华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金2019年半年度报告

2019-06-30

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

报告送出日期：2019-08-29

目录全部展开 目录全部收拢

- 重要提示
- 基金简介
  - 基金基本情况
  - 基金产品说明
  - 基金管理人和基金托管人
  - 信息披露方式
  - 其他相关资料
- 主要财务指标和基金净值表现
  - 主要会计数据和财务指标
  - 基金净值表现
    - 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
    - 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
- 管理人报告
  - 基金管理人及基金经理情况
    - 基金管理人及其管理基金的经验
    - 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介
  - 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
  - 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
    - 公平交易制度的执行情况
    - 异常交易行为的专项说明

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

项目	数值
基金名称	华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞富利混合
场内简称	
基金主代码	004475
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017-09-12
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	448,649,803.29
基金合同存续期	不定期

基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，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。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。根据个股的估值水平优选个股，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。
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。

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	tianqing1.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

信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层及托管人住所

其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

报告期	报告期(2019-01-01 至 2019-06-30)
本期已实现收益	-2,607,105.53
本期利润	89,837,180.51
加权平均基金份额本期利润	0.1901
本期加权平均净值利润率	22.16 %
本期基金份额净值增长率	25.18 %
报告期末	**报告期末(2019-06-30)**
期末可供分配利润	-47,819,368.72
期末可供分配基金份额利润	-0.1066
期末基金资产净值	400,830,434.57
期末基金份额净值	0.8934
报告期末	**报告期末(2019-06-30)**
基金份额累计净值增长率	-10.66 %

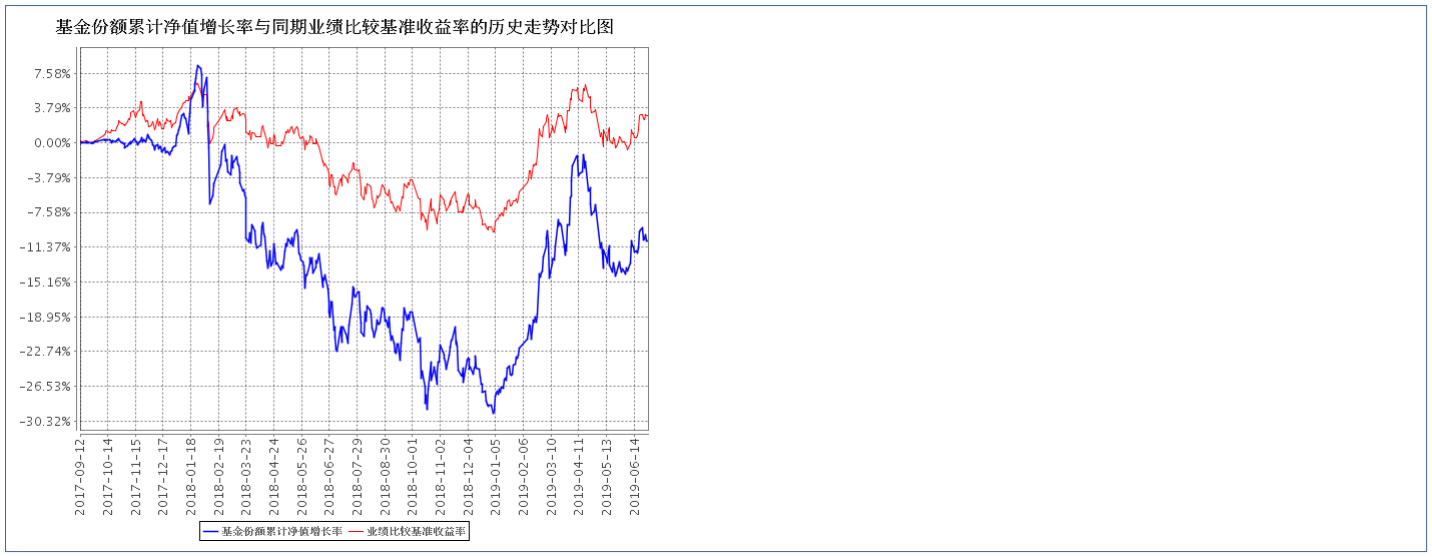
注：注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

基金净值表现

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	净值增长率①	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	3.61 %	0.94 %	2.84 %	0.57 %	0.77 %	0.37 %
过去三个月	-1.92 %	1.37 %	-0.54 %	0.75 %	-1.38 %	0.62 %
过去六个月	25.18 %	1.41 %	13.28 %	0.77 %	11.90 %	0.64 %
过去一年	8.15 %	1.50 %	6.62 %	0.76 %	1.53 %	0.74 %
自基金合同生效起至今	-10.66 %	1.33 %	2.96 %	0.66 %	-13.62 %	0.67 %

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



注：、图示日期为2017年9月12日至2019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投资范围中规定的比例。自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

基金管理人及基金经理情况

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2019年6月30日，公司基金管理规模为1030.82亿元。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨景涵	本基金的基金经理	2017-09-12	-	15年	中山大学经济学硕士。特许金融分析师（CFA），金融风险管理师（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月至2018年4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月至2018年11月任华泰柏瑞爱利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。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月至2018年4月任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起任华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月至2019年3月任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月至2018年3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的基金经理。2017年2月至2018年3月任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月至2018年10月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。2018年3月起任华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年6月起任华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金的基金经理。

注：注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

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。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。

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。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

本基金2019年上半年,采取进取的策略,保持权益资产的进取仓位,以权益收益为主要获利手段,业绩表现较佳。

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0.8934元；本报告期基金份额净值增长率为25.18%，业绩比较基准收益率为13.28%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年下半年,宏观经济预期将持续承受下行压力，但政策亦将保持定力，不会轻易通过刺激政策提振经济，而会以改革开放为手段促进经济结构调整。随着对中美关系的重新定义、国内经济韧性的重新认识、上市公司业绩增长质量和数量的重新理解以及市场结构的重新调整，股票市场有望逐步修复前期较为不切实际的一些预期，包括一些行业的过度乐观预期和另一些行业的过度悲观预期，投资者将会认识到过度追捧某些资产和过度看空某些资产都是充满风险的，尤其是当这些看多看空的观点和短期政策联系过于紧密，趋势过分集中，投资资产过度拥挤的时候，就带来了市场结构性的投资机会。我们认为对于真正的专业投资者来说，当下是比较好的选股获得超额收益的时机，部分原因是因为过去2-3年持续累积的不平衡市场结构，部分因为一些行业持续受到与基本面走势不相称的压制。我们预期下半年股票组合将会获得相当不错的超额收益。本基金将灵活参与权益市场的各种机会，审慎投资，精选个股，降低风险，努力在2019年下半年为投资者带来相对更好的净值表现。

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。

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，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的 基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。本报告期内基金未实施收益分配。

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

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。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。
报告期内，本基金未实施利润分配。

托管人对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

本托管人复核审查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。

资产负债表

会计主体：华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2019-06-30

单位：人民币元

资产	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
资产：		
银行存款	21,731,948.83	19,237,844.19
结算备付金	767,153.11	733,066.31
存出保证金	136,293.16	129,792.48
交易性金融资产	379,374,339.40	338,421,855.83
其中：股票投资	379,374,339.40	338,421,855.83
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	4,928,428.10
应收利息	4,767.24	4,731.31
应收股利	-	-
应收申购款	3,847.66	7,114.77
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	402,018,349.40	363,462,832.99
负债和所有者权益	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
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	-	4,522,882.07
应付赎回款	7,629.57	221,108.72
应付管理人报酬	487,717.23	474,371.01
应付托管费	81,286.23	79,061.83
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	412,922.12	311,156.75
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	198,359.68	400,000.34
负债合计	1,187,914.83	6,008,580.72
所有者权益：	-	-
实收基金	448,649,803.29	500,823,641.58
未分配利润	-47,819,368.72	-143,369,389.31
所有者权益合计	400,830,434.57	357,454,252.27
负债和所有者权益总计	402,018,349.40	363,462,832.99

注：注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值0.8934元，基金份额总额448649803.29份。

利润表

会计主体：华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2019-01-01至2019-06-30

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
一、收入	95,170,899.99	-53,027,418.33
1.利息收入	91,228.77	1,033,014.76
其中：存款利息收入	85,843.56	184,589.97
债券利息收入	5,385.21	94,951.38
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	753,473.41
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	2,626,051.89	18,778,482.55
其中：股票投资收益	-4,422,074.46	10,758,056.11
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,600.00	356,246.28
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	7,050,726.35	7,664,180.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	92,444,286.04	-74,771,894.96
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	9,333.29	1,932,979.32
减：二、费用	5,333,719.48	10,921,903.80
1．管理人报酬	3,010,913.94	4,773,936.05
2．托管费	501,818.99	795,656.04
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	1,600,344.58	5,123,941.26
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6．税金及附加	-	0.45
7．其他费用	220,641.97	228,370.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	89,837,180.51	-63,949,322.13
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	89,837,180.51	-63,949,322.13

所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2019-01-01至2019-06-30

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30		
	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）	500,823,641.58	-143,369,389.31	357,454,252.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	89,837,180.51	89,837,180.51
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）	-52,173,838.29	5,712,840.08	-46,460,998.21
其中：1.基金申购款	5,751,191.84	-661,236.99	5,089,954.85
2.基金赎回款	-57,925,030.13	6,374,077.07	-51,550,953.06
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）	448,649,803.29	-47,819,368.72	400,830,434.57

项目	上年度可比期间 -至-		
	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）	1,275,451,583.30	-4,566,895.60	1,270,884,687.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-63,949,322.13	-63,949,322.13
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）	-604,460,563.59	-48,145,008.02	-652,605,571.61
其中：1.基金申购款	161,791,955.54	-15,379,453.39	146,412,502.15
2.基金赎回款	-766,252,519.13	-32,765,554.63	-799,018,073.76
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）	670,991,019.71	-116,661,225.75	554,329,793.96

本报告第6.1页至第6.4页财务报表由下列负责人签署：

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

注：此处为PDF文件中的章节数或者页数。

报表附注

基金基本情况

华泰柏瑞富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]1468号《关于准予华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和机构部函[2017]341号《关于华泰柏瑞富利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《华泰柏瑞富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1,386,755,880.23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821号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年9月12日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额1,387,409,473.64份基金份额，其中认购资金利息折合653,593.41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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞富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)。本基金持有的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2019年8月29日批准报出。

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》、《华泰柏瑞消费成长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。
财务报表以持续经营为基础编制。

遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年1月1日至2019年6月30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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019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。

重要会计政策和会计估计

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。

会计年度

-

记账本位币

-

金融资产和金融负债的分类

-

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-

金融资产和金融负债的估值原则

-

金融资产和金融负债的抵销

-

实收基金

-

损益平准金

-

收入/(损失)的确认和计量

-

费用的确认和计量

-

基金的收益分配政策

-

其他重要的会计政策和会计估计

-

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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。

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。

差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

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。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
活期存款	21,731,948.83	-
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	21,731,948.83	19,237,844.19

交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019-06-30 成本	公允价值	公允价值变动
股票		389,786,013.75	379,374,339.40	-10,411,674.35
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		389,786,013.75	379,374,339.40	-10,411,674.35

项目		上年度末 2018-12-31 成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
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		-	-	-

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30 合同/名义金额	公允价值 资产	公允价值 负债	备注
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

项目	上年度末 2018-12-31 合同/名义金额	公允价值 资产	公允价值 负债	备注
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

买入返售金融资产

各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30 账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-

项目	上年度末 2018-12-31 账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30 债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量（张）	估值总额	其中：已出售或再质押总额

项目	上年度末 2018-12-31 债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量（张）	估值总额	其中：已出售或再质押总额

应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
应收活期存款利息	4,360.74	-
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	345.20	-
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
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	61.30	-
合计	4,767.24	4,731.31

其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	-

应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
交易所市场应付交易费用	412,922.12	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	412,922.12	311,156.75

其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5.40	-
预提费用	198,354.28	-
合计	198,359.68	400,000.34

实收基金

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	500,823,641.58	500,823,641.58
本期申购	5,751,191.84	5,751,191.84
本期赎回（以“-”号填列）	-57,925,030.13	-57,925,030.13
本期末	448,649,803.29	448,649,803.29

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	-47,729,975.32	-95,639,413.99	-143,369,389.31
本期利润	-2,607,105.53	92,444,286.04	89,837,180.51
本期基金份额交易产生的变动数	7,898,855.27	-2,186,015.19	5,712,840.08
其中：基金申购款	-853,648.40	192,411.41	-661,236.99
基金赎回款	8,752,503.67	-2,378,426.60	6,374,077.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-42,438,225.58	-5,381,143.14	-47,819,368.72

存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
活期存款利息收入	77,624.33	-
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	7,138.22	-
其他	1,081.01	-
合计	85,843.56	184,589.97

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出股票成交总额	560,881,809.38	-
减：卖出股票成本总额	565,303,883.84	-
买卖股票差价收入	-4,422,074.46	-

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,600.00	-
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	-2,600.00	356,246.28

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,037,800.00	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,002,600.00	-
减：应收利息总额	37,800.00	-
买卖债券差价收入	-2,600.00	-

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
赎回基金份额对价总额	-	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回债券成本总额	-	-
减：赎回债券应收利息总额	-	-
赎回差价收入	-	-

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
申购基金份额对价总额	-	-
减：现金支付申购款总额	-	-
减：申购债券成本总额	-	-
减：申购债券应收利息总额	-	-
申购差价收入	-	-

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出资产支持证券成交总额	-	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-	-
减：应收利息总额	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

贵金属投资收益

贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-	-
贵金属投资收益——赎回差价收入	-	-
贵金属投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	-

贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出贵金属成交总额	-	-
减：卖出贵金属成本总额	-	-
减：买卖贵金属差价收入应缴纳增值税额	-	-
买卖贵金属差价收入	-	-

贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
赎回贵金属份额对价总额	-	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回贵金属成本总额	-	-
赎回差价收入	-	-

贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
申购贵金属份额总额	-	-
减：现金支付申购款总额	-	-
减：申购贵金属成本总额	-	-
申购差价收入	-	-

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出权证成交总额	-	-
减：卖出权证成本总额	-	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-	-
买卖权证差价收入	-	-

衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间收益金额 -至-
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-	-

注：无。

股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
股票投资产生的股利收益	7,050,726.35	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	7,050,726.35	7,664,180.16

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
1.交易性金融资产	92,444,286.04	-
——股票投资	92,444,286.04	-
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	92,444,286.04	-74,771,894.96

其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
基金赎回费收入	9,142.24	-
转换费收入	191.05	-
合计	9,333.29	1,932,979.32

交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
交易所市场交易费用	1,600,344.58	-
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,600,344.58	5,123,941.26

其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
审计费用	49,588.57	-
信息披露费	148,765.71	-
银行划款手续费	3,687.69	-
银行间账户服务费	18,600.00	-
合计	220,641.97	228,370.00

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，不需要进行分部报告的披露。
-

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

注：无。

资产负债表日后事项

-

关联方关系

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。

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、基金注册登记人、基金直销机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：注：1、关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 -至-	
	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	31,574,372.06	2.94 %	1,119,068,600.85	32.56 %

权证交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 -至-	
	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

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30			
	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	28,773.78	3.05 %	0.00	0.00 %
关联方名称	上年度可比期间 -至-			
	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	1,042,188.41	32.91 %	43.91	0.00 %

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
当期发生的基金应支付的管理费	3,010,913.94	4,773,936.05
其中：支付销售机构的客户维护费	1,387,202.73	3,347,773.02

注：注1：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提，计算方法如下：
H = E × 1.50% ÷ 当年天数
H为每日应支付的管理人报酬
E为前一日的基金资产净值
基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
当期发生的基金应支付的托管费	501,818.99	795,656.04

注：注1：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0.25%的年费率计提，计算方法如下：
H = E × 0.25% ÷ 当年天数
H为每日应支付的托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30
	当期发生的基金应支付的销售服务费
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 -至-
	当期应支付的销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 -至-					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

各关联方投资本基金的情况

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 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
基金合同生效日（2017-09-12）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-%	-%

注：注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

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

份额单位：份

项目	本期末 2019-06-30		上年度末 2018-12-31	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

注：注：本报告期及上年度可比期间内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

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 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 -至-	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	21,731,948.83	77,624.33	30,152,133.76	134,945.28

注：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。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2019-01-01至2019-06-30					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
上年度可比期间 -至-					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

注：注：无。

其他关联交易事项的说明

无。

利润分配情况

利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配合计	备注

期末（2019-06-30）本基金持有的流通受限证券

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

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	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
受限证券类别：债券										
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	备注

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

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

-

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额

交易所市场债券正回购

-

金融工具风险及管理

-

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。

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人中国建设银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

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。

于2019年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2019-06-30	合计
资产	
资产总计	-
负债	
负债总计	-
流动性净额	-

上年度末 2018-12-31	合计
资产	
资产总计	-
负债	
负债总计	-
流动性净额	-

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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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公司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%。于2019年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.014%。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。

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。

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、存出保证金等。

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019-06-30	1个月以内	不计息	合计
资产			
银行存款	21,731,948.83	-	21,731,948.83
结算备付金	767,153.11	-	767,153.11
存出保证金	136,293.16	-	136,293.16
交易性金融资产	-	379,374,339.40	379,374,339.40
应收利息	-	4,767.24	4,767.24
应收申购款	-	3,847.66	3,847.66
其他资产	-	-	-
资产总计	22,635,395.10	379,382,954.30	402,018,349.40
负债			
应付赎回款	-	7,629.57	7,629.57
应付管理人报酬	-	487,717.23	487,717.23
应付托管费	-	81,286.23	81,286.23
应付交易费用	-	412,922.12	412,922.12
其他负债	-	198,359.68	198,359.68
负债总计	-	1,187,914.83	1,187,914.83
利率敏感度缺口	22,635,395.10	378,195,039.47	400,830,434.57
上年度末 2018-12-31	**1个月以内**	**不计息**	**合计**
资产			
银行存款	19,237,844.19	-	19,237,844.19
结算备付金	733,066.31	-	733,066.31
存出保证金	129,792.48	-	129,792.48
交易性金融资产	-	338,421,855.83	338,421,855.83
应收证券清算款	-	4,928,428.10	4,928,428.10
应收利息	-	4,731.31	4,731.31
应收申购款	-	7,114.77	7,114.77
资产总计	20,100,702.98	343,362,130.01	363,462,832.99
负债			
应付证券清算款	-	4,522,882.07	4,522,882.07
应付赎回款	-	221,108.72	221,108.72
应付管理人报酬	-	474,371.01	474,371.01
应付托管费	-	79,061.83	79,061.83
应付交易费用	-	311,156.75	311,156.75
其他负债	-	400,000.34	400,000.34
负债总计	-	6,008,580.72	6,008,580.72
利率敏感度缺口	20,100,702.98	337,353,549.29	357,454,252.27

利率风险的敏感性分析

假设	-		
		对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
分析	相关风险变量的变动	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31

注：于2019年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2018年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018年12月31日：同)。

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。

外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	**上期末 2018-06-30**			
	美元折合人民币	**港币折合人民币**	**其他币种折合人民币**	**合计**
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

外汇风险的敏感性分析

假设	-		
		对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
分析	相关风险变量的变动	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31

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。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例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%。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。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30		上年度末 2018-12-31	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	379,374,339.40	94.65	338,421,855.83	94.68
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	379,374,339.40	94.65	338,421,855.83	94.68

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		
		对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
分析	相关风险变量的变动	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
	沪深300指数上升5%	17,893,003.00	19,831,041.00
	沪深300指数下降5%	-17,893,003.00	-19,831,041.00

采用风险价值法管理风险

-

假设	- -		
分析	风险价值（金额单位：人民币元）	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31

有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	379,374,339.40	94.37
	其中：股票	379,374,339.40	94.37
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	22,499,101.94	5.60
8	其他各项资产	144,908.06	0.04
9	合计	402,018,349.40	100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	15,511,227.20	3.87
C	制造业	58,758,642.15	14.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	72,709,914.98	18.14
F	批发和零售业	20,057,531.28	5.00
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	72,843.76	0.02
J	金融业	93,724,980.80	23.38
K	房地产业	111,639,492.63	27.85
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	6,899,706.60	1.72
S	综合	-	-
	合计	379,374,339.40	94.65

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-

注：注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601009	南京银行	2,801,414	23,139,679.64	5.77
2	600016	民生银行	3,422,000	21,729,700.00	5.42
3	601166	兴业银行	1,187,022	21,710,632.38	5.42
4	601155	新城控股	537,682	21,405,120.42	5.34
5	600340	华夏幸福	650,860	21,198,510.20	5.29
6	601668	中国建筑	3,622,000	20,826,500.00	5.20
7	601186	中国铁建	2,064,000	20,536,800.00	5.12
8	600068	葛洲坝	3,234,126	20,148,604.98	5.03
9	600153	建发股份	2,258,731	20,057,531.28	5.00
10	000425	徐工机械	4,494,700	20,046,362.00	5.00
11	600325	华发股份	2,515,191	19,643,641.71	4.90
12	000069	华侨城A	2,817,956	19,584,794.20	4.89
13	002146	荣盛发展	2,067,190	19,410,914.10	4.84
14	601328	交通银行	2,811,000	17,203,320.00	4.29
15	600491	龙元建设	1,622,900	11,198,010.00	2.79
16	000671	阳 光 城	1,604,400	10,396,512.00	2.59
17	600308	华泰股份	2,194,910	9,789,298.60	2.44
18	600373	中文传媒	547,500	6,876,600.00	1.72
19	002110	三钢闽光	590,962	5,495,946.60	1.37
20	601318	中国平安	58,044	5,143,278.84	1.28
21	600348	阳泉煤业	867,600	5,040,756.00	1.26
22	600188	兖州煤业	455,260	4,948,676.20	1.23
23	601717	郑煤机	865,100	4,939,721.00	1.23
24	000528	柳 工	729,930	4,861,333.80	1.21
25	600256	广汇能源	1,357,000	4,830,920.00	1.21
26	601288	农业银行	1,295,000	4,662,000.00	1.16
27	600282	南钢股份	1,302,187	4,557,654.50	1.14
28	600567	山鹰纸业	1,352,000	4,556,240.00	1.14
29	000951	中国重汽	264,000	4,237,200.00	1.06
30	601899	紫金矿业	118,000	444,860.00	0.11
31	600968	海油发展	69,300	246,015.00	0.06
32	601555	东吴证券	10,000	102,500.00	0.03
33	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.02
34	603915	国茂股份	2,523	58,710.21	0.01
35	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
36	603217	元利科技	584	39,268.16	0.01
37	603863	松炀资源	1,612	37,204.96	0.01
38	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01

39	002230	科大讯飞	1,000	33,240.00	0.01
40	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
41	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
42	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01

报告期内股票投资组合的重大变动

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	600325	华发股份	24,591,853.40	6.88
2	600585	海螺水泥	23,590,919.61	6.60
3	601288	农业银行	21,994,450.00	6.15
4	601186	中国铁建	21,953,428.41	6.14
5	601328	交通银行	21,876,180.00	6.12
6	601225	陕西煤业	21,861,960.83	6.12
7	601668	中国建筑	21,645,674.00	6.06
8	000830	鲁西化工	21,586,920.81	6.04
9	600000	浦发银行	21,563,176.50	6.03
10	600153	建发股份	21,457,952.63	6.00
11	002024	苏宁易购	20,986,505.36	5.87
12	000069	华侨城A	20,855,001.20	5.83
13	601717	郑煤机	20,708,848.00	5.79
14	600567	山鹰纸业	19,207,784.00	5.37
15	000425	徐工机械	19,129,482.00	5.35
16	000581	威孚高科	16,770,704.75	4.69
17	601155	新城控股	16,310,456.90	4.56
18	002146	荣盛发展	16,268,878.00	4.55
19	600708	光明地产	15,823,969.16	4.43
20	600340	华夏幸福	14,309,703.42	4.00
21	600308	华泰股份	11,071,719.80	3.10
22	600491	龙元建设	10,922,013.00	3.06
23	000671	阳光城	10,590,124.00	2.96
24	600373	中文传媒	9,612,627.00	2.69
25	002128	露天煤业	8,118,534.00	2.27
26	601233	桐昆股份	7,243,112.60	2.03

注：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。

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	000830	鲁西化工	40,758,130.97	11.40
2	600585	海螺水泥	31,308,405.00	8.76
3	601318	中国平安	26,553,604.37	7.43
4	000581	威孚高科	26,526,111.32	7.42
5	601155	新城控股	26,309,224.60	7.36
6	002142	宁波银行	25,108,011.16	7.02
7	600000	浦发银行	22,261,372.60	6.23
8	601225	陕西煤业	22,091,974.83	6.18
9	002024	苏宁易购	22,025,892.00	6.16
10	000059	华锦股份	20,643,457.41	5.78
11	600325	华发股份	19,882,585.57	5.56
12	002146	荣盛发展	19,833,213.83	5.55
13	002051	中工国际	19,116,492.82	5.35
14	000932	华菱钢铁	19,007,917.04	5.32
15	600188	兖州煤业	18,742,473.31	5.24
16	600708	光明地产	18,422,358.94	5.15
17	600567	山鹰纸业	18,202,186.99	5.09
18	300182	捷成股份	18,037,622.45	5.05
19	601288	农业银行	16,989,460.00	4.75
20	002110	三钢闽光	15,684,590.15	4.39
21	600282	南钢股份	15,564,720.00	4.35
22	601717	郑煤机	14,335,183.00	4.01
23	601233	桐昆股份	13,653,598.80	3.82
24	002078	太阳纸业	11,439,661.84	3.20
25	000426	兴业矿业	10,952,813.34	3.06
26	002128	露天煤业	7,599,925.00	2.13

注：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。

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	513,812,081.37
卖出股票收入（成交）总额	560,881,809.38

注：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。

期末按债券品种分类的债券投资组合

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动	风险说明
公允价值变动总额合计				-	
股指期货投资本期收益				-	
股指期货投资本期公允价值变动				-	

本基金投资股指期货的投资政策

-

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

-

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)				-	
国债期货投资本期收益（元）				-	
国债期货投资本期公允价值变动(元)				-	

本期国债期货投资评价

-

投资组合报告附注

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情况的说明

本基金本报告期末投资的前十名证券中，中国建筑（601668）于2019年3月24日公告下属子公司中国建筑第二工程局有限公司所承建的扬州中航宝胜海洋工程电缆项目发生突发事故，项目部立即启动应急预案，及时向有关部门和公司进行报告，相关负责人配合政府有关部门开展应急救援工作。按照《生产安全事故报告和调查处理条例》规定，本次事故属于较大安全事故，由江苏省应急管理厅成立事故调查组进行调查，并判定事故责任，目前事故正在调查之中，尚未认定责任主体。本项目工程施工合同额约为1.48亿元，本次事故预计不会对公司生产经营及业绩产生重大影响，对公司当期损益也无较大影响。对该股票投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。
本基金本报告期末投资的前十名证券中，本基金本报告期末投资的前十名证券中，中国银行保险监督管理委员会于2018年11月9日对民生银行（600016）作出行政处罚决定，对公司贷款业务严重违反审慎经营规则罚款200万元，对相关责任人处以警告并罚款。以及对公司内控管理严重违反审慎经营规则；同业投资违规接受担保；同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；本行理财产品之间风险隔离不到位；个人理财资金违规投资；票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；为非保本理财产品提供保本承诺等行为处以罚款3160万元。对该股票投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。
报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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情形。

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	136,293.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,767.24
5	应收申购款	3,847.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	144,908.06

期末持有的处于转股期的可转换债券明细

期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
5,880	76,300.99	0.00	0.00 %	448,649,803.29	100.00 %

期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占上市总份额比例

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	492.34	0.0001 %

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-%	-	-%	-
基金管理人高级管理人员	-	-%	-	-%	-
基金经理等人员	-	-%	-	-%	-
基金管理人股东	-	-%	-	-%	-
其他	-	-%	-	-%	-
合计	-	-%	-	-%	-

开放式基金份额变动

单位：份

项目	数值
基金合同生效日（2017-09-12）的基金份额总额	1,387,409,473.64
本报告期期初基金份额总额	500,823,641.58
本报告期期间基金总申购份额	5,751,191.84
减：本报告期期间基金总赎回份额	57,925,030.13
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	448,649,803.29

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。

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

2019年3月11日，公司股东批准Anthony Gerard Fasso先生为公司董事。上述人事变动已按相关规定备案、报告。
2019年4月4日，公司股东批准王永筠女士为公司监事。
2019年4月15日，经公司董事会批准刘万方先生为公司副总经理。
托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。
上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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。

基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

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其审计的会计师事务所。

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。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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		基金交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		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	成交金额	占当期基金成交总额的比例	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	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	236,345,056.45	22.03 %	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	171,548.29	18.17 %-	
爱建证券	1	201,189,823.17	18.75 %	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	187,368.42	19.84 %-	
民生证券	1	153,658,101.32	14.32 %	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	140,029.24	14.83 %-	
南京证券	1	142,005,461.65	13.24 %	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	132,249.55	14.01 %-	
方正证券	1	135,036,507.55	12.59 %	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	123,058.93	13.03 %-	
华西证券	1	62,018,757.94	5.78 %	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	57,760.43	6.12 %-	
西藏东方财富	2	38,280,888.19	3.57 %	-	-%	1,002,600.00	100.00 %	-	-%	-	-%	35,651.38	3.78 %-	
西南证券	1	38,146,635.71	3.56 %	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	35,526.11	3.76 %-	
浙商证券	1	34,696,496.66	3.23 %	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	32,311.99	3.42 %-	
华泰证券	5	31,574,372.06	2.94 %	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	28,773.78	3.05 %-	
宏信证券	2	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%-	
天风证券	2	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%-	
信达证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%-	
华宝证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%-	
中信建投	2	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%-	
东海证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%-	
东吴证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%-	
国信证券	2	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%-	
恒泰证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%-	
新时代证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%-	
万联证券	2	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%-	
华创证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%-	
财达证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%-	
东北证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%-	

其他重大事件

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参加中国银行定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-06-27
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-06-25
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加世纪证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-05-25
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加中信建投证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投、申购定投费率优惠业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-05-25
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加中信期货有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-04-26
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加大通证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-04-08
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加北京百度百盈基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定期定额投资及参加费率优惠等业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-04-04
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换及参加费率优惠等业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-03-28
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加广发银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金定投业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-03-27
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加中银国际证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-03-27
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投、申购定投费率优惠业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-03-19
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-03-09
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有的信威集团（600485）估值调整的提示性公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-03-02
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加泉州银行股份有限公司费率优惠的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-02-27
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-02-27
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加北京君德汇富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及参加费率优惠等业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-02-19
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加泰信财富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及参加费率优惠等业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-02-19
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有的信威集团（600485）估值调整的提示性公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-02-15
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019-01-28

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	-	-	-	-	-	-	-	
个人	-	-	-	-	-	-	-	
产品特有风险								
-								

注：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。

影响投资者决策的其他重要信息

-

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

存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

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