华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金 2019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:兴业银行股份有限公司

送出日期:2019年8月29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一以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月28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2019年1月1日起至2019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	华泰柏瑞鼎利混合	
基金主代码	004010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月22日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	201,031,607.25份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞鼎利混合A	华泰柏瑞鼎利混合C
下属分级基金的交易代码:	004010	004011
报告期末下属分级基金的份额总额	200,832,170.69份	199,436.56份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格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	本基金为混合型基金,以获取长期稳定收益为目标,在投资过程中实现风险和收益的优化平衡。根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的分析与比较,对股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整。本基金股票投资以定性和定量分析为基础,从基本面分析入手,结合宏观经济走势及市场分析,根据市场估值与流动性优选个股,重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中的股票
业绩比较基准	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
	华泰柏瑞鼎利混合A 华泰柏瑞鼎利混合C

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	曾麓燕
	联系电话	021-38601777	021-52629999-212040
	电子邮箱	csf4008800016@huatai-pb.com	015292@cib.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95561
传真		021-38601799	021-62535823

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	华泰柏瑞鼎利混合A	华泰柏瑞鼎利混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	6,270,194.59	3,066.71
本期利润	9,466,020.31	6,979.74
加权平均基金份额本期利润	0.0294	0.0275
本期基金份额净值增长率	3.21%	3.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0128	0.0367
期末基金资产净值	208,101,607.39	211,488.99
期末基金份额净值	1.0362	1.0604

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

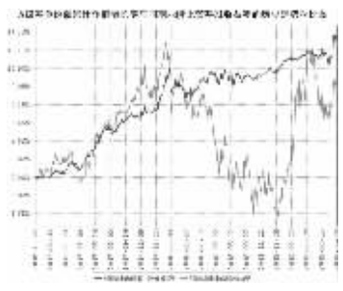
华泰柏瑞鼎利混合A

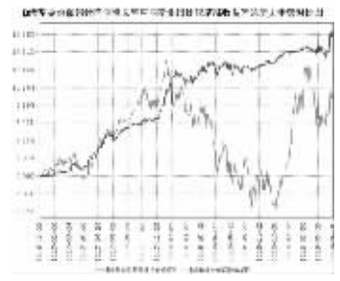
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.12%	0.36%	2.84%	0.57%	-0.72%	-0.21%
过去三个月	1.63%	0.26%	-0.54%	0.75%	2.17%	-0.49%
过去六个月	3.21%	0.19%	13.28%	0.77%	-10.07%	-0.58%
过去一年	3.90%	0.17%	6.62%	0.76%	-2.72%	-0.59%
自基金合同生效起至今	14.20%	0.17%	9.54%	0.58%	4.66%	-0.41%

华泰柏瑞鼎利混合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	2.09%	0.36%	2.84%	0.57%	-0.75%	-0.21%
过去三个月	1.56%	0.26%	-0.54%	0.75%	2.10%	-0.49%
过去六个月	3.07%	0.19%	13.28%	0.77%	-10.21%	-0.58%
过去一年	3.68%	0.17%	6.62%	0.76%	-2.94%	-0.59%
自基金合同生效起至今	16.77%	0.20%	9.54%	0.58%	7.23%	-0.38%

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2016年12月22日至2019年6月30日。

§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、华泰柏瑞微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、华泰柏瑞多策略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、华泰柏瑞享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、华泰柏瑞现代服务业混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞核心优势混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金。截至2019年6月30日,公司基金管理规模为1030.82亿元。

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	-	8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、华泰柏瑞鼎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月至2018年11月任华泰柏瑞爱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。2019年2月起任华泰柏瑞丰汇债券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	-	8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月至2018年11月任华泰柏瑞爱利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、法规和规定以及本基金的《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

19年上半年市场波动性加大,1季度大幅反弹之后,2季度出现一定程度的回落,整体而言大部分指数均取得了正收益。其中沪深300上涨27.07%,创业板上涨20.87%,中证500上涨18.77%。风格上来说,大市值股票在上半年的表现整体较好,而中小市值股票的流动性给与了一定的折价。

1季度政策环境较去年有较大的改善,这也是带动市场环境整体走暖的主要原因。从数据上来看,我们看到社会融资规模数据从2月份开始出现同比改善。但2季度开始,货币政策环境边际趋紧是导致市场出现调整的第一个触发因素。央行及政治局会议在4月份对未来货币政策的表态较去年底的全面放松有一定的收紧,同时“包商”事件对固定收益市场的风险偏好也造成较大的打压,这些均导致了之后的短端利率在2季度有明显的上行,其中1年期国债利率由1季度末的24%一度回升至2.7%的水平,而7天shibor利率回升至2.8%的水平。货币政策的边际收紧,导致A股市场估值出现收缩,市场在3200点左右开始震荡回落。

经济增长方面,由于基建在1季度的发力,2季度开始出现“启动不足”的迹象,在3月份工业增加值回升至近几年的历史较高水平8.5%之后,4月、5月连续两个月这一数据又创出了历史新低5.5%和5%的记录。同时中观层面,可选消费品,如家电、汽车等的销售和库存情况也在2季度进一步恶化,并未显示出见底回暖的态势。从PMI这一先导指标看,5月、6月已经进入荣枯线50以下,因此预计6月份的状况并未见明显好转。

行业表现上来看,1季度市场对中小市值股票给予了较强的修复,由于这类公司去年在“钱紧”的背景下,资金链普遍较为紧张,18年的下滑幅度大于同行业的龙头公司,因此19年1季度在货币环境有一定改观的情况下,超跌股年初以来有了比较好的修复。

但进入2季度之后,大小盘风格两极分化严重,整体上半年来看大盘龙头股的表现优于中小盘股票。尽管沪深300指数2季度仅小幅下跌1%左右,但从中信28个1级行业看,仅5个行业在2季度取得正收益,并战胜沪深300有相对收益,具体来说主要是食品饮料、餐饮旅游、银行、家电以及煤炭。2季度下跌较多的行业主要分布在TMT以及电力设备等成长性行业,另外周期行业2季度的表现也欠佳。

本基金在报告期内增加了上证50成分股的配置。

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鼎利混合A基金份额净值为1.0362元,本报告期基金份额净值增长率为3.21%;截至本报告期末华泰柏瑞鼎利混合C基金份额净值为1.0604元,本报告期基金份额净值增长率为3.07%;同期业绩比较基准收益率为13.28%

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,我们认为指数级别的机会不大,预计呈现震荡的格局,重点在于持仓个股的质量以及行业结构化的差异。从好的一面来看,6月份之后,市场对于国内外货币政策再度宽松的预计重新燃起,10年期长端利率显著下行,我们可以观察到上证红利的股息率相较无风险利率的“息差”再度扩张至较高水平,在这种背景下,显示出作为大盘指数的“主心骨”的红利类个股已经具备绝对收益的配置性价比,这导致指数大幅下跌的空间有限。

但从环的一面来看,经济下行、盈利下行的压力短期内尚未见到缓解。2季度工业企业利润单月出现同比负增长,工业增加值快速回落,且6月PMI数据未见改观,这些都意味着整个A股2季度的企业盈利增速较1季度可能还会有一定程度的下行。展望3季度,领先的下游消费品需求未见好转,地产去化率在6月开始显著恶化,汽车、家电或未见好转,因此我们预计3季度国内宏观经济可能仍将小幅下行。

另外,从A股市场的结构来看,成交不均,持仓拥挤的现象目前较为明显,2季度少部分行业跑赢沪深300的情况也反映了这一状况,因此把握3季度行业配置的结构更为重要。由于7-8月是中报的密集高发期,我们认为3季度业绩超预期的个股将成为获取阿尔法收益的主要来源。

操作方面,预计3季度维持目前仓位和持股结构不动。

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,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%,基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本报告期内本基金未进行利润分配。

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

截止本报告期末,因赎回等原因,本基金自2019年2月27日至2019年5月23日存在连续20 个工作日基金份额持有人数量低于200人的情形,但无基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§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

本托管人依据《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》与《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》,自2016年12月22日起托管华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金(以下称本基金)的全部资产。

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,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

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	2,244,014.04	2,991,482.65
结算备付金	1,427,930.01	-
存出保证金	82,685.95	44,381.37
交易性金融资产	242,267,608.25	463,324,950.03
其中:股票投资	68,139,208.25	20,032,663.63
基金投资	-	-
债券投资	174,128,400.00	443,292,286.40
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	-	-
应收利息	3,345,238.56	9,134,271.79
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	249,367,476.81	475,495,085.84
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	40,499,779.75	73,039,714.44
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	4,827.49
应付管理人报酬	101,261.41	209,645.83
应付托管费	25,315.35	52,411.45
应付销售服务费	47.79	51.28
应付交易费用	225,378.74	76,311.29
应交税费	18,000.02	18,312.24
应付利息	6,078.88	52,199.95
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	178,518.49	360,000.00
负债合计	41,054,380.43	73,813,473.97
所有者权益:		
实收基金	201,031,607.25	400,080,479.01
未分配利润	7,281,489.13	1,601,132.86
所有者权益合计	208,313,096.38	401,681,611.87
负债和所有者权益总计	249,367,476.81	475,495,085.84

注:报告截止日2019年6月30日,华泰柏瑞鼎利混合A基金份额净值1.0362元,基金份额总额200,832,170.69份;华泰柏瑞鼎利混合C基金份额净值1.0604元,基金份额总额199,436.56份。华泰柏瑞鼎利混合份额总额合计为201,031,607.25份。

6.2 利润表

会计主体:华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	12,042,898.66	14,419,691.49
1.利息收入	6,613,451.64	8,228,360.18
其中:存款利息收入	47,466.95	38,811.01
债券利息收入	6,565,185.97	8,135,145.85
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	798.72	54,403.32
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	2,229,695.69	6,640,413.05
其中:股票投资收益	1,106,653.46	4,868,426.32
基金投资收益	-	-
债券投资收益	712,547.91	728,381.36
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	410,494.32	1,043,605.37
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	3,199,738.75	-450,124.34
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	12.58	1,042.60
减:二、费用	2,569,898.61	2,609,408.03
1. 管理人报酬	973,502.34	1,223,866.07
2. 托管费	243,375.54	305,966.54
3. 销售服务费	326.91	284.34
4. 交易费用	487,796.75	270,796.05
5. 利息支出	652,234.10	589,606.38
其中:卖出回购金融资产支出	652,234.10	589,606.38
6. 税金及附加	9,293.81	14,803.20
7. 其他费用	203,369.16	204,085.45
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	9,473,000.05	11,810,283.46
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	9,473,000.05	11,810,283.46

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	400,080,479.01	1,601,132.86	401,681,611.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,473,000.05	9,473,000.05
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)	-199,048,871.76	-3,792,643.78	-202,841,515.54
其中:1.基金申购款	74,929.26	2,834.30	77,763.56
2.基金赎回款	-199,123,801.02	-3,795,478.08	-202,919,279.10
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)	201,031,607.25	7,281,489.13	208,313,096.38
项目	上年度可比期间 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)	399,842,319.36	2,265,478.21	402,107,797.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,810,283.46	11,810,283.46
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)	389,244.28	23,437.56	412,681.84
其中:1.基金申购款	775,154.46	41,785.92	816,940.38
2.基金赎回款	-385,910.18	-18,348.36	-404,258.54
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)	400,231,563.64	14,099,199.23	414,330,762.87

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

华泰柏瑞鼎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]2810号《关于核准华泰柏瑞鼎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《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式, 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200,025,020.14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(2016)第1676号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,030,522.42份基金份额,其中认购资金利息折合 5,502.28 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞鼎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)、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%。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的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2019年8月29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》、《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合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6.4.4所列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2019年1月1日至2019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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019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。

(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
兴业银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	5,029,238.36	100.00%	169,658,612.80	100.00%

6.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	307,814.20	100.00%	212,238.38	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	158,002.40	100.00%	142,387.94	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 2019年1月