华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金
2017年半年度报告 摘要

2017年6月30日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017年8月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 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	华泰柏瑞量化优选混合
基金主代码	000877
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 17 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	566,474,991.92 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略如下：1、股票投资策略 本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。但在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可降至 0%。2、固定收益资产投资策略本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。3、资产支持证券投资策略：在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。4、权证投资策略：权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。5、其他金融衍生工具投资策略：在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的

	衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。
业绩比较基准	95%*沪深 300 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	田青
	联系电话	021-38601777	010-67595096
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	010-67595096
传真		021-38601799	010-66275853

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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	37,992,623.50
本期利润	94,389,878.62
加权平均基金份额本期利润	0.2086
本期基金份额净值增长率	15.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.6002

期末基金资产净值	906,497,253.90
期末基金份额净值	1.6002

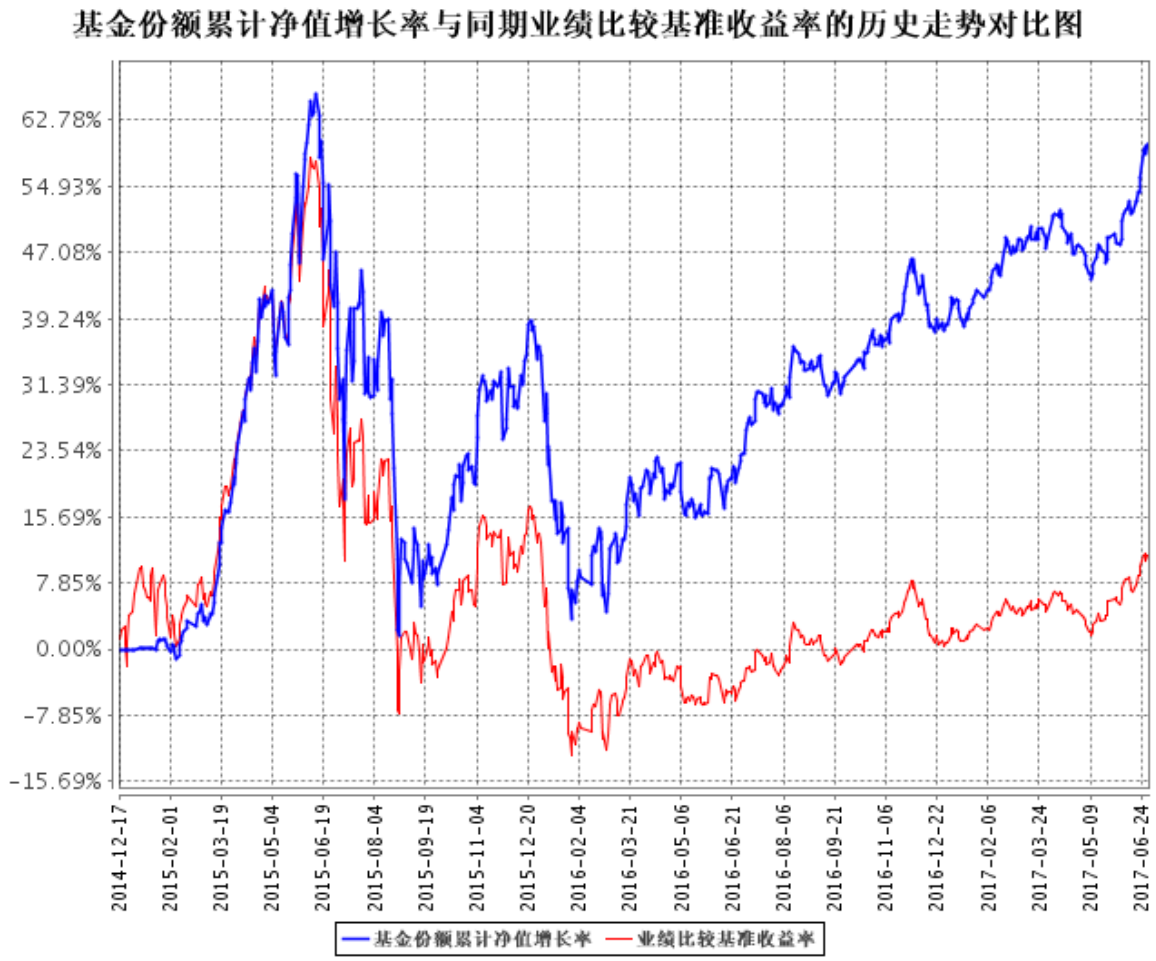
注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	7.22%	0.70%	4.73%	0.64%	2.49%	0.06%
过去三个月	7.65%	0.68%	5.79%	0.59%	1.86%	0.09%
过去六个月	15.55%	0.65%	10.23%	0.54%	5.32%	0.11%
过去一年	29.94%	0.73%	15.44%	0.63%	14.50%	0.10%
自基金合同生效起至今	60.02%	1.78%	11.03%	1.73%	48.99%	0.05%

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 2014 年 12 月 17 日至 2017 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%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金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、华泰柏瑞国企改革主题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。截至 2017 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 916.45 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		
田汉卿	副总经理、本基金的基金经	2014 年 12 月 17 日	-	15	副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI ）担任投资经理，2012 年 8 月加入华泰柏

	理				瑞基金管理有限公司，2013 年 8 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 10 月起任公司副总经理，2014 年 12 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理和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的基金经理。2016 年 5 月起任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的基金经理。2017 年 3 月起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。2017 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学， MBA 毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。
盛豪	量化投资部副总监、本基金的基金经理	2015 年 10 月 13 日	-	9	英国剑桥大学数学系硕士。2007 年 10 月至 2010 年 3 月任 Wilshire Associates 量化研究员，2010 年 11 月至 2012 年 8 月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。2012 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基

					金经理助理。2015 年 1 月起任量化投资部副总监，2015 年 10 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化驱动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。2017 年 3 月起任华泰柏瑞国企改革主题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和华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月起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、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月起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。

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《华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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

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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交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 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。

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

今年一季度大盘整体走势为窄幅震荡向上行，3、4 月份监管机构密集出台了多个监管政策，短期从严监管政策叠加,对市场影响较大，但这些不利影响在 4、5 月份市场的波动中基本反应了。随着 IPO 发行规模趋缓、减持新规出台以及央行逆回购和 MLF 等操作释放流动性，市场流动性问题逐步缓解。5 月 24 日上证综指走出双重底后，市场在一些行业龙头股的带领下出现了较强反弹。

本报告期内本基金正常运作,量化模型运行平稳，投资组合获取了与预期基本吻合的超额收益，主动风险也相对较低。

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 1.6002 元；本报告期基金份额净值增长率为 15.55%，业绩比较基准收益率为 10.23%。

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 2017 下半年，我们认为除非发生系统性风险,股市应该有不错的机会。

尽管 17 年境外境内的不确定性因素仍然会有，国内经济基本面没有出现实质性改变，仍面临调结构的压力，但我们认为在不发生系统风险的前提下，A 股市场下半年应该有不错的表现。根本的驱动因素还是大量资金依然缺少更好的投资方向，而 A 股市场在风险释放之后是一个不错的选择。

本基金还是会一贯坚持利用基本面信息选股的策略，顺应市场的变化，在有效控制主动投资风险的前提下，力求继续获得超越市场的超额收益。

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

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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：华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日： 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		45,632,212.91	12,530,120.94
结算备付金		13,445,694.77	4,849,223.30
存出保证金		164,458.25	47,221.28
交易性金融资产		849,790,923.98	281,606,678.83
其中：股票投资		834,832,923.98	275,615,678.83
基金投资		-	-
债券投资		14,958,000.00	5,991,000.00
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		-	6,500,000.00
应收证券清算款		188,675.43	103,663.06
应收利息		272,937.10	118,326.61
应收股利		-	-

应收申购款		2,821,681.63	5,165,659.85
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		912,316,584.07	310,920,893.87
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2017 年 6 月 30 日**	**上年度末 2016 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		-	-
应付赎回款		3,584,413.10	724,462.66
应付管理人报酬		1,068,630.28	390,101.54
应付托管费		178,105.07	65,016.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		803,482.41	345,624.59
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		184,699.31	375,096.70
负债合计		5,819,330.17	1,900,302.42
所有者权益：			
实收基金		566,474,991.92	223,146,229.14
未分配利润		340,022,261.98	85,874,362.31
所有者权益合计		906,497,253.90	309,020,591.45
负债和所有者权益总计		912,316,584.07	310,920,893.87

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6002 元，基金份额总额 566474991.92 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金
本报告期： 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	**附注号**	**本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日**	**上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日**
一、收入		102,753,945.83	-35,631,440.67
1.利息收入		324,842.61	313,121.46
其中：存款利息收入		219,075.76	118,467.52
债券利息收入		100,328.24	149,599.64
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		5,438.61	45,054.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		45,062,933.40	-23,304,276.41
其中：股票投资收益		37,377,978.12	-22,670,833.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益		47,662.28	-49,660.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-2,922,493.33
股利收益		7,637,293.00	2,338,710.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		56,397,255.12	-12,859,346.12
4. 汇兑收益 （损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		968,914.70	219,060.40
减：二、费用		8,364,067.21	3,378,859.12
1．管理人报酬		4,919,095.32	1,851,981.56
2．托管费		819,849.32	308,663.58
3．销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4．交易费用		2,430,187.09	1,005,339.83
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用		194,935.48	212,874.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		94,389,878.62	-39,010,299.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		94,389,878.62	-39,010,299.79

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	223,146,229.14	85,874,362.31	309,020,591.45

（基金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	94,389,878.62	94,389,878.62
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）	343,328,762.78	159,758,021.05	503,086,783.83
其中：1.基金申购款	496,013,585.86	235,268,993.58	731,282,579.44
2.基金赎回款	-152,684,823.08	-75,510,972.53	-228,195,795.61
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）	566,474,991.92	340,022,261.98	906,497,253.90
项目	**上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	270,531,917.32	94,450,751.24	364,982,668.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-39,010,299.79	-39,010,299.79
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）	-101,541,970.55	-16,327,216.30	-117,869,186.85
其中：1.基金申购款	32,091,900.40	8,007,041.48	40,098,941.88
2.基金赎回款	-133,633,870.95	-24,334,257.78	-157,968,128.73
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）	168,989,946.77	39,113,235.15	208,103,181.92

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

华泰柏瑞量化优选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]第 1132 号《关于准予华泰柏瑞量化优选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《华泰柏瑞量化优选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 1,619,915,951.10 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(2014)第 768 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 12 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,619,915,951.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 305,974.34 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化优选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/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）。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金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 95%*沪深 300 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）

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 2017 年 8 月 26 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》、《华泰柏瑞量化优选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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 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

本报告期内本基金采用的会计政策和会计估计与上年度相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(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、基金直销机构基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国建设银行股份有限公司	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：1、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

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	443,788,137.54	24.65%	-	-

6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内通过关联方交易单元未进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内通过关联方交易单元未进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	412,033.08	25.75%	0.00	0.00%

关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	-	-	-	-

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,919,095.32	1,851,981.56
其中：支付销售机构的客户维护费	1,239,851.82	614,561.49

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 1.50%的年费率计提，计算方法如下：

H = E × 1.50% ÷ 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	819,849.32	308,663.58

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 0.25%的年费率计提，计算方法如下：

H = E × 0.25% ÷ 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

注：本基金报告期内无销售服务费。

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：本基金本报告期与关联方未进行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

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2014 年 12 月 17 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	7,912,865.70	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	7,912,865.70	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.4000%	-

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：报告期末除基金管理人之外的其他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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
中国建设银行	45,632,212.91	110,593.57	4,989,835.23	57,809.17

股份有限公司				

注：本报告期，基金托管人建设银行股份有限公司保管的银行存款按银行间同业存款利率计息

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：本基金本报告期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：本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（ 2017 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

6.4.10.1.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

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
600057	象屿股份	2017年6月27日	临时停牌	10.17	2017年7月4日	10.07	839,975	8,909,403.87	8,542,545.75	-
000662	天夏智慧	2017年6月29日	临时停牌	16.00	-	-	238,200	4,525,708.47	3,811,200.00	-
002600	江粉磁材	2017年2月27日	临时停牌	11.46	2017年8月9日	6.25	300,900	3,315,771.00	3,448,314.00	-
600643	爱建集团	2017年4月17日	临时停牌	14.98	2017年8月2日	16.48	211,260	2,765,313.03	3,164,674.80	-
601919	中远海控	2017年5月17日	临时停牌	5.35	2017年7月26日	5.89	171,100	910,467.00	915,385.00	-
601088	中国神华	2017年6月5日	临时停牌	22.29	-	-	33,400	548,558.06	744,486.00	-

注：1、本基金截至 2017 年 6 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：本基金本报告期内无银行间市场债券正回购。

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债券正回购。

§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	834,832,923.98	91.51
	其中：股票	834,832,923.98	91.51
2	固定收益投资	14,958,000.00	1.64
	其中：债券	14,958,000.00	1.64
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	59,077,907.68	6.48
7	其他各项资产	3,447,752.41	0.38
8	合计	912,316,584.07	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	6,821,576.98	0.75
B	采矿业	27,273,875.11	3.01
C	制造业	363,279,747.29	40.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,450,640.72	0.60
E	建筑业	14,114,377.60	1.56
F	批发和零售业	9,824,495.71	1.08
G	交通运输、仓储和邮政业	31,931,174.00	3.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,870,333.73	2.96

J	金融业	253,814,776.69	28.00
K	房地产业	48,955,427.16	5.40
L	租赁和商务服务业	22,403,018.83	2.47
M	科学研究和技术服务业	3,695,699.00	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	19,835,605.16	2.19
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	562,176.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	834,832,923.98	92.09

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本报告期末未持有通过沪港深投资的股票。

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	601318	中国平安	673,548	33,414,716.28	3.69
2	601601	中国太保	570,417	19,320,023.79	2.13
3	000069	华侨城A	1,897,586	19,089,715.16	2.11
4	601398	工商银行	3,426,600	17,989,650.00	1.98
5	601006	大秦铁路	2,115,200	17,746,528.00	1.96
6	600383	金地集团	1,524,125	17,481,713.75	1.93
7	002195	二三四五	2,433,320	17,398,238.00	1.92
8	000002	万　科A	690,883	17,251,348.51	1.90
9	601231	环旭电子	1,021,900	16,054,049.00	1.77
10	600816	安信信托	1,156,605	15,718,261.95	1.73

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	600966	博汇纸业	19,441,688.18	6.29
2	000069	华侨城A	18,721,753.16	6.06
3	601318	中国平安	18,098,461.00	5.86
4	601006	大秦铁路	18,015,325.05	5.83
5	600739	辽宁成大	17,450,760.81	5.65
6	601601	中国太保	17,150,547.50	5.55
7	000002	万　科A	16,189,685.25	5.24
8	600383	金地集团	15,872,316.73	5.14
9	002195	二三四五	15,340,923.23	4.96
10	601288	农业银行	14,091,840.00	4.56
11	601231	环旭电子	14,005,342.74	4.53
12	601398	工商银行	13,930,595.00	4.51
13	600030	中信证券	13,824,467.77	4.47
14	600688	上海石化	13,783,444.36	4.46
15	002449	国星光电	13,623,596.70	4.41
16	000415	渤海金控	13,199,763.59	4.27
17	002636	金安国纪	12,975,985.26	4.20
18	600153	建发股份	12,942,123.99	4.19
19	600036	招商银行	12,901,356.66	4.17
20	600312	平高电气	12,876,796.44	4.17
21	601211	国泰君安	11,895,406.83	3.85
22	600816	安信信托	11,690,204.33	3.78
23	000338	潍柴动力	11,468,419.99	3.71
24	601636	旗滨集团	11,109,475.62	3.60
25	600016	民生银行	10,993,858.00	3.56
26	002146	荣盛发展	10,838,160.68	3.51
27	002385	大北农	10,427,475.61	3.37
28	601997	贵阳银行	9,840,876.43	3.18
29	002714	牧原股份	9,640,999.83	3.12
30	601633	长城汽车	9,478,111.00	3.07

31	601818	光大银行	9,255,870.33	3.00
32	000426	兴业矿业	9,084,790.24	2.94
33	000750	国海证券	9,014,246.64	2.92
34	600475	华光股份	8,472,178.23	2.74
35	600409	三友化工	8,395,995.76	2.72
36	000001	平安银行	8,322,729.02	2.69
37	000651	格力电器	8,128,305.00	2.63
38	000060	中金岭南	8,091,410.18	2.62
39	600028	中国石化	8,084,118.83	2.62
40	000776	广发证券	7,941,143.90	2.57
41	002559	亚威股份	7,742,498.16	2.51
42	600019	宝钢股份	7,626,821.77	2.47
43	601225	陕西煤业	7,606,024.39	2.46
44	600664	哈药股份	7,375,663.58	2.39
45	601390	中国中铁	6,953,880.00	2.25
46	000903	云内动力	6,940,061.13	2.25
47	002648	卫星石化	6,936,546.19	2.24
48	002555	三七互娱	6,752,338.66	2.19
49	002477	雏鹰农牧	6,734,786.00	2.18
50	600057	象屿股份	6,717,127.37	2.17
51	601166	兴业银行	6,712,593.50	2.17
52	600056	中国医药	6,662,063.04	2.16
53	600900	长江电力	6,323,339.00	2.05
54	603198	迎驾贡酒	6,297,537.32	2.04
55	002148	北纬科技	6,234,402.38	2.02

注：不考虑相关交易费用。

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	601633	长城汽车	19,248,484.60	6.23
2	600739	辽宁成大	18,888,104.01	6.11
3	600036	招商银行	16,418,130.27	5.31
4	002146	荣盛发展	15,813,358.64	5.12
5	601211	国泰君安	15,052,492.66	4.87
6	600104	上汽集团	12,147,837.46	3.93

7	600309	万华化学	10,345,843.18	3.35
8	601318	中国平安	9,745,683.00	3.15
9	600761	安徽合力	8,966,982.21	2.90
10	600900	长江电力	8,416,301.00	2.72
11	600028	中国石化	8,308,859.00	2.69
12	002285	世联行	8,235,642.42	2.67
13	000921	海信科龙	7,991,856.49	2.59
14	000001	平安银行	7,946,629.88	2.57
15	601390	中国中铁	7,681,287.00	2.49
16	600056	中国医药	7,589,308.90	2.46
17	002648	卫星石化	7,429,936.37	2.40
18	002477	雏鹰农牧	6,725,479.00	2.18
19	600585	海螺水泥	6,304,422.62	2.04
20	600000	浦发银行	6,105,414.92	1.98

注：不考虑相关交易费用。

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	1,135,193,903.64
卖出股票收入（成交）总额	669,712,374.73

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	14,958,000.00	1.65
	其中：政策性金融债	14,958,000.00	1.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,958,000.00	1.65

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	170401	17 农发 01	100,000	9,962,000.00	1.10
2	160308	16 进出 08	50,000	4,996,000.00	0.55

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，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。

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	164,458.25
2	应收证券清算款	188,675.43
3	应收股利	-
4	应收利息	272,937.10
5	应收申购款	2,821,681.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,447,752.41

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：报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§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
10,670	53,090.44	287,491,717.12	50.75%	278,983,274.80	49.25%

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	2,908,361.60	0.5100%

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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为100 万份以上。
该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2014 年 12 月 17 日 ）基金份额总额	1,620,221,925.44
本报告期期初基金份额总额	223,146,229.14
本报告期基金总申购份额	496,013,585.86
减:本报告期基金总赎回份额	152,684,823.08
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	566,474,991.92

§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	股票交易	应支付该券商的佣金	

	数量	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	备注
华泰证券	2	443,788,137.54	24.65%	412,033.08	25.75%	-
新时代证券	1	328,630,542.47	18.25%	299,480.92	18.71%	-
国信证券	2	296,645,111.74	16.47%	216,951.75	13.56%	-
方正证券	1	222,277,553.79	12.34%	202,561.88	12.66%	-
宏信证券	2	174,785,422.90	9.71%	160,946.38	10.06%	-
万联证券	2	152,934,282.79	8.49%	140,259.80	8.76%	-
西藏东方财富	2	78,083,627.80	4.34%	71,817.53	4.49%	-
天风证券	1	65,651,341.12	3.65%	61,139.28	3.82%	-
华创证券	1	37,810,832.53	2.10%	35,216.78	2.20%	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	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。

3、本报告期内，本基金新增交易单元为西南证券、新时代证券、万联证券、南京证券、财达证券。

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	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	2,052,319.10	100.00%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

§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
2017 年 8 月 26 日