（上接B212版）

项目	本期 2016年9月2日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	81,473.33
银行间市场交易费用	16,175.00
合计	97,648.33

7.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2016年9月2日至2016年12月31日
审计费用	74,820.11
信息披露费	100,576.59
银行划款手续费	5,871.05
银行间CFCA证书费	-
其他费用	32,500.00
银行间账户服务费	4,800.00
合计	218,567.75

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)的有关规定:2017年7月1日(含)以后,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,按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法,由国家税务总局另行制定。

截止本财务报表批准报出日止,上述税收政策的具体征收管理办法尚未颁布,上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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("中国银行")	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、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("华泰联合证券")	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

注:1、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。

7.4.10 本报告期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年9月2日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	22,655,411.80	17.47%

7.4.10.1.4 权证交易

注:无。

7.4.10.1.5 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9月2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
华泰证券	20,645.86	17.26%	20,645.86	36.00%

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年9月2日至2016年12月31日
当期应支付的管理费	2,021,855.65
其中:支付销售机构的客户维护费	834.92

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0.60%的年费率计提,计算方法如下:

H = E × 0.60% ÷ 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两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年9月2日至2016年12月31日
当期应支付的托管费	505,463.90

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0.15%的年费率计提,计算方法如下:

H = E × 0.15% ÷ 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两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.10.2.3销售服务费

注:无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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

注:无。

7.4.10.5 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9月2日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	13,274,834.70	119,820.61

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注:无。

7.4.11 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.11.1 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	认购	期末估值	数量(单位:股/张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股上市	4.00	4.00	26,696	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新股上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股上市	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股未上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新股未上市	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新股未上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

7.4.11.2 期末持有的暂时停牌股票

注:无。

7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，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款余额229,340,827.60元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
150213	15国开13	2017年1月6日	100.55	1,400,000	140,770,000.00
150209	15国开09	2017年1月6日	102.43	900,000	92,187,000.00
合计				2,300,000	232,957,000.00

7.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)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105,904,988.38元,属于第二层次的余额为663,942,541.17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。

(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(转型前)

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	65,168,264.62	5.56
	其中:股票	65,168,264.62	5.56
2	固定收益投资	1,013,983,000.00	86.45
	其中:债券	1,013,983,000.00	86.45
	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	79,493,105.94	6.78
7	其他资产	14,334,415.55	1.22
8	合计	1,172,978,786.11	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,590,793.25	1.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,363,349.26	0.63
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	174,024.29	0.02
J	金融业	45,851,682.82	4.52
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	188,415.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	65,168,264.62	6.42

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前十名股票投资明细

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	000001	平安银行	1,400,000	13,230,000.00	1.30
2	601288	农业银行	2,500,000	7,950,000.00	0.78
3	000895	双汇发展	300,000	7,257,000.00	0.71
4	601169	北京银行	800,000	7,192,000.00	0.71
5	601668	中国建筑	1,000,000	6,340,000.00	0.62
6	002142	宁波银行	380,000	6,281,400.00	0.62
7	601939	建设银行	1,100,000	5,830,000.00	0.57
8	600015	华夏银行	480,000	5,025,600.00	0.50
9	000488	晨鸣纸业	559,904	4,932,754.24	0.49
10	601997	贵阳银行	16,167	301,029.54	0.03

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	12,846,000.00	1.28
2	601288	农业银行	7,950,000.00	0.79
3	000895	双汇发展	7,376,656.98	0.74
4	601169	北京银行	7,038,417.20	0.70
5	601668	中国建筑	5,681,958.00	0.57
6	601939	建设银行	5,335,000.00	0.53
7	002142	宁波银行	5,116,669.89	0.51
8	600015	华夏银行	5,020,800.00	0.50
9	000488	晨鸣纸业	5,016,869.89	0.50
10	601997	贵阳银行	137,257.83	0.01
11	600977	中国电影	122,248.60	0.01
12	601966	玲珑轮胎	99,556.60	0.01
13	601611	中国核建	87,478.70	0.01
14	601127	小康股份	50,326.22	0.01
15	601595	上海电影	45,855.00	0.00
16	002807	江阴银行	41,653.28	0.00
17	600908	无锡银行	39,791.94	0.00
18	300612	中亚股份	39,164.43	0.00
19	300627	华舟应急	37,190.64	0.00
20	603515	欧普照明	36,647.82	0.00

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601611	中国核建	566,628.40	0.06
2	600977	中国电影	534,045.01	0.05
3	601127	小康股份	394,431.13	0.04
4	601966	玲珑轮胎	309,714.60	0.03
5	300516	久之洋	256,245.08	0.03
6	300627	华舟应急	226,789.48	0.02
7	300518	盛讯达	220,714.00	0.02
8	300529	健帆生物	169,097.50	0.02
9	300512	中亚股份	156,697.52	0.02
10	300628	亿联网络	151,217.82	0.02
11	603737	三棵树	150,712.85	0.02
12	603131	上海沪工	135,204.15	0.01
13	603958	哈森股份	115,279.20	0.01
14	603569	长久物流	113,760.67	0.01
15	002802	洪汇新材	109,315.90	0.01
16	300517	海波重科	100,786.20	0.01
17	300515	三德科技	98,928.55	0.01
18	300520	科大国创	92,738.90	0.01
19	300526	中潜股份	90,528.00	0.01
20	002799	环球印务	88,560.00	0.01

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	62,563,584.62
卖出股票收入(成交)总额	4,510,545.37

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	50,060,000.00	4.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	642,970,000.00	63.34
	其中:政策性金融债	642,970,000.00	63.34
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	320,953,000.00	31.62
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,013,983,000.00	99.88

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	160208	16国开08	3,200,000	319,424,000.00	31.47
2	160408	16农发08	700,000	70,805,000.00	6.97
3	160303	16进出03	600,000	60,486,000.00	5.96
4	160205	16国开05	500,000	52,295,000.00	5.15
5	011699135	16可方SCP001	500,000	50,200,000.00	4.95

8.7 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出现被监管部门立案调查，或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 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,388.73
2	应收证券清算款	546,579.84
3	应收股利	-
4	应收利息	13,773,446.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,334,415.55

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处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 投资组合报告(转型后)

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	106,233,529.55	8.53
	其中:股票	106,233,529.55	8.53
2	固定收益投资	663,614,000.00	53.29
	其中:债券	663,614,000.00	53.29
	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	449,351,234.03	36.09
	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	13,465,504.81	1.08
7	其他资产	12,580,546.15	1.01
8	合计	1,245,244,814.54	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	55,020,740.12	5.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	5,270,400.00	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,817.20	0.00
J	金融业	45,919,980.00	4.53
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	106,233,529.55	10.47

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前十名股票投资明细(转型后)

金额单位:人民币元

代码	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	600438	通威股份	2,110,000	13,440,700.00	1.32
2	000001	平安银行	1,400,000	12,740,000.00	1.26
3	600352	浙江龙盛	1,260,000	11,604,600.00	1.14
4	601169	北京银行	800,000	7,808,000.00	0.77
5	601288	农业银行	2,500,000	7,750,000.00	0.76
6	000059	华锦股份	589,959	7,020,512.10	0.69
7	002142	宁波银行	380,000	6,323,200.00	0.62
8	000895	双汇发展	300,000	6,279,000.00	0.62
9	601939	建设银行	1,100,000	5,984,000.00	0.59
10	000488	晨鸣纸业	559,904	5,800,605.44	0.57

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600438	通威股份	13,796,884.22	1.36
2	600352	浙江龙盛	12,077,657.00	1.19
3	000625	长安汽车	5,300,600.00	0.52
4	000501	鄂武商A	5,253,178.00	0.52
5	000059	华锦股份	5,212,234.31	0.51
6	000876	新希望	5,207,700.00	0.51
7	603858	步长制药	244,195.60	0.02
8	601375	中原证券	106,780.00	0.01
9	603556	海兴电力	100,380.24	0.01
10	002831	裕同科技	81,592.63	0.01
11	002818	富森美	72,396.18	0.01
12	002821	凯莱英	70,005.29	0.01
13	603877	太平鸟	67,734.00	0.01
14	300583	赛托生物	63,738.78	0.01
15	603727	博迈科	58,933.92	0.01
16	603298	杭叉集团	46,131.47	0.00
17	002822	中装建设	41,912.31	0.00
18	600908	无锡银行	39,791.94	0.00
19	603218	日月股份	39,482.80	0.00
20	300558	贝达药业	38,162.04	0.00

注:不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601668	中国建筑	10,998,015.40	1.08
2	603858	步长制药	517,901.58	0.05
3	002821	凯莱英	325,480.55	0.03
4	601997	贵阳银行	296,599.56	0.03
5	603556	海兴电力	258,209.39	0.03
6	002818	富森美	241,519.77	0.02
7	601595	上海电影	214,423.29	0.02
8	300558	贝达药业	201,586.84	0.02
9	603986	兆易创新	200,696.16	0.02
10	603727	博迈科	176,832.73	0.02
11	300533	冰川网络	158,280.19	0.02
12	002831	裕同科技	152,189.46	0.01
13	002807	江阴银行	143,116.93	0.01
14	002822	中装建设	130,579.77	0.01
15	603515	欧普照明	128,391.75	0.01
16	300570	太辰光	123,578.83	0.01
17	600908	无锡银行	120,605.68	0.01
18	300568	星源材质	119,734.50	0.01
19	002820	桂发祥	117,010.68	0.01
20	002823	凯中精密	116,323.29	0.01

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	48,618,164.83
卖出股票收入(成交)总额	16,911,131.90

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	49,935,000.00	4.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	293,050,000.00	28.88
	其中:政策性金融债	293,050,000.00	28.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	290,281,000.00	28.61
6	中期票据	30,348,000.00	2.99
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	663,614,000.00	65.41

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150213	15国开13	1,400,000	140,770,000.00	13.87
2	150209	15国开09	900,000	92,187,000.00	9.09
3	011697766	16中航技SCP007	500,000	50,140,000.00	4.94
4	071602007	16国泰君安CP007	500,000	50,040,000.00	4.93
5	019539	16国债11	500,000	49,935,000.00	4.92

8.7 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，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

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。

8.12.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,221.39
2	应收证券清算款	152,189.46
3	应收股利	-
4	应收利息	12,401,135.30
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,580,546.15

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处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息(转型前)

9.1 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
143	7,004,474.79	1,000,080,000.00	99.84%	1,569,894.43	0.16%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	6,929.40	0.00%

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。

§9 基金份额持有人信息(转型后)

9.1 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
100	10,014,099.94	1,000,080,000.00	99.87%	1,329,994.31	0.13%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,941.18	0.00%

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(2016年3月29日)基金份额总额	1,001,514,242.44
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	725,444.70
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	829,692.83
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,001,409,994.31

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

自2016年8月3日至2016年9月1日华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,自2016年9月2日起,本基金由"华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金"转型为"华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金",基金简称为"华泰柏瑞精选回报混合",基金代码保持不变。

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芮女士、刘晓冰先生为公司监事。 2016年12月,郭曦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。本报告期基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为120,000元人民币,该事务所已向本基金提供了1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 (转型后)

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	
广发证券	1	36,780,179.41	57.69%	34,253.40	58.15%	-
华泰证券	2	22,655,411.80	35.53%	20