华泰柏瑞行业领先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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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。

本基金名称自2015年8月6日起，由 "华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金" 更名为 "华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金"，基金简称为 "华泰柏瑞行业领先混合"，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司2015年8月6日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》。

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	华泰柏瑞行业领先混合
基金主代码	460007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年8月3日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	123,247,317.70份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过采取自上而下和自下而上相结合的方法，从定量和定性的角度把握不同时期所蕴含的行业和个股投资机会，在充分控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	大类资产配置不作为本基金的核心策略。考虑到中国大陆A股市场现阶段仍存在较大的系统性风险，本基金将仅在股票资产整体出现较大程度高估或低估时进行适度的大类资产配置调整，一般情况下本基金将保持大类资产配置的基本稳定。本基金在股票投资中注重自上而下的行业配置，即以行业估值为基础，以行业基本面趋势变化为契机，结合国家产业政策的导向，在不同备选之间合理配置基金资产。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×15%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属主动管理的股票型证券投资基金，为较高风险较高收益品种，其长期平均风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金力争通过主动投资追求适度风险水平下的较高收益。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	郭明
	联系电话	021-38601777	010-66105798
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	010-66105799

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

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	2,395,051.11
本期利润	-22,165,556.70
加权平均基金份额本期利润	-0.1733
本期基金份额净值增长率	-11.31%
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	0.4267
期末基金资产净值	175,836,473.83
期末基金份额净值	1.427

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。

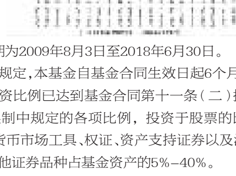
3.2 基金净值表现

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	-7.58%	2.04%	-6.09%	1.03%	-1.49%	1.01%
过去三个月	-9.11%	1.63%	-7.76%	0.91%	-1.35%	0.72%
过去六个月	-11.31%	1.60%	-9.94%	0.92%	-1.37%	0.68%
过去一年	4.70%	1.41%	-2.75%	0.76%	7.45%	0.65%
过去三年	-19.20%	2.12%	-15.14%	1.19%	-4.06%	0.93%
自基金合同生效起至今	42.70%	1.75%	4.25%	1.21%	38.45%	0.54%

注：本基金的业绩基准由沪深300指数、上证国债指数和同业存款利率按照80%、15%和5%之比构建,并每日进行再平衡。

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2009年8月3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十一条(二)投资范围、(八)之2、基金投资组合比例限制中规定的各项比例，投资于股票的比例为基金资产的60%-95%,债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%。

§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		
吕慧建	投资部总监、本基金的基金经理	2009年11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5月15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。任职日期和离任日期指基金管理公司做出决定之日。

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

2017年上半年中国经济运行良好,投资、消费、出口三驾马车均表现稳健并有所回升,PMI持续保持在扩张区间。供给侧改革政策效果显著,煤炭、钢铁、水泥、化工等产品价格回升,上游企业盈利大幅改善。

在金融行业去杠杆政策影响下,货币环境边际趋紧,货币增速下行,6月份M2增速为9.4%,是近年来的历史最低增速。货币当局通过货币市场政策工具调控利率走势,市场利率在一季度阶段性上行,随后回落并保持稳定。

A股市场在一季度走出上涨行情,家电、食品、电子为代表的低估值蓝筹股组成的"漂亮板块"持续上涨。4月份,大宗商品价格回落,同时受金融去杠杆政策影响,A股市场出现调整。5月份后,在周期板块上涨拉动下,上证指数持续上涨。上半年,行业分化较大,沪深300上涨10.78%,创业板下跌7.34%。

本基金主要配置在消费、电子、优势制造业,持仓取得良好收益,但上游周期板块严重低配,错过了盈利机会,配置在成长股板块中的个股表现疲弱,对净值有负贡献。

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1.427元;本报告期基金份额净值增长率为-11.31%,业绩比较基准收益率为-9.95%。

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4次;每次分配比例不低于基金期末可分配利润的10%;基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。报告期内基金未实施收益分配。

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,本基金托管人在对华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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:华泰柏瑞行业领先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		8,827,389.67	12,946,819.08
结算备付金		505,452.45	647,898.82
存出保证金		77,865.46	77,138.65
交易性金融资产		166,904,861.88	215,510,011.00
其中:股票投资		166,904,861.88	215,091,911.00
基金投资		-	-
债券投资		-	418,100.00
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		2,005,968.68	65,774.70
应收利息		2,068.39	3,280.50
应收股利		-	-
应收申购款		17,620.80	138,621.93
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		178,341,227.33	229,389,544.68
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		1,617,675.32	1,140,705.64
应付赎回款		168,010.25	330,805.73
应付管理人报酬		223,537.22	278,362.37
应付托管费		37,256.22	46,393.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		353,697.73	222,708.09
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		104,576.76	210,901.02
负债合计		2,504,753.50	2,229,876.58
所有者权益:			
实收基金		123,247,317.70	141,220,039.10
未分配利润		52,589,156.13	85,939,629.00
所有者权益合计		175,836,473.83	227,159,668.10
负债和所有者权益总计		178,341,227.33	229,389,544.68

注：报告截止日2018年06月30日，基金份额净值1.427元，基金份额总额123247317.70份。

6.2 利润表

会计主体:华泰柏瑞行业领先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		-19,121,347.59	25,375,237.65
1.利息收入		45,348.19	37,906.45
其中:存款利息收入	6.4.7.11	45,302.81	37,906.45
债券利息收入		45.38	-
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)		5,356,338.96	5,590,635.46
其中:股票投资收益	6.4.7.12	4,439,255.60	4,668,405.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-16,276.47	-
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	933,359.83	922,229.82
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-24,560,607.81	19,737,841.25
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	37,573.07	8,854.49
减:二、费用		3,044,209.11	2,252,941.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,469,613.55	1,243,628.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	244,935.59	207,271.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,216,127.45	674,948.54
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.17	-
7. 其他费用	6.4.7.20	113,532.35	127,092.35
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-22,165,556.70	23,122,296.65
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-22,165,556.70	23,122,296.65

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰柏瑞行业领先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)	141,220,039.10	85,939,629.00	227,159,668.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-22,165,556.70	-22,165,556.70
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)	-17,972,721.40	-11,184,916.17	-29,157,637.57
其中:1.基金申购款	12,383,466.03	6,494,733.81	18,878,199.84
2.基金赎回款	-30,356,187.43	-17,679,649.98	-48,035,837.41
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)	123,247,317.70	52,589,156.13	175,836,473.83
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)	136,834,473.45	25,703,031.25	162,537,504.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	23,122,296.65	23,122,296.65
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)	-9,484,704.89	-2,648,090.77	-12,132,795.66
其中:1.基金申购款	5,511,689.02	1,648,966.57	7,160,655.59
2.基金赎回款	-14,996,393.91	-4,297,057.34	-19,293,451.25
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)	127,349,768.56	46,177,237.13	173,527,005.69

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

华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金 (原名为友邦华泰行业领先股票型证券投资基金,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[2009]482号《关于核准友邦华泰行业领先股票型证券投资基金募集的批复》核准,由友邦华泰基金管理有限公司(现更名为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《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同》(现更名为《华泰柏瑞行业领先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2,249,392,302.39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(2009)第132号验资报告。经向中国证监会备案,《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同》于2009年8月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,249,632,307.10份基金份额，其中认购资金利息折合240,004.71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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

因基金管理人更名，经中国证监会批准，本基金名称自2010年4月30日起由"友邦华泰行业领先股票型证券投资基金"更名为"华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金",基金简称为"华泰柏瑞行业领先股票",基金代码保持不变。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及相基金合同的有关规定,并报中国证监会备案,本基金名称自2015年8月6日起由"华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金"更名为"华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金"。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 60%—95%;债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的 其他证券品种占基金资产的 5%—40%,其中,基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%,基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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X80%+上证国债指数X15%+同业存款利率X5%。

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")、中国证监会公告[2010]5号《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》、《友邦华泰行业领先股票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7.4.4所示的基金行业实务操作的有关规定编制。

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 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。

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

注: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、基金注册登记机构、基金直销机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	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: 关联方与资产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

无。

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。

6.4.8.1.2 债券交易

注:本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券回购交易。

6.4.8.1.4 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:无。

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	1,469,613.55	1,243,628.68
其中:支付销售机构的客户维护费	430,465.15	368,092.40

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

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	244,935.59	207,271.43

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 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
中国工商银行	8,827,389.67	39,014.62	9,401,135.28	34,466.71

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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:无。

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

注:无。

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
600485	信威集团	2016年12月26日	临时停牌	14.59	-	-	30,000	744,049.61	437,700.00	-

注:本基金截至2018年06月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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:无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注:无。

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	166,904,861.88	93.59
	其中:股票	166,904,861.88	93.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,332,842.12	5.23
8	其他各项资产	2,103,523.33	1.18
9	合计	178,341,227.33	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	122,015,930.74	69.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,963,200.00	4.53
G	交通运输、仓储和邮政业	11,143,683.00	6.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,432,522.34	10.48
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,923,000.00	2.80
L	租赁和商务服务业	2,200,525.80	1.25
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	226,000.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	166,904,861.88	94.92

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	002507	涪陵榨菜	500,000	12,840,000.00	7.30
2	300038	梅泰诺	1,050,049	11,193,522.34	6.37
3	002120	韵达股份	210,060	11,143,683.00	6.34
4	600872	中炬高新	360,000	10,080,000.00	5.73
5	002812	创新股份	180,000	8,843,400.00	5.03
6	600519	贵州茅台	12,000	8,777,520.00	4.99
7	002640	跨境通	520,000	7,810,400.00	4.44
8	002035	华帝股份	300,000	7,329,000.00	4.17
9	603808	歌力思	280,084	6,304,690.84	3.59
10	002271	东方雨虹	339,998	5,783,365.98	3.29

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	002812	创新股份	11,984,119.61	5.28
2	002035	华帝股份	11,476,229.45	5.05
3	002120	韵达股份	11,352,722.00	5.00
4	601233	桐昆股份	11,052,071.00	4.87
5	000636	风华高科	10,889,148.59	4.79
6	002640	跨境通	10,781,070.76	4.75
7	600585	海螺水泥	10,092,440.43	4.44
8	002146	荣盛发展	9,326,250.00	4.11
9	300296	利亚德	9,140,935.00	4.02
10	300450	先导智能	9,132,482.44	4.02
11	002139	拓邦股份	9,051,660.43	3.98
12	603808	歌力思	8,960,527.76	3.94
13	600340	华夏幸福	8,872,869.00	3.91
14	600521	华海药业	8,801,680.85	3.87
15	600519	贵州茅台	8,465,025.89	3.73
16	002008	大族激光	8,410,287.98	3.70
17	300433	蓝思科技	8,239,730.00	3.63
18	601636	旗滨集团	7,706,067.96	3.39
19	002044	美年健康	7,543,015.00	3.32
20	300324	旋极信息	7,247,192.00	3.19
21	601933	永辉超市	6,638,029.00	2.92
22	002583	海能达	6,394,397.86	2.81
23	002677	浙江美大	6,297,969.99	2.77
24	600779	水井坊	5,910,873.34	2.60
25	603839	安正时尚	5,804,802.44	2.56
26	600703	三安光电	5,246,930.87	2.31
27	600702	舍得酒业	5,096,840.00	2.24
28	000977	浪潮信息	4,959,819.00	2.18
29	300241	瑞丰光电	4,951,404.00	2.18
30	300316	晶盛机电	4,691,378.05	2.07

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	002812	创新股份	15,522,128.00	6.83
2	002507	涪陵榨菜	14,498,886.94	6.38
3	002583	海能达	14,441,313.79	6.36
4	300433	蓝思科技	13,821,700.70	6.08
5	601933	永辉超市	13,762,516.68	6.06
6	000858	五 粮 液	13,474,839.80	5.93
7	600703	三安光电	13,370,131.40	5.89
8	601233	桐昆股份	11,753,463.66	5.17
9	600521	华海药业	11,581,726.78	5.10
10	000786	北新建材	11,398,556.74	5.02
11	601012	隆基股份	11,189,269.60	4.93
12	600585	海螺水泥	9,817,736.00	4.32
13	000636	风华高科	9,806,815.96	4.32
14	600056	中国医药	9,634,770.94	4.24
15	300506	名家汇	8,388,829.00	3.69
16	002008	大族激光	8,194,291.23	3.61
17	600340	华夏幸福	7,997,763.10	3.52
18	600872	中炬高新	7,894,995.10	3.48
19	002273	水晶光电	7,552,968.72	3.32
20	300323	华灿光电	7,532,978.88	3.32
21	002139	拓邦股份	7,392,674.41	3.25
22	300324	旋极信息	7,360,413.00	3.24
23	002044	美年健康	7,063,328.40	3.11
24	002146	荣盛发展	6,925,402.06	3.05
25	300450	先导智能	6,775,219.64	2.98
26	002271	东方雨虹	6,681,761.08	2.94
27	601636	旗滨集团	6,588,553.00	2.90
28	600779	水井坊	6,274,948.70	2.76
29	600438	通威股份	6,193,455.09	2.73
30	002475	立讯精密	6,124,358.00	2.70
31	300316	晶盛机电	5,624,081.00	2.48
32	600519	贵州茅台	5,418,221.91	2.39
33	600702	舍得酒业	4,860,386.93	2.14
34	300241	瑞丰光电	4,609,013.00	2.03

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	384,802,661.04
卖出股票收入(成交)总额	412,827,047.95

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

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	77,865.46
2	应收证券清算款	2,005,968.68
3	应收股利	-
4	应收利息	2,068.39
5	应收申购款	17,620.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,103,523.33

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:无。

7.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

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
5,452	22,605.89	776,109.71	0.63%	122,471,207.99	99.37%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	7.49	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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	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

基金合同生效日(2009年8月3日)基金份额总额	2,249,632,307.10
本报告期期初基金份额总额	141,220,039.10
本报告期基金总申购份额	12,383,466.03
减:本报告期基金总赎回份额	30,356,187.43
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	123,247,317.70

§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

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	
方正证券	2	167,242,386.63	20.98%	153,290.52	20.93%	-
长江证券	2	165,672,149.76	20.78%	150,977.03	20.61%	-
瑞银证券	2	139,600,674.03	17.51%	130,009.55	17.75%	-
东兴证券	2	85,381,768.39	10.71%	78,370.34	10.70%	-
申万宏源	2	70,998,761.61	8.91%	65,269.22	8.91%	-
平安证券	1	65,403,567.82	8.20%	60,910.06	8.31%	-
安信证券	1	59,846,139.53	7.51%	54,537.98	7.44%	-
兴业证券	1	32,498,665.00	4.08%	29,616.26	4.04%	-
广发证券	3	10,520,211.08	1.32%	9,587.08	1.31%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
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		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
方正证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	401,936.25	100.00%	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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