华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:2018年8月25日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

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

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞健康生活混合
基金主代码	001298
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月18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	795,617,485.20份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过深入研究,本基金投资于健康生活相关行业优质的成长性公司,在有效控制风险的前提下,力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为灵活配置混合型基金,基金管理人将跟踪宏观经济变量和国家财政、税收和货币政策等指标,判断经济周期的阶段和未来经济发展的趋势,研究预测宏观经济和国家政策等因素对证券市场的影响,分析比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征,估计各子资产类的相关性矩阵,并在此基础上确定基金资产在各类别资产间的分配比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数×20%
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs400888000140huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层及托管人住所

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	18,385,220.88
本期利润	-83,588,013.92
加权平均基金份额本期利润	-0.0995
本期基金份额净值增长率	-11.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2406
期末基金资产净值	604,215,318.36
期末基金份额净值	0.759

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

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

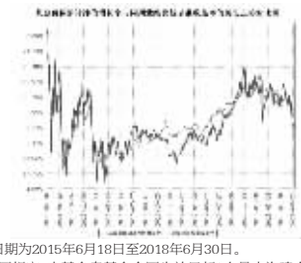
3、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.66%	1.99%	-6.07%	1.03%	-2.59%	0.96%
过去三个月	-10.18%	1.62%	-7.70%	0.91%	-2.48%	0.71%
过去六个月	-11.95%	1.59%	-9.83%	0.92%	-2.12%	0.67%
过去一年	0.53%	1.40%	-2.64%	0.76%	3.17%	0.64%
过去三年	-17.77%	2.06%	-14.81%	1.19%	-2.96%	0.87%
自合同生效日至今	-24.10%	2.09%	-23.61%	1.25%	-0.49%	0.84%

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



注:图示日期为2015年6月18日至2018年6月30日。

按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条(二)投资范围:本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%,其中投资于健康生活主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准,于2004年11月18日成立的合资基金管理公司,注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司(原AIGGIC)和苏州新区高新技术产业股份有限公司,出资比例分别为49%、49%和2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选30灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金。截至2018年6月30日,公司基金管理规模为886.17亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
吕慧建	投资部总监、本基金的基金经理	2015年6月18日	-	20年	经济学硕士。20年证券(基金)从业经历,新加坡国立大学MBA。历任中大投资管理有限公司行业研究员及中信基金管理有限公司的行业研究员。2007年6月加入本公司,任高级行业研究员,2007年11月起担任基金经理助理,自2009年11月起担任华泰柏瑞(原友邦华泰)行业领先混合基金经理。2015年6月起任投资部总监与华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
徐晓杰	本基金的基金经理	2015年6月18日	2018年5月30日	12年	博士研究生,12年证券(基金)从业经历。2006年7月至2007年9月任邦联资产管理有限公司研究员;2007年9月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2014年4月至2015年5月任研究部总监助理。2015年5月至2018年5月任华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金的基金经理。2015年6月至2018年5月任华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年10月起任华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年8月起任华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年6月起任华泰柏瑞医疗健康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。任职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定,在严格控制风险的基础上,忠实履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离,实行集中交易制度,由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务,为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况,不同业务类别的投资经理之间互不干扰,独立做出投资决策。公司机构设置合理,公平交易的相关管理制度健全,投资决策流程完善,各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待,不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现,报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查,交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制,风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内,该制度执行情况良好,无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中,均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期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

2018年上半年中国经济整体保持平稳运行,一季度、二季度的GDP增速分别为6.8%、6.7%,工业生产、投资、消费、进出口指标基本稳定,但是从边际变化的角度看,多项指标呈现小幅回落势态。

受金融去杠杆、表外资产回表影响,人民币贷款增速继续保持在13%左右的情况下,M2增速持续下行,7月份增速为8.5%,货币环境相对较紧。

2018年上半年一些非经常性因素对经济形势、A股市场走势产生了较大影响。年初,在环保高压政策影响下,加上春节在公历二月份、三月份举行两会,节后各地复工较晚,大宗原材料需求较弱,钢铁、煤炭等产品期货价格在春节后大幅回落。二季度,监管层推出大力发展CDR政策规划,大力发行独角兽基金,加剧了市场对于资金供求恶化的担心。国家有关部门调整棚改房政策,也引发了市场对于地产产业链需求下降的担忧。

中国经济整体上呈现底部盘整势态,A股市场资金供求保持在一种脆弱的平衡状态。一系列局部政策因素变化打破了这种平衡。二季度,中美贸易争端持续发酵并走向对抗,市场情绪进一步恶化,A股市场出现加速下跌走势。

2018年上半年A股市场轮番下跌。年初,银行、地产等周期性板块快速上涨,拉动指数上行,上证指数最高见于3587点。随后,受春节后大宗商品价格下跌影响,上证指数出现暴跌。在一季度、二季度末,随着中美贸易争端爆发、加剧,A股市场再度大跌,上证指数最低见于2691点,创出16年初2638点以来新低。

2018年以来,我们在基金操作上出现了一些问题。首先,我们低估了A股市场下跌幅度巨大的风险;其次,我们以选股为核心的操作策略和市场走势特征出现了很大的不匹配。A股市场上半年走势的主要特征是行业分化,弱势行业个股全面下跌且跌幅较大。2018年以来,医药、休闲服务、食品等少数行业存在板块机会,计算机、军工等个别行业阶段性机会,钢铁、水泥在年初大幅下跌后走势较强,其他行业基本上全军覆没,且跌幅较大。由于基金操作以选股为核心,持仓个股分布在互联网、光伏、新能源汽车、家电、零售等多个行业,持仓中除了食品行业表现较好、服装行业有阶段性防御性,较多持仓个股出现了较大幅度下跌,净值表现较弱。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.759元;本报告期基金份额净值增长率为-11.95%,业绩比较基准收益率为-9.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济仍然在底部盘整、结构调整为主要特征,经济运行有很强的韧性。但是,18年以来,经济走势出现走弱的迹象。考虑到中美贸易冲突影响的不确定性,中国政府已经着手对经济政策进行微调,在维持去杠杆大政方向的前提下,货币政策有所放松,并启动更为积极的财政刺激政策。

中国经济现阶段的核心特征三去一降一补。推进去杠杆导致资金紧张、利率保持较高水平。目前,去杠杆已经取得重要进展,货币政策边际放松的背景下,8月份以来市场利率已经有较大下降。

中美贸易争端是目前市场关注的焦点。这一事件发展将推动全球经济规则、产业格局的重新调整,影响是长期的,对经济活动的抑制效应将逐步体现。中国民众、知识精英、舆论意见对中国经济在全球经济体系中的竞争优势、抗压能力普遍缺乏自信和信心,这种情绪投射在A股市场,表现为预期过度悲观,并在短期内难以扭转。

我们认为,目前A股市场很多公司的估值已经具有长期投资价值,2700点以下的下行空间是有限的,A股市场可能在构建一个中长期底部。但是,由于中国经济转型前景尚未明朗,各种悲观情绪难以扭转,市场上行动力仍然微弱。所以,A股市场有可能出现底部盘整走势,机会主要体现为阶段性反弹行情。

18年以来,各地出现P2P倒闭、部分理财产品不能如期兑付,对民间财富形成破坏,对股市的资金供给形成负面影响。

在目前市场环境下,股价涨跌逻辑变得非常短视,公司核心竞争力、长期发展潜力等因素难以在股价走势中充分体现,我们以选股为核心投资策略可能难有突出表现。我们将继续坚持以选股为核心、追求长期合理回报为目标的投资策略,同时在现阶段适当加大波段操作力度,争取在净值表现上有所改善和提高。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定,在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至多12次;每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的25%;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。截止本报告期末,本基金可分配收益为0元。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注:无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在华泰柏瑞健康生活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。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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:华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		30,728,044.24	41,908,226.26
结算备付金		760,271.00	713,451.71
存出保证金		180,089.59	170,971.37
交易性金融资产		573,244,570.97	737,190,806.41
其中:股票投资		573,244,570.97	735,632,206.41
基金投资		-	-
债券投资		-	1,558,600.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		8,890,276.33	8,540,215.59
应收利息		7,003.12	10,228.67
应收股利		-	-
应收申购款		38,702.59	14,686.68
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		613,848,952.84	788,548,586.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,855,173.39	5,090,133.75
应付赎回款		98,788.41	1,369,087.33
应付管理人报酬		779,908.16	1,001,049.79
应付托管费		129,984.69	166,841.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		581,821.53	948,951.97
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		187,958.30	384,132.15
负债合计		9,633,634.48	8,960,196.66
所有者权益:			
实收基金		795,617,485.20	904,485,690.49
未分配利润		-191,402,166.84	-124,897,300.46
所有者权益合计		604,215,318.36	779,588,390.03
负债和所有者权益总计		613,848,952.84	788,548,586.69

注:报告截止日2018年6月30日,华泰柏瑞健康生活基金份额净值0.759元,基金份额总额795,617,485.20份。

6.2 利润表

会计主体:华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-75,186,105.39	107,729,839.08
1.利息收入		147,970.33	186,631.78
其中:存款利息收入		147,801.21	186,631.78
债券利息收入		169.12	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		26,612,039.26	-266,891.55
其中:股票投资收益		23,632,768.19	-4,748,470.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-60,675.66	-
资产支持证券投资收益		-	-
贷金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		3,039,946.73	4,481,578.45
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-101,973,234.80	107,730,063.45
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		27,119.82	80,035.40
减:二、费用		8,401,908.53	10,154,221.63
1.管理人报酬		5,184,253.78	6,339,722.59
2.托管费		864,042.31	1,056,620.46
3.销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4.交易费用		2,148,327.14	2,544,859.98
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附件		-	-
7.其他费用		205,284.69	213,018.60
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-83,588,013.92	97,575,617.45
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-83,588,013.92	97,575,617.45

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	904,485,690.49	-124,897,300.46	779,588,390.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-83,588,013.92	-83,588,013.92
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)	-108,868,205.29	17,083,147.54	-91,785,057.75
其中:1.基金申购款	9,201,026.41	-1,690,703.27	7,510,323.14
2.基金赎回款	-118,069,231.70	18,773,850.81	-99,295,380.89
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)	795,617,485.20	-191,402,166.84	604,215,318.36
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,289,337,723.97	-421,306,547.54	868,031,176.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	97,575,617.45	97,575,617.45
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)	-176,171,083.10	50,698,710.43	-125,472,372.67
其中:1.基金申购款	4,001,220.51	-1,175,553.92	2,825,666.59
2.基金赎回款	-180,172,303.61	51,874,264.35	-128,298,039.26
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)	1,113,166,640.87	-273,032,219.66	840,134,421.21

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

华泰柏瑞健康生活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]920号《关于准予华泰柏瑞健康生活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《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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1,903,380,770.67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784号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年6月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,903,644,804.44份基金份额,其中认购资金利息折合264,033.77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《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》、《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和最新公布的《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票市值占基金资产净值的0%-95%;其中其中投资于健康生活主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的80%;本基金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,应当保持不低于基金资产净值5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+上证国债指数×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2018年8月25日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞健康生活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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金在本报告期间无重大会计差错。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注:关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注:本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的股票交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,184,253.78	6,339,722.59
其中:支付销售机构的客户维护费	2,341,730.00	2,863,833.87

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1.50%的年费率计提,计算方法如下:

H = E × 1.50% ÷ 当年天数

H为每日应支付的管理人报酬

E为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	864,042.31	1,056,620.46

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0.25%的年费率计提,计算方法如下:

H = E × 0.25% ÷ 当年天数

H为每日应支付的托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.2.3 销售服务费

注:本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

6.4.8.3