

华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

2016年度报告摘要

概况、不同业务类型的基金经理之间并不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的机制管理到位，严格执行公平交易制度，各基金经理使用公司内部各基金对冲，不存在内幕交易和利益输送的情况。基金经理分析投资公司旗下各基金均实现了公司对内、外公平交易和利益冲突防范行为，经评估对不同基金在不同交易期间的同向交易价差进行分析测试，报告期内期内同向的买卖价差总体上处于正常的合理水平，只在少数情况下存在“存在显著性”的价差情况。

基金管理人的重大事项及风险提示：本公司所披露资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本基金的运作费用、净值表现和收益承担连带责任。本基金报告已经公告之二以上包含于本报告中。

基金管理人中银基金管理有限公司根据《基金合同》规定，于2017年3月28日复核了《本基金中的财务指标、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，保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承认承认真诚守信、勤勉尽责的管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

本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招募说明书及其更新。

本年度报告财务数据已经审计，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。

本年度报告摘要节选自年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

§ 2 基金的基本情况

2.1 基金的基本情况

基金名称 华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

基金简称 华泰柏瑞价值增长

基金代码 049006

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

基金合同生效日 2009年7月16日

报告期末基金资产净值 346,794,894.93

基金份额净值 1.000

基金类型 混合型

基金运作方式 灵活配置型

基金交易币种 人民币

基金份额总额 346,794,894.93

基金存续期间 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金通过投资于价值低估的股票，基本面良好，被作为成长型投资价值评价的股票，重点关注其中具有基本面变化、行业地位突出、竞争优势明显、估值合理的股票，同时适当配置债券类资产，以降低整体组合的风险。

投资策略 本基金通过主动选择持有价值低估的股票，重点关注其中具有基本面变化、行业地位突出、竞争优势明显、估值合理的股票，同时适当配置债券类资产，以降低整体组合的风险。

投资范围 本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票（含存托凭证）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、基金、股指期货、国债期货、股票期权等金融工具，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。

业绩比较基准 沪深300指数×90%+上证国债指数×20%

风险收益特征 高风险、较高收益

基金管理人和基金托管人

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

基金代销机构 中国银行股份有限公司

基金管理人直销机构 049006

基金管理人客户服务电话 021-30901777

基金管理人网址 http://www.huatai-ph.com

基金管理人住所/办公地址 上海市浦东新区陆家嘴环路1300号太平金融广场17层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及份额净值变动情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 本期数据和指标 2016年 2015年

本期利润 -73,766,370.03 102,420,147.21

加权平均基金份额本期利润 -0.3434 0.1162

本期基金份额变动净额 -108,406,904.00 940,676.00

期末基金份额总额 1,036,800,000.00 1,035,793,096.00

3.1.2 期末数据和指标 2016年末 2015年末

资产总额 1,036,800,000.00 1,035,793,096.00

负债总额 897,076,048.00 1,036,793,096.00

所有者权益(基金净值) 147,723,952.00 3,007.00

基金份额净值 1.0000 1.0000

3.2 基金净值情况

3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 长期利率 年化收益率 净值增长率 (%) ①-③ ②-④

过去一个月 16.05% 0.95% 1.43% 0.97% 0.19% 0.36%

过去一年 6.61% 0.90% 4.23% 0.61% 1.33% 0.29%

过去一年 10.88% 1.81% -0.65% 1.12% -2.75% 0.69%

过去一年 13.00% 2.07% 30.00% 1.43% 9.21% 0.64%

过去一年 17.71% 1.79% 40.63% 1.30% 13.95% 0.49%

过去一年 30.40% 1.70% 27.00% 1.40% 27.00% 0.30%

注：上述基金业绩指标不包括任何买入或卖出交易或基金的费用，计算费用后实际收益水平将低于上述指标。

2.本期实现的现金分红益率：0.00%，持有人（不含非固定收益变动收益）和除权除息时点的金额为0.00%，现金、债券、货币、权证以及中国证监会允许基金投资的其他品种的现金分红益率为0.00%。

3.对期末可供分配利润，采用期末资产净值减去未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

图示：该示意图显示了2009年7月16日至2016年12月31日期间，本基金的累计净值增长率与沪深300指数和上证国债指数的比较情况。

注：该示意图显示为2009年7月16日至2016年12月31日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金的年化净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

图示：该示意图显示了2009年7月16日至2016年12月31日期间，本基金的年化净值增长率与沪深300指数和上证国债指数的比较情况。

注：该示意图显示为2009年7月16日至2016年12月31日。

3.3 过去三年基金的年化净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

图示：该示意图显示了2013年7月16日至2016年12月31日期间，本基金的年化净值增长率与沪深300指数和上证国债指数的比较情况。

注：该示意图显示为2013年7月16日至2016年12月31日。

3.4 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的波动

图示：该示意图显示了2009年7月16日至2016年12月31日期间，本基金的净值增长率与沪深300指数和上证国债指数的波动情况。

注：该示意图显示为2009年7月16日至2016年12月31日。

3.5 基金合同生效日为2009年7月16日，2006年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.6 过去三年基金的年化净值增长率情况

单位：人民币元

3.6.1 报告期各基金余额变动表

3.6.2 报告期各基金利润变动表

3.6.3 报告期各基金费用变动表

3.6.4 报告期各基金收入变动表

3.6.5 报告期各基金支出变动表

3.6.6 报告期各基金申购赎回费用变动表

3.6.7 报告期各基金手续费变动表

3.6.8 报告期各基金税金及附加变动表

3.6.9 报告期各基金摊销费用变动表

3.6.10 报告期各基金其他费用变动表

3.6.11 报告期各基金手续费调整表

3.6.12 报告期各基金收入冲回表

3.6.13 报告期各基金费用冲回表

3.6.14 报告期各基金收入冲销表

3.6.15 报告期各基金费用冲销表

3.6.16 报告期各基金收入冲销表

3.6.17 报告期各基金费用冲销表

3.6.18 报告期各基金收入冲销表

3.6.19 报告期各基金费用冲销表

3.6.20 报告期各基金收入冲销表

3.6.21 报告期各基金费用冲销表

3.6.22 报告期各基金收入冲销表

3.6.23 报告期各基金费用冲销表

3.6.24 报告期各基金收入冲销表

3.6.25 报告期各基金费用冲销表

3.6.26 报告期各基金收入冲销表

3.6.27 报告期各基金费用冲销表

3.6.28 报告期各基金收入冲销表

3.6.29 报告期各基金费用冲销表

3.6.30 报告期各基金收入冲销表

3.6.31 报告期各基金费用冲销表

3.6.32 报告期各基金收入冲销表

3.6.33 报告期各基金费用冲销表

3.6.34 报告期各基金收入冲销表

3.6.35 报告期各基金费用冲销表

3.6.36 报告期各基金收入冲销表

3.6.37 报告期各基金费用冲销表

3.6.38 报告期各基金收入冲销表

3.6.39 报告期各基金费用冲销表

3.6.40 报告期各基金收入冲销表

3.6.41 报告期各基金费用冲销表

3.6.42 报告期各基金收入冲销表

3.6.43 报告期各基金费用冲销表

3.6.44 报告期各基金收入冲销表

3.6.45 报告期各基金费用冲销表

3.6.46 报告期各基金收入冲销表

3.6.47 报告期各基金费用冲销表

3.6.48 报告期各基金收入冲销表

3.6.49 报告期各基金费用冲销表

3.6.50 报告期各基金收入冲销表

3.6.51 报告期各基金费用冲销表

3.6.52 报告期各基金收入冲销表

3.6.53 报告期各基金费用冲销表

3.6.54 报告期各基金收入冲销表

3.6.55 报告期各基金费用冲销表

3.6.56 报告期各基金收入冲销表

3.6.57 报告期各基金费用冲销表

3.6.58 报告期各基金收入冲销表

3.6.59 报告期各基金费用冲销表

3.6.60 报告期各基金收入冲销表