华泰柏瑞兴利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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自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	华泰柏瑞兴利混合	
基金主代码	003970	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月29日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	200,230,101.35份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞兴利混合A级	华泰柏瑞兴利混合C级
下属分级基金的交易代码:	003970	003971
报告期末下属分级基金的份额总额	200,156,290.64份	73,810.71份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效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	本基金在宏观经济分析基础上,结合政策面、市场资金面等情况,在经济周期不同阶段,依据市场不同表现,在大类资产中进行配置,保证整体投资业绩的持续性。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	林葛
	联系电话	021-38601777	010-66060069
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95599
传真		021-38601799	010-68121816

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

§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	华泰柏瑞兴利混合A级	华泰柏瑞兴利混合C级
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)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	8,978,524.24	12,463.98
本期利润	-11,046,124.14	-46,036.58
加权平均基金份额本期利润	-0.0462	-0.1509
本期基金份额净值增长率	-7.29%	-6.83%
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	-0.0439	-0.0364
期末基金资产净值	191,367,399.44	71,123.17
期末基金份额净值	0.9561	0.9636

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

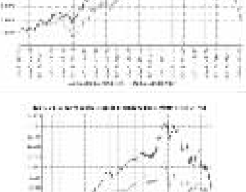
华泰柏瑞兴利混合A级

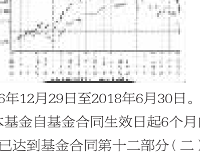
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.87%	0.84%	-3.70%	0.64%	-0.17%	0.20%
过去三个月	-7.30%	0.81%	-4.52%	0.57%	-2.78%	0.24%
过去六个月	-7.29%	0.73%	-5.47%	0.57%	-1.82%	0.16%
过去一年	-0.38%	0.56%	-1.46%	0.47%	1.08%	0.09%
自合同生效日至今	7.35%	0.48%	2.97%	0.42%	4.38%	0.06%

华泰柏瑞兴利混合C级

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	-3.89%	0.84%	-3.70%	0.64%	-0.19%	0.20%
过去三个月	-7.32%	0.81%	-4.52%	0.57%	-2.80%	0.24%
过去六个月	-6.83%	0.73%	-5.47%	0.57%	-1.36%	0.16%
过去一年	-0.01%	0.56%	-1.46%	0.47%	1.45%	0.09%
自合同生效日至今	8.15%	0.48%	2.97%	0.42%	5.18%	0.06%

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:1、图示日期为2016年12月29日至2018年6月30日。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分(二)投资范围中规定的各项比例: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%;

§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、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选30灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金。截至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		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	-	7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、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
杨景涵	本基金的基金经理	2016年12月29日	-	14年	中山大学经济学硕士。特许金融分析师(CFA),金融风险管理师(FRM)。2004年至2006年于平安资产管理有限公司,任投资分析师;2006年至2009年9月于生命人寿保险公司,历任连投资经理、投资经理、基金投资部负责人。2009年10月加入本公司,任专户投资部投资经理。2014年6月至2015年4月任研究部总监助理。2015年4月至2018年4月任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月至2017年12月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年8月至2017年12月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月起任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年11月至2017年12月任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月至2018年4月任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起任华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年1月至2018年3月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月起任华泰柏瑞价值精选30灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年9月起任华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年3月起任华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年6月起任华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金的基金经理。

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

本基金2018年上半年,采取稳健的策略,保持权益资产的稳定仓位,以固定收益和打新为主要获利手段,受到系统性大幅下跌的影响,业绩回撤较大。

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兴利混合A级基金份额净值为0.9561元,本报告期基金份额净值增长率为-7.29%;截至本报告期末华泰柏瑞兴利混合C级基金份额净值为0.9636元,本报告期基金份额净值增长率为-6.83%;同期业绩比较基准收益率为-5.47%。

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2018年下半年,虽然短期市场信心仍然不稳,但经济基本面复苏态势明确,宏观政策调控逐渐转向,外部冲击效应将边际减弱,金融调控逐步进入尾声,股市可能会在下半年进入筑底回升阶段。我们相信目前的权益市场已经初步具备了系统性的配置机会,国内经济经过政策的连续去杠杆和调控以后,整体正在进入更为健康的结构,长期中国经济可持续增长的前景实际上正在变好。我们认为系统性长期配置加精选个股,波段操作将是目前较好的投资策略。本基金将灵活参与权益市场、新股市场以及固定收益市场,审慎投资,精选个股,降低风险,努力在2018年下半年为投资者带来相对更好的净值表现。

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

本基金在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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—华泰柏瑞基金管理有限公司2018 年 1 月 1 日至 2018年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害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

本托管人认为,华泰柏瑞基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,华泰柏瑞基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:华泰柏瑞兴利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		3,229,369.80	4,929,758.09
结算备付金		75,531.99	178,873.74
存出保证金		14,192.36	13,144.39
交易性金融资产		184,625,423.20	303,036,559.56
其中:股票投资		116,698,721.77	128,139,359.56
基金投资		-	-
债券投资		67,926,701.43	174,897,200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		4,000,000.00	3,400,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		913,611.69	2,135,128.87
应收股利		-	-
应收申购款		-	100.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		192,858,129.04	313,693,564.65
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		998,619.18	3,459,694.45
应付赎回款		87,766.15	-
应付管理人报酬		97,034.44	161,629.98
应付托管费		24,258.63	40,407.49
应付销售服务费		34.72	5.97
应付交易费用		28,346.46	164,117.06
应交税费		5,028.36	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		178,518.49	366,000.00
负债合计		1,419,606.43	4,191,854.95
所有者权益:			
实收基金		200,230,101.35	300,120,003.72
未分配利润		-8,791,578.74	9,381,705.98
所有者权益合计		191,438,522.61	309,501,709.70
负债和所有者权益总计		192,858,129.04	313,693,564.65

注:注:报告截止日2018年6月30日,华泰柏瑞泰利混合A基金份额净值0.9561元,基金份额总额200,156,290.64份;华泰柏瑞泰利混合C基金份额净值0.9636元,基金份额总额73,810.71份。华泰柏瑞泰利混合份额总额合计为200,230,101.35份。

6.2 利润表

会计主体:华泰柏瑞兴利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		-9,536,757.17	25,077,629.96
1.利息收入		3,199,628.94	2,967,930.99
其中:存款利息收入		21,459.78	213,299.72
债券利息收入		3,166,643.00	2,528,801.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,526.16	225,830.10
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		7,343,830.43	14,539,956.77
其中:股票投资收益		4,613,234.91	11,299,509.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益		434,083.28	-28,422.07
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		2,296,512.24	3,268,869.29
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-20,083,148.94	7,569,690.39
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		2,932.40	51.81
减:二、费用		1,555,403.55	1,800,420.28
1. 管理人报酬		745,324.71	917,986.73
2. 托管费		186,331.13	229,496.78
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	387.51	10.57
4. 交易费用		105,355.51	365,762.12
5. 利息支出		307,770.73	97,460.30
其中:卖出回购金融资产支出		307,770.73	97,460.30
6. 税金及附加		6,656.71	
7. 其他费用		203,577.25	189,703.78
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-11,092,160.72	23,277,209.68
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-11,092,160.72	23,277,209.68

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰柏瑞兴利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)	300,120,003.72	9,381,705.98	309,501,709.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-11,092,160.72	-11,092,160.72
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)	-99,889,902.37	-7,081,124.00	-106,971,026.37
其中:1.基金申购款	1,212,471.72	97,990.71	1,310,462.43
2.基金赎回款	-101,102,374.09	-7,179,114.71	-108,281,488.80
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)	200,230,101.35	-8,791,578.74	191,438,522.61

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)	300,061,930.18	17,707.58	300,079,637.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	23,277,209.68	23,277,209.68
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)	-11,261.41	-42.87	-11,304.28
其中:1.基金申购款	99.82	0.03	99.85
2.基金赎回款	-11,361.23	-42.90	-11,404.13
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)	300,050,668.77	23,294,874.39	323,345,543.16

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

华泰柏瑞兴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]第2777号《关于准予华泰柏瑞兴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《华泰柏瑞兴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300,020,678.14元人民币,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2016)第1692号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金合同》于2016年12月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为300,020,678.14份基金份额,其中认购资金利息折合41,252.04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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞兴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,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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沪深300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%

本财务报表由本基金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日颁布的《企业会计准则–基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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:

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。

2)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。

3)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。

4)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。

5) 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。

6)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。

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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、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,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,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。

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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

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

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

金额单位:人民币元

关联方名称	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	
	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
华泰证券股份有限公司	67,031,714.48	100.00%	274,371,588.11	100.00%

6.4.8.1.2 权证交易

注:本基金本报告期内通过关联方交易单元未进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年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
华泰证券股份有限公司	62,426.60	100.00%	22,250.47	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
华泰证券股份有限公司	255,523.40	100.00%	121,737.45	100.00%

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	745,324.71	917,986.73
其中:支付销售机构的客户维护费	637.02	5.45

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0.6%的年费率计提,计算方法如下:

H = E × 0.6% ÷ 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	186,331.13	229,496.78

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 × 0.15% ÷ 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

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞兴利混合A级	华泰柏瑞兴利混合C级	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	7.98	7.98
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	5.57	5.57
合计	0.00	13.55	13.55
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	华泰柏瑞兴利混合A级	华泰柏瑞兴利混合C级	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	10.57	10.57
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	10.57	10.57

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 × 0.25% ÷ 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类基金份额前一日的基金资产净值

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本报告期及上年度可比期间内,除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	3,229,369.80	19,743.62	3,387,868.11	66,806.82

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金本报告期及上年度可比区间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注:无。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 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
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注:本基金本报告期末未持有银行间市场正回购。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注:本基金本报告期末未持有交易所市场正回购。

§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	116,698,721.77	60.51
	其中:股票	116,698,721.77	60.51
2	基金投资		
3	固定收益投资	67,926,701.43	35.22
	其中:债券	67,926,701.43	35.22
	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	4,000,000.00	2.07
	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	3,304,901.79	1.71
8	其他各项资产	927,804.05	0.48
9	合计	192,858,129.04	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,946,240.00	3.11
C	制造业	35,800,199.93	18.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,103.85	0.01
E	建筑业	18,814,284.83	9.83
F	批发和零售业	12,104,384.13	6.32
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	-	-
J	金融业	35,253,282.89	18.41
K	房地产业	8,676,000.00	4.53
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	116,698,721.77	60.96

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前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	1,099,976	15,839,654.40	8.27
2	000501	鄂武商A	984,897	12,104,384.13	6.32
3	002142	宁波银行	556,871	9,071,428.59	4.74
4	000069	华侨城A	1,200,000	8,676,000.00	4.53
5	600068	葛洲坝	1,099,923	7,930,444.83	4.14
6	002078	太阳纸业	779,913	7,557,356.97	3.95
7	600000	浦发银行	750,000	7,170,000.00	3.75
8	600409	三友化工	799,917	6,887,285.37	3.60
9	601668	中国建筑	1,204,000	6,573,840.00	3.43
10	002110	三钢闽光	390,000	6,251,700.00	3.27

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.Huatai-pb.com网站的半年度报告正文。

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	000069	华侨城A	9,942,031.00	3.21
2	600409	三友化工	7,048,906.43	2.28
3	601186	中国铁建	5,889,501.00	1.90
4	600188	兖州煤业	4,984,095.44	1.61
5	601009	南京银行	3,015,500.00	0.97
6	000581	威孚高科	2,965,082.00	0.96
7	601668	中国建筑	1,010,400.00	0.33
8	002926	华西证券	282,324.24	0.09
9	300750	宁德时代	112,853.46	0.04
10	300741	华宝股份	101,325.00	0.03
11	601066	中信建投	101,299.80	0.03
12	601828	美凯龙	97,195.23	0.03
13	601838	成都银行	89,465.01	0.03
14	002925	盈趣科技	68,670.00	0.02
15	300737	科顺股份	61,023.35	0.02
16	300747	锐科激光	58,803.73	0.02
17	603587	地素时尚	55,342.72	0.02
18	002929	润建通信	51,540.40	0.02
19	300454	深信服	48,232.28	0.02
20	603680	今创集团	47,171.67	0.02

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	600398	海澜之家	13,934,055.00	4.50
2	000933	神火股份	7,029,385.00	2.27
3	600340	华夏幸福	6,566,928.00	2.12
4	002926	华西证券	434,171.76	0.14
5	002916	深南电路	302,624.80	0.10
6	600025	华能水电	282,697.87	0.09
7	002925	盈趣科技	238,834.52	0.08
8	601828	美凯龙	206,556.74	0.07
9	002920	德赛西威	196,486.93	0.06
10	300454	深信服	170,719.60	0.06
11	601838	成都银行	158,323.63	0.05
12	300741	华宝股份	135,875.75	0.04
13	300504	天邑股份	129,981.90	0.04
14	603486	科沃斯	127,253.40	0.04
15	002929	润建通信	112,576.12	0.04
16	300634	彩讯股份	107,386.44	0.03
17	603712	七一二	106,828.10	0.03
18	300737	科顺股份	104,335.02	0.03
19	603056	德邦股份	101,354.70	0.03
20	300735	光弘科技	98,744.08	0.03

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	36,588,622.46
卖出股票收入(成交)总额	32,176,198.61

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	5,601,340.00	2.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,041,800.00	5.77
	其中:政策性金融债	11,041,800.00	5.77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,186,000.00	15.77
6	中期票据	10,390,000.00	5.43
7	可转债(可交换债)	908,561.43	0.47
8	同业存单	9,799,000.00	5.12
9	其他	-	-
10	合计	67,926,701.43	35.48

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	018005	国开1701	110,000	11,041,800.00	5.77
2	101451018	14滨建投MTN002	100,000	10,390,000.00	5.43
3	041764013	17陕煤化CP001	100,000	10,090,000.00	5.27
4	041800064	18兖矿CP001	100,000	10,057,000.00	5.25
5	011800301	18恒信租赁SCP001	100,000	10,039,000.00	5.24

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

注:无。

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:无。

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:无。

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:无。

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

注:无。

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:无。

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:无。

7.11.3本期国债期货投资评价

注:无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

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	14,192.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	913,611.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	927,804.05

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128029	太阳转债	908,561.43	0.47

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

§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
华泰柏瑞兴利混合A级	114	1,755,756.94	200,027,500.00	99.94%	128,790.64	0.06%
华泰柏瑞兴利混合C级	118	625.51	100.01	0.14%	73,710.70	99.86%
合计	232	863,060.78	200,027,600.01	99.90%	202,501.34	0.10%

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	华泰柏瑞兴利混合A级	360.70	0.0002%
	华泰柏瑞兴利混合C级	18.06	0.0245%
	合计	378.76	0.0175%

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

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本开放式基金。本基金基金经理未持有本开放式基金。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华泰柏瑞兴利混合A级	华泰柏瑞兴利混合C级
基金合同生效日(2016年12月29日)基金份额总额	300,043,238.20	18,691.98
本报告期期初基金份额总额	300,089,000.65	31,003.07
本报告期基金总申购份额	110,720.76	1,101,750.96
减:本报告期基金总赎回份额	100,043,430.77	1,058,943.32
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	200,156,290.64	73,810.71

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内,基金管理人无重大人事变动。

本报告期内,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

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

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

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	67,031,714.48	100.00%	62,426.60	100.00%	-

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	16,595,545.80	100.00%	85,500,000.00	100.00%	-	-

§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	20180101-20180630	200,027,500.00	0.00	0.00	200,027,500.00	99.90%
	2	20180101-20180313	100,013,750.00	0.00	100,013,750.00	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

注:无。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2018年8月25日