

华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金

2017 年年度报告

2017 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 27 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（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2017 年 2 月 16 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

自 2017 年 8 月 28 日至 2017 年 9 月 26 日华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，自 2017 年 9 月 27 日起，本基金由“华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金”转型为“华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞嘉利混合”，基金代码保持不变。关于转型的详细内容见我公司 2017 年 8 月 28 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以通讯方式召开华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金份额持有人大会的公告》。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	9
3.2 基金净值表现（转型前）.....	11
3.3 其他指标.....	13
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	21
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	21
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.....	22
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	23
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	23
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	24
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	24
4.9 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.....	24
§5 托管人报告	25
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	25
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	25
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.....	25
§6 审计报告（转型后）	26
6.1 审计报告基本信息.....	26
6.2 审计报告的基本内容.....	26
§6 审计报告（转型前）	29
6.1 审计报告基本信息.....	29
6.2 审计报告的基本内容.....	29
§7 年度财务报表（转型后）	32
7.1 资产负债表（转型后）.....	32
7.2 利润表.....	33
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	34
7.4 报表附注.....	35
§7 年度财务报表（转型前）	61

7.1 资产负债表（转型前）	61
7.2 利润表	62
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	63
7.4 报表附注	64
§8 投资组合报告（转型后）	87
8.1 期末基金资产组合情况	88
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	88
8.3 报告期内股票投资组合的重大变动	89
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	91
8.5 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	91
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	91
8.7 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明细	91
8.8 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	91
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	92
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	92
8.11 投资组合报告附注	92
§8 投资组合报告（转型前）	94
8.1 期末基金资产组合情况	94
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	94
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	95
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	99
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	101
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	101
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	101
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	101
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	101
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	101
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	101
8.12 投资组合报告附注	102
§9 基金份额持有人信息（转型后）	103
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	103
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	103
9.3 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	103
§9 基金份额持有人信息（转型前）	104
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	104
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	104
9.3 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	104
§ 10 开放式基金份额变动(转型后)	105
§ 10 开放式基金份额变动(转型前)	106
§11 重大事件揭示	107
11.1 基金份额持有人大会决议	107
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	107
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	107
11.4 基金投资策略的改变	107
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	107

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	107
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	108
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	109
11.9 其他重大事件（转型后）	111
11.9 其他重大事件（转型前）	112
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	114
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	114
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	114
§13 备查文件目录.....	115
13.1 备查文件目录	115
13.2 存放地点	115
13.3 查阅方式	115

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞嘉利混合
基金主代码	004358
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,231,723.47 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞国企改革混合
基金主代码	004358
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 2 月 16 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	200,372,907.72 份

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极灵活的合理资产配置，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资收益。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；通过适度的大类资产配置来降低组合的风险。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险高于债券型基金与货

	币市场基金，低于股票型基金
--	---------------

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金将深入挖掘国企改革所带来的投资机会，精选受益于国企改革的相关证券，在有效控制风险前提下，力求超越业绩比较基准的投资回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，判断证券市场的发展趋势，结合国企改革主题相关行业的发展状况包括相关行业的国家政策变化情况及行业发展状况等行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例，在严格控制投资组合风险的前提下，调整投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。
业绩比较基准	中证国有企业改革指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金未混合型基金，期预期风险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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	田青
	联系电话	021-38601777	010-67595096
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	010-67595096
传真		021-38601799	010-66275853
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200135	100033
法定代表人		贾波	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层
注册登记机构	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

§ 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

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年9月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日
本期已实现收益	14,378,034.64
本期利润	2,484,490.97
加权平均基金份额本期利润	0.0147
本期加权平均净值利润率	1.24%
本期基金份额净值增长率	3.57%
3.1.2 期末数据和指标	2017年12月31日
期末可供分配利润	1,717,299.57
期末可供分配基金份额利润	0.1678
期末基金资产净值	12,261,794.85
期末基金份额净值	1.1984
3.1.3 累计期末指标	2017年12月31日
基金份额累计净值增长率	3.57%

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年2月16日至2017年9月26日
本期已实现收益	18,256,797.97
本期利润	31,465,290.67
加权平均基金份额本期利润	0.1571
本期加权平均净值利润率	14.72%
本期基金份额净值增长率	15.37%
3.1.2 期末数据和指标	2017年9月26日
期末可供分配利润	19,623,819.10
期末可供分配基金份额利润	0.0979
期末基金资产净值	231,857,674.45
期末基金份额净值	1.1571
3.1.3 累计期末指标	2017年9月26日
基金份额累计净值增长率	15.37%

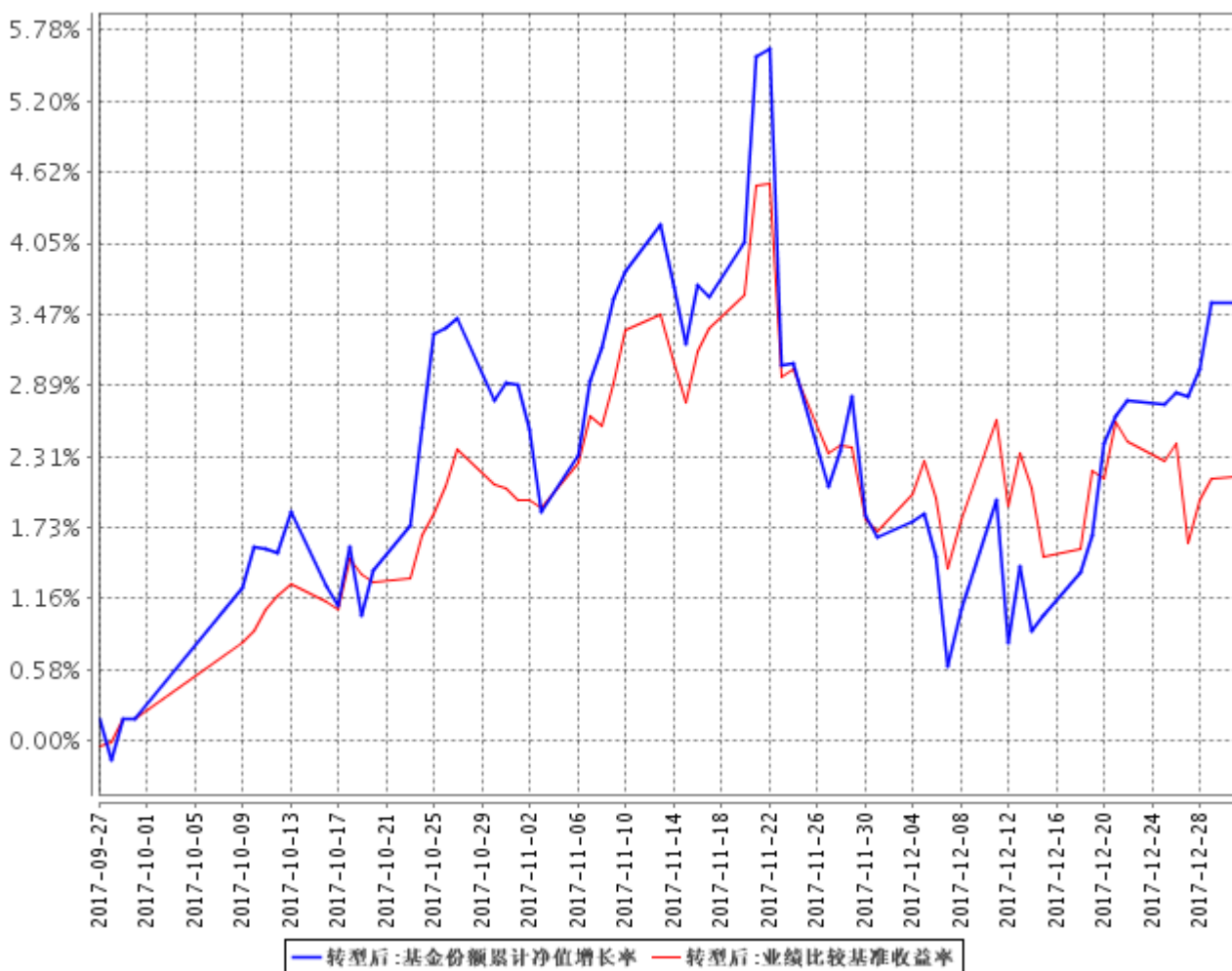
3.2 基金净值表现（转型后）

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	3.38%	0.60%	1.96%	0.40%	1.42%	0.20%
自基金合同生效起至今	3.57%	0.58%	2.19%	0.39%	1.38%	0.19%

3.2.2 自基金转型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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2017 年 9 月 27 日至 2017 年 12 月 31 日。

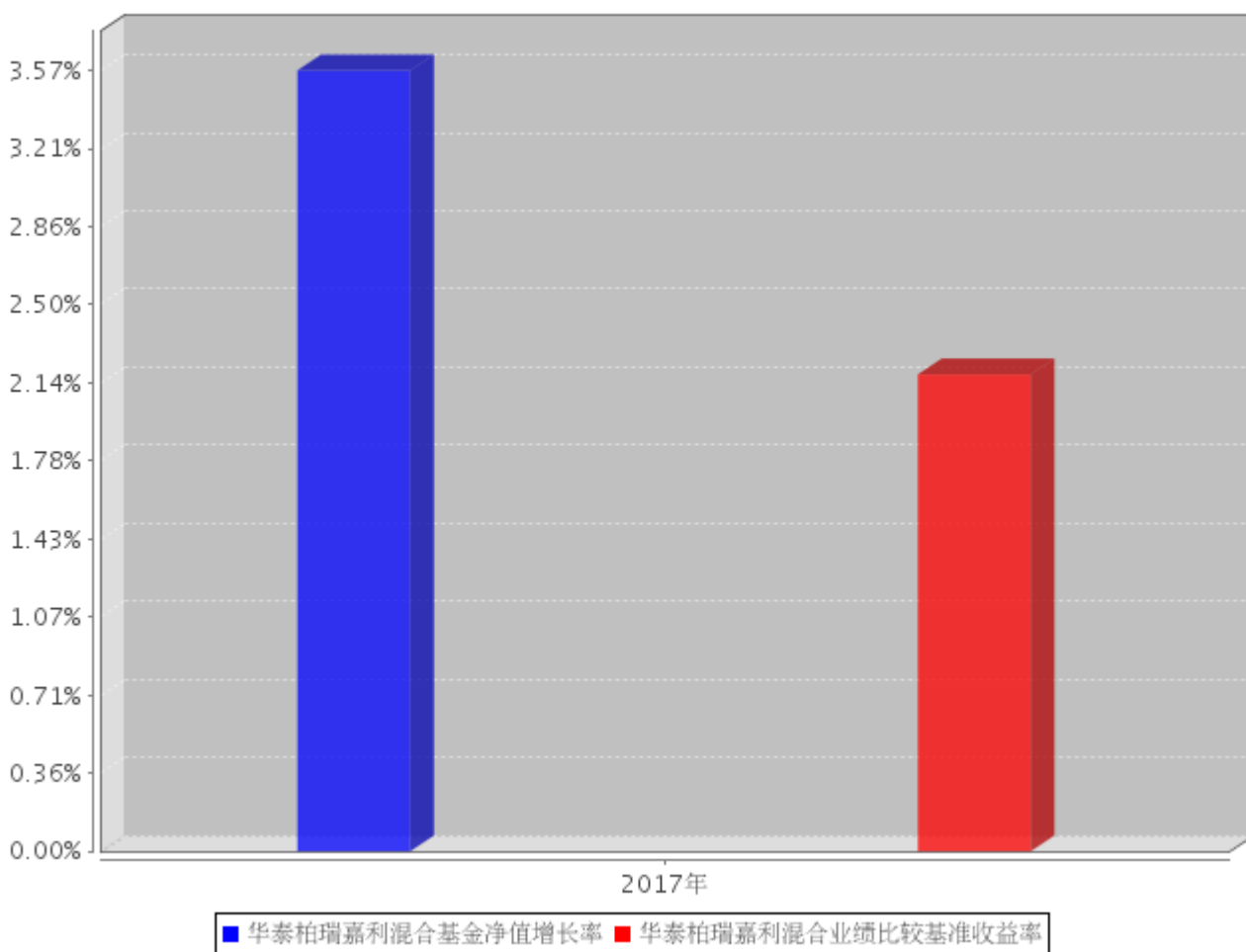
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围中规定的各项比例：股票资产占基金资产的比例为 0-95%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指

期货 合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不 低于基金资产净值的 5%。

3、本基金自 2017 年 9 月 27 日，由“华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金”转型为“华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金”，基金转型起至本报告期末不满一年。

3.2.3 自基金转型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

华泰柏瑞嘉利混合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对比图



注：基金合同生效日为 2017 年 9 月 27 日，2017 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

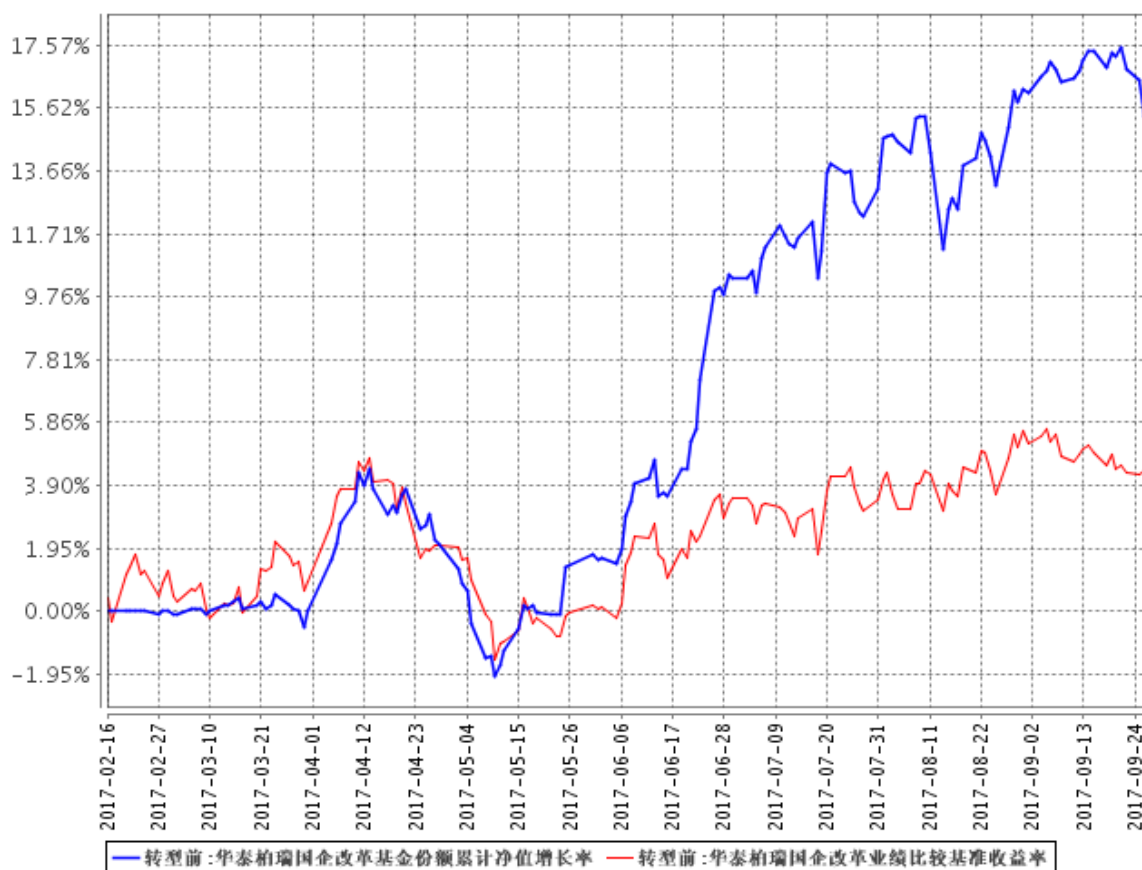
3.2 基金净值表现（转型前）

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	5.25%	0.70%	0.87%	0.35%	4.38%	0.36%
过去六个月	15.13%	0.69%	1.83%	0.38%	13.30%	0.31%
自基金合同生效起至今	15.71%	0.63%	3.43%	0.39%	12.28%	0.25%

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

华泰柏瑞国企改革基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



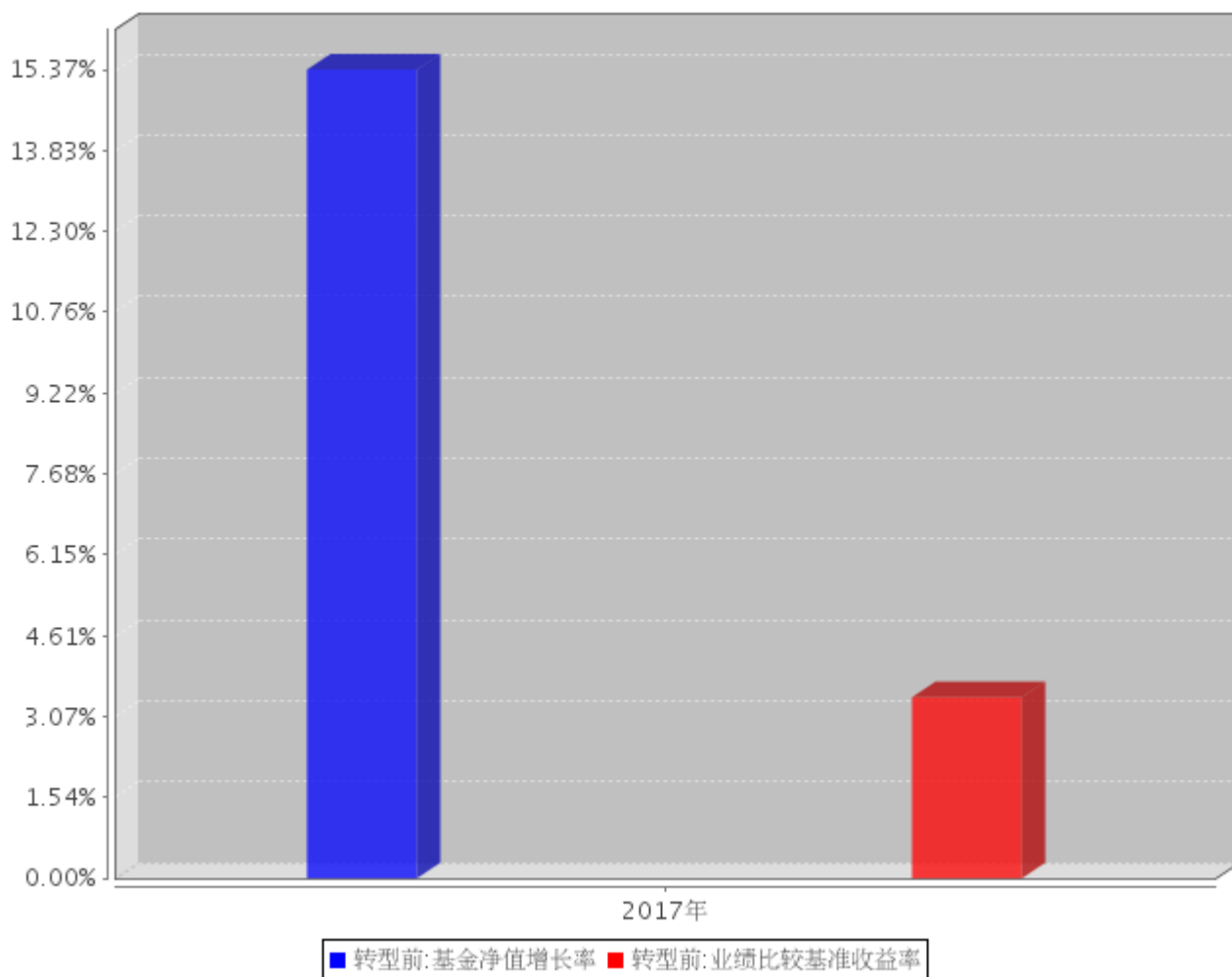
注：1、图示日期为 2017 年 2 月 16 日至 2017 年 9 月 26 日。

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部分（二）投资范围中规定的各项比例：本基金持有的股票占基金资产的比例为 0%–95%，投资于消费相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易

日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券。

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

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对比图



注：基金合同生效日为 2017 年 2 月 16 日，2017 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 其他指标

注：无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

转型前

注：本基金成立以来未进行利润分配。

转型后

注：本基金成立以来未进行利润分配。

§ 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发起式证券投资基金、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、华泰柏瑞亨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、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金。截至 2017 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 826.34 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（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
盛豪	量化投资部副总监、本基金的基金经理	2017 年 3 月 1 日	-	9 年	英国剑桥大学数学系硕士。2007 年 10 月至 2010 年 3 月任 Wilshire Associates 量化研究员，2010 年 11 月至 2012 年 8 月任 Goldenberg Hehmyer Trading Company 交易员。2012 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。2015 年 1 月起任量化投资部副总监，2015 年 10 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化驱动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。2017 年 3 月起任华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置

					<p>混合型证券投资基金和华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年4月起任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年6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。2017年9月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年12月起任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
杨景涵	本基金的基金经理	2017年2月16日	-	13年	<p>中山大学经济学硕士。特许金融分析师（CFA），金融风险经理（FRM）。2004年至2006年于平安资产管理有限公司，任投资分析师；2006年至2009年9月于生命人寿保险公司，历任投连投资经理、投资经理、基金投资部负责人。2009年10月加入本公司，任专户投资部投资经理。2014年6月至2015年4月任研究部总监助理。2015年4月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的</p>

				<p>基金经理。2015 年 5 月至 2017 年 12 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 12 月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。2016 年 9 月起任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至 2017 年 12 月任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起任华泰柏瑞鼎利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和华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 1 月起任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起任华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

					2017 年 9 月起任华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---------------------------------------

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
盛豪	量化投资部副总监、本基金的基金经理	2017年3月1日	-	9年	英国剑桥大学数学系硕士。2007年10月至2010年3月任 Wilshire Associates 量化研究员，2010年11月至2012年8月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。2012年9月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。2015年1月起任量化投资部副总监，2015年10月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化驱动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。2017年3月起任华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年4月起任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年6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。2017年9月起

					任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
杨景涵	本基金的基金经理	2017 年 2 月 16 日	-	13 年	中山大学经济学硕士。特许金融分析师（CFA），金融风险经理（FRM）。2004 年至 2006 年于平安资产管理有限公司，任投资分析师；2006 年至 2009 年 9 月于生命人寿保险公司，历任投连投资经理、投资经理、基金投资部负责人。2009 年 10 月加入本公司，任专户投资部投资经理。2014 年 6 月至 2015 年 4 月任研究部总监助理。2015 年 4 月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月至 2017 年 12 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 12 月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。2016 年 9 月起任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至 2017 年 12 月任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 1 月起任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利

					灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起任华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞富利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合规守信情况的说明

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，对于场内交易的非组合指令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）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。

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。公司机构设置合理，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。

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。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合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% 的同日反向交易共 4 次，皆是出于日常定期换仓操作。

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

2017 年全年 A 股市场大盘指数在白马蓝筹股带领下震荡上行，而中小盘指数则表现不佳。全年万德全 A 指数和上证综指分别上涨 4.93% 和 6.56%。以大盘蓝筹股为代表的沪深 300 全收益指数 17 年全年上涨 24.25%，以中盘股为代表的中证 500 全收益指数同期仅上涨 0.61%，而以中小盘股为代表的中证 1000 全收益指数则下跌了 16.89%。这种市场结构分化行情在四季度表现尤为明显，全市场剔除停牌股和 IPO 股票，共 2969 只股票，四季度取得正回报的股票有 594 只，占比 20.0%。四季度正回报超过沪深 300 指数回报（约 5%）的股票有 400 只，占比 13.5%。

本报告期内，基金精选个股，表现符合预期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1984 元；本报告期基金份额净值增长率为 19.84%，业绩比较基准收益率为 5.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，我们认为在不发生系统风险的前提下，A 股市场可以预期正收益。

2018 年境外境内的不确定性因素仍然存在。境外面临全球央行进一步收紧流动性对各类资产价格的影响，以及国家之间可能的经济上和政治上的摩擦；境内面临金融去杠杆和监管趋严的影响。但我们认为在不发生系统风险的前提下，A 股市场在经历了 2015 年以来的调整之后，估值趋向合理，向下风险应该有限，全年录得正收益的可能性较大。其中的一个主要驱动因素是：在债市低迷，房市和境外投资受限，资金成本高企的情况下，大量资金依然缺少更好的投资方向，考虑风险与收益，A 股市场会是一个不错的选择。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017 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、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的

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。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

本基金成立以来未进行利润分配。

4.9 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

注：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”）在华泰柏瑞嘉利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（转型后）

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	无保留意见带强调事项
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 21088 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	华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金(原华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金,以下简称“华泰柏瑞嘉利混合基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间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。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附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,公允反映了华泰柏瑞嘉利混合基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞嘉利混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注,如财务报表附注“7.4.2 会计报表的编制基础”所述,华泰柏瑞嘉利混合基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)拟在资产负债表日后清算华泰柏瑞嘉利混合基金的剩余资产。因此,上述华泰柏瑞嘉利混合基金的财务报表以清算基础编制。该事项不影响已发表的审计意见。</p>

其他事项	-
其他信息	-
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞嘉利混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞嘉利混合基金、终止运营或别无其他现实的选择参见财务报表附注 742 有关以清算基础编制财务报表的说明。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞嘉利混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2018 年 3 月 26 日

§ 6 审计报告（转型前）

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(2018)第 21109 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	华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞国企改革基金”)的财务报表,包括 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)的资产负债表,2017 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)止期间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。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附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,公允反映了华泰柏瑞国企改革基金 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2017 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞国企改革混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>华泰柏瑞国企改革基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞国企改革基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞国企改革基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞国企改革基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对华泰柏瑞国企改革基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞国企改革基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价</p>

	<p>财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2018 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	6,982,698.61
结算备付金		298,045.36
存出保证金		21,645.72
交易性金融资产	7.4.7.2	5,798,054.31
其中：股票投资		5,798,054.31
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	1,671.54
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		13,102,115.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		5,964.82
应付管理人报酬		128,301.50
应付托管费		26,729.49
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	337,358.33
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	341,966.55
负债合计		840,320.69
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	10,231,723.47
未分配利润	7.4.7.10	2,030,071.38
所有者权益合计		12,261,794.85
负债和所有者权益总计		13,102,115.54

注：1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1984 元，基金份额总额 10,231,723.47 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年9月27日(基金合同生效日)至2017 年12月31日
一、收入		4,025,788.89
1. 利息收入		57,418.02
其中：存款利息收入	7.4.7.11	57,382.55
债券利息收入		35.47
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,584,078.89
其中：股票投资收益	7.4.7.12	15,737,781.30
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-2,248.12
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-151,454.29
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号	7.4.7.17	-11,893,543.67

填列)		
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.18	277,835.65
减: 二、费用		1,541,297.92
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	634,689.35
2. 托管费	7.4.10.2.2	132,226.95
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	678,297.31
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	96,084.31
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		2,484,490.97
减: 所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		2,484,490.97

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2017 年 9 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 9 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2017 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)	200,372,907.72	31,484,766.73	231,857,674.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	2,484,490.97	2,484,490.97
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)	-190,141,184.25	-31,939,186.32	-222,080,370.57
其中: 1. 基金申购款	1,265.55	225.51	1,491.06
2. 基金赎回款 (以“-”号填列)	-190,142,449.80	-31,939,411.83	-222,081,861.63
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)	10,231,723.47	2,030,071.38	12,261,794.85

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：

<u> 韩勇 </u>	<u> 房伟力 </u>	<u> 赵景云 </u>
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

华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金是根据原华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“国企改革基金”)基金份额持有人大会审议通过的《关于修改华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》，由原国企改革基金转型而来。自 2017 年 9 月 27 日起，由《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。原国企改革基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 231,857,674.45 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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、企业债、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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。本基金持有的股票资产占基金资产的比例为 0-95%；本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

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 2018 年 3 月 26 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》、《华泰柏瑞嘉利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。

根据《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 3 月 20 日发布的《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于 2018 年 3 月 20 日进入财产清算期，详情参见附注 7.4.8.2 资产负债表日后事项，因此本基金财务报表以清算基础编制。于 2017 年 12 月 31 日，所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量，其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

于本报告期内，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。于本报告期末，各项金融资产以可收回金额和账面价值孰低计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产

与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 12 月 26 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计

字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 26 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

2、本基金各项资产的可收回金额为资产的公允价值减去处置费用后的净额与资产预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

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

根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期

的股票等流通受限股票，本基金自 2017 年 12 月 26 日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

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[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) 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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	6,982,698.61
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	6,982,698.61

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	4,483,105.28	5,798,054.31	1,314,949.03
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,483,105.28	5,798,054.31	1,314,949.03

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,513.36
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	147.51
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	10.67
合计	1,671.54

7.4.7.6 其他资产

注：无

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	337,358.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	337,358.33

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	22.48
预提费用	341,944.07
合计	341,966.55

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	200,372,907.72	200,372,907.72
本期申购	1,265.55	1,265.55
本期赎回(以“-”号填列)	-190,142,449.80	-190,142,449.80

- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	10,231,723.47	10,231,723.47

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	18,264,561.47	13,220,205.26	31,484,766.73
本期利润	14,378,034.64	-11,893,543.67	2,484,490.97
本期基金份额交易产生的变动数	-30,925,296.54	-1,013,889.78	-31,939,186.32
其中：基金申购款	146.53	78.98	225.51
基金赎回款	-30,925,443.07	-1,013,968.76	-31,939,411.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,717,299.57	312,771.81	2,030,071.38

7.4.7.11 存款利息收入

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年9月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日
活期存款利息收入	56,025.98
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,249.27
其他	107.30
合计	57,382.55

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日
卖出股票成交总额	295,336,364.97
减：卖出股票成本总额	279,598,583.67
买卖股票差价收入	15,737,781.30

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月27日至2017年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,248.12
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-2,248.12

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月27日至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	171,787.35
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	174,000.00
减：应收利息总额	35.47
买卖债券差价收入	-2,248.12

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

7.4.7.16 股利收益

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年9月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	-151,454.29
基金投资产生的股利收益	-
合计	-151,454.29

7.4.7.17 公允价值变动损益

单位：人民币元

项目名称	本期2017年9月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-11,893,543.67
——股票投资	-11,893,543.67
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-11,893,543.67

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日
基金赎回费收入	277,423.51
转换费收入	412.14

合计	277,835.65
----	------------

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	678,297.31
银行间市场交易费用	-
合计	678,297.31

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	-
信息披露费	90,281.88
银行划款手续费	1,252.43
银行间账户服务费	4,500.00
其他费用	50.00
合计	96,084.31

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

注：无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及基金管理人华泰柏瑞基金

管理有限公司于 2018 年 3 月 20 日发布的《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于 2018 年 3 月 20 日进入财产清算程序。

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（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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、基金销售机构
柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 2017 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 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	224,638,752.41	59.34%

7.4.10.1.2 权证交易

注：无

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年9月27日(基金合同生效日)至2017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	208,851.54	59.78%	208,810.20	61.90%

注：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 2017年9月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	77.00

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.20% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

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：本报告期及 2016 年度，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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：本报告期及 2016 年度，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2017 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	6,982,698.61	56,025.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：无

7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	说明

603161	科华控股	2017年 12月28 日	2018年 1月5 日	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
--------	------	---------------------	-------------------	-------	-------	-------	-------	-----------	-----------	---

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌日期	复牌 开盘单价	数量（股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600309	万华化学	2017 年12 月5日	重大资产重组	37.67	-	-	62,900	1,429,284.62	2,369,443.00	
600664	哈药股份	2017 年9月 28日	重大资产重组	6.11	2018年 2月27 日	6.00	283,400	1,637,385.70	1,731,574.00	
600332	白云山	2017 年10 月31 日	重大资产重组	32.14	2018年 1月8 日	30.15	34,400	998,919.00	1,105,616.00	
000688	建新矿业	2017 年9月 6日	重大事项	10.13	2018年 2月7 日	9.86	17,400	190,896.00	176,262.00	
002919	名臣健康	2017 年12 月28 日	重大事项	35.26	2018年 1月2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基

金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和法律监察部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金无债券投资。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：无

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债

券投资的公允价值。

于 2017 年 12 月 31 日,本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注:无

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%,本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流

动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,982,698.61	-	-	-	-	-	6,982,698.61
结算备付金	298,045.36	-	-	-	-	-	298,045.36
存出保证金	21,645.72	-	-	-	-	-	21,645.72
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,798,054.31	5,798,054.31
应收利息	-	-	-	-	-	1,671.54	1,671.54
资产总计	7,302,389.69	-	-	-	-	5,799,725.85	13,102,115.54
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,964.82	5,964.82

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	128,301.50	128,301.50
应付托管费	-	-	-	-	-	26,729.49	26,729.49
应付交易费用	-	-	-	-	-	337,358.33	337,358.33
其他负债	-	-	-	-	-	341,966.55	341,966.55
负债总计	-	-	-	-	-	840,320.69	840,320.69
利率敏感度缺口	7,302,389.69	-	-	-	-	-4,959,405.16	12,261,794.85

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金持有的股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	5,798,054.31	47.29
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	5,798,054.31	47.29

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币万元) 本期末 (2017 年 12 月 31 日)
	1. 沪深 300 指数上升 5%	32.00
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-32.00

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

7.4.14 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 2017 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 365,457.60 元，属于第二层次的余额为 5,432,596.71 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 2017 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有

关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 9 月 26 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 9 月 26 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	18,954,238.04
结算备付金		187,279.60
存出保证金		45,213.92
交易性金融资产	7.4.7.2	213,281,759.05
其中：股票投资		213,281,759.05
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		124,275.31
应收利息	7.4.7.5	2,329.11
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		232,595,095.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 9 月 26 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		249,977.98
应付托管费		41,663.00
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	194,117.41
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	251,662.19
负债合计		737,420.58
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	200,372,907.72
未分配利润	7.4.7.10	31,484,766.73
所有者权益合计		231,857,674.45
负债和所有者权益总计		232,595,095.03

注：

1. 报告截止日 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)，基金份额净值 1.1571 元，基金份额总额 200,372,907.72 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)止期间。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 2 月 16 日至 2017 年 9 月 26 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 2 月 16 日至 2017 年 9 月 26 日
一、收入		34,724,841.54
1. 利息收入		705,433.02
其中：存款利息收入	7.4.7.11	187,095.79
债券利息收入		0.00
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		518,337.23
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,810,467.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	17,649,828.36
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-

股利收益	7.4.7.16	3,160,639.32
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	13,208,492.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	448.14
减：二、费用		3,259,550.87
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,948,029.30
2. 托管费	7.4.10.2.2	324,671.54
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	717,059.55
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	269,790.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,465,290.67
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,465,290.67

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 2 月 16 日至 2017 年 9 月 26 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 2 月 16 日至 2017 年 9 月 26 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）	200,250,914.93	-	200,250,914.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,465,290.67	31,465,290.67
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）	121,992.79	19,476.06	141,468.85
其中：1. 基金申购款	189,237.41	28,524.09	217,761.50
2. 基金赎回款	-67,244.62	-9,048.03	-76,292.65
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）	200,372,907.72	31,484,766.73	231,857,674.45

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：

<u> 韩勇 </u>	<u> 房伟力 </u>	<u> 赵景云 </u>
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

华泰柏瑞国企改革主题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]1499号《关于准予华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和机构部函[2016]2727号《关于华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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 200,232,903.23 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(2017)第 139 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 2 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,250,914.93 份基金份额,其中认购资金利息折合 18,011.70 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金以通讯方式自 2017 年 8 月 28 日起至 2017 年 9 月 26 日止期间召开了基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于修改华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》。本基金的基金管理人于 2017 年 9 月 28 日发布了《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。自 2017 年 9 月 27 日起,由《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,原《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金持有的股票资产占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于本基金界定的国企改革主题方向的相关证券比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中证国有企业改革指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

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 2018 年 3 月 26 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》、《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同基金合同》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。

经中国证监会批准，基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)止期间的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 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2017 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)止期间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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；

对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件, 应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 于处置时, 其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益, 其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股

票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

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[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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 9 月 26 日
活期存款	18,954,238.04
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	18,954,238.04

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 9 月 26 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	200,073,266.35	213,281,759.05	13,208,492.70
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		200,073,266.35	213,281,759.05	13,208,492.70

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年9月26日
应收活期存款利息	2,266.35
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	50.58
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	12.18
合计	2,329.11

7.4.7.6 其他资产

注：无

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年9月26日

交易所市场应付交易费用	194,117.41
银行间市场应付交易费用	-
合计	194,117.41

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年9月26日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	251,662.19
合计	251,662.19

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年2月16日至2017年9月26日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	200,250,914.93	200,250,914.93
本期申购	189,237.41	189,237.41
本期赎回（以“-”号填列）	-67,244.62	-67,244.62
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	200,372,907.72	200,372,907.72

注：

1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。
2. 本基金自 2017 年 2 月 13 日至 2017 年 2 月 14 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 200,232,903.23 元。根据《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 18,011.70 元在本基金成立后，折算为 18,011.70 份基金份额，划入基金份额持有人账户。
3. 根据《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2017 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 2 月 27 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申

购业务、赎回业务和转换业务自 2017 年 2 月 28 日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	18,256,797.97	13,208,492.70	31,465,290.67
本期基金份额交易产生的变动数	7,763.50	11,712.56	19,476.06
其中：基金申购款	11,701.10	16,822.99	28,524.09
基金赎回款	-3,937.60	-5,110.43	-9,048.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,264,561.47	13,220,205.26	31,484,766.73

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 2 月 16 日至 2017 年 9 月 26 日
活期存款利息收入	174,390.37
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	12,367.29
其他	338.13
合计	187,095.79

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 2 月 16 日至 2017 年 9 月 26 日
卖出股票成交总额	176,776,973.63
减：卖出股票成本总额	159,127,145.27
买卖股票差价收入	17,649,828.36

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：无

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年2月16日至2017年9月26日
股票投资产生的股利收益	3,160,639.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,160,639.32

7.4.7.17 公允价值变动损益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年2月16日(基金合同生效日)至2017年9月26日(基金合同失效前日)
1. 交易性金融资产	13,208,492.70
——股票投资	13,208,492.70
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	13,208,492.70

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年2月16日至2017年9月26日
基金赎回费收入	65.10
转换费收入	383.04
合计	448.14

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 2 月 16 日至 2017 年 9 月 26 日
交易所市场交易费用	717,059.55
银行间市场交易费用	-
合计	717,059.55

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 2 月 16 日至 2017 年 9 月 26 日
审计费用	41,944.07
信息披露费	209,718.12
银行划款手续费	3,628.29
银行间账户服务费	4,500.00
其他费用	10,000.00
合计	269,790.48

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

注：无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2017 年 9 月 28 日发布了《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。自 2017 年 9 月 27 日起，由《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日起失效，本基金转型为华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金。

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（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	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
柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

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 2017年2月16日至2017年9月26日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	247,540,605.73	46.37%

7.4.10.1.2 权证交易

注：无

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年2月16日至2017年9月26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	228,052.08	46.26%	11,655.71	6.00%

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
	2017年2月16日至2017年9月26日
当期发生的基金应支付的管理费	1,948,029.30
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	213.58

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年2月16日至2017年9月26日
当期发生的基金应支付的托管费	324,671.54

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

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：本报告期及 2016 年度，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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：本报告期及 2016 年度，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2017年2月16日至2017年9月26日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	18,954,238.04	174,390.37

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

-

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：无

7.4.12 期末（2017年9月26日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	说明
603619	中曼石油	2017年8月4日	2017年11月17日	新股未上市	22.61	22.61	1,701	38,459.61	38,459.61	-
603367	辰欣药业	2017年9月21日	2017年9月29日	新股未上市	11.66	11.66	2,917	34,012.22	34,012.22	-
603103	横店影视	2017年9月26日	2017年10月12日	新股未上市	15.45	15.45	2,021	31,224.45	31,224.45	-
603378	亚士创能	2017年9月21日	2017年9月28日	新股未上市	12.94	12.94	1,433	18,543.02	18,543.02	-
601086	国芳集团	2017年9月22日	2017年9月29日	新股未上市	3.16	3.16	5,799	18,324.84	18,324.84	-
002902	铭普	2017年9月	2017年	新股未上市	14.13	14.13	1,270	17,945.10	17,945.10	-

	光磁	月 22 日	9 月 29 日	市						
300705	九典制药	2017 年 9 月 25 日	2017 年 10 月 10 日	新股未上市	10.37	10.37	1,073	11,127.01	11,127.01	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000688	建新矿业	2017 年 9 月 6 日	重大事项	10.95	2018 年 2 月 7 日	9.86	17,400	190,896.00	190,530.00	-

注：本基金截至 2017 年 9 月 26 日（基金合同失效前日）止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险

控制委员会、风险管理部和法律监察部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)，本基金未持有债券投资。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：无

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

注：无。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2017年9月26日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	18,954,238.04	-	-	-	-	-	18,954,238.04
结算备付金	187,279.60	-	-	-	-	-	187,279.60
存出保证金	45,213.92	-	-	-	-	-	45,213.92
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-213,281,759.05	213,281,759.05
应收证券清算款	-	-	-	-	-	124,275.31	124,275.31
应收利息	-	-	-	-	-	2,329.11	2,329.11
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	19,186,731.56	-	-	-	-	-213,408,363.47	232,595,095.03
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	249,977.98	249,977.98

应付托管费	-	-	-	-	-	41,663.00	41,663.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	194,117.41	194,117.41
其他负债	-	-	-	-	-	251,662.19	251,662.19
负债总计	-	-	-	-	-	737,420.58	737,420.58
利率敏感度缺口	19,186,731.56	-	-	-	-	-212,670,942.89	231,857,674.45

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金持有的股票资产占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于本基金界定的国企改革主题方向的相关证券比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年9月26日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	213,281,759.05	91.99
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	213,281,759.05	91.99

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元)
		本期末 (2017年9月26日)
	1. 沪深 300 指数上升 5%	1,076.00
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-1,076.00

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

7.4.14 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 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)，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 212,921,592.80 元,属于第二层次的余额为 360,166.25 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 2017 年 9 月 26 日(基金合同失效前日)，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	5,798,054.31	44.25
	其中：股票	5,798,054.31	44.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,280,743.97	55.57
8	其他各项资产	23,317.26	0.18
9	合计	13,102,115.54	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	176,262.00	1.44
C	制造业	5,621,792.31	45.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	5,798,054.31	47.29

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600309	万华化学	62,900	2,369,443.00	19.32
2	600664	哈药股份	283,400	1,731,574.00	14.12
3	600332	白云山	34,400	1,105,616.00	9.02
4	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	1.46
5	000688	建新矿业	17,400	176,262.00	1.44
6	002918	蒙娜丽莎	1,512	84,218.40	0.69
7	300735	光弘科技	3,255	46,839.45	0.38
8	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.30
9	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.24
10	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.17
11	300684	中石科技	827	11,528.38	0.09
12	603655	朗博科技	759	7,058.70	0.06

8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

8.3.1 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	600688	上海石化	9,231,214.18	75.28%
2	000002	万科A	8,458,779.80	68.98%

3	000338	潍柴动力	8,230,434.87	67.12%
4	600019	宝钢股份	8,177,738.92	66.69%
5	600383	金地集团	7,760,959.50	63.29%
6	002146	荣盛发展	7,602,681.16	62.00%
7	002195	二三四五	7,323,887.28	59.73%
8	601318	中国平安	7,096,576.03	57.88%
9	000415	渤海金控	6,958,615.31	56.75%
10	600816	安信信托	6,773,998.42	55.24%
11	600153	建发股份	6,699,600.63	54.64%
12	000069	华侨城A	6,532,806.37	53.28%
13	002385	大北农	6,510,415.26	53.10%
14	601633	长城汽车	6,491,977.00	52.94%
15	000709	河钢股份	6,301,116.09	51.39%
16	601628	中国人寿	5,887,853.00	48.02%
17	601006	大秦铁路	5,018,974.73	40.93%
18	600585	海螺水泥	4,975,048.00	40.57%
19	600188	兖州煤业	4,886,877.01	39.85%
20	600021	上海电力	4,807,903.36	39.21%
21	000060	中金岭南	4,792,816.92	39.09%
22	601997	贵阳银行	4,761,222.73	38.83%
23	601225	陕西煤业	4,744,515.00	38.69%
24	600741	华域汽车	4,657,355.98	37.98%

8.3.2 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	601318	中国平安	8,675,419.00	70.75%
2	600383	金地集团	6,791,890.00	55.39%
3	600585	海螺水泥	6,480,533.83	52.85%
4	000002	万科A	6,361,534.62	51.88%
5	002385	大北农	6,347,268.81	51.76%
6	000415	渤海金控	6,204,805.35	50.60%
7	000725	京东方A	6,016,711.40	49.07%
8	601628	中国人寿	5,891,229.91	48.05%

9	600741	华域汽车	5,426,774.01	44.26%
10	601006	大秦铁路	4,960,635.00	40.46%
11	000651	格力电器	4,924,279.00	40.16%
12	000338	潍柴动力	4,564,908.00	37.23%
13	601390	中国中铁	4,435,009.12	36.17%
14	601288	农业银行	4,412,510.00	35.99%
15	601997	贵阳银行	4,312,654.84	35.17%
16	601398	工商银行	4,220,180.32	34.42%
17	601988	中国银行	4,085,436.00	33.32%
18	600036	招商银行	4,021,175.80	32.79%
19	600153	建发股份	3,990,270.44	32.54%
20	600019	宝钢股份	3,828,103.02	31.22%

8.3.3 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	84,101,721.58
卖出股票收入（成交）总额	295,336,364.97

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

8.5 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

注：无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

8.7 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明细

注：无。

8.8 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：无。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：无。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

注：无。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

8.10.3 本期国债期货投资评价

注：无。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	21,645.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,671.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	23,317.26
---	----	-----------

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600309	万华化学	2,369,443.00	19.32	停牌
2	600664	哈药股份	1,731,574.00	14.12	停牌
3	600332	白云山	1,105,616.00	9.02	停牌
4	000688	建新矿业	176,262.00	1.44	停牌
5	002919	名臣健康	28,948.46	0.24	停牌
6	603161	科华控股	20,753.25	0.17	新股锁定

§ 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	213,281,759.05	91.62
	其中：股票	213,281,759.05	91.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,141,517.64	8.34
8	其他资产	171,818.34	0.04
9	合计	232,595,095.03	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	6,701,993.61	2.89
C	制造业	80,992,481.05	34.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,248,726.04	0.97
E	建筑业	6,982,472.40	3.01
F	批发和零售业	4,182,354.84	1.80
G	交通运输、仓储和邮政业	14,167,722.13	6.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,156,283.56	1.36
J	金融业	61,479,304.34	26.52

K	房地产业	19,435,547.12	8.38
L	租赁和商务服务业	9,078,021.96	3.92
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	549,940.05	0.24
R	文化、体育和娱乐业	788,225.95	0.34
S	综合	3,518,686.00	1.52
	合计	213,281,759.05	91.99

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000415	渤海金控	1,007,600	6,690,464.00	2.89
2	600383	金地集团	571,700	6,666,022.00	2.88
3	002385	大北农	1,026,536	6,323,461.76	2.73
4	600585	海螺水泥	228,800	5,790,928.00	2.50
5	000002	万科A	212,337	5,682,138.12	2.45
6	601006	大秦铁路	560,500	4,994,055.00	2.15
7	601318	中国平安	88,300	4,790,275.00	2.07
8	601997	贵阳银行	306,300	4,557,744.00	1.97
9	000651	格力电器	116,100	4,458,240.00	1.92
10	000725	京东方A	1,041,700	4,343,889.00	1.87
11	600741	华域汽车	198,501	4,331,291.82	1.87
12	601398	工商银行	712,352	4,323,976.64	1.86
13	000750	国海证券	728,300	4,253,272.00	1.83
14	600153	建发股份	355,900	4,164,030.00	1.80
15	601390	中国中铁	477,552	4,154,702.40	1.79
16	601288	农业银行	935,000	3,599,750.00	1.55
17	000060	中金岭南	294,415	3,588,918.85	1.55
18	600036	招商银行	139,590	3,588,858.90	1.55
19	600783	鲁信创投	195,700	3,518,686.00	1.52

20	601225	陕西煤业	406,800	3,502,548.00	1.51
21	601169	北京银行	458,100	3,399,102.00	1.47
22	000338	潍柴动力	458,900	3,395,860.00	1.46
23	601919	中远海控	473,500	3,357,115.00	1.45
24	000069	华侨城 A	373,100	3,134,040.00	1.35
25	002195	二三四五	425,244	3,078,766.56	1.33
26	600019	宝钢股份	419,680	3,051,073.60	1.32
27	601628	中国人寿	105,200	2,984,524.00	1.29
28	000596	古井贡酒	51,700	2,970,165.00	1.28
29	601127	小康股份	140,800	2,969,472.00	1.28
30	600309	万华化学	73,300	2,962,786.00	1.28
31	601328	交通银行	452,600	2,892,114.00	1.25
32	600705	中航资本	472,600	2,807,244.00	1.21
33	601377	兴业证券	323,600	2,734,420.00	1.18
34	000402	金融街	225,400	2,731,848.00	1.18
35	600089	特变电工	274,447	2,725,258.71	1.18
36	002449	国星光电	143,200	2,667,816.00	1.15
37	000425	徐工机械	723,700	2,648,742.00	1.14
38	002536	西泵股份	172,200	2,646,714.00	1.14
39	002320	海峡股份	131,500	2,544,525.00	1.10
40	601111	中国国航	266,100	2,349,663.00	1.01
41	601988	中国银行	502,700	2,111,340.00	0.91
42	002142	宁波银行	131,040	2,109,744.00	0.91
43	601818	光大银行	510,100	2,091,410.00	0.90
44	000157	中联重科	462,400	2,057,680.00	0.89
45	300178	腾邦国际	121,400	1,937,544.00	0.84
46	300193	佳士科技	222,900	1,921,398.00	0.83
47	601555	东吴证券	154,500	1,872,540.00	0.81
48	600900	长江电力	122,700	1,871,175.00	0.81
49	600188	兖州煤业	141,400	1,849,512.00	0.80
50	000498	山东路桥	222,200	1,846,482.00	0.80
51	002737	葵花药业	53,100	1,771,947.00	0.76
52	000709	河钢股份	397,000	1,746,800.00	0.75
53	000666	经纬纺机	85,500	1,733,940.00	0.75
54	600664	哈药股份	283,400	1,657,890.00	0.72
55	600690	青岛海尔	109,200	1,585,584.00	0.68
56	601601	中国太保	42,000	1,582,140.00	0.68
57	000776	广发证券	80,000	1,509,600.00	0.65
58	601788	光大证券	96,100	1,483,784.00	0.64

59	600703	三安光电	63,800	1,387,650.00	0.60
60	000959	首钢股份	199,882	1,363,195.24	0.59
61	600015	华夏银行	141,600	1,322,544.00	0.57
62	600271	航天信息	63,200	1,196,376.00	0.52
63	601088	中国神华	52,800	1,120,944.00	0.48
64	600030	中信证券	54,500	981,000.00	0.42
65	600643	爱建集团	69,700	972,315.00	0.42
66	002283	天润曲轴	142,700	957,517.00	0.41
67	000563	陕国投 A	178,300	944,990.00	0.41
68	600018	上港集团	133,800	903,150.00	0.39
69	601216	君正集团	161,600	833,856.00	0.36
70	002084	海鸥卫浴	87,400	763,876.00	0.33
71	601928	凤凰传媒	80,800	747,400.00	0.32
72	000726	鲁 泰 A	61,200	731,340.00	0.32
73	002146	荣盛发展	73,700	716,364.00	0.31
74	601166	兴业银行	38,100	668,655.00	0.29
75	600449	宁夏建材	49,800	643,914.00	0.28
76	600109	国金证券	53,800	631,074.00	0.27
77	600782	新钢股份	102,800	615,772.00	0.27
78	000728	国元证券	42,700	596,092.00	0.26
79	002736	国信证券	43,000	584,800.00	0.25
80	002507	涪陵榨菜	39,000	553,020.00	0.24
81	002775	文科园林	25,600	535,808.00	0.23
82	002202	金风科技	36,660	486,478.20	0.21
83	600000	浦发银行	36,700	471,962.00	0.20
84	300347	泰格医药	16,500	463,320.00	0.20
85	601186	中国铁建	37,000	445,480.00	0.19
86	600369	西南证券	74,000	430,680.00	0.19
87	300007	汉威科技	24,000	421,200.00	0.18
88	000001	平安银行	37,000	408,850.00	0.18
89	600409	三友化工	35,000	402,850.00	0.17
90	600837	海通证券	26,800	397,176.00	0.17
91	300338	开元股份	15,900	376,830.00	0.16
92	600606	绿地控股	46,500	355,725.00	0.15
93	600886	国投电力	47,200	349,280.00	0.15
94	300316	晶盛机电	22,400	336,672.00	0.15
95	603369	今世缘	20,700	325,404.00	0.14
96	002496	辉丰股份	60,300	323,811.00	0.14
97	601009	南京银行	39,420	314,965.80	0.14

98	601888	中国国旅	7,600	262,580.00	0.11
99	300233	金城医药	12,200	246,684.00	0.11
100	002304	洋河股份	2,400	240,192.00	0.10
101	002152	广电运通	28,800	229,248.00	0.10
102	000688	建新矿业	17,400	190,530.00	0.08
103	002406	远东传动	15,200	122,512.00	0.05
104	300269	联建光电	5,700	107,502.00	0.05
105	300158	振东制药	6,200	100,502.00	0.04
106	000718	苏宁环球	18,200	100,282.00	0.04
107	600688	上海石化	13,500	86,805.00	0.04
108	603882	金城医学	2,763	86,620.05	0.04
109	603648	畅联股份	3,196	79,931.96	0.03
110	600588	用友网络	3,300	77,517.00	0.03
111	300698	万马科技	1,350	64,854.00	0.03
112	002899	英派斯	1,408	63,402.24	0.03
113	603106	恒银金融	2,786	63,130.76	0.03
114	002900	哈三联	1,983	62,424.84	0.03
115	300697	电工合金	1,630	61,858.50	0.03
116	300702	天宇股份	1,124	58,436.76	0.03
117	600823	世茂股份	9,200	49,128.00	0.02
118	601211	国泰君安	2,200	47,762.00	0.02
119	603055	台华新材	2,658	46,940.28	0.02
120	603321	梅轮电梯	2,726	46,423.78	0.02
121	002898	赛隆药业	1,464	45,457.20	0.02
122	603619	中曼石油	1,701	38,459.61	0.02
123	603386	广东骏亚	1,644	38,321.64	0.02
124	002901	大博医疗	1,834	36,955.10	0.02
125	002334	英威腾	3,900	35,139.00	0.02
126	000858	五粮液	600	34,134.00	0.01
127	603367	辰欣药业	2,917	34,012.22	0.01
128	300700	岱勒新材	833	32,636.94	0.01
129	603103	横店影视	2,021	31,224.45	0.01
130	603157	拉夏贝尔	2,150	28,638.00	0.01
131	002893	华通热力	1,176	28,271.04	0.01
132	601908	京运通	4,600	25,714.00	0.01
133	603963	大理药业	999	21,898.08	0.01
134	603813	原尚股份	741	19,214.13	0.01
135	603378	亚士创能	1,433	18,543.02	0.01
136	601086	国芳集团	5,799	18,324.84	0.01

137	002902	铭普光磁	1,270	17,945.10	0.01
138	603363	傲农生物	2,486	17,153.40	0.01
139	601231	环旭电子	1,100	15,389.00	0.01
140	000166	申万宏源	2,500	14,600.00	0.01
141	000413	东旭光电	1,200	13,596.00	0.01
142	300705	九典制药	1,073	11,127.01	0.00
143	300654	世纪天鸿	865	9,601.50	0.00
144	603198	迎驾贡酒	100	1,950.00	0.00
145	601678	滨化股份	100	840.00	0.00

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	000002	万科A	8,458,779.80	4.22
2	600019	宝钢股份	7,980,133.92	3.99
3	600383	金地集团	7,760,959.50	3.88
4	002146	荣盛发展	7,602,681.16	3.80
5	600688	上海石化	7,455,321.18	3.72
6	002195	二三四五	7,323,887.28	3.66
7	000338	潍柴动力	7,204,117.87	3.60
8	000415	渤海金控	6,958,615.31	3.47
9	600816	安信信托	6,773,998.42	3.38
10	600153	建发股份	6,699,600.63	3.35
11	000069	华侨城A	6,532,806.37	3.26
12	002385	大北农	6,510,415.26	3.25
13	601633	长城汽车	6,491,977.00	3.24
14	000709	河钢股份	6,301,116.09	3.15
15	601006	大秦铁路	5,018,974.73	2.51
16	600585	海螺水泥	4,975,048.00	2.48
17	600188	兖州煤业	4,886,877.01	2.44
18	601318	中国平安	4,818,627.03	2.41
19	600021	上海电力	4,807,903.36	2.40

20	000060	中金岭南	4,792,816.92	2.39
21	601997	贵阳银行	4,761,222.73	2.38
22	600741	华域汽车	4,657,355.98	2.33
23	600060	海信电器	4,647,129.00	2.32
24	601390	中国中铁	4,552,232.16	2.27
25	000651	格力电器	4,533,311.91	2.26
26	000402	金融街	4,437,774.14	2.22
27	601225	陕西煤业	4,407,199.00	2.20
28	600309	万华化学	4,226,501.42	2.11
29	000750	国海证券	4,172,754.50	2.08

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	002146	荣盛发展	9,243,544.08	4.62
2	600816	安信信托	7,964,123.42	3.98
3	600688	上海石化	7,407,504.00	3.70
4	601633	长城汽车	6,452,943.60	3.22
5	600019	宝钢股份	6,248,295.49	3.12
6	000709	河钢股份	5,504,843.75	2.75
7	002195	二三四五	5,420,075.50	2.71
8	000338	潍柴动力	5,402,236.95	2.70
9	000002	万科A	4,861,588.90	2.43
10	000069	华侨城A	4,774,175.15	2.38
11	600021	上海电力	4,644,095.00	2.32
12	002714	牧原股份	4,098,473.00	2.05
13	600309	万华化学	4,028,109.00	2.01
14	600188	兖州煤业	4,000,216.39	2.00
15	601899	紫金矿业	3,857,765.00	1.93
16	600060	海信电器	3,757,837.00	1.88
17	600031	三一重工	3,595,474.37	1.80
18	601225	陕西煤业	3,221,009.00	1.61
19	000423	东阿阿胶	2,705,599.72	1.35
20	601928	凤凰传媒	2,611,611.93	1.30

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	359,200,411.62
卖出股票收入（成交）总额	176,776,973.63

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

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

注：无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

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：无。

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：无。

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：无。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：无。

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：无。

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：无。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：无。

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 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	45,213.92
2	应收证券清算款	124,275.31
3	应收股利	-
4	应收利息	2,329.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	171,818.34

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

§ 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
328	31,194.28	10,018,000.00	97.91%	213,723.47	2.09%

9.2 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	412.21	0.0040%

9.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0-10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 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
358	559,700.86	200,018,000.00	99.82%	354,907.72	0.18%

9.2 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	412.38	0.0002%

9.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	200,372,907.72
本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	1,265.55
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	190,142,449.80
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)	-
本报告期期末基金份额总额	10,231,723.47

§ 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	200,250,914.93
本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	189,237.41
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	67,244.62
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)	-
本报告期期末基金份额总额	200,372,907.72

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

自 2017 年 8 月 28 日至 2017 年 9 月 26 日本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,自 2017 年 9 月 27 日起,本基金由“华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金”转型为“华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金”,基金简称为“华泰柏瑞嘉利混合”,基金代码保持不变。关于转型的详细内容见我公司 2017 年 8 月 28 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以通讯方式召开华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。

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

2017 年 7 月 12 日,经公司股东会批准吴海云女士为公司监事会主席。

2017 年 9 月 1 日,中国建设银行发布公告,聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,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

本基金本报告期内未改变投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 41944.07 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

本报告期内,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无受稽查或处罚等情况。

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	
恒泰证券	1	-	-	17,138.86	4.91%	-
天风证券	1	-	-	5,875.48	1.68%	-
华泰证券	2	-	-	208,851.54	59.78%	-
华创证券	1	-	-	6,070.19	1.74%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	111,425.64	31.89%	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

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	
华西证券	1	-	-	11,650.77	2.36%	-
天风证券	1	-	-	12,721.71	2.58%	-
信达证券	1	-	-	13,636.20	2.77%	-
恒泰证券	1	-	-	4,211.26	0.85%	-
方正证券	1	-	-	22,523.56	4.57%	-
西藏东方财富	2	-	-	13,861.11	2.81%	-
万联证券	2	-	-	81,446.34	16.52%	-

华创证券	1	-	-	69,083.67	14.01%	-
宏信证券	2	-	-	35,760.35	7.25%	-
华泰证券	2	-	-	228,052.08	46.26%	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-

万联证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

11.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金实施增值税政策的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年12月30日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年12月26日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加上海好买基金销售有限公司转换业务费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年12月1日
4	华泰柏瑞嘉利 2017 年三季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年10月25日
5	关于华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金召开基金份额持有人大会的法律意见	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年9月28日
6	华泰柏瑞国企改革混合关于基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年9月28日
7	华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（正文）2017 年第 1 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年9月28日

8	华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（摘要）2017 年第 1 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 9 月 28 日
---	--	------------------	-----------------

11.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞国企改革混合关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 30 日
2	华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 29 日
3	华泰柏瑞国企改革混合关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 28 日
4	华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年报	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 26 日
5	华泰柏瑞国企改革 2017 年度半年报摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 26 日
6	华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第二季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 7 月 20 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加上海汇付金融服务有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 7 月 14 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加佳泓(北京)基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 7 月 14 日
9	华泰柏瑞基金关于执行《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 7 月 1 日
10	华泰柏瑞国企改革关于基金份额净值计算位数变更及修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 13 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任华泰柏瑞国企改革主题	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 2 日

	灵活配置混合型证券投资基金 基金经理的公告		
12	华泰柏瑞国企改革主题混合基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资、费率优惠以及限制大额申购（含转换转入、定期定额投资）等业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年2月24日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更旗下基金产品转换补差费计算方式的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年2月23日
14	华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年2月17日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017. 02. 16-2017. 12. 31	0.00	200,018,000.00	190,000,000.00	10,018,000.00	97.91%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费）021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2018 年 3 月 28 日