323,930.00 | - |
| 002345 | 潮宏基 | 2017 年 12 月 20 日 | 重大事项 | 10.75 | - | - | 27,300 | 392,773.74 | 293,475.00 | - |
| 300032 | 金龙机电 | 2017 年 11 月 27 日 | 重大事项 | 13.89 | - | - | 20,700 | 366,486.89 | 287,523.00 | - |
| 002344 | 海宁皮城 | 2017 年 11 月 1 日 | 重大事项 | 7.93 | 2018 年 1 月 31 日 | 7.44 | 35,229 | 556,492.66 | 279,365.97 | - |
| 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。

7.4.9.3 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

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末，本基金未持有交易所债券正回购。

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 2017 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 27,682,947.60 元，其中包括以股票支付的申购款 11,898,012.00 元和以现金支付的申购款 15,784,935.60 元（于 2016 年度，申购基金份额的对价总额为 64,573,621.28 元，其中包括以股票支付的申购款 29,263,191.00 元和以现金支付的申购款 35,310,430.28 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 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 244,081,493.03 元, 属于第二层次的余额为 20,503,607.30 元, 无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日: 第一层次 308,907,326.75 元, 第二层次 26,428,010.01 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。

(3) 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。

(4) 除基金申购款、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 | 264,585,100.33 | 98.62 |
| | 其中：股票 | 264,585,100.33 | 98.62 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 3,528,991.80 | 1.32 |
| 8 | 其他各项资产 | 184,475.70 | 0.07 |
| 9 | 合计 | 268,298,567.83 | 100.00 |

8.2 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 | 600516 | 方大炭素 | 68,359 | 1,974,207.92 | 0.74 |
| 2 | 600176 | 中国巨石 | 112,083 | 1,825,832.07 | 0.68 |
| 3 | 600201 | 生物股份 | 56,225 | 1,784,581.50 | 0.67 |
| 4 | 000661 | 长春高新 | 8,736 | 1,598,688.00 | 0.60 |
| 5 | 002405 | 四维图新 | 59,819 | 1,578,623.41 | 0.59 |
| 6 | 002422 | 科伦药业 | 55,219 | 1,374,953.10 | 0.51 |
| 7 | 002271 | 东方雨虹 | 33,867 | 1,353,325.32 | 0.51 |
| 8 | 600525 | 长园集团 | 84,318 | 1,331,381.22 | 0.50 |
| 9 | 600584 | 长电科技 | 60,928 | 1,299,594.24 | 0.49 |
| 10 | 000786 | 北新建材 | 57,222 | 1,287,495.00 | 0.48 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

8.3.1 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 | 600642 | 申能股份 | 1,297,489.37 | 0.38 |
| 2 | 603799 | 华友钴业 | 1,198,984.00 | 0.35 |
| 3 | 000778 | 新兴铸管 | 1,109,368.00 | 0.33 |
| 4 | 002049 | 紫光国芯 | 1,099,414.00 | 0.32 |
| 5 | 600438 | 通威股份 | 1,058,183.00 | 0.31 |
| 6 | 000009 | 中国宝安 | 1,015,499.00 | 0.30 |
| 7 | 000039 | 中集集团 | 1,009,569.09 | 0.30 |
| 8 | 600256 | 广汇能源 | 1,004,500.00 | 0.30 |
| 9 | 600839 | 四川长虹 | 986,538.93 | 0.29 |
| 10 | 002583 | 海能达 | 972,594.00 | 0.29 |
| 11 | 600004 | 白云机场 | 923,630.00 | 0.27 |
| 12 | 300002 | 神州泰岳 | 911,168.50 | 0.27 |
| 13 | 000977 | 浪潮信息 | 906,780.00 | 0.27 |
| 14 | 300058 | 蓝色光标 | 883,760.00 | 0.26 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 15 | 600885 | 宏发股份 | 881,280.00 | 0.26 |
| 16 | 300383 | 光环新网 | 847,650.00 | 0.25 |
| 17 | 600718 | 东软集团 | 834,374.00 | 0.25 |
| 18 | 600875 | 东方电气 | 808,199.00 | 0.24 |
| 19 | 000887 | 中鼎股份 | 796,270.00 | 0.23 |
| 20 | 002195 | 二三四五 | 786,630.00 | 0.23 |

注：不考虑相关交易费用。

8.3.2 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 | 300136 | 信维通信 | 3,371,360.08 | 0.99 |
| 2 | 002460 | 赣锋锂业 | 2,854,770.00 | 0.84 |
| 3 | 601012 | 隆基股份 | 2,543,797.52 | 0.75 |
| 4 | 600487 | 亨通光电 | 2,466,026.76 | 0.72 |
| 5 | 002508 | 老板电器 | 1,886,796.00 | 0.55 |
| 6 | 002572 | 索菲亚 | 1,856,755.84 | 0.55 |
| 7 | 600522 | 中天科技 | 1,669,588.28 | 0.49 |
| 8 | 603799 | 华友钴业 | 1,527,809.00 | 0.45 |
| 9 | 300296 | 利亚德 | 1,519,248.00 | 0.45 |
| 10 | 600682 | 南京新百 | 1,461,658.48 | 0.43 |
| 11 | 600436 | 片仔癀 | 1,354,280.16 | 0.40 |
| 12 | 000887 | 中鼎股份 | 1,327,101.68 | 0.39 |
| 13 | 002217 | 合力泰 | 1,308,268.11 | 0.38 |
| 14 | 600219 | 南山铝业 | 1,288,799.32 | 0.38 |
| 15 | 300122 | 智飞生物 | 1,176,672.90 | 0.35 |
| 16 | 002602 | 世纪华通 | 972,303.00 | 0.29 |
| 17 | 600699 | 均胜电子 | 971,725.63 | 0.29 |
| 18 | 000959 | 首钢股份 | 971,191.94 | 0.29 |
| 19 | 000697 | 炼石有色 | 898,449.44 | 0.26 |
| 20 | 600809 | 山西汾酒 | 839,442.00 | 0.25 |

注：不考虑相关交易费用。

8.3.3 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 | 98,201,096.61 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 145,027,185.12 |

注：不考虑相关交易费用。

8.4 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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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。

8.11.3 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 | 15,012.80 |
| 2 | 应收证券清算款 | 168,934.31 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 528.59 |
| 5 | 应收申购款 | — |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 184,475.70 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1 | 600525 | 长园集团 | 1,331,381.22 | 0.50 | 临时停牌 |

§ 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 |
|-------|-----------|----------------|------------|----------------|------------|
| 3,483 | 59,267.82 | 105,038,261.00 | 50.88% | 101,391,540.00 | 49.12% |

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 |
|------|----------------|--------|
| 联接基金 | 102,805,231.00 | 49.80% |

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 | 38,260,678.00 | 18.53% |
| 2 | 方正证券股份有限公司 | 2,213,095.00 | 1.07% |
| 3 | 兰树华 | 1,000,000.00 | 0.48% |
| 4 | 周志军 | 972,100.00 | 0.47% |
| 5 | 黄文飞 | 632,400.00 | 0.31% |
| 6 | 赵洪维 | 592,134.00 | 0.29% |
| 7 | 秦向平 | 580,000.00 | 0.28% |
| 8 | 史晓霞 | 521,162.00 | 0.25% |
| 9 | 姜荣贤 | 498,978.00 | 0.24% |
| 10 | 虞衡 | 497,162.00 | 0.24% |
| 11 | 游炜泽 | 497,162.00 | 0.24% |
| 12 | 成少怡 | 497,162.00 | 0.24% |
| 13 | 陈顺 | 497,162.00 | 0.24% |

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

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（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 | 266,429,801.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 22,000,000.00 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 82,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 206,429,801.00 |

§ 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

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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金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 3 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 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 | 84,819,668.30 | 36.24% | 77,296.21 | 35.97% | - |
| 国信证券 | 2 | 75,959,098.14 | 32.46% | 70,740.92 | 32.92% | - |
| 东方证券 | 1 | 50,293,800.00 | 21.49% | 45,832.87 | 21.33% | - |
| 光大证券 | 2 | 15,602,653.23 | 6.67% | 14,218.62 | 6.62% | - |
| 海通证券 | 2 | 4,194,865.00 | 1.79% | 3,822.90 | 1.78% | - |
| 安信证券 | 2 | 3,168,605.70 | 1.35% | 2,951.00 | 1.37% | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国都证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财富证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 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。

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 | 147,501.85 | 37.17% | - | - | - | - |
| 国信证券 | 249,328.00 | 62.83% | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|----------------|------|---------------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | - | - | - | - | - | - | - |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 联接基金 | 1 | 2017.01.01-2017.12.31 | 143,646,934.00 | 0.00 | 40,841,703.00 | 102,805,231.00 | 49.80% |

产品特有风险

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2018 年 3 月 28 日