

华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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
报告送出日期:2016年1月21日

1 重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现,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。
本报告自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

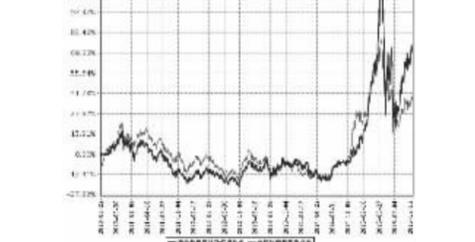
基金简称	华泰柏瑞量化先行混合
交易代码	600009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月12日
报告期末基金份额总额	197,225,427.62份
投资目标	以定量模型分析为主,结合基本面定性研究,力求发现价值被市场低估且具备成长潜力的标的,在风险可控的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1 股票投资策略:定量模型驱动为主,并综合考虑其他基本面因素,寻找具有中长期成长性、估值合理、流动性较好的个股,并在此基础上,结合基本面定性研究,进行投资组合优化,追求超额收益。 2 债券投资策略:在严格控制风险的前提下,采取自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置,重点配置信用债,在严格控制风险和流动性风险的前提下,适当参与可转债投资。 3 衍生品投资策略:权证投资作为基金资产增值的辅助工具,不以套利为目的。 4 股指期货投资策略:基金管理人将根据风险管理的原则,在充分评估股指期货的风险和收益的基础上,审慎参与股指期货投资,并制定明确的投资策略,力求实现基金资产的增值。 5 融资融券业务:基金管理人将根据中国证监会的相关规定,审慎参与融资融券业务,并制定明确的投资策略,力求实现基金资产的增值。
业绩比较基准	中证500指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为股票型基金,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

3.1 主要财务指标	
单位:人民币元	
报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)	
1.本期已实现收益	5,953,863.63
2.本期利润	100,090,970.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.4457
4.期末基金资产净值	331,892,246.94
5.期末基金份额净值	1.683

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。
3.2.1 本期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	净值增长率①	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	31.09%	1.03%	13.57%	1.34%	18.24%	0.59%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:
1. 图示日期为2010年6月22日至2015年12月31日。
2. 按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十章(二)投资组合(十)2.2基金投资组合比例限制中的相关规定,投资组合符合基金合同的60%-95%股票、资产市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的30%-65%。

4.1 基金投资组合情况 (或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	说明
田汉卿	副总经理, 本基金基金经理	2015年1月18日	12

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内本基金运作符合相关法律法规及基金合同的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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,通过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送,首先投资部和研究部通过统一的决策流程来确保公平对待不同投资组合,其次交易部严格执行公平交易制度,识别和控制利益输送,其次由风控和合规部门对公平交易制度的执行情况进行持续监控,确保公平交易制度的执行。同时,风控管理部对报告期内公平交易情况进行持续监控和报告。本报告期间,上述公平交易制度执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期间无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
在进一步产需结构调整的情况下,经济增长仍面临很大的压力,同时,市场中多年积累的多种风险较多,政府救市政策推出,稳增长、促改革、调结构、惠民生、防风险成为今年政府工作的一个主要任务,当前股市仍缺少明确的有力支撑,市场流动性紧张,但近期市场流动性紧张,基金仓位整体偏低的情况下,本基金管理人将采取积极投资策略,力争实现基金资产的增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至报告期末,本基金份额净值为1.683元,本报告期内净值增长率为31.09%,同期业绩比较基准增长率为13.57%。

4.5 管理人对于报告期内基金投资运作、业绩比较基准执行情况
股票市场在经历了2015年的大幅波动之后,2016年将面临挑战的一年。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
注:无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

基金简称	华泰柏瑞量化先行混合
基金代码	600009
报告送出日期	2016年1月21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
报告送出日期	2016年1月21日

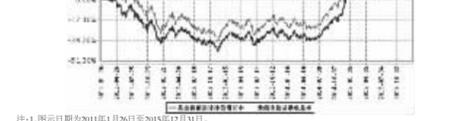
基金简称	华泰柏瑞量化先行混合
交易代码	510220
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月26日
报告期末基金份额总额	7,229,160.09份
投资目标	紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1 股票投资策略:紧密跟踪标的指数,采用被动式投资策略,力争取得与标的指数相似的投资收益。 2 债券投资策略:在严格控制风险的前提下,采取自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置,重点配置信用债,在严格控制风险和流动性风险的前提下,适当参与可转债投资。 3 衍生品投资策略:权证投资作为基金资产增值的辅助工具,不以套利为目的。 4 股指期货投资策略:基金管理人将根据风险管理的原则,在充分评估股指期货的风险和收益的基础上,审慎参与股指期货投资,并制定明确的投资策略,力求实现基金资产的增值。
业绩比较基准	上证中小盘指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

3.1 主要财务指标	
单位:人民币元	
报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)	
1.本期已实现收益	-593,173.30
2.本期利润	6,095,005.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.8011
4.期末基金资产净值	34,111,542.80
5.期末基金份额净值	4.719

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。
3.2.1 本期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	净值增长率①	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	18.18%	1.88%	17.59%	1.87%	0.43%	0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1. 图示日期为2011年11月26日至2015年12月31日。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	300,719,728.38	89.44
2	其中:股票	300,719,728.38	89.44
3	其中:存托凭证	18,177.60	0.01
4	其他权益投资	18,177.60	0.01
5	买入返售金融资产	-	-
6	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,306,221.56	6.04
8	其他资产	15,173,568.73	4.51
9	合计	336,217,698.27	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	3,370,410.15	1.02
B	采矿业	3,944,669.97	1.19
C	制造业	213,964,887.73	64.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,996,670.00	4.82
E	建筑业	4,769,042.68	1.44
F	批发和零售业	12,733,896.72	3.84
G	交通运输、仓储和邮政业	10,493,167.67	3.16
H	住宿和餐饮业	694,738.89	0.21
I	信息技术业	9,979,406.36	3.01
J	房地产业	227,050.70	0.07
K	金融业	15,447,562.42	4.65
L	租赁和商务服务业	40,260.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,866,983.98	2.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	17,100,000.00	5.05
S	综合	-	-
合计		300,719,728.38	90.61

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600886	金发汽车	397,992	7,637,466.48	2.30
2	000185	小商品	304,071	7,297,704.00	2.20
3	600027	华鲁恒升	1,071,548	7,289,246.80	2.20
4	000501	河南路桥	536,560	6,749,028.48	2.03
5	002551	天地风能	488,100	6,711,325.00	2.02
6	000044	华鲁恒升	696,840	6,515,454.00	1.96
7	000733	振华科技	247,331	6,183,275.00	1.86
8	000488	神州兴业	629,438	5,703,766.00	1.72
9	601872	皖通铁路	791,700	5,613,153.00	1.69
10	002179	华星光电	138,560	5,259,373.60	1.58

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	国开转债	140	18,177.60	0.01

5.6 报告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情况
注:本基金本报告期末持有资产支持证券。

5.7 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情况
注:本基金本报告期末持有贵金属。

5.8 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权证投资情况
注:本基金本报告期末持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期末没有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期末没有国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内本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,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
5.11.2 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定股票品种之外的情况。

序号	证券代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101923	其他资产	-	-	-
2	101923	其他资产	-	-	-
3	101923	其他资产	-	-	-
4	101923	其他资产	-	-	-
5	101923	其他资产	-	-	-
6	101923	其他资产	-	-	-
7	101923	其他资产	-	-	-
8	101923	其他资产	-	-	-
9	101923	其他资产	-	-	-
10	101923	其他资产	-	-	-

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.6 资产支持证券的投资情况

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
注:无。

5.8 备查文件目录
1. 基金合同
2. 基金招募说明书
3. 基金管理人基金投资管理制度
4. 基金管理人内部控制制度
5. 基金管理人业务操作手册
6. 基金管理人内部稽核制度
7. 基金管理人内部审计制度
8. 基金管理人信息披露制度
9. 基金管理人投资者服务制度
10. 基金管理人其他内部管理制度

5.9 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.10 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.11 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.12 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.13 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.14 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.15 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.16 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.17 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.18 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.19 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.20 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.21 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.22 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.23 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.24 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

5.25 基金管理人及基金托管人履行信息披露义务的情况
注:无。

上证红利交易型开放式指数证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月21日

1 重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现,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。
本报告自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

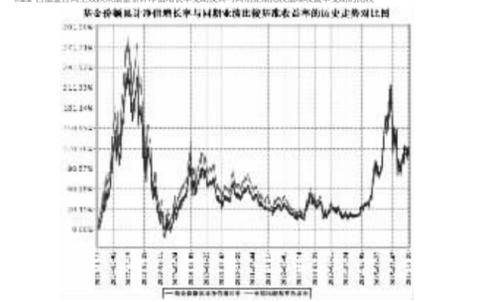
基金简称	华泰柏瑞上证红利ETF
交易代码	510800
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年11月17日
报告期末基金份额总额	227,175,303.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1 股票投资策略:紧密跟踪标的指数,采用被动式投资策略,力争取得与标的指数相似的投资收益。 2 债券投资策略:在严格控制风险的前提下,采取自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置,重点配置信用债,在严格控制风险和流动性风险的前提下,适当参与可转债投资。 3 衍生品投资策略:权证投资作为基金资产增值的辅助工具,不以套利为目的。 4 股指期货投资策略:基金管理人将根据风险管理的原则,在充分评估股指期货的风险和收益的基础上,审慎参与股指期货投资,并制定明确的投资策略,力求实现基金资产的增值。
业绩比较基准	上证红利指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标	
单位:人民币元	
报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)	
1.本期已实现收益	21,158,800.79
2.本期利润	83,245,202.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.3763
4.期末基金资产净值	644,304,843.70
5.期末基金份额净值	2.830

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。
3.2.1 本期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	净值增长率①	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	14.00%	1.56%	14.32%	1.56%	-0.24%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1. 图示日期为2007年11月17日至2015年12月31日。
2. 按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起3个月为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十章(二)投资组合中规定的比例,跟踪投资于指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的95%。

4.1 基金投资组合情况 (或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	说明
柳军	基金经理, 指数投资部总监	2009年6月4日	14
袁姗姗	基金经理	2015年6月31日	4年

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内本基金运作符合相关法律法规及基金合同的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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,通过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送,首先投资部和研究部通过统一的决策流程来确保公平对待不同投资组合,其次交易部严格执行公平交易制度,识别和控制利益输送,其次由风控和合规部门对公平交易制度的执行情况进行持续监控,确保公平交易制度的执行。同时,风控管理部对报告期内公平交易情况进行持续监控和报告。本报告期间,上述公平交易制度执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期间无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
在进一步产需结构调整的情况下,经济增长仍面临很大的压力,同时,市场中多年积累的多种风险较多,政府救市政策推出,稳增长、促改革、调结构、惠民生、防风险成为今年政府工作的一个主要任务,当前股市仍缺少明确的有力支撑,市场流动性紧张,但近期市场流动性紧张,基金仓位整体偏低的情况下,本基金管理人将采取积极投资策略,力争实现基金资产的增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至报告期末,本基金份额净值为2.830元,本报告期内净值增长率为14.00%,同期业绩比较基准增长率为14.32%。

4.5 管理人对于报告期内基金投资运作、业绩比较基准执行情况
股票市场在经历了2015年的大幅波动之后,2016年将面临挑战的一年。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
注:无。

4.7 报告期末基金资产组合情况

基金简称	华泰柏瑞上证红利ETF
基金代码	510800
报告送出日期	2016年1月21日

基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告送出日期	2016年1月21日

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	333,630,466.97	97.20
2	其中:股票	333,630,466.97	97.20
3	其中:存托凭证	-	-
4	其他权益投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	967,482.68	2.80
8	其他资产	2,184.36	0.01
9	合计	334,600,134.01	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	131,545.94	0.39
B	采矿业	1,280,738.76	5.32
C	制造业	15,379,564.14	45.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,314,084.64	6.78
E	建筑业	965,767.04	2.83
F	批发和零售业	1,023,167.67	3.16
G	交通运输、仓储和邮政业	1,049,316.67	3.16
H	住宿和餐饮业	694,738.89	0.21
I	信息技术业	9,979,406.36	3.01
J	房地产业	227,050.70	0.07
K	金融业	15,447,562.42	4.65
L	租赁和商务服务业	40,260.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,866,983.98	