华泰柏瑞盛世中国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。

本基金名称自2015年8月6日起,由“华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金”,基金简称为“华泰柏瑞盛世中国混合”,基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司2015年8月6日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》。

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	华泰柏瑞盛世中国混合
基金主代码	460001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年4月27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	3,591,244,889.13份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	主要通过股票选择,辅以适度的大类资产配置调整,追求管理资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票类资产为主要投资工具,通过精选个股获取资产的长期增值;以债券类资产作为降低组合风险的策略性投资工具,通过适当的大类资产配置来降低组合的系统性风险。
业绩比较基准	标普中国A股300指数×70%+中信国债指数×30%(2005/4/27-2015/8/5) 标普中国A股300指数×70%+中证全债指数×30%(2015/8/6-至今)
风险收益特征	较高风险、较高收益

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	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

§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	2014年
本期已实现收益	-164,975,591.40	2,077,656,963.65	861,578,829.11
本期利润	-440,700,024.01	1,710,011,393.27	816,073,012.99
加权平均基金份额本期利润	-0.1218	0.4597	0.1065
本期基金份额净值增长率	-20.78%	31.63%	20.10%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0205	0.4229	-0.0226
期末基金资产净值	1,582,256,745.02	2,299,109,558.16	4,886,136,568.37
期末基金份额净值	0.4406	0.9626	0.7313

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

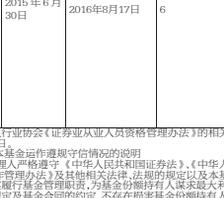
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.76%	0.75%	0.70%	0.48%	-4.46%	0.27%
过去六个月	0.56%	0.77%	4.31%	0.51%	-3.75%	0.26%
过去一年	-20.78%	1.79%	-6.23%	0.94%	-14.55%	0.85%
过去三年	25.24%	1.97%	35.77%	1.22%	-10.53%	0.75%
过去五年	48.77%	1.71%	40.06%	1.11%	8.71%	0.60%
自基金合同生效起至今	351.05%	1.63%	213.97%	1.27%	137.08%	0.36%

注:本基金的业绩基准由标普中国A股300指数和中证全债指数按照70%与30%之比构建,并每日进行再平衡。

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:图示日期为2005年4月27日至2016年12月31日。
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十三条中“(二)投资范围”以及“(八)投资组合”中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为基金净资产的0%-40%。

3.2.3 过去五年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



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
2016	3.1400	6,116,972,561.52	410,041,808.06	6,527,014,369.58	注:-
2015	-	-	-	-	注:-
2014	-	-	-	-	注:-
合计	3.1400	6,116,972,561.52	410,041,808.06	6,527,014,369.58	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、华泰柏瑞全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、华泰柏瑞主题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、华泰柏瑞沪深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、华泰柏瑞宁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974.38亿元。

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		
张慧	投资部总监助理,本基金的基金经理	2013年9月16日	-	9	经济学硕士,9年证券从业经历。2007年7月至2010年6月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010年6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,2013年9月起任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理,2014年5月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2015年2月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年1月起任投资部总监助理。
李灿	本基金的基金经理	2015年6月30日	2016年8月17日	6	北京大学西方经济学硕士。2010年7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。2015年6月至2016年8月任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理。2015年8月起任华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年3月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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。任职日期和离职日期指基金管理人内部做出决定的日期。

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》、《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、投资原则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账户。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,公司将投资管理部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,投资决策流程正善,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间同向交易价差进行分析发现,报告期内基金之间的交易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,国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。

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,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%的交易共有2次,系因策略需要,认为公司有投资价值,后续交易日还有持续买入。

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

16年全年市场呈现先抑后扬的V字型格局,全年指数基本收阴,沪深300指数下跌11.28%,创业板指数下跌27.71%,中证500指数下跌17.78%。主要的跌幅基本在年初完成,年初的下跌由于人民币贬值加剧,“熔断”机制造成起跌。而由于经济基本面在16年逐渐好转,带动上市公司盈利在随后的几个季度里不断改善,带动股指从16年3月开始逐级震荡走高。

16年1季度市场基本在下跌和震荡整固中完成。由于投资人对国际、国内经济和流动性的担心,叠加股票估值重回高位以及全球风险资产下跌共振,“春季躁动”行情落空,风险偏好急剧下降,导致1月份整体跌幅较大。1月份各行业指数跌幅基本与15年涨幅成反比,高估值主题概念股跌幅居前。2月份,在消胀预期推动下,大宗、商价、供给侧改革等主题表现较好,成长股在快速反弹后有较大回撤,很多公司股价创出年内新低。随着投资人的担忧逐渐缓解,风险偏好开始回升。3月份成长股和小市值公司涨幅居前,稳定消费类资产亦有不错表现,各板块和主题均有轮动机会,但持续性不强。

进入16年2季度之后,市场指数波动区间明显收窄,但在指数变化不大的情况下,2季度行业和主题热点轮动开始活跃。这其中以新能源车产业链的表现最为优异,主题层面,行业空间较大的半导体、OLED等相对收益明显,稀土主题强势上涨,除此之外,还有一些主题的轮动较快,持续力并不是很强,如物联网、区块链等。

16年下半年之后,市场开始对宏观经济的逐渐回暖有所察觉,一方面工业品价格开始上涨,另一方面PPP、基建等订单也在陆续落地,尽管在国庆期间各地出台了针对地产行业强烈的限购政策,但随着经济数据的好转,供给侧改革相关的煤炭、钢铁价格和流通经济复苏预期下的基本金属价格在10-12月的期间有显著的上涨,刺激了相关行业的股价抬升。

与此同时,保险资金在2016年的配置压力也导致了市场出现了多次的险资举牌主题行情。以宝能系、安邦、恒大等为代表的产业资本和保险资金在4季度纷纷举牌高股息、资产折价明显的大盘蓝筹股票,成为带动4季度前期指数显著上升的主要原因。

本基金在1月份对市场相对乐观导致了净值跌幅较大。在市场调整的过程中,本基金优化了持仓结构,保持了高仓位,使得在反弹中净值回升亦较快。在2季度初,本基金认为投资人对于市场过于悲观的预期修复可能进入尾声,因此我们在4月上旬的反弹中逐渐降低仓位获利了结,在4月中旬开始的调整中净值回撤有限。

下半年由于指数的波动区间变发收窄,本基金在结构上降低了成长股的配置比例,逐步转向周期、蓝筹和消费行业的轮动化配置。并且在风格上,尽量降低过小市值公司的投资比例,同时更加关注对业绩兑现程度的选股标准。基金净值在下半年基本也保持了区间内窄幅波动的态势。

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0.4406元,本报告期份额净值增长率为-20.78%,同期业绩比较基准增长率为-6.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受到去年1月熔断的心理影响,2017年1-2月投资者绝对收益目标的情绪浓烈,市场并未呈现出趋势性的行情,领涨板块之间的轮动较快。

步入3月之后,春节后的旺季开工逐渐临近,预计工业需求将会逐渐回暖,从今年地方政府对于全年固定资产投资的规划来看,地方基建投资的冲动较高。2月PM1数据已经出现反弹,3月工业增加值、PM1等数据预计也将继续回升,整个经济月度数据在3月有利于提升风险偏好,目前1-2月的高频数据显示经济回暖仍在持续,我们预期3月主要工业周期品价格将会重新有所上涨。但与此同时,我们也注意到一、线城市的房地产销量等先导指标开始出现回落,对此,2季度的经济走否会在旺季之后开始有下滑迹象,本基金也将在未来的投资过程中持续跟踪。

而流动性方面,未来几个月还将维持中性偏紧的态势。一方面,我们需要关注美联储加息预期的变化以及对人民币贬值和外汇流出压力的影响。目前来看,中美长期国债利差仍旧保持在合理位置,短期人民币流出的压力不大。但预计最晚在2季度,联储将会启动一次加息进程,届时对于新兴市场可能都会有一定冲击。另一方面,国内通胀、房价如果继续走高,央行和住建部等政府部门可能出台进一步的调控政策。

整体而言,我们对于未来3个月的市场走势认为先上后下,支撑市场上行的主要动力在于3月实体经济需求的逐渐回证。而2季度中后期开始存在的市场风险,更多将源于物价上涨后政府主动调控的行为,以及美联储逐渐收紧可能给新兴国家市场带来的资金抽离。

市场结构上,3月上行的主线应当还是围绕着经济复苏逻辑,因此周期品预计将会是行业配置中相对收益的主要获取板块。国内需求上,更加看好供需格局较好的钢铁、造纸,而海外方面,有色和石油价格预计也将有所回升。

4月之后,本基金可能转为相对防御的配置结构,目前来看,高速、旅游和受益消费升级的消费品等行业可能是配置的方向。

主题机会上,我们相对看好偏蓝筹的主题,国企混改,一带一路等主题将会是逢低关注的方向,本基金将会结合上市公司目身因素、股价所处位置,结合政策预期来有所布局。

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,确保各项法规制度管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序,通过实时监控、现场检查、重点抽查和入员询问等方式,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流程程序与业务流程,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要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入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。报告期内估值程序等事项均按照有关法律、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。

4.8 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6次;全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的90%;基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值,本期末,基金可供分配利润为73,714,202.83元。本报告期内,本基金符合分红条件,于2016年4月13日、2016年12月30日分别进行分配,每10份基金份额共派发现金红利3.14元,利润分配合计6,527,014,369.58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”)在华泰柏瑞盛世中国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

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(2017)第21066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	华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金全体基金份额持有人:
引言段	我们审计了后附的华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金(原华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金,以下简称“华泰柏瑞盛世中国基金”)的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表、2016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。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是华泰柏瑞盛世中国基金 的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和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财务报表,并使其实现公允反映; (2)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。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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。审计工作还包括评价管层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 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。
审计意见段	我们认为,上述华泰柏瑞盛世中国基金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,公允反映了华泰柏瑞盛世中国基金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。
注册会计师的姓名	单峰 傅琛慧
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	上海湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2017年3月28日

§7 年度财务报表

7.1资产负债表
会计主体:华泰柏瑞盛世中国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		177,037,637.84	175,933,945.61
结算备付金		7,788,541.10	10,269,247.43
存出保证金		887,432.95	1,380,596.90
交易性金融资产		1,413,409,461.03	2,098,408,249.73
其中:股票投资		1,413,409,461.03	2,000,884,249.73
基金投资		-	-
债券投资		-	97,524,000.00
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		42,400,162.29	27,453,497.31
应收利息		53,762.05	2,789,607.06
应收股利		-	-
应收申购款		50,910.83	357,386.21
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,641,627,908.09	2,316,592,530.25
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		-	-
应付赎回款		1,398,855.23	3,726,490.07
应付管理人报酬		2,124,734.64	2,858,381.38
应付托管费		354,122.48	476,396.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,728,299.90	8,935,024.74
应交税费		214,960.00	214,960.00
应付利息		-	-
应付利润		50,277,454.02	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,272,746.80	1,271,728.98
负债合计		59,371,163.07	17,482,972.09
所有者权益:			
实收基金		1,502,824,140.62	999,308,449.31
未分配利润		79,432,604.40	1,299,801,108.85
所有者权益合计		1,582,256,745.02	2,299,109,558.16
负债和所有者权益总计		1,641,627,908.09	2,316,592,530.25

注:1,报告截止日2016年12月31日,基金份额净值0.4406元,基金份额总额3,591,244,889.13份。

7.2 利润表
会计主体:华泰柏瑞盛世中国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1月1日至2015年12月31日
一.收入		-384,578,901.59	1,820,576,373.96
1.利息收入		4,453,442.13	9,172,449.69
其中:存款利息收入		4,213,460.48	3,313,818.49
债券利息收入		144,934.43	4,945,605.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		95,047.22	913,025.83
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-123,920,466.67	2,178,490,840.20
其中:股票投资收益		-136,208,154.12	2,164,784,467.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益		5,608,530.00	8,107,824.09
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		6,679,557.45	5,598,548.62
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-275,724,432.61	-367,645,570.38
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		10,612,555.56	558,654.45
减:二.费用		56,121,122.42	110,564,980.69
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	27,703,834.56	49,835,548.20
2. 托管费	7.4.8.2.2	4,617,305.87	8,305,924.67
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		23,323,794.26	51,942,871.18
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		476,187.73	480,636.64
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-440,700,024.01	1,710,011,393.27
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)		-440,700,024.01	1,710,011,393.27

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:华泰柏瑞盛世中国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)	999,308,449.31	1,299,801,108.85	2,299,109,558.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-440,700,024.01	-440,700,024.01
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)	503,515,691.31	5,747,345,889.14	6,250,861,580.45
其中:1.基金申购款	8,539,202,351.72	6,266,294,053.16	14,805,496,404.88
2.基金赎回款	-8,035,686,660.41	-518,948,164.02	-8,554,634,824.43
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)	-	-6,527,014,369.58	-6,527,014,369.58
五、期末所有者权益(基金净值)	1,502,824,140.62	79,432,604.40	1,582,256,745.02

项目	上年度可比期间 2015年1月1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)	2,795,326,896.45	2,090,809,671.92	4,886,136,568.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	1,710,011,393.27	1,710,011,393.27
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)	-1,796,018,447.14	-2,501,019,956.34	-4,297,038,403.48
其中:1.基金申购款	102,030,250.51	129,933,900.04	231,964,150.55
2.基金赎回款	-1,898,048,697.65	-2,630,953,856.38	-4,529,002,554.03
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)	999,308,449.31	1,299,801,108.85	2,299,109,558.16

注: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:
基金管理人负责人 胡勇 主管会计工作负责人 房伟力 会计机构负责人 赵景云
7.4 报表附注
7.4.1 基金基本情况
华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金(原名为华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金,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”)证监基金字[2005]第19号《关于同意友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金设立的批复》核准,由友邦华泰基金管理有限公司(已自2010年4月30日起更名为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《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金合同》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人民币900,348,752.84元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第48号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金合同》于2006年4月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为900,519,775.77份基金份额,其中认购资金利息折合171,022.93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《华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金招募说明书》和《友邦华泰