

华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金

2018 年半年度报告摘要

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 25 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。本半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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞睿利混合	
基金主代码	003555	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 23 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	198,915,199.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞睿利混合 A	华泰柏瑞睿利混合 C
下属分级基金的交易代码:	003555	003556
报告期末下属分级基金的份额总额	198,837,629.25 份	77,569.86 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效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	<p>（一）资产配置策略 本基金为混合型基金，以获取长期稳定收益为目标，在投资过程中实现风险和收益的优化平衡。根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的分析与比较，对股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整。（二）股票投资策略 本基金股票投资以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手，结合宏观经济走势及市场分析，根据市场估值与流动性优选个股，重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中的股票。（三）固定收益资产投资策略 本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。（四）权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。（五）资产支持证券投资策略 在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>（六）其他金融衍生工具投资策略</p> <p>在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，</p>

	本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。
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，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	曾麓燕
	联系电话	021-38601777	021-52629999-212040
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	015292@cib.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95561
传真		021-38601799	021-62535823

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金半年度报告备置地点	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华泰柏瑞睿利混合 A	华泰柏瑞睿利混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日-2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-136,998.48	-92.78
本期利润	-9,258,686.12	-2,562.75
加权平均基金份额本期利润	-0.0466	-0.0309
本期基金份额净值增长率	-4.41%	-4.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0099	0.0058
期末基金资产净值	200,813,686.10	78,017.68
期末基金份额净值	1.0099	1.0058

注：1、所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

华泰柏瑞睿利混合 A

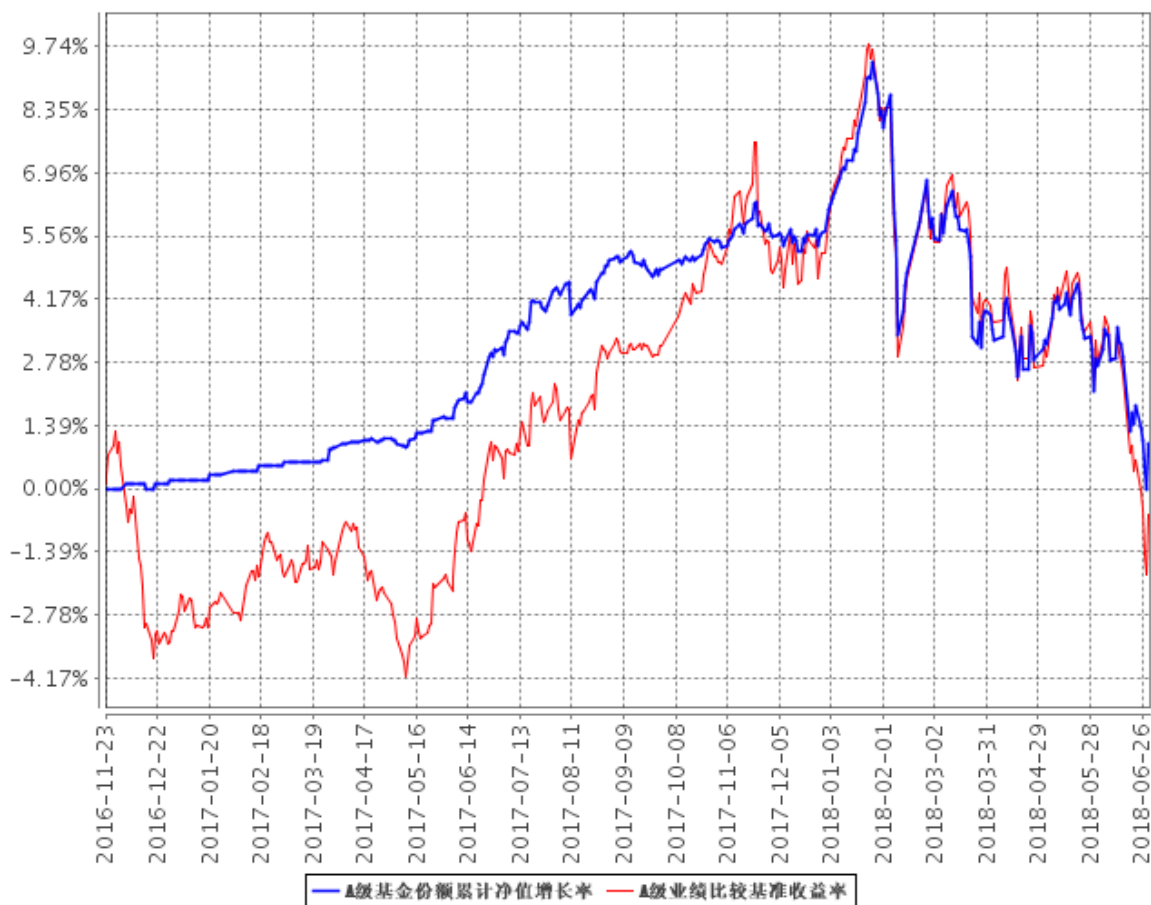
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.83%	0.54%	-3.70%	0.64%	1.87%	-0.10%
过去三个月	-2.81%	0.45%	-4.52%	0.57%	1.71%	-0.12%
过去六个月	-4.41%	0.49%	-5.47%	0.57%	1.06%	-0.08%
过去一年	-1.99%	0.36%	-1.46%	0.47%	-0.53%	-0.11%
自基金合同生效起至今	0.99%	0.29%	-0.57%	0.42%	1.56%	-0.13%

华泰柏瑞睿利混合 C

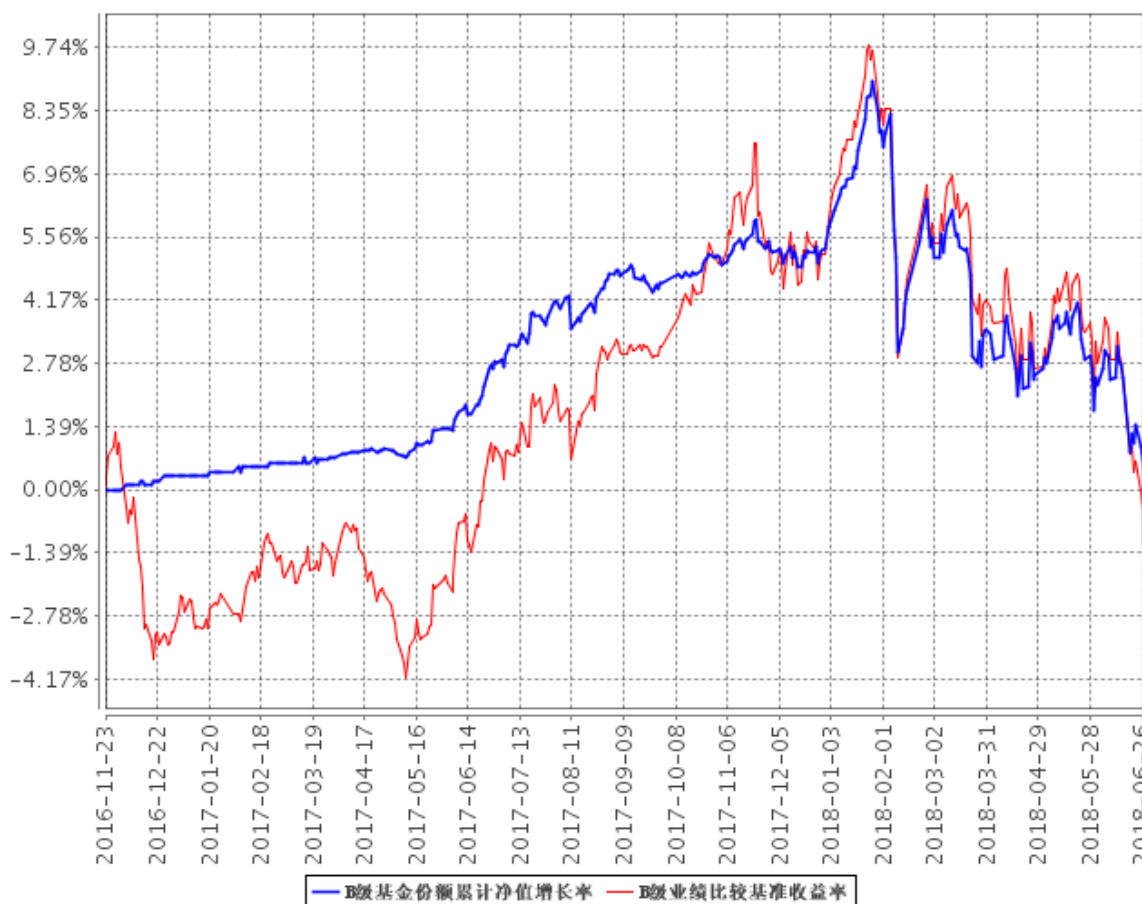
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.84%	0.54%	-3.70%	0.64%	1.86%	-0.10%
过去三个月	-2.84%	0.45%	-4.52%	0.57%	1.68%	-0.12%
过去六个月	-4.47%	0.49%	-5.47%	0.57%	1.00%	-0.08%
过去一年	-2.16%	0.36%	-1.46%	0.47%	-0.70%	-0.11%
自基金合同生效起至今	0.58%	0.29%	-0.57%	0.42%	1.15%	-0.13%

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

A级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



B级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 2016 年 11 月 23 日至 2018 年 6 月 30 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，截至报告期末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，本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%。

§ 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证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金。截至

2018 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 886.17 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		
盛豪	量化投资部副总监、本基金的基金经理	2017 年 4 月 13 日	-	10 年	<p>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 月至 2018 年 4 月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的基金经理。2017 年 4 月起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。2017 年 6 月起</p>

					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。
--	--	--	--	--	---

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。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

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。

4.3.2 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。

本报告期内本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，受外围市场调整、中兴事件、中美贸易战以及去杠杆等事件的影响，A 股市场回调压力增大。并且受大额质押爆仓、财务造假曝光等黑天鹅事件频发等因素影响，市场风险偏好降低，大市值因子本报告期表现较好。

本报告期内我们坚持了一贯的量化选股策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞睿利混合 A 基金份额净值为 1.0099 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.41%；截至本报告期末华泰柏瑞睿利混合 C 基金份额净值为 1.0058 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.47%；同期业绩比较基准收益率为-5.47%。

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 年下半年，我们认为经历了一月份以来，尤其是 6 月份的深度调整之后，在不发生系统风险的前提下，A 股市场具备了更好的投资价值。

下半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，境内面临金融去杠杆和监管趋严的影响。我们认为尽管有中美贸易摩擦升级、美股牛市终结等外部风险，但 A 股大概率可以走出独立行情，经过上半年的下跌以后，在不发生系统性风险的情况下，股票市场向下风险应该比较有限了。站在当前的时点，我们对后市比较乐观，认为 A 股股票是当前国内大类资产中风险收益特征较好的资产。

本基金还是坚持利用量化选股策略，并注意个股风险的控制。

4.6 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。

4.7 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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 25%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 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

本托管人依据《华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》与《华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》，自 2016 年 11 月 23 日起托管华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		34,446,410.37	87,983,459.35
结算备付金		7,594,018.39	2,991,506.37
存出保证金		26,973.37	4,394.34
交易性金融资产		84,775,454.74	59,522,138.38
其中：股票投资		74,775,454.74	49,569,076.58
基金投资		-	-
债券投资		10,000,000.00	9,953,061.80
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		74,000,000.00	130,000,000.00
应收证券清算款		500,500.72	-
应收利息		438,412.21	265,383.62

应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		201,781,769.80	280,766,882.06
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		479,605.13	70,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		100,412.10	106,983.13
应付托管费		25,103.05	26,745.78
应付销售服务费		12.93	21.11
应付交易费用		106,414.32	47,159.99
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		178,518.49	366,000.00
负债合计		890,066.02	70,546,910.01
所有者权益:			
实收基金		198,915,199.11	198,977,505.97
未分配利润		1,976,504.67	11,242,466.08
所有者权益合计		200,891,703.78	210,219,972.05
负债和所有者权益总计		201,781,769.80	280,766,882.06

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，华泰柏瑞睿利混合 A 基金份额净值 1.0099 元，基金份额总额 198,837,629.25 份；华泰柏瑞睿利混合 C 基金份额净值 1.0058 元，基金份额总额 77,569.86 份。华泰柏瑞睿利混合份额总额合计为 198,915,199.11 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
一、收入		-7,970,515.11	6,899,487.20

1.利息收入		1,591,004.30	3,289,555.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	692,879.67	807,296.71
债券利息收入		175,049.59	774,562.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		723,075.04	1,707,696.76
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-437,396.81	167,523.29
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,350,537.58	-116,284.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	153.72	19,003.84
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	264,804.18
股利收益	6.4.7.16	912,987.05	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-9,124,157.61	2,946,271.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	35.01	496,136.81
减：二、费用		1,290,733.76	1,105,837.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	619,334.70	651,697.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	154,833.70	156,860.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	85.66	370.59
4. 交易费用	6.4.7.19	323,556.21	50,956.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	192,923.49	245,953.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,261,248.87	5,793,649.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,261,248.87	5,793,649.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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)	198,977,505.97	11,242,466.08	210,219,972.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-9,261,248.87	-9,261,248.87
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)	-62,306.86	-4,712.54	-67,019.40
其中: 1.基金申购款	9,295.65	391.41	9,687.06
2.基金赎回款	-71,602.51	-5,103.95	-76,706.46
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)	198,915,199.11	1,976,504.67	200,891,703.78
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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)	200,900,898.20	381,475.40	201,282,373.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	5,793,649.46	5,793,649.46
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)	-1,628,441.80	-113,914.48	-1,742,356.28
其中: 1.基金申购款	198,962,089.14	1,193,481.39	200,155,570.53
2.基金赎回款	-200,590,530.94	-1,307,395.87	-201,897,926.81
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)	199,272,456.40	6,061,210.38	205,333,666.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞睿利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]1827号《关于核准华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,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201,277,477.07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(2016)第1534号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年11月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为201,315,465.44份基金份额,其中认购资金利息折合37,988.37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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞睿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/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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%;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(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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 8 月 25 日批准报出。

6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞睿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 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 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》、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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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。

(e) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人
兴业银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	225,745,874.09	100.00%	40,557,074.08	100.00%

6.4.8.1.2 权证交易

注：无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30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	208,519.31	100.00%	106,289.32	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	37,473.25	100.00%	-	-

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	619,334.70	651,697.00
其中：支付销售机构的客户维护费	77.18	533.14

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的适用年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times \text{适用年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2016 年 11 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 1 月 22 日，管理人报酬的适用年费率为 0.8%，自 2017 年 1 月 23 日起适用年费率为 0.6%。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	154,833.70	156,860.47

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的适用年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times \text{适用年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支取。

2016 年 11 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 1 月 22 日，C 类基金份额的销售服务费的适用年费率为 0.5%，自 2017 年 1 月 23 日起适用年费率为 0.2%。

本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期和上年同期未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.8.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	34,446,410.37	624,436.22	99,886,127.24	261,414.33

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.9 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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
300118	东方日升	2018年5月7日	重大事项	10.80	2018年8月7日	9.63	127,800	1,577,158.00	1,380,240.00	-
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大事项	7.47	2018年8月20日	7.25	100,700	789,416.02	752,229.00	-
601727	上海电气	2018年6月6日	重大事项	6.34	2018年8月7日	5.71	71,700	422,028.00	454,578.00	-
002668	奥马电器	2018年6月15日	重大事项	20.10	-	-	20,900	452,051.00	420,090.00	-
002102	冠福股份	2018年6月1日	重大事项	4.07	-	-	100,600	420,073.06	409,442.00	-
000415	渤海金控	2018年1月17日	重大事项	5.21	2018年7月17日	5.26	40,200	266,028.32	209,442.00	-
000666	经纬纺机	2018年3月12日	重大事项	18.08	-	-	5,800	124,331.00	104,864.00	-
000825	太钢不锈	2018年4月16日	重大事项	6.00	-	-	9,500	47,363.00	57,000.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	74,775,454.74	37.06
	其中：股票	74,775,454.74	37.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,000,000.00	4.96
	其中：债券	10,000,000.00	4.96
	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	74,000,000.00	36.67
	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	42,040,428.76	20.83
8	其他各项资产	965,886.30	0.48
9	合计	201,781,769.80	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	30,980.00	0.02
B	采矿业	648,282.40	0.32
C	制造业	37,221,476.02	18.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,483,444.00	0.74
E	建筑业	3,542,801.00	1.76
F	批发和零售业	2,055,476.80	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	1,775,823.00	0.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,472,084.00	1.73
J	金融业	19,679,676.07	9.80
K	房地产业	3,129,866.00	1.56
L	租赁和商务服务业	751,950.45	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	776,710.00	0.39
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	206,885.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	74,775,454.74	37.22

7.2.2 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投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	-------	------	---------

					比例 (%)
1	601318	中国平安	75,794	4,440,012.52	2.21
2	601288	农业银行	520,500	1,790,520.00	0.89
3	601006	大秦铁路	216,300	1,775,823.00	0.88
4	000651	格力电器	33,100	1,560,665.00	0.78
5	000338	潍柴动力	170,200	1,489,250.00	0.74
6	300118	东方日升	127,800	1,380,240.00	0.69
7	002373	千方科技	101,700	1,327,185.00	0.66
8	601800	中国交建	116,200	1,323,518.00	0.66
9	601328	交通银行	225,000	1,291,500.00	0.64
10	601398	工商银行	236,500	1,258,180.00	0.63

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	3,420,075.08	1.63
2	600050	中国联通	2,564,325.00	1.22
3	600519	贵州茅台	2,003,032.00	0.95
4	601800	中国交建	1,984,811.00	0.94
5	601288	农业银行	1,878,704.53	0.89
6	601988	中国银行	1,774,981.00	0.84
7	600516	方大炭素	1,762,741.00	0.84
8	000651	格力电器	1,706,097.00	0.81
9	300118	东方日升	1,555,404.00	0.74
10	002373	千方科技	1,525,703.95	0.73
11	002626	金达威	1,502,942.00	0.71
12	600566	济川药业	1,502,012.00	0.71
13	601788	光大证券	1,479,025.43	0.70
14	601398	工商银行	1,445,534.00	0.69
15	000858	五粮液	1,435,517.00	0.68
16	600276	恒瑞医药	1,307,096.00	0.62

17	600030	中信证券	1,258,292.00	0.60
18	601328	交通银行	1,246,805.00	0.59
19	600282	南钢股份	1,221,524.00	0.58
20	002304	洋河股份	1,190,998.00	0.57

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	2,991,246.88	1.42
2	600030	中信证券	2,646,124.00	1.26
3	601288	农业银行	1,843,905.00	0.88
4	600050	中国联通	1,744,403.92	0.83
5	600029	南方航空	1,654,517.00	0.79
6	600566	济川药业	1,603,682.00	0.76
7	600028	中国石化	1,602,375.00	0.76
8	601318	中国平安	1,564,755.00	0.74
9	601988	中国银行	1,445,572.00	0.69
10	002024	苏宁易购	1,436,499.00	0.68
11	002626	金达威	1,410,958.00	0.67
12	601111	中国国航	1,389,197.72	0.66
13	000651	格力电器	1,386,334.00	0.66
14	600036	招商银行	1,355,689.00	0.64
15	601225	陕西煤业	1,343,834.98	0.64
16	600383	金地集团	1,266,749.00	0.60
17	600900	长江电力	1,181,371.00	0.56
18	300219	鸿利智汇	1,104,232.20	0.53
19	601377	兴业证券	1,084,189.79	0.52
20	601601	中国太保	1,068,463.00	0.51

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

7.4.3 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	130,737,442.82
卖出股票收入（成交）总额	95,008,431.27

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,000,000.00	4.98
	其中：政策性金融债	10,000,000.00	4.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,000,000.00	4.98

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	170207	17 国开 07	100,000	10,000,000.00	4.98

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

7.12.3 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	26,973.37
2	应收证券清算款	500,500.72

3	应收股利	-
4	应收利息	438,412.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	965,886.30

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期内的可转换债券。

7.12.5 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	300118	东方日升	1,380,240.00	0.69	停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
华泰柏瑞睿利混合 A	134	1,483,862.90	198,807,157.06	99.98%	30,472.19	0.02%
华泰柏瑞睿利混合	81	957.65	0.00	0.00%	77,569.86	100.00%

C						
合计	215	925,186.97	198,807,157.06	99.95%	108,042.05	0.05%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华泰柏瑞睿利混合 A	363.27	0.0002%
	华泰柏瑞睿利混合 C	38.55	0.0497%
	合计	401.82	0.0002%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	华泰柏瑞睿利混合 A	0~10
	华泰柏瑞睿利混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞睿利混合 A	0
	华泰柏瑞睿利混合 C	0
	合计	0

注：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份额总量的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

本基金基金经理未持有本开放式基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞睿利混合 A	华泰柏瑞睿利混合 C
基金合同生效日（2016 年 11 月 23 日）基金	200,313,141.14	1,002,324.30

份额总额		
本报告期期初基金份额总额	198,860,382.88	117,123.09
本报告期基金总申购份额	1,048.81	8,246.84
减:本报告期基金总赎回份额	23,802.44	47,800.07
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	198,837,629.25	77,569.86

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
华泰证券	2	225,745,874.09	100.00%	208,519.31	100.00%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

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，并能为基金提供全面的信息服。
- 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。

10.7.2 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
华泰证券	1,154.20	100.00%	871,000,000.00	100.00%	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20180101-20180630	198,807,157.06	0.00	0.00	198,807,157.06	99.95%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2018 年 8 月 25 日