

# 华泰柏瑞鼎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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>19</b>
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
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>59</b>
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.....	59

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞鼎利混合	
基金主代码	004010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 22 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	444,677,561.57 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞鼎利混合 A	华泰柏瑞鼎利混合 C
下属分级基金的交易代码:	004010	004011
报告期末下属分级基金的份额总额	261,728,342.48 份	182,949,219.09 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极灵活的合理资产配置，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金，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，结合宏观经济走势及市场分析，根据市场估值与流动性优选个股，重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中的股票
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	林兴盛
	联系电话	021-38601777	021-52629999-213707
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	linxingsheng@cib.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95561
传真		021-38601799	021-62159217
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	福州市湖东路 154 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199	上海市银城路 167 号兴业大厦 4

	弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	楼
邮政编码	200135	200120
法定代表人	贾波	高建平

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

## 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 弄上海证大五道口广场 1 号 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	华泰柏瑞鼎利混合 A	华泰柏瑞鼎利混合 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	11,554,691.57	2,228,607.71
本期利润	8,560,507.00	2,102,088.38
加权平均基金份额本期利润	0.0417	0.1559
本期加权平均净值利润率	3.65%	13.30%
本期基金份额净值增长率	3.42%	3.29%
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	40,309,723.60	32,758,353.49
期末可供分配基金份额利润	0.1540	0.1791
期末基金资产净值	307,049,319.84	219,245,510.92
期末基金份额净值	1.1732	1.1984
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	29.30%	31.96%

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

华泰柏瑞鼎利混合 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	2.06%	0.25%	3.31%	0.44%	-1.25%	-0.19%
过去三个月	4.10%	0.23%	5.80%	0.45%	-1.70%	-0.22%
过去六个月	3.42%	0.35%	1.58%	0.74%	1.84%	-0.39%
过去一年	13.22%	0.40%	5.81%	0.60%	7.41%	-0.20%
过去三年	24.99%	0.27%	11.17%	0.62%	13.82%	-0.35%
自基金合同生效起至今	29.30%	0.25%	15.90%	0.58%	13.40%	-0.33%

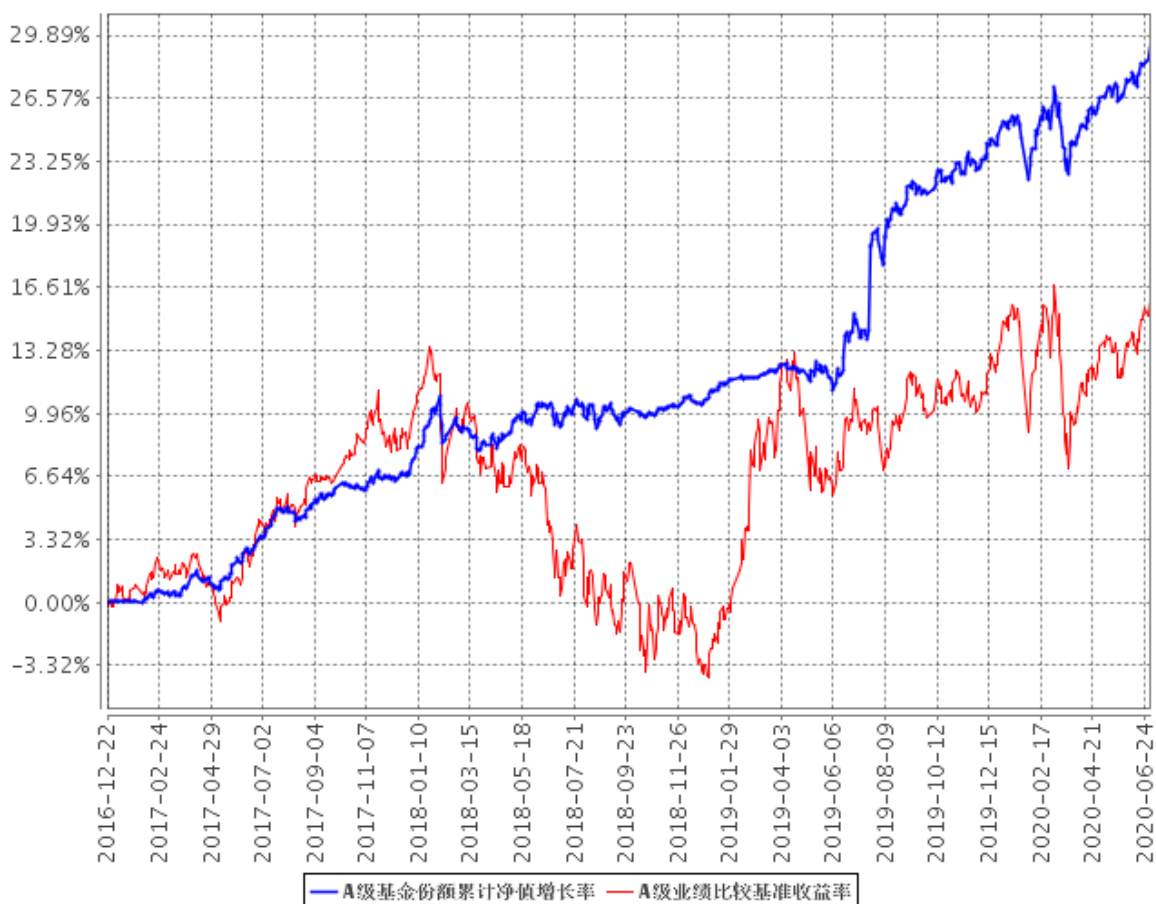


华泰柏瑞鼎利混合 C

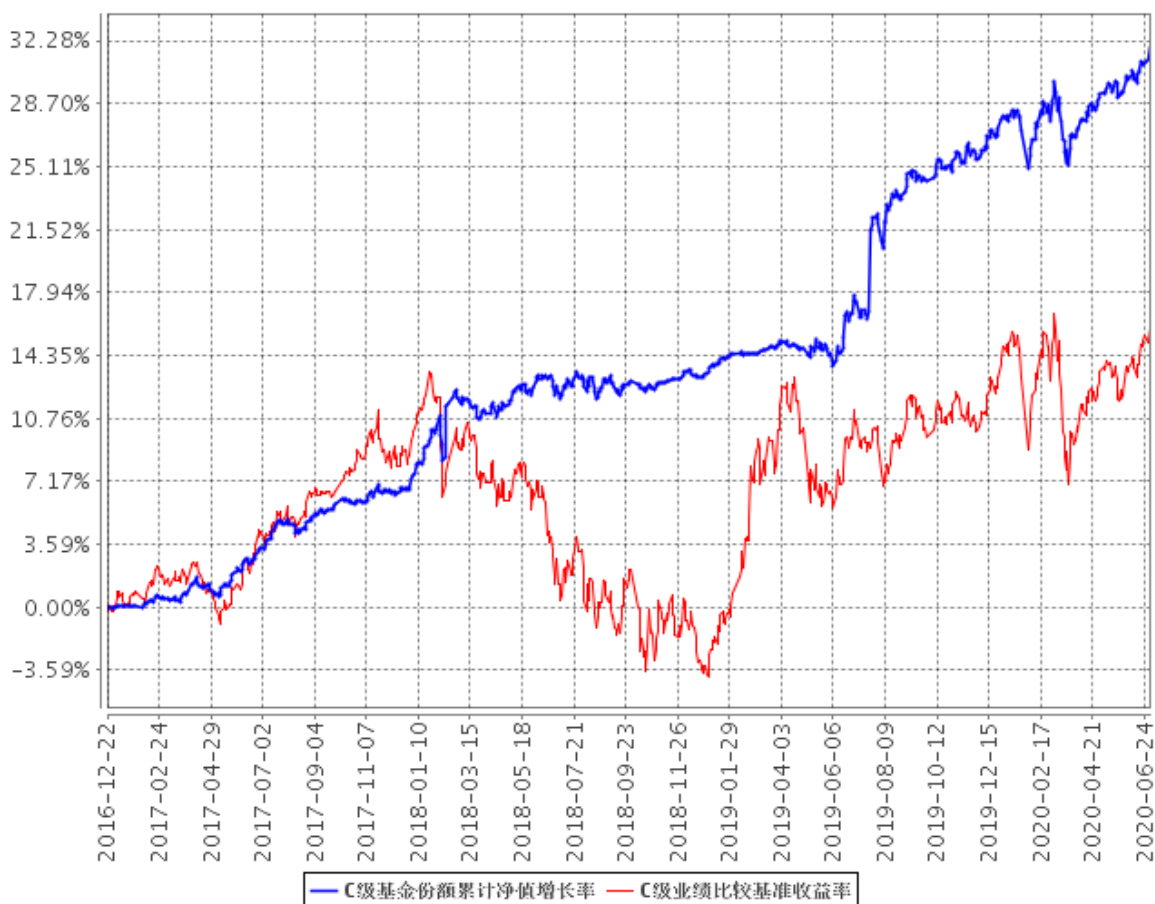
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.04%	0.25%	3.31%	0.44%	-1.27%	-0.19%
过去三个月	4.04%	0.23%	5.80%	0.45%	-1.76%	-0.22%
过去六个月	3.29%	0.35%	1.58%	0.74%	1.71%	-0.39%
过去一年	13.01%	0.40%	5.81%	0.60%	7.20%	-0.20%
过去三年	27.66%	0.29%	11.17%	0.62%	16.49%	-0.33%
自基金合同生效起至今	31.96%	0.27%	15.90%	0.58%	16.06%	-0.31%

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：图示日期为 2016 年 12 月 22 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 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞现代服务业混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、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 日起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、消费等部分必须消费品，对于金融、周期以及受疫情影响较大的线下领域表现较差。

本基金在报告期内保持上证 50 股票为主的配置。

#### 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鼎利混合 A 基金份额净值为 1.1732 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.42%；截至本报告期末华泰柏瑞鼎利混合 C 基金份额净值为 1.1984 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.29%；同期业绩比较基准收益率为 1.58%。

#### 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，本基金将更加注重在中报季对公司业绩质量的判断，自下而上挖掘个股，在组合方面剔除一些季报低于预期的品种，加入一些具备业绩持续超预期能力的个股及细分子行业。行业结构上，以消费和金融为主，科技精选个股为弹性。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 25%，基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本托管人依据《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》与《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》，自 2016 年 12 月 22 日起托管华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。

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

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞鼎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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,768,412.17	2,419,120.29
结算备付金		-	-
存出保证金		9,271.01	19,455.48
交易性金融资产	6.4.7.2	438,998,212.86	301,869,210.87
其中：股票投资		133,032,311.26	71,823,810.87
基金投资		-	-
债券投资		305,965,901.60	230,045,400.00
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	80,115,498.39	-
应收证券清算款		406,066.45	-
应收利息	6.4.7.5	4,459,607.41	3,034,523.06
应收股利		-	-
应收申购款		143,806.62	55,995.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		526,900,874.91	307,398,304.72
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	36,449,625.32
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		147,681.20	1,655.59
应付管理人报酬		152,136.80	136,859.28
应付托管费		38,034.21	34,214.84
应付销售服务费		11,003.98	9,086.81
应付交易费用	6.4.7.7	161,989.05	15,536.84
应交税费		5,691.31	13,494.33

应付利息		-	17,718.22
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,507.60	180,000.00
负债合计		606,044.15	36,858,191.23
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	444,677,561.57	237,652,592.32
未分配利润	6.4.7.10	81,617,269.19	32,887,521.17
所有者权益合计		526,294,830.76	270,540,113.49
负债和所有者权益总计		526,900,874.91	307,398,304.72

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞鼎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
<b>一、收入</b>		12,379,057.28	12,042,898.66
1.利息收入		3,314,549.77	6,613,451.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	29,951.03	47,466.95
债券利息收入		3,276,770.20	6,565,185.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,828.54	798.72
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,179,824.79	2,229,695.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,233,179.22	1,106,653.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	92,814.00	712,547.91
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	853,831.57	410,494.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,120,703.90	3,199,738.75
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	5,386.62	12.58
<b>减：二、费用</b>		1,716,461.90	2,569,898.61

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	757,813.56	973,502.34
2. 托管费	6.4.10.2.2	189,453.35	243,375.54
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	23,670.97	326.91
4. 交易费用	6.4.7.19	270,264.19	487,796.75
5. 利息支出		360,335.76	652,234.10
其中：卖出回购金融资产支出		360,335.76	652,234.10
6. 税金及附加		3,600.81	9,293.81
7. 其他费用	6.4.7.20	111,323.26	203,369.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,662,595.38	9,473,000.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,662,595.38	9,473,000.05

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞鼎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）	237,652,592.32	32,887,521.17	270,540,113.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,662,595.38	10,662,595.38
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）	207,024,969.25	38,067,152.64	245,092,121.89
其中：1.基金申购款	243,445,535.16	44,049,867.90	287,495,403.06
2.基金赎回款	-36,420,565.91	-5,982,715.26	-42,403,281.17
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	444,677,561.57	81,617,269.19	526,294,830.76

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
	(基金净值)		
一、期初所有者权益 (基金净值)	400,080,479.01	1,601,132.86	401,681,611.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,473,000.05	9,473,000.05
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)	-199,048,871.76	-3,792,643.78	-202,841,515.54
其中：1.基金申购款	74,929.26	2,834.30	77,763.56
2.基金赎回款	-199,123,801.02	-3,795,478.08	-202,919,279.10
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)	201,031,607.25	7,281,489.13	208,313,096.38

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

华泰柏瑞鼎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[2016]2810号《关于核准华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币200,025,020.14元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1676号验资报告予

以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,030,522.42 份基金份额,其中认购资金利息折合 5,502.28 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞鼎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)、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 $\times$ 50%+中债综合指数收益率 $\times$ 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 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

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 报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。



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

(c)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(d)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

#### 6.4.7 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	2,768,412.17
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：	2,768,412.17

##### 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	129,131,045.67	133,032,311.26	3,901,265.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	3,005,002.00	3,004,401.60	-600.40

	银行间市场	302,316,218.91	302,961,500.00	645,281.09
	合计	305,321,220.91	305,965,901.60	644,680.69
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		434,452,266.58	438,998,212.86	4,545,946.28

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	80,115,498.39	-
合计	80,115,498.39	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

### 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	12,417.88
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	-
应收债券利息	4,439,356.79
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	7,828.54
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	4.20

合计	4,459,607.41
----	--------------

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 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	148,242.02
银行间市场应付交易费用	13,747.03
合计	161,989.05

#### 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

华泰柏瑞鼎利混合 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	200,996,768.60	200,996,768.60
本期申购	60,825,425.80	60,825,425.80
本期赎回(以“-”号填列)	-93,851.92	-93,851.92
- 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	261,728,342.48	261,728,342.48

金额单位：人民币元

华泰柏瑞鼎利混合 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	36,655,823.72	36,655,823.72
本期申购	182,620,109.36	182,620,109.36
本期赎回(以“-”号填列)	-36,326,713.99	-36,326,713.99
- 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	182,949,219.09	182,949,219.09

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞鼎利混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,029,452.96	6,986,159.83	27,015,612.79
本期利润	11,554,691.57	-2,994,184.57	8,560,507.00
本期基金份额交易产生的变动数	8,725,579.07	1,019,278.50	9,744,857.57
其中：基金申购款	8,736,790.05	1,021,036.38	9,757,826.43
基金赎回款	-11,210.98	-1,757.88	-12,968.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,309,723.60	5,011,253.76	45,320,977.36

单位：人民币元

华泰柏瑞鼎利混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,577,784.54	1,294,123.84	5,871,908.38
本期利润	2,228,607.71	-126,519.33	2,102,088.38
本期基金份额交易产生的变动数	25,951,961.24	2,370,333.83	28,322,295.07
其中：基金申购款	30,828,862.22	3,463,179.25	34,292,041.47
基金赎回款	-4,876,900.98	-1,092,845.42	-5,969,746.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,758,353.49	3,537,938.34	36,296,291.83

### 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	29,675.72
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	187.85
其他	87.46
合计	29,951.03

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	67,009,931.31
减：卖出股票成本总额	55,776,752.09
买卖股票差价收入	11,233,179.22

### 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	92,814.00
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	92,814.00

### 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	104,052,251.64
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	101,744,486.00
减：应收利息总额	2,214,951.64
买卖债券差价收入	92,814.00

### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

### 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	853,831.57
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	853,831.57

#### 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	-3,120,703.90
——股票投资	-3,094,045.37
——债券投资	-26,658.53
——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	-3,120,703.90

#### 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	5,386.62
合计	5,386.62

### 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	267,881.69
银行间市场交易费用	2,382.50
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	270,264.19

### 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	3,215.66
银行间账户服务费	18,600.00
合计	111,323.26

## 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

截至资产负债表日，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	基金管理人
兴业银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

## 6.4.10 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

金额单位：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	
	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	183,564,927.41	100.00%	5,029,238.36	100.00%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本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。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	169,657.59	100.00%	148,242.02	100.00%
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	307,814.20	100.00%	212,238.38	100.00%

### 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	757,813.56	973,502.34
其中：支付销售机构的客户维护费	12,929.28	293.21

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 0.60%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 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	189,453.35	243,375.54

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

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

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.3 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

	华泰柏瑞鼎利混合 A	华泰柏瑞鼎利混合 C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	35.19	35.19
华泰柏瑞基金管理有限 公司	0.00	9,197.44	9,197.44
合计	0.00	9,232.63	9,232.63
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		
	华泰柏瑞鼎利混合 A	华泰柏瑞鼎利混合 C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	74.34	74.34
华泰柏瑞基金管理有限 公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	74.34	74.34

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 0.25% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 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：本报告期与上年度可比期间，未与关联方进行银行间同业市场的债券和回购交易。

#### 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

华泰柏瑞鼎利混合 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	12,958,795.75	2.9142%	0.00	0.0000%

##### 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
兴业银行	2,768,412.17	29,675.72	2,244,014.04	42,933.58

##### 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：无。

##### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：无。

##### 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:	期末 成本总额	期末估值总 额	备注

							股)			
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
688466	金科环境	2020年4月27日	2020年11月9日	新股锁定期内	24.61	36.59	4,907	120,761.27	179,547.13	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.3 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为零元。

##### 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为 0 元。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 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兴业银行股份有限公司，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	10,070,000.00	10,043,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	35,894,901.60	14,008,400.00
合计	45,964,901.60	24,051,400.00

注：未评级的债券包括国债、政策性金融债、短期融资券。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

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	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	97,238,000.00	155,500,000.00
合计	97,238,000.00	155,500,000.00

注：同业存单信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 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	162,763,000.00	40,596,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	9,898,000.00
合计	162,763,000.00	50,494,000.00

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

#### 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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



券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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 0.07%。

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、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，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 2020年6月 30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	2,768,412.17	-	-	-	-	-	2,768,412.17
存出保证金	9,271.01	-	-	-	-	-	9,271.01
交易性金融资产	19,775,000.00	71,003,401.60	52,424,500.00	162,763,000.00	-	-133,032,311.26	438,998,212.86
买入返售金融资产	80,115,498.39	-	-	-	-	-	80,115,498.39
应收证券清算款	-	-	-	-	-	406,066.45	406,066.45
应收利息	-	-	-	-	-	4,459,607.41	4,459,607.41
应收申购款	-	-	-	-	-	143,806.62	143,806.62
资产总计	102,668,181.57	71,003,401.60	52,424,500.00	162,763,000.00	-	-138,041,791.74	526,900,874.91
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	147,681.20	147,681.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	152,136.80	152,136.80
应付托管费	-	-	-	-	-	38,034.21	38,034.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	11,003.98	11,003.98
应付交易费用	-	-	-	-	-	161,989.05	161,989.05
应交税费	-	-	-	-	-	5,691.31	5,691.31
其他负债	-	-	-	-	-	89,507.60	89,507.60
负债总计	-	-	-	-	-	606,044.15	606,044.15
利率敏感度缺口	102,668,181.57	71,003,401.60	52,424,500.00	162,763,000.00	-	-137,435,747.59	526,294,830.76
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	2,419,120.29	-	-	-	-	-	2,419,120.29
存出保证金	19,455.48	-	-	-	-	-	19,455.48
交易性金融资产	14,008,400.00	9,929,000.00	155,614,000.00	40,596,000.00	9,898,000.00	71,823,810.87	301,869,210.87
应收利息	-	-	-	-	-	3,034,523.06	3,034,523.06
应收申购款	-	-	-	-	-	55,995.02	55,995.02
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	16,446,975.77	9,929,000.00	155,614,000.00	40,596,000.00	9,898,000.00	74,914,328.95	307,398,304.72
负债							
卖出回购金融资产款	36,449,625.32	-	-	-	-	-	36,449,625.32
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,655.59	1,655.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	136,859.28	136,859.28
应付托管费	-	-	-	-	-	34,214.84	34,214.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,086.81	9,086.81
应付交易费用	-	-	-	-	-	15,536.84	15,536.84
应付利息	-	-	-	-	-	17,718.22	17,718.22
应交税费	-	-	-	-	-	13,494.33	13,494.33
其他负债	-	-	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	36,449,625.32	-	-	-	-	408,565.91	36,858,191.23
利率敏感度缺口	-20,002,649.55	9,929,000.00	155,614,000.00	40,596,000.00	9,898,000.00	74,505,763.04	270,540,113.49

#### 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	778,822.92	621,467.74
市场利率上升25个基点	-773,981.66	-614,557.69	

#### 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。

##### 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	133,032,311.26	25.28	71,823,810.87	26.55
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	133,032,311.26	25.28	71,823,810.87	26.55

#### 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%	6,599,810.44	3,213,559.02
	沪深 300 指数下降 5%	-6,599,810.44	-3,213,559.02

#### 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

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	133,032,311.26	25.25
	其中：股票	133,032,311.26	25.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	305,965,901.60	58.07
	其中：债券	305,965,901.60	58.07
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	80,115,498.39	15.21
	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	2,768,412.17	0.53
8	其他各项资产	5,018,751.49	0.95
9	合计	526,900,874.91	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	2,723,393.20	0.52
B	采矿业	-	-
C	制造业	73,447,665.02	13.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,344,620.80	1.02
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	13,357,725.34	2.54
J	金融业	25,474,109.00	4.84
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,615,155.20	0.50

N	水利、环境和公共设施管理业	179,547.13	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,569,178.25	0.49
Q	卫生和社会工作	5,299,620.00	1.01
R	文化、体育和娱乐业	2,008,531.00	0.38
S	综合	-	-
	合计	133,032,311.26	25.28

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600036	招商银行	189,000	6,373,080.00	1.21
2	601398	工商银行	634,900	3,161,802.00	0.60
3	300433	蓝思科技	109,173	3,061,210.92	0.58
4	688111	金山办公	8,567	2,926,315.86	0.56
5	300454	深信服	14,013	2,886,117.48	0.55
6	300685	艾德生物	37,440	2,881,382.40	0.55
7	600529	山东药玻	49,599	2,876,742.00	0.55
8	002555	三七互娱	61,385	2,872,818.00	0.55
9	002475	立讯精密	54,340	2,790,359.00	0.53
10	300316	晶盛机电	112,609	2,785,946.66	0.53
11	000739	普洛药业	119,100	2,773,839.00	0.53
12	002216	三全食品	115,800	2,767,620.00	0.53
13	300750	宁德时代	15,800	2,754,888.00	0.52
14	300033	同花顺	20,700	2,754,756.00	0.52
15	002041	登海种业	215,288	2,723,393.20	0.52
16	000858	五粮液	15,900	2,720,808.00	0.52
17	002242	九阳股份	72,706	2,709,752.62	0.51
18	000513	丽珠集团	56,400	2,707,764.00	0.51
19	300476	胜宏科技	112,406	2,703,364.30	0.51
20	000333	美的集团	45,105	2,696,827.95	0.51
21	603939	益丰药房	29,600	2,693,600.00	0.51
22	600298	安琪酵母	54,300	2,686,764.00	0.51
23	002705	新宝股份	73,469	2,680,149.12	0.51

24	002311	海大集团	56,300	2,679,317.00	0.51
25	002332	仙琚制药	158,700	2,672,508.00	0.51
26	600763	通策医疗	16,000	2,668,320.00	0.51
27	002050	三花智控	121,100	2,652,090.00	0.50
28	603233	大参林	32,640	2,651,020.80	0.50
29	600809	山西汾酒	18,200	2,639,000.00	0.50
30	603882	金城医学	29,400	2,631,300.00	0.50
31	002013	中航机电	331,897	2,621,986.30	0.50
32	603259	药明康德	27,072	2,615,155.20	0.50
33	603288	海天味业	20,800	2,587,520.00	0.49
34	600885	宏发股份	64,424	2,584,690.88	0.49
35	002607	中公教育	92,583	2,569,178.25	0.49
36	600862	中航高科	151,500	2,563,380.00	0.49
37	601288	农业银行	751,800	2,541,084.00	0.48
38	600183	生益科技	86,500	2,531,855.00	0.48
39	603517	绝味食品	35,500	2,511,270.00	0.48
40	600519	贵州茅台	1,702	2,489,821.76	0.47
41	603456	九洲药业	89,500	2,425,450.00	0.46
42	600016	民生银行	417,500	2,367,225.00	0.45
43	600000	浦发银行	207,300	2,193,234.00	0.42
44	300251	光线传媒	184,100	2,008,531.00	0.38
45	002624	完美世界	29,200	1,683,088.00	0.32
46	601328	交通银行	323,700	1,660,581.00	0.32
47	000001	平安银行	120,600	1,543,680.00	0.29
48	601818	光大银行	322,300	1,153,834.00	0.22
49	002142	宁波银行	37,300	979,871.00	0.19
50	601229	上海银行	117,100	971,930.00	0.18
51	601169	北京银行	174,300	854,070.00	0.16
52	601939	建设银行	112,900	712,399.00	0.14
53	688399	硕世生物	2,290	636,620.00	0.12
54	601009	南京银行	70,700	518,231.00	0.10
55	600015	华夏银行	72,400	443,088.00	0.08
56	688369	致远互联	2,970	234,630.00	0.04
57	688466	金科环境	4,907	179,547.13	0.03
58	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
59	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
60	603087	甘李药业	753	75,525.90	0.01
61	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	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	300750	宁德时代	2,716,937.00	1.00
2	300433	蓝思科技	2,706,728.27	1.00
3	300316	晶盛机电	2,694,787.82	1.00
4	002555	三七互娱	2,693,641.55	1.00
5	000858	五粮液	2,685,288.00	0.99
6	002242	九阳股份	2,684,097.44	0.99
7	300685	艾德生物	2,682,260.60	0.99
8	002050	三花智控	2,678,819.40	0.99
9	000333	美的集团	2,676,891.43	0.99
10	002216	三全食品	2,672,562.00	0.99
11	300476	胜宏科技	2,668,268.42	0.99
12	300454	深信服	2,661,278.05	0.98
13	002311	海大集团	2,653,582.00	0.98
14	000513	丽珠集团	2,647,155.00	0.98
15	002013	中航机电	2,646,455.54	0.98
16	300033	同花顺	2,645,357.00	0.98
17	002475	立讯精密	2,639,925.00	0.98
18	002705	新宝股份	2,637,781.89	0.98
19	002607	中公教育	2,637,677.24	0.97
20	000739	普洛药业	2,625,636.00	0.97

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	11,126,343.60	4.11
2	600519	贵州茅台	7,487,911.94	2.77
3	600276	恒瑞医药	4,230,948.49	1.56
4	600030	中信证券	3,707,795.00	1.37
5	600887	伊利股份	2,561,584.00	0.95

6	601888	中国中免	1,726,193.00	0.64
7	600585	海螺水泥	1,543,643.65	0.57
8	688099	晶晨股份	1,335,013.65	0.49
9	600048	保利地产	1,325,961.64	0.49
10	601601	中国太保	1,263,931.00	0.47
11	601766	中国中车	1,226,022.00	0.45
12	601988	中国银行	1,225,410.00	0.45
13	600309	万华化学	1,095,896.42	0.41
14	601211	国泰君安	1,094,639.53	0.40
15	600690	海尔智家	907,426.77	0.34
16	600104	上汽集团	897,695.00	0.33
17	601186	中国铁建	859,682.00	0.32
18	601390	中国中铁	855,088.00	0.32
19	600703	三安光电	848,583.00	0.31
20	688396	华润微	797,967.70	0.29

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	120,079,297.85
卖出股票收入（成交）总额	67,009,931.31

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	12,876,500.00	2.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,025,401.60	2.47
	其中：政策性金融债	13,025,401.60	2.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,063,000.00	3.81
6	中期票据	162,763,000.00	30.93
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	97,238,000.00	18.48
9	其他	-	-
10	合计	305,965,901.60	58.14

## 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	101900256	19 河钢集 MTN003	300,000	30,849,000.00	5.86
2	101900209	19 兖矿 MTN001A	300,000	30,474,000.00	5.79
3	101900843	19 中化工 MTN002	300,000	30,387,000.00	5.77
4	111913061	19 浙商银行 CD061	300,000	29,139,000.00	5.54
5	101900282	19 鞍钢 MTN001	200,000	20,392,000.00	3.87

## 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票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。

### 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	9,271.01
2	应收证券清算款	406,066.45
3	应收股利	-
4	应收利息	4,459,607.41
5	应收申购款	143,806.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,018,751.49

### 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：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 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
华泰柏瑞鼎利混合 A	157	1,667,059.51	261,149,737.07	99.78%	578,605.41	0.22%
华泰柏瑞鼎利混合 C	4,324	42,310.18	175,176,071.69	95.75%	7,773,147.40	4.25%
合计	4,472	99,435.95	436,325,808.76	98.12%	8,351,752.81	1.88%

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	华泰柏瑞鼎利混合 A	345.20	0.0001%
	华泰柏瑞鼎利混合 C	229.46	0.0001%
	合计	574.66	0.0001%

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

---

	合计	0
--	----	---

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞鼎利混 合 A	华泰柏瑞鼎利混 合 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 22 日）基金 份额总额	200,007,488.26	23,034.16
本报告期期初基金份额总额	200,996,768.60	36,655,823.72
本报告期基金总申购份额	60,825,425.80	182,620,109.36
减：本报告期基金总赎回份额	93,851.92	36,326,713.99
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	261,728,342.48	182,949,219.09

## § 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	
华泰证券	2	183,564,927.41	100.00%	169,657.59	100.00%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

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

1) 具有相应的业务经营资格；



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

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

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

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	3,005,002.00	100.00%	10,600,000.00	100.00%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

**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聘任华泰柏瑞鼎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
2	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
3	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
4	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	证监会规定报刊和网站	2020年3月18日

	的公告		
5	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
6	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 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	20200101-20200630	200,825,661.85	0.00	0.00	200,825,661.85	45.16%
	2	20200624-20200630	0.00	168,222,726.89	0.00	168,222,726.89	37.83%
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

注：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 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

### 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2020 年 8 月 29 日