

华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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。本中期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 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金于 2015 年 11 月 19 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 11 月 19 日开始计算。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	50
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
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.....	61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	61
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.....	61
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.....	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
7.12 投资组合报告附注.....	62
§8 基金份额持有人信息.....	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
8.3 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.....	63
§9 开放式基金份额变动.....	65
§10 重大事件揭示.....	66
10.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
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.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	69
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
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.....	71

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞新利混合	
基金主代码	001247	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 4 月 28 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	208,115,760.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞新利混合 A	华泰柏瑞新利混合 C
下属分级基金的交易代码:	001247	002091
报告期末下属分级基金的份额总额	39,949,218.01 份	168,166,542.27 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值，前瞻性地把握不同时期股票市场、债券市场和银行间市场的收益率，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。	
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。当股票市场的整体估值水平严重地偏离了企业实际的盈利状况和预期的成长率，出现明显的价值高估，如果不及时调整将可能给基金份额持有人带来潜在的资本损失时，本基金将进行大类资产配置调整，降低股票资产的比例，同时相应提高债券等其他资产的比例。	
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+1%。	
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。	
	华泰柏瑞新利混合 A	华泰柏瑞新利混合 C

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	许俊
	联系电话	021-38601777	010-66594319
	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
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200135	100818
法定代表人	贾波	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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

§ 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	华泰柏瑞新利混合 A	华泰柏瑞新利混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	1,094,043.96	1,313,857.92
本期利润	-939,323.37	2,159,921.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0085	0.0557
本期加权平均净值利润率	-0.80%	5.25%
本期基金份额净值增长率	1.74%	1.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	3,166,509.61	13,008,624.27
期末可供分配基金份额利润	0.0793	0.0774
期末基金资产净值	43,115,727.62	181,175,166.54
期末基金份额净值	1.0793	1.0774
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	20.68%	18.87%

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

华泰柏瑞新利混合 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	1.22%	0.55%	0.20%	0.01%	1.02%	0.54%
过去三个月	2.62%	0.38%	0.56%	0.01%	2.06%	0.37%
过去六个月	1.74%	0.43%	1.13%	0.01%	0.61%	0.42%
过去一年	5.04%	0.33%	2.29%	0.01%	2.75%	0.32%
过去三年	11.85%	0.28%	7.20%	0.01%	4.65%	0.27%
自合同生效日至今	20.68%	0.22%	13.39%	0.01%	7.29%	0.21%

华泰柏瑞新利混合 C

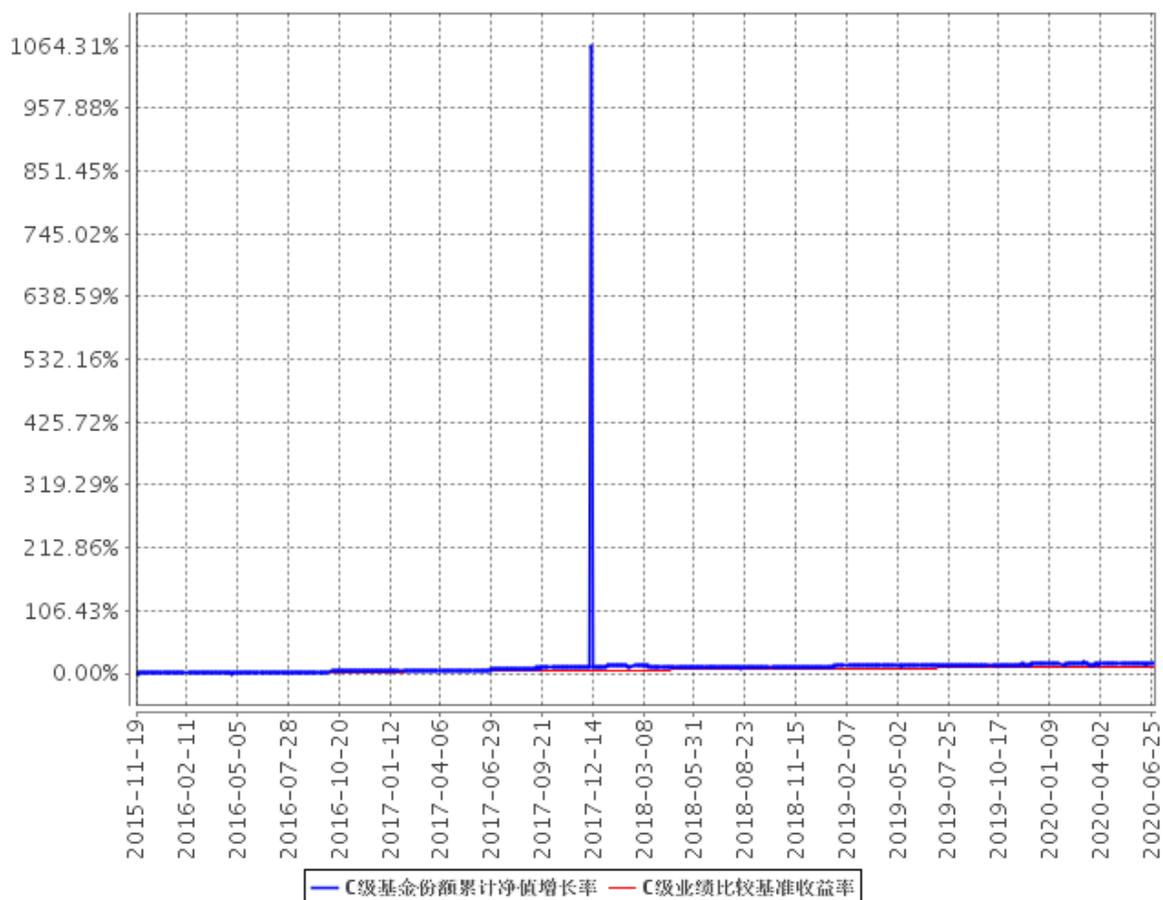
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.20%	0.55%	0.20%	0.01%	1.00%	0.54%
过去三个月	2.57%	0.38%	0.57%	0.01%	2.00%	0.37%
过去六个月	1.65%	0.42%	1.14%	0.01%	0.51%	0.41%
过去一年	4.86%	0.33%	2.33%	0.01%	2.53%	0.32%
过去三年	11.84%	35.67%	7.31%	0.01%	4.53%	35.66%
自合同生效日至今	18.87%	28.78%	11.71%	0.01%	7.16%	28.77%

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



C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：A 级图示日期为 2015 年 4 月 28 日至 2020 年 6 月 30 日。C 级图示日期为 2015 年 11 月 19 日至 2020 年 6 月 30 日。

§ 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、华泰柏瑞享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、华泰柏瑞核心优势混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、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联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放华泰柏瑞益商型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金。截至 2020 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 1317.21 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		
罗远航	本基金的基金经理	2017 年 3 月 24 日	-	9 年	清华大学应用经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司交易员、研究员、基金经理。2017 年 1 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2017 年 3 月至 2018 年 4 月任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 3 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。2017 年 3 月至 2019 年 3 月任华泰

					<p>柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 2 月起任华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月起任华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2020 年 1 月起任华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。</p>
吴邦栋	本基金的基金经理	2018 年 4 月 2 日	-	9 年	<p>上海财经大学金融学硕士。曾任长江证券股份有限公司研究员、农银汇理基金管理有限公司研究员。2015 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任高级研究员兼基金经理助理。2018 年 3 月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 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。2018 年 4 月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月起任华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月起任华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经</p>

					理。2020 年 6 月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
郑青	固定收益部副总监、本基金的基金经理	2020 年 6 月 23 日	-	15 年	15 年证券（基金）从业经验，经济学硕士。曾任职于国信证券股份有限公司、平安资产管理有限责任公司，2008 年 3 月至 2010 年 4 月任中海基金管理有限公司交易员，2010 年加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任债券研究员。2012 年 6 月起任华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金经理，2013 年 7 月至 2017 年 11 月任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 1 月起任固定收益部副总监。2015 年 7 月起任华泰柏瑞交易型货币市场基金的基金经理。2016 年 9 月起任华泰柏瑞天添宝货币市场基金的基金经理。2020 年 6 月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞鼎利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。罗远航自 2020 年 7 月 21 日离任本基金基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

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。目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。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

2020 年 1 季度 A 股呈现宽幅震荡的走势，指数整体先涨后跌，3 月上旬开始出现一定程度上的回落。1 季度上证综指下跌 9.83%，沪深 300 下跌 10.02%，中证 500 下跌 4.29%，创业板指上涨 4.1%。20 年 2 季度市场基本呈现匀速上涨态势，结构性机会较多。上证指数上涨幅度较低，创业板表现相对较好。其中，沪深 300 上涨 12.96%，创业板指上涨 30.25%，中证 500 上涨 16.32%。风格上来说，消费行业整体在 2 季度的表现较为优秀，成长个股分化和波动较大。

1 季度市场受到政策放松和疫情冲击这正、反双方面的影响，指数呈现宽幅震荡的走势。去年底开始资金状况维持宽松，而宏观数据有所好转，这些积极信号都带动了指数的上行，但 2 月开始新冠疫情在中国以及世界各地逐渐扩散之后，严重影响了未来经济增长的预期，使得全球资

本市场均出现较大程度下跌。与此同时，全球央行均开启了新一轮的货币宽松计划，国内央行也对金融市场的流动性给与了较高的支持，可以看到银行间利率已经处于过去 4 年来的新低水平，而降准政策也频频推出。

2 季度货币政策及行业政策方面继续保持相对宽松，这使得整体股票市场热点频出。shibor 同业拆借利率从 1 季度最高的 2.2% 一度回落至 0.7%-0.8% 左右，10 年期国债利率也一度跌破 2.5% 的水平。较为宽松的流动性环境，叠加疫情相对较弱的经济基本面，导致市场在 2 季度的行业呈现结构剧烈分化的局面，围绕疫情受益的消费、医药持续力度最强。科技股略有表现但震荡较大，而经济相关的股票受损较多。

2 季度中后期，经济数据开始出现一定程度的恢复，以 PMI 指数为例，已连续 4 个月站上 50 荣枯线。进入 2 季度末 3 季度初，伴随雨量增加，以及工业生产逐步恢复正常，高频周期行业数据出现了一定程度的回落，包括钢材现货的成交，以及部分周期品的价格等。3 季度的复苏进度仍有待进一步跟踪。

行业表现上来看，上半年市场风格偏向于科技成长以及医药、消费等部分必需消费品，对于金融、周期以及受疫情影响较大的线下领域表现较差。

本基金在报告期在沪深 300 中精选个股。

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新利混合 A 基金份额净值为 1.0793 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.74%，同期业绩比较基准收益率为 1.13%；截至本报告期末华泰柏瑞新利混合 C 基金份额净值为 1.0774 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.65%，同期业绩比较基准收益率为 1.14%。

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 3 季度，我们认为市场活跃度仍将维持，一方面全市场来看，蓝筹股的估值仍在市场底部，在流动性整体宽松的环境没有大变化的情况下，这决定了市场整体下行的空间不大。另一方面，伴随国内疫情的逐渐平息，制造业开工开始恢复，预计未来半年的业绩展望也将逐级上修。从近期跟踪的制造业行业中观数据来看，企业对于下半年的需求乐观程度有明显的好转。

流动性方面，我们观察到近一段时间央行对“资金空转”现象开始有所关注，鼓励之前货币放松的流动性向实体倾斜。短端利率前期出现一定的抬升。3 季度需要密切关注银行间利率水平的抬升幅度，以及债券市场下跌可能对全社会流动性产生的冲击。从目前的情况来看，我们倾向于认为 3 季度流动性仅是对前期极为宽松流动性的一次修正，不会产生过度收紧的货币预期。

当前市场不具备系统性风险的基础。市场出现系统性风险的条件有两个：一是，再次出现趋势性下修盈利的事件，比如国内外疫情二次爆发、大国间超预期冲突等。二是，流动性趋势性收

紧，最早观察时间点预计在 4 季度。

与此同时，经过 1 年多的结构性上涨，市场估值分化加大，交易结构较为拥挤。3 季度市场会对这一极度差异化的相对估值进行一次修复。但 3 季报前市场的投资主线依然是业绩超预期。当前市场对业绩超预期个股的反馈依然正面，并不存在风格偏见，当高景气资产下跌后，其吸引力将会上升。

操作方面，本基金预计 3 季度保持目前持仓结构不会有太大变化。

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

基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，收益分配基准日可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	124,568,447.81	1,009,634.46
结算备付金		147,163.78	41,874.24
存出保证金		52,982.83	39,882.40
交易性金融资产	6.4.7.2	236,557,117.39	261,070,399.64
其中：股票投资		185,024,467.39	65,160,999.64
基金投资		-	-
债券投资		51,532,650.00	195,909,400.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	2,000,000.00
应收利息	6.4.7.5	573,784.75	2,882,387.74
应收股利		-	-
应收申购款		236.92	10,054.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		361,899,733.48	267,054,233.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		18,499,875.00	2,000,000.00
应付证券清算款		117,258,451.10	-
应付赎回款		1,292,853.33	250,048.06
应付管理人报酬		94,242.51	144,022.42
应付托管费		29,450.78	45,007.02
应付销售服务费		16,235.02	13,808.40
应付交易费用	6.4.7.7	326,384.76	102,266.89
应交税费		318.53	12,963.27

应付利息		1,520.69	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,507.60	180,000.02
负债合计		137,608,839.32	2,748,116.08
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	208,115,760.28	249,214,261.58
未分配利润	6.4.7.10	16,175,133.88	15,091,855.75
所有者权益合计		224,290,894.16	264,306,117.33
负债和所有者权益总计		361,899,733.48	267,054,233.41

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额为 208,115,760.28 份，其中 A 类基金份额净值 1.0793 元，A 类基金份额总额 39,949,218.01 份；C 类基金份额净值 1.0774 元，C 类基金份额总额 168,166,542.27 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		3,138,692.96	6,232,744.85
1.利息收入		1,872,478.96	3,170,094.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	34,888.96	44,655.76
债券利息收入		1,837,590.00	3,048,622.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	76,816.39
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,196,504.25	5,593,465.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-600,742.48	1,869,433.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,959,527.98	3,346,202.28
资产支持证券投资收益	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	-	-
股利收益	6.4.7.16	837,718.75	377,829.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,187,303.57	-2,531,801.15
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	257,013.32	985.85
减：二、费用		1,918,094.65	1,622,694.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	637,026.54	744,190.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	199,070.81	232,559.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	42,145.28	4,474.39
4. 交易费用	6.4.7.19	618,861.10	261,846.42
5. 利息支出		304,371.28	166,496.19
其中：卖出回购金融资产支出		304,371.28	166,496.19
6. 税金及附加		5,298.90	8,944.71
7. 其他费用	6.4.7.20	111,320.74	204,182.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,220,598.31	4,610,050.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,220,598.31	4,610,050.77

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	249,214,261.58	15,091,855.75	264,306,117.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,220,598.31	1,220,598.31
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）	-41,098,501.30	-137,320.18	-41,235,821.48
其中：1.基金申购款	178,058,642.64	11,555,514.53	189,614,157.17
2.基金赎回款	-219,157,143.94	-11,692,834.71	-230,849,978.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-	-

基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	208,115,760.28	16,175,133.88	224,290,894.16
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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）	311,519,461.46	3,056,110.16	314,575,571.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,610,050.77	4,610,050.77
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）	-46,409,678.56	-381,905.89	-46,791,584.45
其中：1.基金申购款	200,748,233.93	5,658,292.58	206,406,526.51
2.基金赎回款	-247,157,912.49	-6,040,198.47	-253,198,110.96
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）	265,109,782.90	7,284,255.04	272,394,037.94

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞新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]629号《关于准予华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《华泰柏瑞新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 1,652,616,261.61 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(2015)第 407 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,652,694,626.58 份基金份额，其中认购资金利息折合 78,364.97 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《关于华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》的有关规定，本基金自 2015 年 11 月 19 日起增加收取销售服务费的 C 类份额，并对本基金的基金合同、托管协议作相应修改。在本基金增加收取销售服务费的 C 类份额后，原有的基金份额全部自动转换为本基金 A 类份额。对投资者申购时收取申购费用、赎回时收取赎回费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；对投资者申购时不收取申购费用，但在赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞新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，包括国内依法发行和上市交易的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：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一年期银行定期存款利率(税后)+1%。

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 2020 年 8 月 29 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<年度报告和中期报告>》、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》、《华泰柏瑞新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、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 重要会计政策和会计估计

本报告期内本基金采用的会计政策和会计估计与上年度相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	124,568,447.81
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：	124,568,447.81

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	183,003,977.36	185,024,467.39	2,020,490.03
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	11,746,753.80	11,634,650.00
	银行间市场	40,555,740.00	39,898,000.00
	合计	52,302,493.80	51,532,650.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	235,306,471.16	236,557,117.39	1,250,646.23

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	8,777.90
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	70.61
应收债券利息	564,912.34
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	-
应收出借证券利息	-
其他	23.90
合计	573,784.75

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	321,169.26
银行间市场应付交易费用	5,215.50
合计	326,384.76

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

预提费用	89,507.60
合计	89,507.60

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞新利混合 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	183,056,597.66	183,056,597.66
本期申购	5,144,404.75	5,144,404.75
本期赎回(以“-”号填列)	-148,251,784.40	-148,251,784.40
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	39,949,218.01	39,949,218.01

金额单位：人民币元

华泰柏瑞新利混合 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	66,157,663.92	66,157,663.92
本期申购	172,914,237.89	172,914,237.89
本期赎回(以“-”号填列)	-70,905,359.54	-70,905,359.54
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	168,166,542.27	168,166,542.27

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞新利混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,154,734.22	-1,028,450.05	11,126,284.17
本期利润	1,094,043.96	-2,033,367.33	-939,323.37

本期基金份额交易产生的变动数	-8,986,472.47	1,966,021.28	-7,020,451.19
其中：基金申购款	382,824.31	-91,454.98	291,369.33
基金赎回款	-9,369,296.78	2,057,476.26	-7,311,820.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,262,305.71	-1,095,796.10	3,166,509.61

单位：人民币元

华泰柏瑞新利混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,729,845.27	1,235,726.31	3,965,571.58
本期利润	1,313,857.92	846,063.76	2,159,921.68
本期基金份额交易产生的变动数	9,487,575.10	-2,604,444.09	6,883,131.01
其中：基金申购款	12,894,683.49	-1,630,538.29	11,264,145.20
基金赎回款	-3,407,108.39	-973,905.80	-4,381,014.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,531,278.29	-522,654.02	13,008,624.27

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	32,888.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,744.92
其他	255.56
合计	34,888.96

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-600,742.48
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-600,742.48

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	160,339,476.80
减：卖出股票成本总额	160,940,219.28
买卖股票差价收入	-600,742.48

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,959,527.98
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	1,959,527.98

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	257,092,835.35
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	250,225,269.46
减：应收利息总额	4,908,037.91
买卖债券差价收入	1,959,527.98

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	837,718.75
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	837,718.75

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,187,303.57
——股票投资	-460,650.28
——债券投资	-726,653.29
——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	-1,187,303.57

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	256,997.76
转换费收入 001247	15.56
合计	257,013.32

- 注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金财产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于 25% 的部分归入转出基金的基金财产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	614,786.10
银行间市场交易费用	4,075.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-

合计	618,861.10
----	------------

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,213.14
银行间账户服务费	18,600.00
合计	111,320.74

6.4.7.21 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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（“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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券回购交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券回购交易。

6.4.10.1.3 权证交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	637,026.54	744,190.05
其中：支付销售机构的客户维护费	162,879.96	248,476.83

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 0.80% 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 0.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	199,070.81	232,559.41

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×0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞新利混合 A	华泰柏瑞新利混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	42,144.98	42,144.98
合计	0.00	42,144.98	42,144.98
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞新利混合 A	华泰柏瑞新利混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	4,474.37	4,474.37
合计	0.00	4,474.37	4,474.37

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 0.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期与上年度可比期间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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 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

份额单位：份

华泰柏瑞新利混合 A				
关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	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
华泰证券股份 有限公司	0.00	0.0000%	5,767,657.09	2.3143%

6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
中国银行股份有限公司	124,568,447.81	32,888.48	2,649,898.25	39,265.43

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	
688186	广大特材	2020 年 1 月 23 日	2020 年 8 月 11 日	新股锁定期内	17.16	34.15	7,459	127,996.44	254,724.85	
688181	八亿时空	2020 年 1 月 6 日	2020 年 7 月 6 日	新股锁定期内	43.98	61.09	2,392	105,200.16	146,127.28	

注：根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，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款余额 9,999,875.00 元，是以如下债券作为抵押：

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
200204	20 国开 04	2020 年 7 月 1 日	100.90	100,000	10,090,000.00
合计				100,000	10,090,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 8,500,000.00 元，于 2020 年 7 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券的出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上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、风险管理部和合规法律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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行，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。

6.4.13.2.1 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	0.00	20,077,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	20,028,000.00	14,008,400.00
合计	20,028,000.00	34,085,400.00

注：未评级的债券包括政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	4,965,000.00	161,824,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	26,539,650.00	0.00
合计	31,504,650.00	161,824,000.00

注：未评级的债券包括国债、政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 18,499,875.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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，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 6.4.12。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 2020 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 0.18%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评

估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 0 年 6 月	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
----------------------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

30日							
资产							
银行存款	124,568,447.81	-	-	-	-	-	124,568,447.81
结算备付金	147,163.78	-	-	-	-	-	147,163.78
存出保证金	52,982.83	-	-	-	-	-	52,982.83
交易性金融资产	-	-	20,028,000.00	21,414,650.00	10,090,000.00	185,024,467.39	236,557,117.39
应收利息	-	-	-	-	-	573,784.75	573,784.75
应收申购款	-	-	-	-	-	236.92	236.92
资产总计	124,768,594.42	-	20,028,000.00	21,414,650.00	10,090,000.00	185,598,489.06	361,899,733.48
负债							
卖出回购	18,499,875.00	-	-	-	-	-	18,499,875.00

金融资产款							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	117,258,451.10	117,258,451.10
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,292,853.33	1,292,853.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	94,242.51	94,242.51
应付托管费	-	-	-	-	-	29,450.78	29,450.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	16,235.02	16,235.02
应付交易费用	-	-	-	-	-	326,384.76	326,384.76
应付	-	-	-	-	-	1,520.69	1,520.69

利息							
应交税费	-	-	-	-	-	318.53	318.53
其他负债	-	-	-	-	-	89,507.60	89,507.60
负债总计	18,499,875.00	-	-	-	-	119,108,964.32	137,608,839.32
利率敏感度缺口	106,268,719.42	-	20,028,000.00	21,414,650.00	10,090,000.00	66,489,524.74	224,290,894.16
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,009,634.46	-	-	-	-	-	1,009,634.46
结算备付金	41,874.24	-	-	-	-	-	41,874.24
存出	39,882.40	-	-	-	-	-	39,882.40

保证金							
交易性金融资产	14,008,400.00	10,055,000.00	30,122,000.00	141,724,000.00	-	65,160,999.64	261,070,399.64
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,000,000.00	2,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	2,882,387.74	2,882,387.74
应收申购款	-	-	-	-	-	10,054.93	10,054.93
资产总计	15,099,791.10	10,055,000.00	30,122,000.00	141,724,000.00	-	70,053,442.31	267,054,233.41
负债							
卖出回购金融资产款	2,000,000.00	-	-	-	-	-	2,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	250,048.06	250,048.06

回款							
应付管理人报酬		-	-	-	-	144,022.42	144,022.42
应付托管费		-	-	-	-	45,007.02	45,007.02
应付销售服务费		-	-	-	-	13,808.40	13,808.40
应付交易费用		-	-	-	-	102,266.89	102,266.89
应交税费		-	-	-	-	12,963.27	12,963.27
其他负债		-	-	-	-	180,000.02	180,000.02
负债总计	2,000,000.00		-	-	-	748,116.08	2,748,116.08
利率敏感度	13,099,791.10	10,055,000.00	30,122,000.00	141,724,000.00		-69,305,326.23	264,306,117.33

缺口							
----	--	--	--	--	--	--	--

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率下降25个基点	286,624.18	729,078.44
	市场利率上升25个基点	-283,061.78	-723,836.25

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：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%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	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	185,024,467.39	82.49	65,160,999.64	24.65
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	185,024,467.39	82.49	65,160,999.64	24.65

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	9,322,433.66	2,987,647.36
沪深 300 指数下降 5%	-9,322,433.66	-2,987,647.36	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 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	185,024,467.39	51.13
	其中：股票	185,024,467.39	51.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	51,532,650.00	14.24
	其中：债券	51,532,650.00	14.24
	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	124,715,611.59	34.46
8	其他各项资产	627,004.50	0.17
9	合计	361,899,733.48	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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,779,792.00	1.24
B	采矿业	4,677,961.00	2.09
C	制造业	86,613,782.23	38.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,591,021.08	1.60
E	建筑业	3,860,076.00	1.72
F	批发和零售业	1,850,958.00	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	5,017,848.00	2.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,433,914.22	3.31
J	金融业	54,729,382.36	24.40
K	房地产业	7,478,390.90	3.33
L	租赁和商务服务业	2,461,878.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	1,168,860.00	0.52

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	249,750.00	0.11
Q	卫生和社会工作	2,026,276.60	0.90
R	文化、体育和娱乐业	1,084,577.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	185,024,467.39	82.49

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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	136,648	9,756,667.20	4.35
2	600519	贵州茅台	5,945	8,696,821.60	3.88
3	600036	招商银行	167,000	5,631,240.00	2.51
4	600276	恒瑞医药	43,923	4,054,092.90	1.81
5	000858	五粮液	21,900	3,747,528.00	1.67
6	000333	美的集团	61,700	3,689,043.00	1.64
7	000651	格力电器	62,000	3,507,340.00	1.56
8	601166	兴业银行	208,300	3,286,974.00	1.47
9	002475	立讯精密	52,940	2,718,469.00	1.21
10	600016	民生银行	462,600	2,622,942.00	1.17
11	600030	中信证券	108,300	2,611,113.00	1.16
12	601288	农业银行	679,100	2,295,358.00	1.02
13	000002	万科 A	86,535	2,262,024.90	1.01
14	601398	工商银行	450,100	2,241,498.00	1.00
15	600000	浦发银行	206,900	2,189,002.00	0.98
16	600887	伊利股份	70,300	2,188,439.00	0.98
17	600900	长江电力	108,582	2,056,543.08	0.92
18	601328	交通银行	352,200	1,806,786.00	0.81
19	601888	中国中免	10,700	1,648,121.00	0.73
20	300059	东方财富	78,400	1,583,680.00	0.71
21	000725	京东方 A	328,200	1,532,694.00	0.68
22	600585	海螺水泥	28,600	1,513,226.00	0.67
23	000001	平安银行	114,700	1,468,160.00	0.65

24	000661	长春高新	3,300	1,436,490.00	0.64
25	600031	三一重工	75,642	1,419,043.92	0.63
26	002714	牧原股份	17,300	1,418,600.00	0.63
27	601818	光大银行	393,300	1,408,014.00	0.63
28	600048	保利地产	95,100	1,405,578.00	0.63
29	000063	中兴通讯	34,468	1,383,200.84	0.62
30	002415	海康威视	44,900	1,362,715.00	0.61
31	300498	温氏股份	62,440	1,361,192.00	0.61
32	600837	海通证券	106,800	1,343,544.00	0.60
33	603288	海天味业	10,400	1,293,760.00	0.58
34	601668	中国建筑	249,500	1,190,115.00	0.53
35	601012	隆基股份	29,100	1,185,243.00	0.53
36	603259	药明康德	12,100	1,168,860.00	0.52
37	600570	恒生电子	10,500	1,130,850.00	0.50
38	002352	顺丰控股	18,600	1,017,420.00	0.45
39	601211	国泰君安	58,934	1,017,200.84	0.45
40	601601	中国太保	36,900	1,005,525.00	0.45
41	300015	爱尔眼科	23,088	1,003,173.60	0.45
42	300142	沃森生物	19,000	994,840.00	0.44
43	601229	上海银行	118,200	981,060.00	0.44
44	000100	TCL 科技	153,600	952,320.00	0.42
45	600309	万华化学	18,909	945,260.91	0.42
46	603986	兆易创新	3,900	920,049.00	0.41
47	600009	上海机场	12,200	879,254.00	0.39
48	600588	用友网络	19,900	877,590.00	0.39
49	601169	北京银行	178,900	876,610.00	0.39
50	600690	海尔智家	49,200	870,840.00	0.39
51	000568	泸州老窖	9,500	865,640.00	0.39
52	002142	宁波银行	32,200	845,894.00	0.38
53	002241	歌尔股份	27,500	807,400.00	0.36
54	601899	紫金矿业	178,100	783,640.00	0.35
55	600104	上汽集团	45,700	776,443.00	0.35
56	000876	新希望	26,000	774,800.00	0.35
57	002230	科大讯飞	20,500	767,315.00	0.34
58	000338	潍柴动力	55,864	766,454.08	0.34
59	600703	三安光电	30,600	765,000.00	0.34
60	600383	金地集团	55,800	764,460.00	0.34
61	601766	中国中车	137,100	763,647.00	0.34
62	601939	建设银行	120,600	760,986.00	0.34

63	002027	分众传媒	136,400	759,748.00	0.34
64	601857	中国石油	176,000	737,440.00	0.33
65	002304	洋河股份	7,000	735,980.00	0.33
66	002594	比亚迪	10,200	732,360.00	0.33
67	600340	华夏幸福	30,300	692,658.00	0.31
68	300122	智飞生物	6,900	691,035.00	0.31
69	600028	中国石化	176,700	690,897.00	0.31
70	300014	亿纬锂能	14,234	681,096.90	0.30
71	000166	申万宏源	134,000	676,700.00	0.30
72	001979	招商蛇口	39,600	651,024.00	0.29
73	600999	招商证券	29,300	643,135.00	0.29
74	688399	硕世生物	2,290	636,620.00	0.28
75	002007	华兰生物	12,700	636,397.00	0.28
76	002410	广联达	9,100	634,270.00	0.28
77	600745	闻泰科技	4,800	604,560.00	0.27
78	300601	康泰生物	3,700	599,992.00	0.27
79	002555	三七互娱	12,700	594,360.00	0.26
80	300347	泰格医药	5,700	580,716.00	0.26
81	601628	中国人寿	20,800	565,968.00	0.25
82	000538	云南白药	6,000	562,860.00	0.25
83	600436	片仔癀	3,300	561,825.00	0.25
84	002271	东方雨虹	13,700	556,631.00	0.25
85	600547	山东黄金	15,200	556,624.00	0.25
86	600050	中国联通	114,600	554,664.00	0.25
87	600958	东方证券	58,000	550,420.00	0.25
88	603019	中科曙光	14,100	541,440.00	0.24
89	300003	乐普医疗	14,800	540,496.00	0.24
90	601006	大秦铁路	76,600	539,264.00	0.24
91	601088	中国神华	37,100	532,756.00	0.24
92	600019	宝钢股份	116,600	531,696.00	0.24
93	002460	赣锋锂业	9,900	530,343.00	0.24
94	601186	中国铁建	63,000	527,940.00	0.24
95	600406	国电南瑞	26,000	526,500.00	0.23
96	002129	中环股份	22,900	514,334.00	0.23
97	300124	汇川技术	13,500	512,865.00	0.23
98	603160	汇顶科技	2,300	512,670.00	0.23
99	002050	三花智控	23,400	512,460.00	0.23
100	000977	浪潮信息	13,000	509,340.00	0.23
101	601009	南京银行	69,069	506,275.77	0.23

102	000938	紫光股份	11,755	505,229.90	0.23
103	601390	中国中铁	99,400	498,988.00	0.22
104	000895	双汇发展	10,800	497,772.00	0.22
105	600438	通威股份	27,900	484,902.00	0.22
106	002624	完美世界	8,400	484,176.00	0.22
107	600196	复星医药	14,100	477,285.00	0.21
108	601933	永辉超市	50,800	476,504.00	0.21
109	300413	芒果超媒	7,300	475,960.00	0.21
110	600809	山西汾酒	3,200	464,000.00	0.21
110	601989	中国重工	116,000	464,000.00	0.21
111	601800	中国交建	63,200	463,888.00	0.21
112	002371	北方华创	2,700	461,457.00	0.21
113	300433	蓝思科技	16,400	459,856.00	0.21
114	002456	欧菲光	25,000	459,750.00	0.20
115	002044	美年健康	30,700	442,387.00	0.20
116	600183	生益科技	15,100	441,977.00	0.20
117	600015	华夏银行	72,100	441,252.00	0.20
118	601336	新华保险	9,700	429,516.00	0.19
119	600352	浙江龙盛	33,200	424,628.00	0.19
120	603501	韦尔股份	2,100	424,095.00	0.19
121	601377	兴业证券	61,743	422,939.55	0.19
122	002311	海大集团	8,800	418,792.00	0.19
123	002236	大华股份	21,400	411,094.00	0.18
124	000157	中联重科	63,500	408,305.00	0.18
125	002001	新和成	14,000	407,400.00	0.18
126	601901	方正证券	56,800	402,144.00	0.18
127	002024	苏宁易购	44,900	393,773.00	0.18
128	002841	视源股份	3,900	388,128.00	0.17
129	600741	华域汽车	18,400	382,536.00	0.17
130	601360	三六零	20,700	379,017.00	0.17
131	000783	长江证券	55,800	376,092.00	0.17
132	002463	沪电股份	15,000	374,700.00	0.17
133	002120	韵达股份	15,300	374,085.00	0.17
134	002008	大族激光	10,400	373,880.00	0.17
135	600522	中天科技	32,400	370,980.00	0.17
136	002602	世纪华通	23,900	365,909.00	0.16
137	600660	福耀玻璃	17,500	365,225.00	0.16
138	601138	工业富联	24,000	363,600.00	0.16
139	601225	陕西煤业	50,200	361,942.00	0.16

140	300408	三环集团	13,000	360,100.00	0.16
141	603993	洛阳钼业	97,700	358,559.00	0.16
142	603799	华友钴业	9,100	353,626.00	0.16
143	000860	顺鑫农业	6,200	353,276.00	0.16
144	600109	国金证券	30,900	352,569.00	0.16
145	603369	今世缘	8,800	350,152.00	0.16
146	601108	财通证券	34,100	349,525.00	0.16
147	000069	华侨城 A	57,600	349,056.00	0.16
148	300033	同花顺	2,600	346,008.00	0.15
149	601788	光大证券	21,200	340,472.00	0.15
150	601877	正泰电器	12,900	339,915.00	0.15
151	000425	徐工机械	54,500	322,095.00	0.14
152	002202	金风科技	32,300	322,031.00	0.14
153	601555	东吴证券	39,200	319,872.00	0.14
154	000066	中国长城	24,200	319,440.00	0.14
155	600346	恒力石化	22,613	316,582.00	0.14
156	300144	宋城演艺	18,100	313,130.00	0.14
157	002736	国信证券	27,600	311,880.00	0.14
158	600010	包钢股份	285,000	307,800.00	0.14
159	601669	中国电建	88,300	305,518.00	0.14
160	600487	亨通光电	18,400	301,944.00	0.13
161	002916	深南电路	1,800	301,536.00	0.13
162	000656	金科股份	36,600	298,656.00	0.13
163	601600	中国铝业	107,900	297,804.00	0.13
164	600332	白云山	9,200	297,436.00	0.13
165	000625	长安汽车	26,700	293,700.00	0.13
166	002157	正邦科技	16,500	288,420.00	0.13
167	601162	XD 天风证	47,500	287,850.00	0.13
168	600029	南方航空	55,600	287,452.00	0.13
169	600089	特变电工	42,000	284,340.00	0.13
170	002179	中航光电	6,900	282,969.00	0.13
171	600867	通化东宝	16,200	282,366.00	0.13
172	600886	国投电力	35,500	279,030.00	0.12
173	600893	航发动力	11,800	277,064.00	0.12
174	601727	上海电气	53,900	271,656.00	0.12
175	600061	国投资本	21,300	271,149.00	0.12
176	600926	杭州银行	30,100	268,492.00	0.12
177	688025	杰普特	4,655	267,662.50	0.12
178	600795	国电电力	143,300	265,105.00	0.12

179	601100	恒立液压	3,300	264,660.00	0.12
180	002601	龙鳞佰利	14,300	264,550.00	0.12
181	601985	中国核电	64,600	264,214.00	0.12
182	600705	中航资本	65,900	260,964.00	0.12
183	603658	安图生物	1,600	259,904.00	0.12
184	600176	中国巨石	28,000	256,200.00	0.11
185	601066	中信建投	6,500	255,970.00	0.11
186	688186	广大特材	7,459	254,724.85	0.11
187	600118	中国卫星	8,200	252,806.00	0.11
188	600011	华能国际	59,800	252,356.00	0.11
189	600111	北方稀土	27,000	251,640.00	0.11
190	600498	烽火通信	8,700	251,517.00	0.11
191	002493	荣盛石化	20,400	250,920.00	0.11
192	600637	东方明珠	25,900	249,935.00	0.11
193	002422	科伦药业	11,900	249,900.00	0.11
194	002607	中公教育	9,000	249,750.00	0.11
195	600606	绿地控股	40,000	247,200.00	0.11
196	601607	上海医药	13,300	244,454.00	0.11
197	601111	中国国航	36,600	241,926.00	0.11
198	000786	北新建材	11,200	238,896.00	0.11
199	000963	华东医药	9,400	237,820.00	0.11
200	600085	同仁堂	8,600	233,232.00	0.10
201	600170	上海建工	73,300	225,031.00	0.10
202	600271	航天信息	13,800	224,112.00	0.10
203	601816	京沪高铁	35,800	223,034.00	0.10
204	600177	雅戈尔	37,100	221,116.00	0.10
205	601618	中国中冶	87,900	220,629.00	0.10
206	000703	恒逸石化	24,100	220,033.00	0.10
207	000768	中航飞机	12,400	219,976.00	0.10
208	600390	五矿资本	31,000	218,860.00	0.10
209	600115	东方航空	51,800	218,596.00	0.10
210	600068	葛洲坝	36,100	214,795.00	0.10
211	601997	贵阳银行	29,800	213,368.00	0.10
212	601117	中国化学	38,900	213,172.00	0.10
213	603899	晨光文具	3,900	212,940.00	0.09
214	600004	白云机场	13,900	211,836.00	0.09
215	000728	国元证券	25,100	210,840.00	0.09
216	000596	古井贡酒	1,400	210,336.00	0.09
217	601658	邮储银行	45,700	208,849.00	0.09

218	600066	宇通客车	17,100	208,620.00	0.09
219	600233	圆通速递	14,100	205,296.00	0.09
220	600489	中金黄金	22,400	204,736.00	0.09
221	600516	方大炭素	32,100	201,588.00	0.09
222	601998	中信银行	38,700	199,305.00	0.09
223	000961	中南建设	22,100	196,690.00	0.09
224	601838	成都银行	24,600	195,816.00	0.09
225	002252	上海莱士	23,100	195,426.00	0.09
226	601919	中远海控	56,300	195,361.00	0.09
227	600018	上港集团	45,800	192,360.00	0.09
228	601881	中国银河	16,700	191,549.00	0.09
229	002673	西部证券	23,300	190,128.00	0.08
230	002508	老板电器	6,100	189,771.00	0.08
231	002739	万达电影	12,300	187,821.00	0.08
232	002146	荣盛发展	22,900	185,490.00	0.08
233	600998	九州通	9,600	178,752.00	0.08
234	600219	南山铝业	87,200	177,016.00	0.08
235	600297	广汇汽车	54,100	172,579.00	0.08
236	600369	西南证券	37,500	172,125.00	0.08
237	601878	浙商证券	17,100	169,461.00	0.08
238	601021	春秋航空	4,800	169,152.00	0.08
239	002958	青农商行	36,800	163,024.00	0.07
240	600760	中航沈飞	4,900	160,818.00	0.07
241	601319	中国人保	24,900	160,356.00	0.07
242	002773	康弘药业	3,200	158,720.00	0.07
243	600362	江西铜业	11,700	157,482.00	0.07
244	688111	金山办公	459	156,785.22	0.07
245	600299	安迪苏	12,800	156,416.00	0.07
246	002153	石基信息	4,000	156,120.00	0.07
247	002938	鹏鼎控股	3,100	155,186.00	0.07
248	600674	川投能源	16,700	154,809.00	0.07
249	002939	长城证券	12,400	152,768.00	0.07
250	600208	新潮中宝	51,000	151,980.00	0.07
251	603833	欧派家居	1,300	150,670.00	0.07
252	601018	宁波港	41,900	149,583.00	0.07
253	601992	金隅集团	48,700	149,022.00	0.07
254	603156	养元饮品	6,900	148,350.00	0.07
255	600655	豫园股份	16,600	147,076.00	0.07
256	688181	八亿时空	2,392	146,127.28	0.07

257	601231	环旭电子	6,600	144,144.00	0.06
258	600848	上海临港	6,600	141,702.00	0.06
259	600038	中直股份	3,400	139,638.00	0.06
260	601916	浙商银行	34,500	135,930.00	0.06
261	600482	中国动力	8,600	135,020.00	0.06
262	002032	苏泊尔	1,900	134,900.00	0.06
263	000671	阳光城	20,800	131,872.00	0.06
264	600027	华电国际	38,100	130,302.00	0.06
265	603392	万泰生物	785	129,525.00	0.06
266	600583	海油工程	27,500	125,125.00	0.06
267	000723	美锦能源	19,100	119,566.00	0.05
268	000709	河钢股份	55,900	114,036.00	0.05
269	002468	申通快递	6,900	113,229.00	0.05
270	002558	巨人网络	6,400	111,360.00	0.05
271	600977	中国电影	8,200	107,666.00	0.05
272	000627	天茂集团	20,600	107,326.00	0.05
273	600398	海澜之家	18,100	105,342.00	0.05
274	601577	长沙银行	13,200	104,808.00	0.05
275	003816	中国广核	34,800	103,008.00	0.05
276	601808	中海油服	7,700	101,178.00	0.05
277	601698	中国卫通	5,500	99,055.00	0.04
278	601633	长城汽车	12,700	98,044.00	0.04
279	601077	渝农商行	18,400	86,848.00	0.04
280	600372	中航电子	6,500	86,580.00	0.04
281	600025	华能水电	22,600	85,654.00	0.04
282	600188	兖州煤业	9,600	84,096.00	0.04
283	600928	西安银行	15,700	82,582.00	0.04
284	600989	宝丰能源	9,700	81,674.00	0.04
285	601898	中煤能源	21,400	81,320.00	0.04
286	000708	大冶特钢	4,400	75,196.00	0.03
287	601238	广汽集团	8,000	72,000.00	0.03
288	600968	海油发展	25,600	59,648.00	0.03
289	601212	白银有色	23,100	58,905.00	0.03
290	601828	美凯龙	5,100	54,009.00	0.02
291	300136	信维通信	1,000	53,020.00	0.02
292	603260	合盛硅业	1,700	46,478.00	0.02
293	300838	浙江力诺	909	22,243.23	0.01
294	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
295	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01

296	688357	建龙微纳	200	10,170.00	0.00
297	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00

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	16,397,413.84	6.20
2	600519	贵州茅台	14,124,565.50	5.34
3	600036	招商银行	9,894,988.00	3.74
4	600276	恒瑞医药	7,667,034.80	2.90
5	000858	五粮液	6,731,164.43	2.55
6	601166	兴业银行	6,292,174.00	2.38
7	600030	中信证券	6,283,513.00	2.38
8	000002	万科 A	6,246,881.48	2.36
9	600887	伊利股份	5,291,419.00	2.00
10	000001	平安银行	4,956,291.90	1.88
11	600016	民生银行	4,075,656.00	1.54
12	601328	交通银行	3,919,839.00	1.48
13	601288	农业银行	3,762,762.00	1.42
14	000333	美的集团	3,742,507.00	1.42
15	600000	浦发银行	3,541,512.00	1.34
16	000651	格力电器	3,509,814.00	1.33
17	601398	工商银行	3,308,954.00	1.25
18	600585	海螺水泥	3,037,599.00	1.15
19	600837	海通证券	2,944,487.00	1.11
20	600031	三一重工	2,793,158.50	1.06

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	601318	中国平安	14,565,865.00	5.51
2	600519	贵州茅台	12,046,360.09	4.56
3	600036	招商银行	8,286,600.23	3.14

4	600276	恒瑞医药	7,646,934.78	2.89
5	600030	中信证券	6,810,784.70	2.58
6	600887	伊利股份	5,127,919.93	1.94
7	000002	万科 A	4,090,225.21	1.55
8	601328	交通银行	3,933,995.00	1.49
9	601398	工商银行	3,771,101.80	1.43
10	601288	农业银行	3,666,424.00	1.39
11	000001	平安银行	3,503,078.38	1.33
12	600016	民生银行	3,234,338.00	1.22
13	000858	五粮液	3,124,294.00	1.18
14	600000	浦发银行	2,867,127.00	1.08
15	601166	兴业银行	2,843,077.00	1.08
16	600585	海螺水泥	2,680,436.52	1.01
17	601766	中国中车	2,523,618.00	0.95
18	600048	保利地产	2,467,552.00	0.93
19	601888	中国中免	2,355,643.20	0.89
20	601211	国泰君安	2,304,793.00	0.87

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	281,264,337.31
卖出股票收入（成交）总额	160,339,476.80

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	6,669,650.00	2.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,898,000.00	17.79
	其中：政策性金融债	39,898,000.00	17.79
4	企业债券	4,965,000.00	2.21
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	51,532,650.00	22.98

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	200201	20 国开 01	200,000	20,028,000.00	8.93
2	200204	20 国开 04	100,000	10,090,000.00	4.50
3	200202	20 国开 02	100,000	9,780,000.00	4.36
4	010107	21 国债(7)	65,000	6,669,650.00	2.97
5	163320	20 能源 03	50,000	4,965,000.00	2.21

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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持有股指期货。

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持有股指期货。

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 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

本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体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。

7.12.2 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股票。

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	52,982.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	573,784.75
5	应收申购款	236.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	627,004.50

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
华泰柏瑞新利混合 A	1,055	37,866.56	296,466.69	0.74%	39,652,751.32	99.26%
华泰柏瑞新利混合 C	13	12,935,887.87	168,068,245.27	99.94%	98,297.00	0.06%
合计	1,068	194,864.94	168,364,711.96	80.90%	39,751,048.32	19.10%

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）。

8.2 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	华泰柏瑞新利混合 A	27.00	0.0001%
	华泰柏瑞新利混合 C	0.00	0.0000%
	合计	27.00	0.0000%

8.3 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	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	华泰柏瑞新利混合 A	0
	华泰柏瑞新利混合 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞新利混合 A	0
	华泰柏瑞新利混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞新利混 合 A	华泰柏瑞新利混 合 C
基金合同生效日（2015 年 4 月 28 日）基金份 额总额	1,652,694,626.58	-
本报告期期初基金份额总额	183,056,597.66	66,157,663.92
本报告期基金总申购份额	5,144,404.75	172,914,237.89
减：本报告期基金总赎回份额	148,251,784.40	70,905,359.54
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	39,949,218.01	168,166,542.27

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本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

2020 年 2 月 10 日，经公司董事会批准程安至先生不再担任公司副总经理。
上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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

2020 年 3 月，公司收到上海证监局对公司采取责令改正措施的决定。公司高度重视，立即制定并实施相关整改措施，落实整改要求。2020 年 4 月公司完成整改事项并及时向监管机构提交整改报告。

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	
中信证券	3	191,348,088.58	43.53%	176,882.28	43.44%	-
方正证券	2	113,993,837.95	25.93%	106,166.02	26.07%	-
光大证券	2	58,732,243.27	13.36%	54,697.23	13.43%	-
安信证券	3	36,682,305.93	8.35%	33,948.10	8.34%	-
申港证券	2	21,759,488.98	4.95%	19,829.40	4.87%	-
长江证券	4	10,790,446.49	2.45%	9,834.84	2.42%	-
国金证券	1	4,940,001.06	1.12%	4,600.52	1.13%	-

银河证券	1	751,790.30	0.17%	700.19	0.17%	-
瑞银证券	2	370,126.16	0.08%	344.72	0.08%	-
中泰证券	2	142,444.00	0.03%	132.65	0.03%	-
民生证券	1	50,734.80	0.01%	46.24	0.01%	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	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, 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。

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
中信证券	4,000,599.60	7.23%	21,000,000.00	16.61%	-	-
方正证券	-	-	71,500,000.00	56.57%	-	-
光大证券	-	-	10,000,000.00	7.91%	-	-
安信证券	4,002,999.00	7.23%	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	6,814,505.30	12.31%	-	-	-	-
国金证券	-	-	3,900,000.00	3.09%	-	-
银河证券	-	-	15,000,000.00	11.87%	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	5,000,000.00	3.96%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	40,537,773.70	73.23%	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年6月30日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	证监会规定报刊和网站	2020年6月24日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于包商银行股份有限公司转让相关业务的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2020年5月26日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司费率	证监会规定报刊和网站	2020年4月1日

	优惠活动的公告		
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加和合期货有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 4 月 1 日
6	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	证监会规定报刊和网站	2020 年 3 月 19 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国国际期货有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 3 月 18 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金最低申购金额、最低赎回份额和最低持有份额的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 3 月 9 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 2 月 14 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 1 月 30 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加嘉实财富管理有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 1 月 9 日

§ 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	20200608-20200630	0.00	46,965,996.62	0.00	46,965,996.62	22.57%
	2	20200624-20200630	0.00	46,728,971.96	0.00	46,728,971.96	22.45%
	3	20200521-20200528	0.00	18,998,961.00	9,633,911.37	9,365,049.63	4.50%
	4	20200327-20200331	29,233,370.01	0.00	29,233,370.01	0.00	0.00%
	5	20200327-20200330	29,296,875.56	0.00	29,296,875.56	0.00	0.00%
	6	20200101-20200326	75,750,402.42	0.00	75,750,402.42	0.00	0.00%
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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

托管人住所

12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2020 年 8 月 29 日