华泰柏瑞新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。

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2015年11月19日开始计算。

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	469,119,420.85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	469,119,401.56份	19.29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。

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	cs4008880001@huatai-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	基金管理人及基金托管人住所

§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

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(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	5,259,478.54	0.13
本期利润	868,379.29	-0.06
加权平均基金份额本期利润	0.0018	-0.0031
本期基金份额净值增长率	0.12%	-0.31%
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	0.0395	0.0378
期末基金资产净值	487,659,344.42	20.02
期末基金份额净值	1.0395	1.0378

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

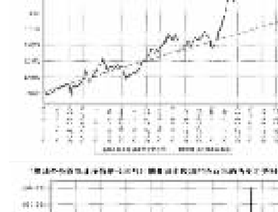
华泰柏瑞新利混合A

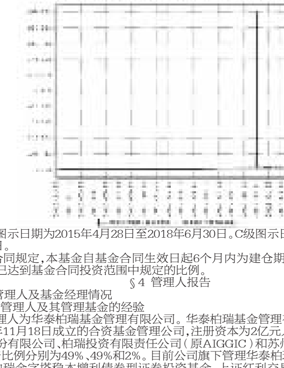
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.74%	0.32%	0.19%	0.01%	-0.93%	0.31%
过去三个月	-0.69%	0.30%	0.59%	0.01%	-1.28%	0.29%
过去六个月	0.12%	0.35%	1.17%	0.01%	-1.05%	0.34%
过去一年	3.81%	0.27%	2.40%	0.01%	1.41%	0.26%
过去三年	11.40%	0.19%	7.68%	0.01%	3.72%	0.18%
自基金合同生效起至今	12.01%	0.18%	8.31%	0.01%	3.70%	0.17%

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	-0.90%	0.32%	0.19%	0.01%	-1.09%	0.31%
过去三个月	-0.79%	0.30%	0.59%	0.01%	-1.38%	0.29%
过去六个月	-0.31%	0.35%	1.18%	0.01%	-1.49%	0.34%
过去一年	3.81%	61.50%	2.40%	0.01%	1.41%	61.49%
自基金合同生效起至今	10.34%	38.19%	6.54%	0.01%	3.80%	38.18%

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.A级图示日期为2015年4月28日至2018年6月30日。C级图示日期为2015年11月19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,截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

§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灵活配置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
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	2015年4月28日	2018年4月2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,历任投资主管、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灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
吴邦栋	本基金的基金经理	2018年4月2日	-	7年	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、华泰柏瑞爱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。

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

18年上半年,除了1月份指数有一定上涨,市场基本以单边下行的态势运行,创业板在1季度末期有一定的主题性机会,但随后回落较多,主板出现持续下跌。其中上半年沪深300指数下跌12.9%,创业板指数下跌8.33%,中证500指数下跌16.53%。市场基本呈现持续下跌的局面,风格上来看,消费类的个股在上半年表现相对优异,其次是周期类的行业。而以半导体、计算机、军工等为代表的成长股冲高回落。

上半年宏观环境内外均存在较大的压力。首先,中美贸易摩擦愈演愈烈。市场在中美不断加码的双边贸易摩擦中,对外需产生较强的悲观预期。如果贸易战持续发酵,一方面,一些传统经济领域受制于出口需求的下滑,可能造成出口订单的较快收缩,对部分出口导向性的公司不利。另一方面,本次中美的贸易战,美国针对"中国制造2025"涉及的新兴制造领域重点打击,市场担心发达国家经济体对中国科技封锁可能对成长性行业发展速度的制约。

其次,从国内经济而言,上半年可以看到社会融资规模同比持续快速回落,结构上主要是表外的委托贷款,信托贷款等受到资管新规以及"去杠杆"政策打击有明显收缩。而2季度监管层对于信用收紧政策表态持续偏紧,这加重了投资者对于未来经济增速回落的担忧。同时,我们看到很多高杠杆企业例如建筑,城投公司、地产开发商等也出现了发债困难,存续债务到期还款压力增大等问题。

最后,流动性方面,人民币在美联储鹰派加息之后,出现了比较明显的一波贬值趋势。由于美联储加快加息节奏,而国内央行持续降准,人民币贬值压力增大。另外,贸易战担忧的加剧,也对外资对人民币的持有信心减弱。可以看到北上资金在5-6月以来持续流出,而其持有较多的金融、消费等行业的权重股票在这段时间表现一般。

行业情况来看,行业指数基本均出现普跌状态。表现较好的是消费类的行业以及钢铁煤炭等中报业绩高增长的周期性行业。科技类股票在1季度末期表现较好,而之后受到贸易战影响,有比较大的回撤。建筑、地产等高杠杆类的行业,由于去杠杆担忧,2季度表现也相对较差。

本基金在报告期内保持较为均衡的配置思路,保持组合低估值、高增长匹配的特性。在银行中选择高分红、具有估值折价,且基本面较好的大行作为底仓性品种。另外从行业景气度和1季报业绩筛选出发,选取了商贸、纺服、食品等大众消费品,以及钢铁、煤炭等中报业绩改善的低估值周期性个股。对于建筑等高杠杆行业进行了减配。

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1.0395元,本报告期基金份额净值增长率为0.12%,同期业绩比较基准收益率为1.17%;截至本报告期末华泰柏瑞新利混合C基金份额净值为1.0378元,本报告期基金份额净值增长率为-0.31%,同期业绩比较基准收益率为1.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们认为指数保持平稳,市场开始具备结构性机会。一方面,从整个市场而言,当前点位的下行空间有限。2季度市场大幅下行之后,估值水平已经回落至历史较低水平,代表投资者对于流动性收紧,以及贸易战影响国内经济均有着较为悲观的看法。而我们注意到近期央行等监管机构已经在货币政策及相关监管态度上发生了轻微的转向,注重国内外风险加剧对经济的负面影响,边际上有对冲的政策迹象。因此,3季度而言,预计流动性环境会较2季度有一定的缓解。

但由于大的环境,盈利增速回落背景未有改变,市场大幅指数性上行的可能性较低,更多需要挖掘行业性的结构机会。从行业比较角度看,过去1年多大盘蓝筹全面的占优的环境可能已经发生改变,转型成长股的关注度将持续提升。

首先,业绩展望方面,由于去年下半年商品价格开始显著抬升,预计3季度中后期PPI同比开始趋势性见顶回落,这将对3、4季度主板行业的盈利增速有比较大的负面拖累。具体而言,周期相关性的行业、以及后周期性的可选消费品在今年下半年业绩增速均面临回落的可能。而与此同时,成长性行业在去年计提了部分商誉减值之后,今年下半年盈利同比增速预计将会有所改善。从盈利的增速差情况来看,成长行业的性价比开始提升。

其次,政策方面转向的迹象也较为明显。从过去两年的供给侧改革,已经逐步深化进入"补短板"阶段。由于传统行业这两年盈利改善已经较为显著,政策的方向已经逐步向新兴制造等高端转型方面倾斜。预计下半年伴随一些重大会议时间点的临近,改革相关的政策催化剂会愈发密集。

操作方面,目前银行板块仍旧具备显著低估,本基金仍将持有部分龙头银行个股作为底仓性配置。另外坚持精选细分景气行业,自下而上挖掘个股,赚取业绩增长的收益。从目前对中报,以及三季报的预期来看,我们倾向于选择消费类,以及部分成长类行业中业绩持续改善的个股。对传统的周期类相关公司较为谨慎。除了银行股配置以外,维持"成长为矛,消费为盾"的结构。

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。

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:华泰柏瑞新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		1,489,399.53	4,493,675.32
结算备付金		1,291,907.48	150,958.13
存出保证金		16,542.92	18,372.73
交易性金融资产		362,513,629.83	486,303,150.54
其中:股票投资		13,467,388.21	125,460,142.54
基金投资		-	-
债券投资		349,046,241.62	360,843,008.00
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		18,600,209.30	19,600,000.00
应收证券清算款		99,512,997.22	-
应收利息		5,588,678.60	4,838,897.69
应收股利		-	-
应收申购款		2,268.35	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		489,015,633.23	515,405,054.41
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		-	9,000,000.00
应付证券清算款		-	2,607,150.00
应付赎回款		364,141.89	21,528.71
应付管理人报酬		323,671.12	350,387.02
应付托管费		101,147.22	109,495.92
应付销售服务费		-	191.30
应付交易费用		355,685.45	102,848.55
应交税费		33,090.44	-
应付利息		-	9,423.76
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		178,532.67	365,000.00
负债合计		1,356,268.79	12,566,025.26
所有者权益:			
实收基金		469,119,420.85	484,278,515.63
未分配利润		18,539,943.59	18,560,513.52
所有者权益合计		487,659,364.44	502,839,029.15
负债和所有者权益总计		489,015,633.23	515,405,054.41

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额总额为469,119,420.85份,其中A类基金份额净值1.0395元,A类基金份额总额469,119,401.56份;C类基金份额净值1.0378元,C类基金份额总额19.29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: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		5,130,347.71	24,047,834.27
1.利息收入		8,107,657.31	10,336,025.80
其中:存款利息收入	6.4.7.11	31,832.58	75,045.18
债券利息收入		8,016,352.00	10,169,421.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		59,472.73	91,558.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		1,402,388.94	-2,949,594.66
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-1,798,424.98	2,180,279.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,621,170.76	-7,834,310.41
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	1,579,643.16	2,704,436.70
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-4,391,099.44	16,486,070.25
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	11,400.90	175,332.88
减:二、费用		4,261,968.48	4,451,642.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,980,723.55	2,727,970.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	618,976.07	852,490.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	0.03
4. 交易费用	6.4.7.19	653,027.25	240,967.61
5. 利息支出		780,051.95	406,794.90
其中:卖出回购金融资产支出		780,051.95	406,794.90
6. 税金及附加		26,165.82	-
7. 其他费用	6.4.7.20	203,023.84	223,419.08
三、利润总额 (亏损总额以"-"号填列)		868,379.23	19,596,191.45
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		868,379.23	19,596,191.45

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: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)	484,278,515.63	18,560,513.52	502,839,029.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	868,379.23	868,379.23
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)	-15,159,094.78	-888,949.16	-16,048,043.94
其中:1.基金申购款	2,725,581.45	135,826.24	2,861,407.69
2.基金赎回款	-17,884,676.23	-1,024,775.40	-18,909,451.63
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)	469,119,420.85	18,539,943.59	487,659,364.44
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)	782,276,925.46	36,711,460.76	818,988,386.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	19,596,191.45	19,596,191.45
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)	-260,761,087.59	-15,085,181.91	-275,846,269.50
其中:1.基金申购款	84,194.36	4,717.41	88,911.77
2.基金赎回款	-260,845,281.95	-15,089,899.32	-275,935,181.27
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)	521,515,837.87	41,222,470.30	562,738,308.17

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[2014]88号《关于核准华泰柏瑞新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有限公司普华永道中天验字(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1,652,616,261.61份基金份额,其中认购资金利息折合78364.97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《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞创新升级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/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)。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%。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,经与基金托管人协商一致后,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理,届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事宜按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。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 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的说明

本报告期内本基金采用的会计政策和会计估计与上年度一致。

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:

(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、基金直销机构基金
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

注:本基金本报告期及上年度可比期间无关联方交易。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	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
华泰证券股份有限公司	-	-	11,109,443.04	7.16%

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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	-	-	-	-
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	10,124.00	7.10%	-	-

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	1,980,723.55	2,727,970.46
其中:支付销售机构的客户维护费	332,751.81	575,239.91

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H＝E×0.80%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由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。

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	618,976.07	852,490.74

注: 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H＝E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由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托管人。

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 华泰柏瑞新利混合A	华泰柏瑞新利混合C	合计
合计	-		-
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	0.03	0.03
合计	0.00	0.03	0.03

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×0.20%÷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。

本基金本期无发生关联方销售服务费。

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: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。

6.4.8.4 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

份额单位:份

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 期末余额	当期利息收入	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
中国银行股份有限公司	1,489,399.53	21,710.15	1,469,570.01	61,736.90

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金报告期及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

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

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002051	中工国际	2018年4月9日	重大资产重组	12.76	-	-	389,971	7,049,780.13	4,976,029.96	-

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

截至本报告期末,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余额0元,无债券作为质押。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额0元,无债券作为质押。

6.4.10 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	13,467,388.21	2.75
	其中:股票	13,467,388.21	2.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	349,046,241.62	71.38
	其中:债券	349,046,241.62	71.38
	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	18,600,209.30	3.80
	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	2,781,307.01	0.57
8	其他各项资产	105,120,487.09	21.50
9	合计	489,015,633.23	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	-	-
C	制造业	6,808,337.76	1.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,103.85	0.00
E	建筑业	4,976,029.96	1.02
F	批发和零售业	-	-
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	1,467,695.00	0.30
J	金融业	110,995.50	0.02
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.02
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	13,467,388.21	2.76

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	002051	中工国际	389,971	4,976,029.96	1.02
2	002821	凯莱英	21,700	1,892,891.00	0.39
3	000661	长春高新	8,100	1,844,370.00	0.38
4	600845	宝信软件	55,700	1,467,695.00	0.30
5	000977	浪潮信息	59,400	1,416,690.00	0.29
6	600271	航天信息	53,900	1,362,053.00	0.28
7	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.03
8	601990	南京证券	10,230	110,995.50	0.02
9	603587	地素时尚	2,442	100,879.02	0.02
10	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.02

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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	601288	农业银行	6,504,964.00	1.29
2	601398	工商银行	6,243,437.00	1.24
3	601998	中信银行	6,197,666.00	1.23
4	601818	光大银行	6,194,535.00	1.23
5	000002	万 科A	6,094,367.00	1.21
6	000069	华侨城A	6,084,280.00	1.21
7	002557	洽洽食品	5,966,600.40	1.19
8	000932	华菱钢铁	5,523,128.00	1.10
9	600028	中国石化	5,169,507.00	1.03
10	600048	保利地产	5,012,601.00	1.00
11	002179	中航光电	4,608,695.34	0.92
12	000933	神火股份	4,269,785.00	0.85
13	002078	太阳纸业	4,267,561.15	0.85
14	000807	云铝股份	4,209,840.00	0.84
15	603877	太平鸟	3,670,225.35	0.73
16	600398	海澜之家	3,664,144.28	0.73
17	600519	贵州茅台	3,650,973.00	0.73
18	600104	上汽集团	3,627,285.00	0.72
19	600887	伊利股份	3,619,190.12	0.72
20	000858	五 粮 液	3,245,144.00	0.65

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	11,357,938.00	2.26
2	002142	宁波银行	10,526,145.47	2.09
3	000059	华锦股份	9,388,168.62	1.87
4	600000	浦发银行	8,122,000.57	1.62
5	600068	葛洲坝	8,050,454.00	1.60
6	601166	兴业银行	8,043,405.93	1.60
7	000933	神火股份	7,614,045.00	1.51
8	002557	洽洽食品	7,140,099.00	1.42
9	000501	鄂武商A	6,633,074.24	1.32
10	300182	捷成股份	6,234,905.00	1.24
11	601998	中信银行	6,086,424.05	1.21
12	601009	南京银行	5,849,921.40	1.16
13	600340	华夏幸福	5,807,459.22	1.15
14	601668	中国建筑	5,783,707.00	1.15
15	601288	农业银行	5,770,587.00	1.15
16	000932	华菱钢铁	5,674,624.17	1.13
17	601398	工商银行	5,535,731.00	1.10
18	600188	兖州煤业	5,531,964.91	1.10
19	601818	光大银行	5,525,223.00	1.10
20	000069	华侨城A	5,216,722.50	1.04

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	145,103,379.58
卖出股票收入(成交)总额	247,880,233.27

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,344,000.00	12.58
	其中:政策性金融债	61,344,000.00	12.58
4	企业债券	45,372,206.20	9.30
5	企业短期融资券	190,926,000.00	39.15
6	中期票据	50,602,000.00	10.38
7	可转债(可交换债)	802,035.42	0.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	349,046,241.62	71.58

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	041764013	17陕煤化CP001	400,000	40,360,000.00	8.28
2	127293	15国网04	400,000	39,340,000.00	8.07
3	011800301	18恒信租赁SCP001	300,000	30,117,000.00	6.18
4	018005	国开1701	300,000	30,114,000.00	6.18
5	011800616	18首钢SCP003	300,000	30,111,000.00	6.17

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: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	16,542.92
2	应收证券清算款	99,512,997.22
3	应收股利	-
4	应收利息	5,588,678.60
5	应收申购款	2,268.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	105,120,487.09

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	802,035.42	0.16

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002051	中工国际	4,976,029.96	1.02	停牌

§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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
华泰柏瑞新利混合A	2,950	159,023.53	379,335,602.48	80.86%	89,783,799.08	19.14%
华泰柏瑞新利混合C	1	19.29	0.00	0.00%	19.29	100.00%
合计	2,951	158,969.64	379,335,602.48	80.86%	89,783,818.37	19.14%

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)。

8.3 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	0.0000%
	华泰柏瑞新利混合C	-	-
	合计	27.00	0.0000%

8.4 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

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	484,278,496.34	19.29
本报告期基金总申购份额	2,725,581.45	-
减:本报告期基金总赎回份额	17,884,676.23	-
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	469,119,401.56	19.29

§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

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

本报告期内,本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
光大证券	2	166,702,282.54	42.65%	154,166.12	42.79%	-
华安证券	2	62,177,889.76	15.91%	57,907.19	16.07%	-
广发证券	2	54,358,936.99	13.91%	49,563.83	13.76%	-
海通证券	2	30,740,719.53	7.86%	28,350.13	7.87%	-
兴业证券	1	22,605,281.31	5.78%	20,600.80	5.72%	-
东方证券	3	21,771,669.00	5.57%	19,840.68	5.51%	-
中投证券	1	12,057,873.37	3.08%	10,988.44	3.05%	-
华鑫证券	1	6,747,310.07	1.73%	6,148.82	1.71%	-
恒泰证券	1	5,129,955.60	1.31%	4,777.53	1.33%	-
瑞银证券	2	3,550,191.16	0.91%	3,235.29	0.90%	-
西南证券	1	2,896,446.72	0.74%	2,697.48	0.75%	-
长江证券	1	1,627,224.10	0.42%	1,515.41	0.42%	-
齐鲁证券	1	225,671.43	0.06%	210.18	0.06%	-
国都证券	1	156,481.27	0.04%	145.73	0.04%	-
华创证券	1	79,413.60	0.02%	72.37	0.02%	-
银河证券	1	67,852.11	0.02%	63.19	0.02%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中信证券	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为,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务;

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务,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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	-	-	106,000,000.00	10.04%	-	-
华安证券	-	-	103,000,000.00	9.75%	-	-
广发证券	1,388,571.56	3.38%	149,000,000.00	14.11%	-	-
海通证券	30,023,864.40	73.09%	92,000,000.00	8.71%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	20,000,000.00	1.89%	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	190,000,000.00	17.99%	-	-
齐鲁证券	-	-	3,000,000.00	0.28%	-	-
国都证券	-	-	3,000,000.00	0.28%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	66,000,000.00	6.25%	-	-
华泰证券	9,667,190.42	23.53%	-	-	-	-
安信证券	-	-	80,000,000.00	7.57%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	244,200,000.00	23.12%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

§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	序号	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180630	379,039,135.79	0.00	0.00	379,039,135.79	80.80%
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。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2018年8月25日