

华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

2018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：中国银行股份有限公司

送出日期：2019年3月27日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月26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2018年1月1日起至2018年12月31日止。

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞价值增长混合
基金主代码	460005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	227,530,764.59份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于市场估值相对较低、基本面良好、能够为股东持续创造价值的公司，重点关注其中基本面有良性变化、市场认同度逐步提高的优质个股，在充分控制投资组合风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	基于对宏观经济和投资环境的分析和预测，全面评估证券市场各大类资产的中长期预期风险收益率，确定基金资产在股票、债券和现金及其他资产之间的配置比例，适度控制系统性风险。 主要通过积极主动地精选为股东持续创造价值的股票来获取超额收益。重点投资于基本面趋势良好或出现良性转折、价格相对低估、基本面趋势认同度逐步或加速提高的优质股票，辅以适度的行业配置调整来优化股票的选择和配置的权重。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	较高风险、较高收益

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§ 3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-80,239,603.75	-11,312,733.52	-73,765,387.03
本期利润	-117,274,345.10	23,466,995.28	-138,989,759.96
加权平均基金份额本期利润	-0.5275	0.0778	-0.3434
本期基金份额净值增长率	-23.19%	2.83%	-10.88%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.6316	1.1186	1.2774
期末基金资产净值	410,561,199.17	581,923,289.74	887,078,084.40
期末基金份额净值	1.8044	2.4854	2.5654

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

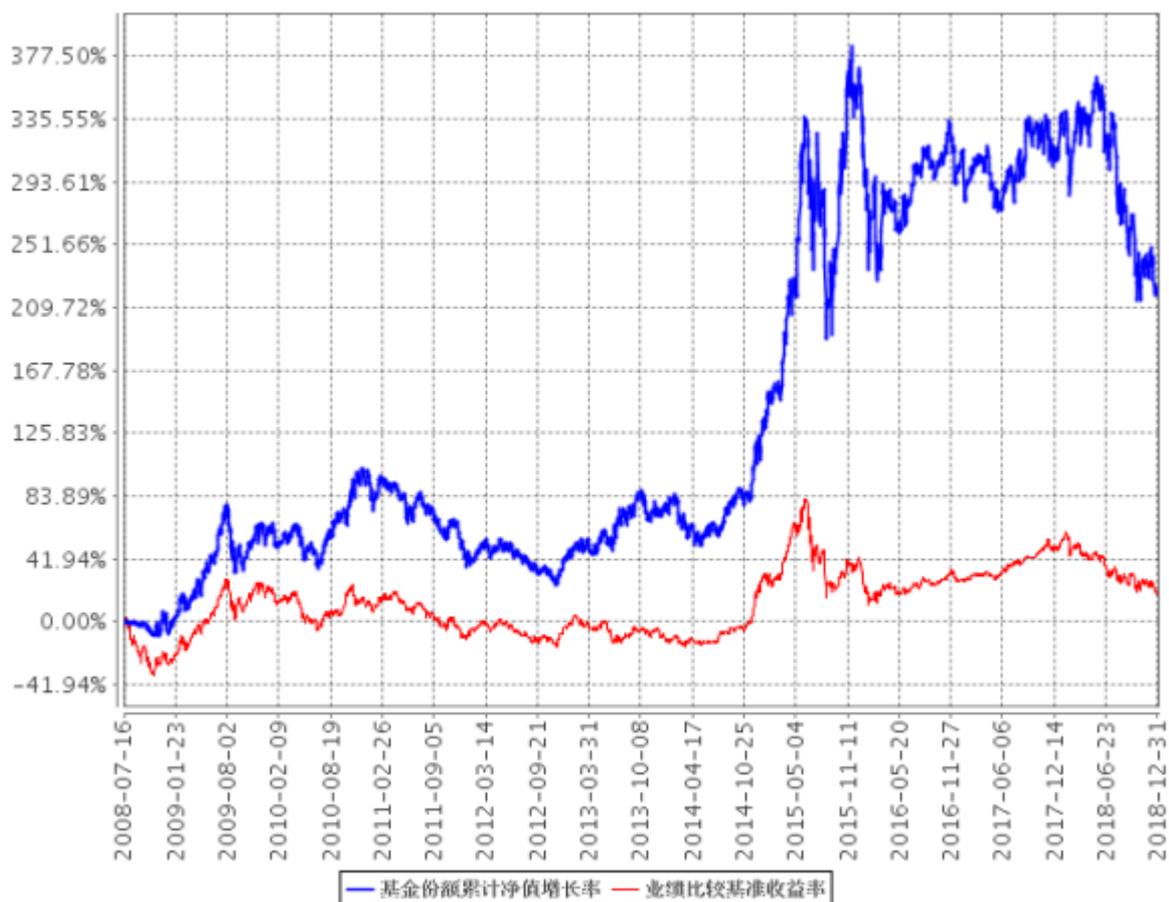
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-14.14%	1.94%	-9.65%	1.31%	-4.49%	0.63%
过去六个月	-24.90%	1.79%	-10.90%	1.20%	-14.00%	0.59%
过去一年	-23.19%	1.68%	-19.66%	1.07%	-3.53%	0.61%
过去三年	-29.61%	1.55%	-13.44%	0.94%	-16.17%	0.61%
过去五年	82.37%	1.84%	30.72%	1.23%	51.65%	0.61%
自基金合同生效起至今	219.12%	1.65%	19.70%	1.31%	199.42%	0.34%

注：本基金的业绩基准由沪深300指数和上证国债指数按照80%与20%之比构建，并每日进行再平衡。

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

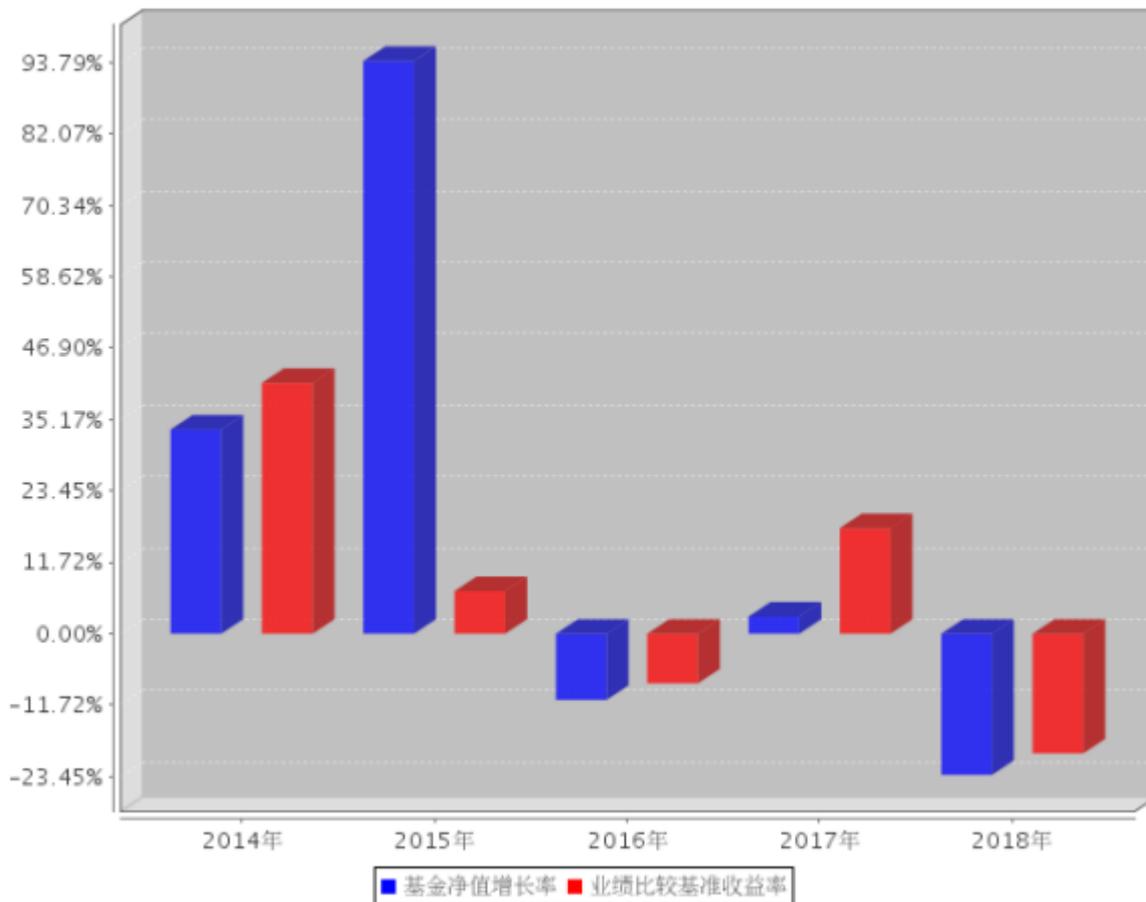
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为2008年7月16日至2018年12月31日。

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

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对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2018	1.3000	15,358,021.45	12,680,507.98	28,038,529.43	
2017	1.5000	29,371,097.90	18,478,625.84	47,849,723.74	
2016	1.6300	42,850,645.91	17,548,045.24	60,398,691.15	
合计	4.4300	87,579,765.26	48,707,179.06	136,286,944.32	

§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、华泰柏瑞价值精选30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、华泰柏瑞现代服务业混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金。

截至2018年12月31日，公司基金管理规模为980.05亿元。

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		
方纬	本基金的基金经理	2014年8月22日	-	15年	经济学硕士。2003年9月至2005年1月任上海金信研究所研究员；2005年1月至2007年2月任万家基金管理有限公司高级研究员；2007年2月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2014年8月起任华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金的基金经理。2015年4月至2016年8月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月起任华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月至2016年8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。2015年8月至2016年11月任华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年3月至2017年6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月起任华泰柏瑞多策略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，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，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3次，系因股票配置比例调整，不存在利益输送行为。

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

2018年，沪深300指数下跌25.31%，中证500指数下跌33.32%，创业板指数下跌28.65%，本基金下跌23.19%。

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1.8044元；本报告期基金份额净值增长率为-23.19%，业绩比较基准收益率为-19.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年，“贸易战”继续发酵，经济衰退兑现，货币环境被动宽松，A股处于下跌趋势中。从估值上看，A股估值水平已经处于历史低位区域。未来，价值增长基金将继续坚守精选个股的投资策略，争取获得超额收益。

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、金融工程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，基金收益分配每年至多6次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的10%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本报告期内2018年2月7日本基金进行收益分配，每份额分红0.13元。

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

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”）在华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第21813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	华泰柏瑞价值增长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价值增长混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞价值增长基金”)的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</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价值增长基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度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价值增长基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华泰柏瑞价值增长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价值增长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价值增长基金、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价值增长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价值增长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价值增长基金不能持续经营。</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	2019年3月26日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	25,797,646.29	38,235,732.69
结算备付金	1,021,705.34	3,830,482.06
存出保证金	141,080.41	264,397.75
交易性金融资产	385,036,597.51	541,842,178.89
其中：股票投资	384,733,721.51	540,757,978.89
基金投资	-	-
债券投资	302,876.00	1,084,200.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	5,598,449.46
应收利息	11,363.06	10,784.20
应收股利	-	-
应收申购款	309,734.60	393,887.72
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	412,318,127.21	590,175,912.77
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31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	-	3,731,696.71
应付赎回款	135,044.01	1,447,692.97
应付管理人报酬	540,882.83	746,476.39
应付托管费	90,147.15	124,412.70
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	630,725.45	1,819,975.02
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	360,128.60	382,369.24
负债合计	1,756,928.04	8,252,623.03

所有者权益：		
实收基金	227,530,764.59	234,136,405.95
未分配利润	183,030,434.58	347,786,883.79
所有者权益合计	410,561,199.17	581,923,289.74
负债和所有者权益总计	412,318,127.21	590,175,912.77

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额净值1.8044元，基金份额总额227,530,764.59份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
一、收入	-100,608,978.02	54,865,667.11
1. 利息收入	254,702.62	462,319.12
其中：存款利息收入	249,130.38	462,262.09
债券利息收入	5,572.24	57.03
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）	-63,941,274.51	19,234,016.41
其中：股票投资收益	-68,144,242.22	13,602,662.97
基金投资收益	-	-
债券投资收益	160,079.65	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	4,042,888.06	5,631,353.44
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-37,034,741.35	34,779,728.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	112,335.22	389,602.78
减：二、费用	16,665,367.08	31,398,671.83
1. 管理人报酬	7,540,626.99	11,186,772.74
2. 托管费	1,256,771.12	1,864,462.00
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	7,480,438.49	17,932,729.81
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	0.85	-
7. 其他费用	387,529.63	414,707.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-117,274,345.10	23,466,995.28
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填	-117,274,345.10	23,466,995.28

列)		
----	--	--

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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）	234,136,405.95	347,786,883.79	581,923,289.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-117,274,345.10	-117,274,345.10
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）	-6,605,641.36	-19,443,574.68	-26,049,216.04
其中：1. 基金申购款	64,678,988.61	82,613,760.75	147,292,749.36
2. 基金赎回款	-71,284,629.97	-102,057,335.43	-173,341,965.40
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）	-	-28,038,529.43	-28,038,529.43
五、期末所有者权益（基金净值）	227,530,764.59	183,030,434.58	410,561,199.17
项目	上年度可比期间 2017年1月1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）	345,784,894.93	541,293,189.47	887,078,084.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,466,995.28	23,466,995.28
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）	-111,648,488.98	-169,123,577.22	-280,772,066.20
其中：1. 基金申购款	83,068,980.61	121,916,306.01	204,985,286.62
2. 基金赎回款	-194,717,469.59	-291,039,883.23	-485,757,352.82
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）	-	-47,849,723.74	-47,849,723.74
五、期末所有者权益（基金净值）	234,136,405.95	347,786,883.79	581,923,289.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
韩勇	房伟力	赵景云
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金(原名为友邦华泰价值增长股票型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第543号《关于核准友邦华泰价值增长股票型证券投资基金募集的批复》核准,由友邦华泰基金管理有限公司(已自2010年4月30日起更名为华泰柏瑞基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《友邦华泰价值增长股票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406,224,705.76元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第109号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《友邦华泰价值增长股票型证券投资基金基金合同》于2008年7月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为406,303,580.25份基金份额,其中认购资金利息折合78,874.49份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金于2015年8月6日公告后更名为华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞价值增长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,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票资产占基金资产的60%-95%;现金、债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%,其中,基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的3%,基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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×80%+上证国债指数×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2019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》、《华泰柏瑞价值增长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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

本基金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一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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：

(1) 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。

(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。

(5) 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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司(“华泰柏瑞基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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
PineBridgeInvestmentLLC	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、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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
华泰证券	132,775,094.59	2.69%	3,418,380,068.73	29.02%

7.4.8.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元未进行权证交易。

7.4.8.1.3 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	121,092.81	2.66%	37,508.21	5.95%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1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	3,133,107.97	28.94%	-	-

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。权证交易不计佣金。

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,540,626.99	11,186,772.74
其中：支付销售机构的客户维护费	1,395,751.42	2,957,010.56

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1.50%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 X 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,256,771.12	1,864,462.00

注：支付基金托管人中国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。

7.4.8.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
----	----	----------------------------------

	2018年1月1日至2018年12月31日	
基金合同生效日（2008年7月16日）持有的基金份额	10,007,525.00	10,007,525.00
期初持有的基金份额	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

注：本报告期内，基金管理人未投资本基金。

7.4.8.4.2 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：本报告期及上年度，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	25,797,646.29	212,693.60	38,235,732.69	363,963.26

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上一年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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/增发的流通受限股票。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额0元，无债券作为质押。

7.4.9.1.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末交易所市场债券正回购余额为零。

7.4.10 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2018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384,733,721.51元，属于第二层次的余额为302,876.00元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次540,641,793.89元，第二层次1,200,385.00元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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2018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(2017年12月31日：同)。

(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

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	384,733,721.51	93.31
	其中：股票	384,733,721.51	93.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	302,876.00	0.07
	其中：债券	302,876.00	0.07
	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	26,819,351.63	6.50
8	其他各项资产	462,178.07	0.11
9	合计	412,318,127.21	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	8,740,525.00	2.13
B	采矿业	-	-
C	制造业	289,212,785.44	70.44
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	1,597,628.10	0.39
H	住宿和餐饮业	3,644,051.04	0.89
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,489,321.31	12.78
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,491,845.12	2.56
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	7,385,388.50	1.80
R	文化、体育和娱乐业	11,172,177.00	2.72
S	综合	-	-
	合计	384,733,721.51	93.71

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	600845	宝信软件	799,625	16,672,181.25	4.06
2	000661	长春高新	92,600	16,205,000.00	3.95
3	600588	用友网络	736,520	15,687,876.00	3.82
4	300595	欧普康视	352,900	13,671,346.00	3.33
5	600438	通威股份	1,637,500	13,558,500.00	3.30
6	002821	凯莱英	180,000	12,213,000.00	2.97
7	300750	宁德时代	134,100	9,896,580.00	2.41
8	002714	牧原股份	276,700	7,955,125.00	1.94
9	601012	隆基股份	425,900	7,427,696.00	1.81
10	600196	复星医药	299,901	6,978,696.27	1.70

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。

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	600588	用友网络	94,793,749.78	16.29
2	002007	华兰生物	45,925,719.37	7.89
3	300059	东方财富	41,076,275.32	7.06
4	300253	卫宁健康	39,038,122.58	6.71
5	300142	沃森生物	31,573,809.36	5.43
6	600754	锦江股份	31,276,573.00	5.37
7	600760	中航沈飞	29,400,776.68	5.05
8	600845	宝信软件	29,350,617.28	5.04
9	300122	智飞生物	28,259,449.84	4.86
10	603690	至纯科技	26,631,924.00	4.58
11	603986	兆易创新	25,498,364.80	4.38
12	000661	长春高新	24,580,180.00	4.22

13	600271	航天信息	23,578,241.35	4.05
14	002027	分众传媒	23,529,716.73	4.04
15	600438	通威股份	22,698,584.60	3.90
16	002368	太极股份	21,773,642.92	3.74
17	300595	欧普康视	20,175,649.29	3.47
18	000066	中国长城	20,140,580.13	3.46
19	002410	广联达	20,067,826.75	3.45
20	600703	三安光电	19,648,044.00	3.38
21	002341	新纶科技	19,293,490.00	3.32
22	600276	恒瑞医药	19,130,997.60	3.29
23	600887	伊利股份	18,304,400.78	3.15
24	601111	中国国航	16,834,145.00	2.89
25	000063	中兴通讯	16,642,881.00	2.86
26	002672	东江环保	15,520,133.91	2.67
27	300009	安科生物	15,372,573.54	2.64
28	601012	隆基股份	15,261,753.68	2.62
29	002353	杰瑞股份	15,155,045.78	2.60
30	002508	老板电器	14,805,534.38	2.54
31	300750	宁德时代	14,747,569.05	2.53
32	300357	我武生物	14,412,887.41	2.48
33	000503	国新健康	14,207,043.00	2.44
34	002456	欧菲科技	14,106,471.00	2.42
35	002714	牧原股份	14,072,328.60	2.42
36	002821	凯莱英	13,307,588.00	2.29
37	300450	先导智能	13,182,628.81	2.27
38	002422	科伦药业	13,013,112.63	2.24
39	000799	酒鬼酒	12,678,221.00	2.18
40	600176	中国巨石	12,636,579.64	2.17
41	002078	太阳纸业	12,575,830.60	2.16
42	000786	北新建材	12,418,021.30	2.13
43	300618	寒锐钴业	12,398,832.05	2.13
44	000528	柳工	12,302,052.41	2.11
45	000568	泸州老窖	12,213,787.00	2.10
46	600160	巨化股份	12,148,016.09	2.09
47	002912	中新赛克	12,090,405.31	2.08
48	002680	ST长生	12,033,599.41	2.07

49	600519	贵州茅台	12,031,636.91	2.07
50	603816	顾家家居	12,019,300.64	2.07
51	002466	天齐锂业	11,996,373.07	2.06
52	600038	中直股份	11,741,935.00	2.02
53	603833	欧派家居	11,711,441.52	2.01

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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	600588	用友网络	79,004,657.83	13.58
2	300142	沃森生物	60,434,570.36	10.39
3	300122	智飞生物	47,224,636.81	8.12
4	002007	华兰生物	45,204,938.39	7.77
5	300059	东方财富	43,039,065.92	7.40
6	002044	美年健康	40,736,160.75	7.00
7	600703	三安光电	38,880,238.50	6.68
8	600754	锦江股份	37,238,724.92	6.40
9	300253	卫宁健康	33,419,386.24	5.74
10	000786	北新建材	26,158,183.43	4.50
11	603690	至纯科技	22,946,868.11	3.94
12	600760	中航沈飞	22,428,533.56	3.85
13	002341	新纶科技	22,348,748.60	3.84
14	600585	海螺水泥	21,541,893.19	3.70
15	002410	广联达	20,856,979.23	3.58
16	603659	璞泰来	20,752,304.15	3.57
17	601233	桐昆股份	20,269,867.79	3.48
18	600271	航天信息	20,093,665.66	3.45
19	603986	兆易创新	19,893,026.21	3.42
20	002368	太极股份	19,833,234.06	3.41
21	000066	中国长城	18,449,981.51	3.17
22	600276	恒瑞医药	17,307,671.91	2.97
23	000703	恒逸石化	17,257,819.49	2.97
24	002648	卫星石化	17,071,137.25	2.93
25	600521	华海药业	17,008,250.92	2.92
26	600426	华鲁恒升	16,629,538.85	2.86
27	000503	国新健康	16,393,258.34	2.82
28	600887	伊利股份	16,375,610.00	2.81

29	601111	中国国航	16,357,421.89	2.81
30	601318	中国平安	16,133,546.00	2.77
31	002027	分众传媒	16,073,377.97	2.76
32	002680	ST长生	16,066,983.14	2.76
33	603308	应流股份	15,834,037.28	2.72
34	000002	万科A	15,684,651.26	2.70
35	600867	通化东宝	15,616,117.72	2.68
36	000932	华菱钢铁	15,274,934.43	2.62
37	002353	杰瑞股份	15,188,575.55	2.61
38	600031	三一重工	14,978,728.88	2.57
39	603799	华友钴业	14,918,884.81	2.56
40	300357	我武生物	14,544,601.57	2.50
41	000681	视觉中国	14,089,216.25	2.42
42	002672	东江环保	13,945,000.20	2.40
43	601155	新城控股	13,434,549.30	2.31
44	000528	柳工	12,869,590.60	2.21
45	002456	欧菲科技	12,258,869.31	2.11
46	600019	宝钢股份	12,140,756.80	2.09
47	603658	安图生物	12,029,531.25	2.07
48	600782	新钢股份	12,013,724.60	2.06
49	000858	五粮液	11,909,780.59	2.05
50	000717	韶钢松山	11,703,521.59	2.01

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,446,996,455.42
卖出股票收入（成交）总额	2,497,825,694.23

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	302,876.00	0.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	302,876.00	0.07

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019517	15国债17	2,900	302,876.00	0.07

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	141,080.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,363.06
5	应收申购款	309,734.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	462,178.07

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有的前十名股票中未存在流通受限。

§9 基金份额持有人信息

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
34,028	6,686.57	224,253.79	0.10%	227,306,510.80	99.90%

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	247,389.79	0.1087%

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、基金投资和研究人员持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年7月16日）基金份额总额	406,303,580.25
本报告期期初基金份额总额	234,136,405.95
本报告期期间基金总申购份额	64,678,988.61
减:本报告期期间基金总赎回份额	71,284,629.97
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	227,530,764.59

§ 11重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

2018年8月20日，公司任命李晓西先生为公司副总经理，李晓西先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试，其任命已在中国证券投资基金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

报告期内，2018年8月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金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60,000.00元人民币，该事务所已向本基金提供了11年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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		
		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	
渤海证券	3	1,660,890,338.74	33.60%	1,523,985.40	33.53%	-
广发证券	2	1,024,210,041.84	20.72%	934,018.71	20.55%	-
兴业证券	1	763,270,777.96	15.44%	710,834.21	15.64%	-
银河证券	1	698,128,583.26	14.12%	650,161.37	14.31%	-
万联证券	2	338,150,607.86	6.84%	308,157.02	6.78%	-
中投证券	1	278,912,267.97	5.64%	254,173.74	5.59%	-

华泰证券	3	132,775,094.59	2.69%	121,092.81	2.66%	-
联讯证券	2	44,865,334.28	0.91%	40,885.81	0.90%	-
东方证券	1	1,379,990.00	0.03%	1,257.64	0.03%	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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要，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，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
渤海证券	40,195.27	2.40%	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	251,172.95	15.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	1,351,944.23	80.73%	-	-	-	-
中投证券	31,427.90	1.88%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

§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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 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

2019年3月27日