期末基金

3.1 主要财务指标

基金管理人: 华泰柏瑞基金管理有限公司 基金柱管 : 中国银行股份有限公司 报告送出日期: 2018年10月26日 基金管理人的董事会及董事集 1 重要提示 基金管理人的董事会及董事保证本报告所裁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。 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10月25

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

日夏核了本报告中的财务看标、停ll表现机投资组合报告等内容,保止复核内容不存在處假记载,误导性陈述或者重大通漏。 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。 本报告中的财务资料未经审计。 本报告明自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

《2基金产品概况

过去三个月 -3.97% 1.23% -3.34% 1.26% -0.63% -0.03% 3.2.2 目基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基

注:1.图示日期为日为2017年9月26日至2018年9月30日。 2.核基金合同规定,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。

§ 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 .井对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。 基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月25日复核了 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

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

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

《3 主要财务指标和基金净值表现

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

2、按基金合同规定,本基金目基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告期末本基金的 项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

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 报告送出日期:2018年10月26日 § 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 述或重力遗漏,并对其内容的真实性,海崎庄和污磨性承征与作列及连带责任。 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10月25 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 干水产业地汇进。程度标准连承长载、进

1 过後了本报告中的财务指标、净值表现相投资组合报告等内容,保止复核内容不存在儘假立就,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谈明书。 本组生力的财务及购出、公司、

《2.基金产品概况

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

[2017/2018/2019] 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容示时性/各

3.2.1 本报告期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 

本基金主要通过定量投资模型,选取并持有预期收益较好 股票构成投资组合,在有效控制风险的前提下,力争实现 越业绩比较基准的投资回报。但在极端市场情况下,为保 投资者的本金安全,股票资产比例可降至0%。

本基金的业绩比较基准为:95%\*沪深300指数收益率+E 银行活期存飲利率( 税后 )

本报告中的财务资料未经审计。 本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

业绩比较基准

3.1 主要财务指标

值变动收益。 3.2 基金净值表现

准收益率变动的比较

注:1.图示日期为2015年6月29日至2018年9月30日

全相关费用后的金额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益

3.2.1 本报告期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

§ 4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

基金托管人:中国建设银行股份有 报告送出日期:2018年10月26日

k基金的招募说明书。

业绩比较基准

3.1 主要财务指标

3.2.2 自基金台

(一)资产配置策略 本基金为灵活配置混合型基金,基金 理人将跟踪宏观经济变量和国家财政、税收和货币政策等 标、判断经济周期的阶段和未来经济发展的趋势,研究预

单位:人民币元



### 华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金

2年天理即時代李明成時時時期 42. 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的原明 报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定,不存在损 害基金持有人利益的行为。 43. 公平交易制度的执行情况 报告期内,本基金管型人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意 见》的要求,通过科学完善的制度及流程、从事前,事中和事后等环节严格控制不 而基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公 平对待不同投资组合,其次交易部对投资指令的合规性,有效性及合理性进行级 中对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性,有效性及合理性进行级 企事核 在交易过程使由用用投资安易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。 同时,风险管理部对报告拥内的交易进行日常监控和分析评估。 本报告期 内,上述公平交易制度或传统执行情况良好。 4.32 异常交易行为的专项说明 本报告期内,公司能下所有投资组合参与的交易所公开竟价交易中,同日反 向支易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的,本基金合计发生8次,为量化投资银投资策略需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

20	18	年第三李度报告	
----	----	---------	--

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
本报告期内,受中美贸易摩擦升温、国内去杠杆等因素影响,A股市场总体呈
现震荡行情,市场风险偏好降低,大小盘分化较大,大盘股指数表现较好,中小盘、
创业板指数出现较大跌幅。9月下旬市场开始有所反弹。
本报告期内本基金正常运作,我们坚持了一贯的量化选股策略。
今年以来,受中美贸易摩擦和国内去杠杆,以及一系列事件的影响,A股市场
呈现了震荡下行的走势。我们认为当前A股市场的估值基本反映了当前可预见的
· 主风 目 麻椒的 影响 计划 八 Cm

4.5 截至 -3.979 4.6	工产观点,我们与前的操报告期内基金的业绩表现 在报告期末本基金份额 %,业绩比较基准收益率为报告期内基金持有人数可	(1) (1) (1) (1) (1) (2) (2) (2) (3) (4) (4) (4) (4) (4) (4) (4) (4) (4) (4	市場開墾自城的形式。 5期基金份额净值增长 明
元。		5 投资组合报告	
序号	项目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,509,064,994.31	94.18
	其中:股票	2,509,064,994.31	94.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	75,249,000.00	2.82
	其中:债券	75,249,000.00	2.82
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买人返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买人返售金融 资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	76,635,799.50	2.88
8	其他资产	3,227,959.63	0.12
9	合计	2,664,177,753.44	100.00
5.2 5.2.1	报告期末按行业分类的R L 报告期末按行业分类的	是票投资组合  境内股票投资组合	
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	5,269,135.0	0.20
В	采矿业	98,807,920.3	3.72
C	制造业	1,390,384,409.4	17 52.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	94,314,995.1	18 3.55
E	建筑业	183,428,534.1	18 6.91
F	批发和零售业	180,208,902.€	39 6.79
G	交通运输、仓储和邮政业	30,134,136.3	32 1.13
Н	住宿和餐饮业		
	位自体检 经外部位出 安阳公儿	114 970 4745	14 4 22

注:本基金本报告期末未投资港股通股票。 5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(	元)	例(%)
1	603993	洛阳钼业	10,937,000	49,872	,720.00	1.88
2	600104	上汽集团	1,412,634	47,012	,459.52	1.77
3	002024	苏宁易购	3,402,700	45,868	,396.00	1.73
4	600585	海螺水泥	1,189,037	43,744	,671.23	1.65
5	601390	中国中铁	5,557,160	43,179	,133.20	1.63
6	601992	金隅集团	11,175,051	41,459	,439.21	1.56
7	600016	民生银行	6,439,500	40,826	430.00	1.54
8	601186	中国铁建	3,526,600	39,321	,590.00	1.48
9	600031	三一班工	4,364,191	38,754	,016.08	1.46
10	601618	中国中冶	10,531,600	37,597	,812.00	1.42
5.4	报告期末按	债券品种分类	的债券投资	组合		
序号	债	券品种	公允价值	(元)	占基金	b资产净值比例(%)
1	国家债券			-		_
2	央行票据			-		_
3	金融债券		7	5,249,000.00		2.83

5.5 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债券投资明 细

5.6 报告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投资资产支持证券。 5.7 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

5.8 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权证投资明

注:本基金本报告期末未投资权证。 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 代码 名称 持仓量(亚/ 安) 注, 木基全木报告期末未投资股指期货

根据公募基金相关法规和本基金合同,我们可以使用股指期货进行加减仓位 的投资操作。本报告期间,股指期货仍然大幅贴水,我们选择保持一定比例的股指 期货长仓 一方面获取比较确定的超额收益。 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期末未投资国债期货 5.10.2 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。

5.10.3 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。 5.11 投资组合报告附注

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。

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

5.11.3 其他资产构成 序号

5.11.4 报告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投资可转换债券。 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:截至本报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。 § 6 开放式基金份额变动

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

《8 影响投资者决策的其他重要信息 8.1 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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

§ 9 备查文件目录 1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》 3、本基金的《招募说明书》

4. 本基金的《托管协议》 5. 基金管理人业务资格批件, 营业执照

項目

14.公管理人因2

基金管理人高级

5.基金管理人业务资格批件、营业执照 6.本基金的公告 9.2 存放地点 上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层 9.3 查阅方式 投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。 投资者对本报 告如有疑问,可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线: 400-888-0001(免长途费) 021-3878 4638 公司网址;www.huatai-pb.com 传表种理基本会管理者起公司 华泰柏瑞基金管理有限公司 2018年10月26日

§ 6 开放式基金份额变动

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

持有份额

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的

## 华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

姓名	10.44	任本基金的基金经理期限		证券从业组图	idel
XEC	任职日期 离任日期		ML979CHE-1-19C	0077	
ных мр	關总经理、本基金的基 金经理	2015年6月29 日 城企运作環境	-	364t	與位於原、管在美國民族公司 (以下) 相任民政策 (以下) 相任民政策 (以下) 相任民政策 (以下) 相任民政策 (以下) 和任民政策 (以下) 和任民政策 (以下) 和任民政策 (以下) 和民政策 (以下)

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况 报告期内,本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,通

单位:人民币元

过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。 首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资 指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核,在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易 模块,确保公平交易的实施。同时,风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。 本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的,本基金合计发生1次,为量化投资因投资策略 需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 报告期内,本基金继续采用量化对冲策略,通过量化选股模型构建跟踪沪深300指数的增

温贮更组合 同时利用冷率200股指排作合约进行对油 门兹得格对收益 本报告期内,受中美贸易摩擦持续升温、宏观经济数据不佳等影响,A股市场小幅回调,并

日恶十缩氏细胞点 财务法即雇业领理工物事件标告领用表影响 古忆风险伯好路低 十亩值用 子本报告期表现较好。本报告期内,股指期货基差逐步收敛,我们在基差升水时将对冲仓位提高

- 比收敛,个别交易日变为正基差。在未来市场问题时,期货基差有可能进一步收敛为中性或 一步收敛、个别交易日至少正基差。 在来来市场回题时,则货基差有可能进一步收敛为中性或 略微偏正。 此外,来来在市场车值回最后证底交对起相削货交易进一步处解的帐率加入。在股 指明货交易正常化的背景下,流动性将得到改善,量化对冲策略的对冲成本有望进一步降低。 超顺败盆方面,今年以来,在贸易战,龙红杆、个股爆器,梁观政策变更等一系列率件的冲击 下,A股市场逐级下跌,今年以来,必股市场市场要单年和政策面影响更大。上市公司的基本面用 非市场参与者的主要关注点,尽管我们量化模型还有正的超额收益,但这种环境整体不太有利 非印场等与省印土要大社点、《管弦》,加化保证公司证的加密区点。但这种外观整体不不利利于基于基本基本简单能化选规模型发展,进入10月、AR2多种逐渐并未被重新。计计场在消化一条列率件带来的冲击后仍将继续回归上市公司基本面。由于分散化投资的特点,量化投资受个股黑天鹅事件的影响会比较小、尽管如此、我们还是严格控制对质用比例较高股票的暴露。监控民营中小企业的参格与高,建立对财务通常的公司,尽可能控制"罪器风险"风险。另一方面,我们也会密切监控各方面的暴露,必要的收案风险。

45. 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1.0965元,基金份额净值上涨0.28%,本基金的业绩比

较基准上涨0.28%

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

序号	项目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)	
1	权益投资	174,309,810.63	80.8	
	其中:股票	174,309,810.63	80.81	
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	买人返售金融资产	-	-	
	其中: 买断式回购的买人返售金融 资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	15,772,230.88	7.3	
8	其他资产	25,622,478.30	11.88	
9	습납	215,704,519.81		
	告期末按行业分类的股票投 报告期末按行业分类的境内h			
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
Α	农、林、牧、渔业	4,076.0	0.00	
- 10	TTI Direction	11 700 010 0	0 5.45	

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。 5.3 报告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

数量(股)

注:本基金本报告期末未持有债券。 6.5 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债券投资明纸注:本基金本报告期末未持有债券。

是当业年成日两个不行可回牙。 设告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

5.6 报告期来校公允时值占基金资产净电比例大小排序的闸干仓资产支持业券处
 5.7 报告期末来持有资产支持业券。
 5.7 报告期末校公允价值占基金资产单值比例大小排序的前五名贯金属投资明细注,本基金本程台期末未持有投资。
 5.8 报告期末校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,本基金本程台期末来持有权证。
 5.9 报告期末本基金投资的股指制资之易情况说明。
 5.9 报告期末本基金投资的股指制资金

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期

报告期內,本基金继续采用量化对冲策略,通过量化选股模型构建跟踪沪深300指数的增强股票组合。同时利用沪深300股指附货合约进行对中、以获得绝对收益。 5.10 报告期末本基金投资的国债期货合约进行对中、以获得绝对收益。

5.10.1 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。

5.10.2 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。

注:本基金本报告期末未持有国债期货。 5.11 投资组合报告附注

5.1.1 投资程可依证即为证。
5.1.1 投资程可依证即为证。
5.1.1.1 投资程可依证的办法。
4.基金本报告期末投资的前十名证券中,中国农业银行股份有限公司共17个分行因未按规定中报缴纳购产税等。未按规定申报缴纳购产税等。未依法履行职员。受到院务处罚,实证海投资实现和所分别明,根据我司的基金投资管理相关制度,以相应的研究报告为基础。结合其未来增长前员,由基金全理决定直接处设行为。报告期内基金投资行前十名证券的其他发行方法。
报告期内基金投资行前十名证券的其他发行方法。
5.1.1.2

5.11.2 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。

9 合计 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 主: 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

注:截至本报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况

1、本基金的中国证监会批准募集文件 2、本基金的《基金合同》 3、本基金的《拓募说明书》 4、本基金的《托管协议》 5、基金管理人业务资格批件、营业执照 6、本基金的公告 10.2 存放地点

10.1 备查文件目录

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

§ 10 备查文件目录

# 华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金

姓名	即各	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	2Herr	
X1-25	10/07	任职日期 离任日期		北アアハ、北下半月日	说明	
盛豪	嚴化投資停 副总监、本 基金的基金 经理	2015年10月13日	-	10%	與認時所少數學系統十、2007年10月至 2010年3月代的社會人名 中月年 2010年3月代的社會人名 中月年 2010年3月代的社會人名 中月年 2010年11月至 2012年1月至 2012年1月 2010年11月至 2012年1月人会等的 2012年3月上旬日本等 2012年3月日本等 2	
田仪卿	副总经理、本基金的基金经理	2015年3月24日	-	104:	無效性學。使在與四世與東陸股份等 解於同樣的目標的是使物學與一個的 別為人格學的關係也們看得的一個的 別為人格學的關係也們看得的一個的 別為人格學的關係也們看得的一個的 是可能性的學與一個的一個的 是可能性的學與一個的一個的一個 会問題,如如此可以他們學與一個 会問題,如如此可以他們學與一個 会問題,如此如可以他們學與一個 是可能性的可以他們與一個 是可能性的可以他們 與一個 是可能性的可以他們 是可能性的 是可能性	

42 管理人对报告期内本基金运作理规宁信情允阳说明 报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定,不存在损 害基金持有人利益的行为。

4.3.公平交易专项协约
4.3.公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人根据(证券投资基金管理公司公平交易制度指导意
见)的要求,通过科学完善的制度及流程,从事前,事中和事后等环节严格控制不
可基金之间可能的利益输送。首先投资指和时外活通过规范的决策流程来确保公
平对待不同线设组合。其次集中交易密数投资信令的合规性,有效压及合理性进
方统立审核。在交易过程中信用投资交易系统中的公平交易颇典,确保公平交易
的实施。同时,从险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。
来在
期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。
4.32 异常交易行为的专项说明
本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反
向交易成交换的电过交易超超过该证券当日成交量的多的,依集金合计发生5
次,为量化投资因投资策略需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行
为。

44 报告期内基金投资策略和运作分析 本报告期内,受中美贸易摩擦升温、国内去杠杆等因素影响,A股市场总体星 滤游行请,市场风险偏好降低,大小盘分化较大,大盘股指数表现较好,中小盘、 坡后被打即较大跌幅。月下旬市场开始有所反弹。 本报告期内,我们坚持了一贯的量化选股策略,同时监控各项风险暴露,控制

| 51 报告期末基金资产组合情況 | 51 投资组合报告 | 51 报告期末基金资产组合情況 | 金額(元) | 1 収益投資 | 1607,749.3 | 其中:股票

要投资组合

数量(股) 5基金资产净值 例(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小非序的前五名债券投资明

报告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 [3] 注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。 5.7 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

。 注:本基金本报告期末未持有贵金属。 5.8 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权证投资明

26. 报告解末处公儿市信日整业员一种信记的人内研护的 注:本基金水报告期末未持有权证。 5.9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 5.9.1 报告期末本基金投资的股情期货持仓和损益明细 注:本基金本供告期末未持有限清明货, 5.9.2 本基金投资股情期货的投资放策 5.10 报告期末本基金投资股值调货交易情况说明 5.10 报告期末本基金投资股重 注:本基金本报告期末未持有国情期货。 5.10.2 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 5.10.2 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, 5.10.3 本期国债期货投资评价。

10.3 本期国债期货投资评价 ::本基金本报告期末未持有国债期货。 11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金本报告期末投资的前十名证券中,中国农业银行股份有限公司共17个 汀因未按规定代扣代缴个人所得税、未按规定申报缴纳营业税、未按规定申报 内城市维护建设税、未按规定申报缴纳房产税等,未依法履行职责,受到税务处

罚。 对该证券投资决策程序的说明:根据我司的基金投资管理相关制度,以相应 的研究程告为基础,结合其未来增长前景,由基金经理决定具体投资行为。 报告期户基金投资的前十名证券的其他发行主体,没有出现被监管部门立案 调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责,处罚的情形。 5.11.2 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 10.3 至國万式 投资者可在營业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问,司 咨询基金管理人华泰年鴻基金管朝有限公司。 客户服务捣线:400-888-0001 (免长途费) 021-3378 4388 公司网址:vww.hutatl-pb.com 华泰柏瑞基金管理有限公司 2018年10月26日

5.11.4 报告期末挂有的处于转股期的可转换债券明如 注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

单位:份

《7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.115 报告期末前十夕股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。 § 6 开放式基金份额变动

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:无。 《8 影响投资者决策的其他重要信息 8.1 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

期初 份額 赎回 份額 43,387,518.4

8.2 影响投资者决策的其他重要信息 无。

9.1 备查文件目录 1、本基金的中国证监会批准募集文件 2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》 4、本基金的《托管协议》 5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告 9.2 存放地点 上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层 9.3 查阅方式

管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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。

- Ma

注:1、图示日期为2015年3月24日至2018年9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

单位:人民币元

。 5.11.3 其他资产构成

9.3 查阅方式 投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。 投资者对本报 告如有疑问,可咨询基金管理人华泰桕瑞基金管理有限公司。 客户服务热线: 400–888–0001(免长途费) 021–3878 4638 公司网址:www.huatai-pb.com 华泰柏瑞基金管理有限公司 2018年10月26日