华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

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

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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

基金简称	华泰柏瑞健康生活
基金主代码	001398
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月18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	1,289,337,723.97份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过深入研究,本基金投资于健康生活相关行业优质的成长性公司,在有效控制风险的前提下,力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为灵活配置混合型基金,基金管理人将跟踪宏观经济变量和国家财政、税收和货币政策等指标,判断经济周期的阶段和未来经济发展的趋势,研究预测宏观经济和国家政策等因素对证券市场的影响,分析比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征,估计各子资产类的相关性矩阵,并在此基础上确定基金资产在各类别资产间的分配比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

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	csf008@300018@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6月18日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	-100,625,013.11	-395,722,591.31
本期利润	-244,911,120.95	-324,232,740.06
加权平均基金份额本期利润	-0.1652	-0.1834
本期基金份额净值增长率	-19.30%	-16.60%
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	-0.3268	-0.2185
期末基金资产净值	868,031,176.43	1,334,101,571.57
期末基金份额净值	0.673	0.834

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。

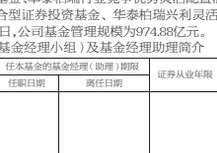
3、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	-7.30%	0.85%	1.43%	0.57%	-8.73%	0.28%
过去六个月	-8.19%	0.88%	4.28%	0.61%	-12.47%	0.27%
过去一年	-19.30%	2.02%	-8.16%	1.12%	-11.14%	0.90%
自基金合同生效起至今	-32.70%	2.66%	-27.79%	1.63%	-4.91%	1.03%

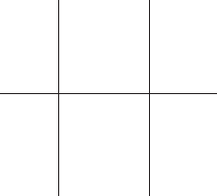
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、图示日期为2015年6月18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6个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条(二)中规定的各项比例, 本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%,其中投资于健康生活主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的80%;

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



注:基金合同生效日为2015年6月18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、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
吕慧建	本基金基金经理、投资部总监	2015年6月18日	-	18年	吕慧建先生,新加坡国立大学MBA。历任中大投资管理有限公司行业研究员及中信基金管理有限公司的行业研究员。2007年6月加入本公司,任高级行业研究员,2007年11月起担任基金经理助理,自2009年11月起担任华泰柏瑞(原友邦华泰)行业领先混合基金基金经理。2015年6月起任投资部总监与华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
徐晓杰	本基金基金经理	2015年6月18日	-	10	博士研究生,10年证券(基金)从业经历。2006年7月至2007年9月任邦联资产管理有限公司研究员;2007年9月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2014年4月至2015年5月任研究部总监助理。2015年5月起任华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金的基金经理。2015年6月起任华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年10月起任华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。公司机构投置合理,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。同时潜在利益输送金额比较小,因此不构成利益输送。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年中国经济呈见底企稳走势,GDP增长6.7%。其中,消费和进出口表现平稳,社会零售总额增速保持在10%以上,月度贸易顺差保持在400多亿美元的水平。2016年第二产业投资在去产能的大背景下增速继续下行,增速下降到3.5%;在政府房地产去库存政策推动下,16年商品房销售大幅增长22.5%, 拉动地产投资从15年1%的增速提高到6.9%,支持全社会固定资产增速保持相对稳定,增速为8.1%。

2016年原油在1月份最低不到30美元的位置反弹, 大部分时间维持在40-50美元之间。其他大宗商品,包括煤炭、有色、钢铁出现了类似的走势,走出显著的上涨行情。

大宗原材料价格上涨支持PPI走出来2012年以来的负增长状态,有利于改善企业效益,工业增加值低位企稳,全年增速为6%。2016年四季度,CPI也上升到了2以上。

A股市场在2016年开年由于启动熔断机制造成上证指数暴跌了约1000点, 最低见于2638点。随后,市场整体呈现震荡上行走势。其中,传统周期板块如煤炭、钢铁、建筑板块涨幅巨大,低估值消费股如家电、汽车表现强劲,新能源汽车、一带一路、保险举牌概念股、阿里概念股等题材阶段性强势表现,而成长股则一路下跌,创业板全年表现疲弱。就全年看,沪深300下跌了12.31%,创业板指下跌27.7%。

本基金在年初熔断中净值损失较大,全年操作策略较为保守谨慎,未参与题材股行情,持仓风格偏成长,和热点板块特征不匹配,全年净值表现疲弱,跑输基准。

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0.673元,本报告期份额净值增长率为-19.30%,同期业绩比较基准增长率为-8.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济增速从2010年10.9%的高点回落,已经调整了较长时间。需求不振、价格下行压力下,企业去产能、去库存、去杠杆,2016年可能是一个阶段性见底的转折点。中国政府尊重经济发展规律,推动经济结构调整,降低税费,激发民间活力,取得积极效果。

展望2017年,在去产能大背景下,固定资产投资增速可能保持在一个相对较低的水平,但较2016年进一步下行的可能性不大。美国向好、欧洲企稳的大背景下,预计进出口将继续保持稳定,并有一定程度向好的潜力。中国消费已经呈现一定程度的复苏向好趋势。整体而言,我们认为2017年中国经济将表现出弱复苏的特征。

2017年中国经济将面临一定的通胀压力。但是,我们认为,PPI、CPI上行主要是基数原因、由产品本身的阶段性供求关系变化引起,在经济整体较弱的大背景下,通胀趋势线向上的可能性不大。但是,这仍然会制约货币政策的操作空间。

从政策取向看,中国政府为更有效管理金融风险,金融去杠杆是2017年的政策主基调。从M2增速目标定为12%来看,2017年的货币环境相对中性,但存在边际收紧的取向。

所以,总体来看,A股市场经历了2015年下半年以来的大幅调整后,再度趋势线下跌的可能性已经大幅下降。展望2017年,我们认为A股市场大幅上涨的条件并不充分,但可以有所作为。

在操作上,我们主要关注如下方面:(1)传统制造业的结构性增长机会。这种机会可能来自于经济结构调整带来的发展空间,也可能来自于龙头企业市占率不断提升、盈利水平提高带来的增长机会;(2)盈利有持续增长潜力的消费板块。消费板块的配置价值会越来越突出。我们将努力挖掘有持续增长潜力的公司,作为长期投资的基础配置品种;(3)优质成长股。部分成长股经历了两年的盈利增长、股价调整后,估值已经基本合理。成长股代表了中国经济未来的发展方向,在投资中是超额收益的主要来源。2017年预计部分成长股会有所表现,值得关注。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016年度,本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时,始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求,继续致力于内控机制的完善,加强内部风险的控制与防范,确保各项法规和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序,通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法,独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核,发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改,同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内,基金管理人内部监察稽核主要工作如下:

(1)全面开展基金运作合规监察工作,确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有:严格执行集中交易制度,各基金相互独立,交易指令由中央交易室统一执行完成;对基金投资交易系统进行事先合规性设置,并由风险控制部门进行实时监控,杜绝出现违规行为;严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序;通过以上措施,保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程,保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定,确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2)开展定期和专项监察稽核工作,确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资业务、交易合规、市场宣传、客户服务、信息技术安全、交易佣金分配等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函,要求相关部门限期整改,并对改进情况安排后续跟踪检查,确保各项业务开展合法合规。

(3)促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求,公司法律监察部及时更求各部门制订或修改相应制度,促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4)通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新人职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展,在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形,基金运作整体合法合规。在今后的工作中,本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范各种风险,为基金持有人谋求最大利益。

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12次;每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的25%;基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算, 收益分配基准日可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满3个月,收益可不分配。截止本报告期末,本基金可分配收益为0元。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10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

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”)在华泰柏瑞健康生活灵活配置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

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21059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:华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金

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		50,606,416.95	99,912,485.61
结算备付金		2,713,532.52	9,265,862.33
存出保证金		223,675.01	1,259,779.19
交易性金融资产		820,348,378.39	1,238,384,036.96
其中:股票投资		820,348,378.39	1,238,384,036.96
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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		2,096,781.57	-
应收利息		12,335.43	30,703.39
应收股利		-	-
应收申购款		2,416.45	128,793.45
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		876,003,536.32	1,348,981,660.93
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,034,637.33	3,875,663.90
应付赎回款		646,644.13	2,792,575.91
应付管理人报酬		1,139,698.04	1,715,270.64
应付托管费		189,949.71	285,878.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,570,212.65	5,930,458.67
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		391,218.03	290,241.81
负债合计		7,972,359.89	14,880,089.36
所有者权益:			
实收基金		1,289,337,723.97	1,599,156,286.10
未分配利润		-421,306,547.54	-265,054,714.53
所有者权益合计		868,031,176.43	1,334,101,571.57
负债和所有者权益总计		876,003,536.32	1,348,981,660.93

注:报告截止日2016年12月31日,华泰柏瑞健康生活基金份额净值0.673元,基金份额总额1,289,337,723.97份。

7.2 利润表

会计主体:华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金

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6月18日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入		-218,587,218.48	-300,479,126.02
1.利息收入		499,118.68	797,723.33
其中:存款利息收入		491,222.84	797,723.33
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		7,895.84	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-75,097,577.48	-373,769,054.12
其中:股票投资收益		-79,093,652.96	-374,920,734.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		3,996,075.48	1,151,680.23
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-144,286,107.84	71,489,851.25
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		297,348.16	1,002,353.52
减:二、费用		26,323,902.47	23,753,614.04
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	15,680,155.62	11,350,180.52
2. 托管费	7.4.8.2.2	2,613,359.36	1,891,696.70
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		7,599,073.47	10,222,737.37
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		431,314.02	288,999.45
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-244,911,120.95	-324,232,740.06
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-244,911,120.95	-324,232,740.06

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金

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)	1,599,156,286.10	-265,054,714.53	1,334,101,571.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-244,911,120.95	-244,911,120.95
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)	-309,818,562.13	88,659,287.94	-221,159,274.19
其中:1.基金申购款	54,353,523.62	-16,792,952.70	37,560,570.92
2.基金赎回款	-364,172,085.75	105,452,240.64	-258,719,845.11
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)	1,289,337,723.97	-421,306,547.54	868,031,176.43
项目	上年度可比期间 2015年6月18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)	1,903,644,804.44	-	1,903,644,804.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-324,232,740.06	-324,232,740.06
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)	-304,488,518.34	59,178,025.53	-245,310,492.81
其中:1.基金申购款	72,351,900.12	-14,114,002.77	58,237,897.35
2.基金赎回款	-376,840,418.46	73,292,028.30	-303,548,390.16
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)	1,599,156,286.10	-265,054,714.53	1,334,101,571.57

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

华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金(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[2015] 920号《关于准予华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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1,903,380,770.67元,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784号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年6月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,903,644,804.44份基金份额,其中认购资金利息折合264,033.77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《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》、《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和最新公布的《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中

小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(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、货币市场工具、股指期货、权证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。本基金的投资组合比例为:股票市值占基金资产净值的0%-95%;其中其中投资于健康生活主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:沪深 300指数收益率×80%+上证国债指数×20%。

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2016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》、《华泰柏瑞健康生活灵活配置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。

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[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)对于内地投资者持有的基金类别,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	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	基金管理人的股东、基金代销机构
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	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

注:关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

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6月18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
华泰证券股份有限公司	463,444,571.82	9.30%	-	-

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期内未通过关