

# 华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金

## 金

### 2017 年半年度报告

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：上海银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人上海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、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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 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.....	49
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>50</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>53</b>
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.....	53

---

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞爱利混合
基金主代码	001533
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 20 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	500,080,099.82 份
基金合同存续期	不定期

### 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	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>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。根据个股的估值水平优选个股，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。</p> <p>(三) 固定收益资产投资策略</p> <p>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。</p> <p>(四) 权证投资策略</p> <p>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。</p>

	<p>(五) 资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> <p>(六) 其他金融衍生工具投资策略</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为: 中国人民银行公布的一年期银行定期存款利率(税后)+1%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金, 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	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	闻怡
	联系电话	021-38601777	021-68475683
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	wenyi@bankofshanghai.com
客户服务电话		400-888-0001	95594
传真		021-38601799	021-68475888
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 168 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 168 号
邮政编码		200135	200120
法定代表人		贾波	金煜

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	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	21,629,348.59
本期利润	30,216,159.57
加权平均基金份额本期利润	0.0563
本期加权平均净值利润率	5.48%
本期基金份额净值增长率	5.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	22,414,469.03
期末可供分配基金份额利润	0.0448
期末基金资产净值	529,611,002.41
期末基金份额净值	1.0591
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	5.91%

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。

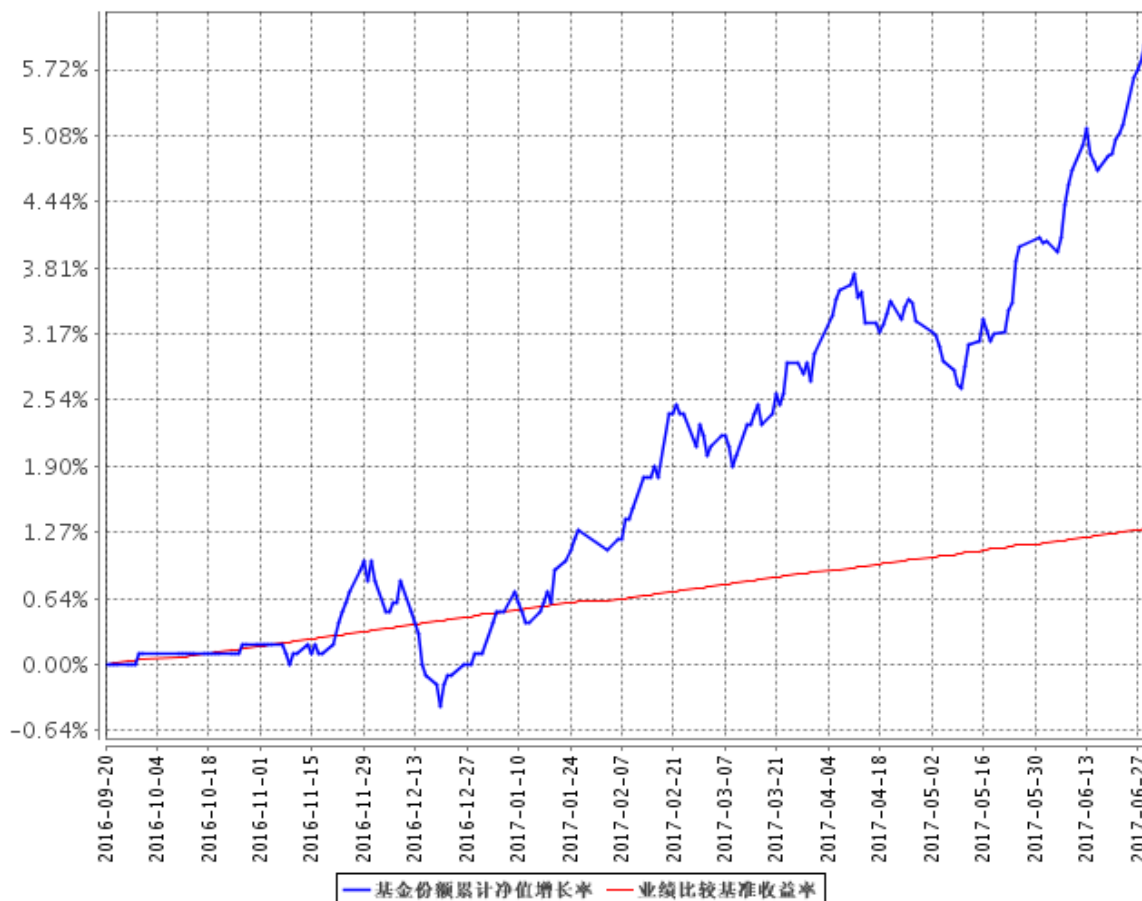
#### 3.2 基金净值表现

##### 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

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	1.74%	0.14%	0.15%	0.00%	1.59%	0.14%
过去三个月	2.84%	0.15%	0.42%	0.00%	2.42%	0.15%
过去六个月	5.80%	0.15%	0.83%	0.00%	4.97%	0.15%
自合同生效日至今	5.91%	0.14%	1.31%	0.00%	4.60%	0.14%

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2016 年 9 月 20 至 2017 年 6 月 30 日。

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条（二）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%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

## § 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

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		
杨景涵	本基金的基金经理	2016 年 9 月 20 日	-	13	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，历任投连投资经理、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 月起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。2016 年 8 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。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 月起任华泰柏

					<p>瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起任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国企改革主题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。</p>
罗远航	本基金的基金经理	2017 年 3 月 24 日	-	6	<p>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、华泰柏瑞精选回报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、华泰柏瑞兴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</p>

					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。
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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《华泰柏瑞爱利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

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，只在少数情况下“存在显著的倾向性”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究表明，交易价差方向没有规律性，即没有明确的利益输送方向。造成少量显著交易价差的原因来自两方面：一是报告期内股票市场的波动幅度较大，为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件；二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异，对证券买卖时点的把握也不同，导致股票买卖存在价差。

### 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。本报告期公司旗下基金所管理的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

本基金 2017 年初以来, 采取稳健保守的策略, 保持权益资产的稳定仓位, 以固定收益和打新为主要获利手段, 较为成功的取得了一定的绝对收益。

### 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 1.0591 元; 本报告期基金份额净值增长率为 5.80%, 业绩比较基准收益率为 0.83%。

## 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 年下半年, 尽管市场风险有一定上升, 但需求复苏叠加供给侧改革深入推进, 使股市迎来较佳的投资机会。货币政策仍将保持中性, 政府以防控风险为主。我们认为下半年市场仍然存在不错的结构性投资机会, 但依然需要保持对风险的警惕, 防范系统性风险的短期冲击。控制仓位和精选个股将成为下半年获取权益收益的重要手段。本基金将灵活参与权益市场、新股市场以及固定收益市场, 审慎投资, 精选个股, 降低风险, 努力在 2017 年下半年为投资者带来相对更好的净值表现。

## 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**

本基金在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**

截止本报告期末，因赎回等原因，本基金存在连续 60 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。本基金管理人已于 2017 年 7 月 19 日将《关于华泰柏瑞旗下基金出现基金份额持有人连续 60 个工作日少于 200 人情形及相关解决方案的报告》上报中国证监会。



## § 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，上海银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞爱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：华泰柏瑞爱利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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,690,611.36	3,641,402.30
结算备付金		561,302.72	877,963.57
存出保证金		62,977.62	74,959.12
交易性金融资产	6.4.7.2	515,610,618.78	542,761,239.63
其中：股票投资		129,776,618.78	83,414,239.63
基金投资		-	-
债券投资		385,834,000.00	459,347,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	7,000,000.00	-
应收证券清算款		115,320.22	-
应收利息	6.4.7.5	3,278,180.39	4,442,637.84
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		530,319,011.09	551,798,202.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		344,662.30	374,046.86
应付托管费		64,624.16	70,133.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	120,203.73	23,251.46

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	178,518.49	150,000.00
负债合计		708,008.68	617,432.11
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	500,080,099.82	550,421,746.81
未分配利润	6.4.7.10	29,530,902.59	759,023.54
所有者权益合计		529,611,002.41	551,180,770.35
负债和所有者权益总计		530,319,011.09	551,798,202.46

注：1. 报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0591 元，基金份额总额 500,080,099.82 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞爱利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
<b>一、收入</b>		33,387,088.66
1.利息收入		6,191,778.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	36,079.07
债券利息收入		6,082,100.64
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		73,598.98
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		18,608,320.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	14,558,437.91
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	1,499,247.95
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	2,550,634.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	8,586,810.98
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	178.92
<b>减：二、费用</b>		3,170,929.09

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,186,069.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	409,888.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	246,847.87
5. 利息支出		134,696.41
其中：卖出回购金融资产支出		134,696.41
6. 其他费用	6.4.7.20	193,426.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>30,216,159.57</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>30,216,159.57</b>

注：本基金基金合同生效日为 2016 年 9 月 20 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞爱利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（基金净值）	550,421,746.81	759,023.54	551,180,770.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,216,159.57	30,216,159.57
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）	-50,341,646.99	-1,444,280.52	-51,785,927.51
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-50,341,646.99	-1,444,280.52	-51,785,927.51
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）	500,080,099.82	29,530,902.59	529,611,002.41

注：本基金基金合同生效日为 2016 年 9 月 20 日，无上年度可比期间数据。

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：

<u>          韩勇          </u>	<u>          房伟力          </u>	<u>          赵景云          </u>
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

华泰柏瑞爱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[2015] 1250 号《关于准予华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》以及中国证监会机构部函[2016]2089 号《关于华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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 200,878,831.93 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 1228 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,898,913.94 份基金份额，其中认购资金利息折合 20,082.01 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，基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和最新公布的《华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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%；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%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的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 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》、《华泰柏瑞爱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 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 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 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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[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[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》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)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，股权的股息、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。

(3)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。自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂减按 25%计入应纳税所得额。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。

(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 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	3,690,611.36

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,690,611.36

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	121,887,125.76	129,776,618.78	7,889,493.02	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	386,092,771.10	385,834,000.00	-258,771.10
	合计	386,092,771.10	385,834,000.00	-258,771.10
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	507,979,896.86	515,610,618.78	7,630,721.92	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	7,000,000.00	-
合计	7,000,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。



#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	3,548.31
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	252.60
应收债券利息	3,272,452.54
应收买入返售证券利息	1,898.64
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	28.30
合计	3,278,180.39

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	110,475.64
银行间市场应付交易费用	9,728.09
合计	120,203.73

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	178,518.49
合计	178,518.49

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	550,421,746.81	550,421,746.81
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-50,341,646.99	-50,341,646.99
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	500,080,099.82	500,080,099.82

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,013,628.46	-1,254,604.92	759,023.54
本期利润	21,629,348.59	8,586,810.98	30,216,159.57
本期基金份额交易产生的变动数	-1,228,508.02	-215,772.50	-1,444,280.52
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,228,508.02	-215,772.50	-1,444,280.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,414,469.03	7,116,433.56	29,530,902.59

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,944.20
其他	966.21
合计	36,079.07

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	73,469,513.30
减：卖出股票成本总额	58,911,075.39
买卖股票差价收入	14,558,437.91

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,499,247.95
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,499,247.95

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	579,012,921.24
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	568,460,568.77
减：应收利息总额	9,053,104.52
买卖债券差价收入	1,499,247.95

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,550,634.21
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,550,634.21

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	8,586,810.98
——股票投资	7,695,462.63
——债券投资	891,348.35
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	8,586,810.98

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	178.92
合计	178.92

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	241,847.87
银行间市场交易费用	5,000.00
合计	246,847.87

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	24,752.78
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	5,604.38
其他费用	804.00
银行间账户服务费	13,500.00
合计	193,426.87

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截止资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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
上海银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
柏瑞投资有限责任公司	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 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。

#### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 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。

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本期与上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	2,186,069.83
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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 0.8% 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 × 0.8% / 当年天数。

本基金基金合同生效日为 2016 年 9 月 20 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	409,888.11

注：支付基金托管人上海银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

本基金基金合同生效日为 2016 年 9 月 20 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期无销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间债券市场债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及 2016 年度，基金管理人未投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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 2016 年度，基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.5 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
-------	---------------------------------------

	期末余额	当期利息收入
上海银行股份有限公司	3,690,611.36	33,168.66

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按银行同业利率计息。

本基金基金合同生效日为 2016 年 9 月 20 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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	2017 年	2017	新股流	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-



	电子	6 月 27 日	年 7 月 5 日	通受限						
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	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 7,000,000 元，于 2017 年 7 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险

管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行上海银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	345,892,000.00	439,091,000.00
合计	345,892,000.00	439,091,000.00

注：未评级的债券包括政策性金融债、存单和超短融。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	10,081,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	29,861,000.00	20,256,000.00
合计	39,942,000.00	20,256,000.00

注：未评级的债券包括政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年 6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,690,611.36	-	-	-	-	-	3,690,611.36
结算备付金	561,302.72	-	-	-	-	-	561,302.72
存出保证金	62,977.62	-	-	-	-	-	62,977.62
交	129,054,000.00	138,148,000.00	78,690,000.00	30,067,000.00	9,875,000.00	129,776,618.70	515,610,618.70

易性金融资产	0	0	0	0	0	8	8
买入返售金融资产	7,000,000.00	-	-	-	-	-	7,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	115,320.22	115,320.22
应收利息	-	-	-	-	-	3,278,180.39	3,278,180.39
资产总计	140,368,891.70	138,148,000.00	78,690,000.00	30,067,000.00	9,875,000.00	133,170,119.39	530,319,011.09
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	344,662.30	344,662.30
应付托管费	-	-	-	-	-	64,624.16	64,624.16
应	-	-	-	-	-	120,203.73	120,203.73

付交易费用							
其他负债						178,518.49	178,518.49
负债总计						708,008.68	708,008.68
利率敏感度缺口	140,368,891.70	138,148,000.00	78,690,000.00	30,067,000.00	9,875,000.00	132,462,110.71	529,611,002.41
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,641,402.30						3,641,402.30
结算备付金	877,963.57						877,963.57
存出保	74,959.12						74,959.12

证 金							
交易性金融资产	30,123,000.00	80,015,000.00	328,953,000.00	20,256,000.00		- 83,414,239.63	542,761,239.63
应收利息						- 4,442,637.84	4,442,637.84
资产总计	34,717,324.99	80,015,000.00	328,953,000.00	20,256,000.00		- 87,856,877.47	551,798,202.46
负债							
应付管理人报酬						- 374,046.86	374,046.86
应付托管费						- 70,133.79	70,133.79
应付交易费用						- 23,251.46	23,251.46
其他负债						- 150,000.00	150,000.00
负债总						- 617,432.11	617,432.11

计							
利率敏感度缺口	34,717,324.99	80,015,000.00	328,953,000.00	20,256,000.00		-87,239,445.36	551,180,770.35

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	52.90	44.00
	2. 市场利率上升 25 个基点	-52.23	-44.00

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	129,776,618.78	24.50	83,414,239.63	15.13
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	385,834,000.00	72.85	459,347,000.00	83.34
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	515,610,618.78	97.36	542,761,239.63	98.47

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准(附注 7.4.1) 上升 5%	703.49	-
业绩比较基准(附注 7.4.1) 下降 5%	-703.49	-	

注：截至上年度末，本基金持有的交易性权益类投资占总净值比例较小，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响

## § 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	129,776,618.78	24.47
	其中：股票	129,776,618.78	24.47
2	固定收益投资	385,834,000.00	72.76
	其中：债券	385,834,000.00	72.76
	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	7,000,000.00	1.32
	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	4,251,914.08	0.80
7	其他各项资产	3,456,478.23	0.65
8	合计	530,319,011.09	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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,607,283.84	1.25
C	制造业	51,422,006.35	9.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,798,378.24	1.09
F	批发和零售业	8,158,581.60	1.54
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	6,795,086.66	1.28
J	金融业	50,995,282.09	9.63
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	-	-
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	129,776,618.78	24.50

### 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所有股票投资明细

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	601288	农业银行	2,670,000	9,398,400.00	1.77
2	000501	鄂武商 A	441,960	8,158,581.60	1.54
3	000625	长安汽车	560,000	8,075,200.00	1.52
4	000059	华锦股份	760,000	7,607,600.00	1.44
5	000001	平安银行	780,000	7,324,200.00	1.38
6	601318	中国平安	145,000	7,193,450.00	1.36
7	000933	神火股份	949,998	6,925,485.42	1.31
8	300182	捷成股份	709,984	6,787,447.04	1.28
9	002202	金风科技	399,946	6,187,164.62	1.17
10	601668	中国建筑	595,000	5,759,600.00	1.09
11	601009	南京银行	500,000	5,605,000.00	1.06
12	002142	宁波银行	289,902	5,595,108.60	1.06
13	600066	宇通客车	244,926	5,381,024.22	1.02
14	600000	浦发银行	410,000	5,186,500.00	0.98
15	002078	太阳纸业	699,978	5,144,838.30	0.97
16	600016	民生银行	620,000	5,096,400.00	0.96
17	600398	海澜之家	439,986	4,175,467.14	0.79
18	000488	晨鸣纸业	320,000	4,128,000.00	0.78
19	601899	紫金矿业	1,070,000	3,670,100.00	0.69

20	600104	上汽集团	110,000	3,415,500.00	0.64
21	600188	兖州煤业	239,966	2,937,183.84	0.55
22	600015	华夏银行	294,000	2,710,680.00	0.51
23	601166	兴业银行	160,000	2,697,600.00	0.51
24	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.04
25	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
26	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
27	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
28	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.01
29	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
30	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
31	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
32	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
33	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
34	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
35	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
36	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
37	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
38	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
39	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
40	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
41	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
42	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

## 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	300498	温氏股份	7,121,174.42	1.29
2	300182	捷成股份	7,051,593.50	1.28
3	000933	神火股份	6,033,345.36	1.09
4	002202	金风科技	6,027,554.92	1.09
5	601288	农业银行	5,932,100.00	1.08

6	000625	长安汽车	5,635,700.00	1.02
7	600000	浦发银行	5,084,686.00	0.92
8	000001	平安银行	5,032,500.00	0.91
9	000895	双汇发展	4,998,390.47	0.91
10	600016	民生银行	4,984,800.00	0.90
11	000059	华锦股份	4,939,698.00	0.90
12	002078	太阳纸业	4,551,601.78	0.83
13	002236	大华股份	4,004,200.00	0.73
14	601633	长城汽车	3,959,689.00	0.72
15	000501	鄂武商 A	3,927,473.66	0.71
16	601899	紫金矿业	3,509,600.00	0.64
17	601088	中国神华	3,088,804.00	0.56
18	000651	格力电器	2,998,673.00	0.54
19	600188	兖州煤业	2,829,167.21	0.51
20	002142	宁波银行	1,947,089.00	0.35

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	000651	格力电器	8,424,030.54	1.53
2	000895	双汇发展	8,179,227.62	1.48
3	300498	温氏股份	6,559,901.00	1.19
4	600886	国投电力	5,903,650.00	1.07
5	600352	浙江龙盛	5,070,000.48	0.92
6	002236	大华股份	4,810,272.83	0.87
7	601633	长城汽车	4,440,343.53	0.81
8	600717	天津港	4,385,477.00	0.80
9	000333	美的集团	3,916,000.00	0.71
10	601088	中国神华	3,373,872.00	0.61
11	000400	许继电气	3,246,353.42	0.59
12	600004	白云机场	2,944,425.25	0.53
13	000001	平安银行	914,000.00	0.17
14	601881	中国银河	605,661.88	0.11
15	601212	白银有色	417,561.10	0.08

16	300616	尚品宅配	343,915.80	0.06
17	601228	广州港	299,992.71	0.05
18	002850	科达利	239,253.18	0.04
19	603833	欧派家居	236,393.50	0.04
20	300625	三雄极光	229,130.72	0.04

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	97,577,991.91
卖出股票收入（成交）总额	73,469,513.30

### 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	59,840,000.00	11.30
	其中：政策性金融债	59,840,000.00	11.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	119,087,000.00	22.49
6	中期票据	10,081,000.00	1.90
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	196,826,000.00	37.16
9	其他	-	-
10	合计	385,834,000.00	72.85

### 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	111715121	17 民生银行 CD121	500,000	49,460,000.00	9.34
2	111709175	17 浦发银行 CD175	500,000	49,455,000.00	9.34

3	111710245	17 兴业银行 CD245	500,000	49,445,000.00	9.34
4	111710192	17 兴业银行 CD192	400,000	39,580,000.00	7.47
5	160419	16 农发 19	300,000	29,979,000.00	5.66

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 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	62,977.62
2	应收证券清算款	115,320.22
3	应收股利	-
4	应收利息	3,278,180.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,456,478.23

#### 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：本基金本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
137	3,650,219.71	499,620,798.40	99.91%	459,301.42	0.09%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.3 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

注：1、期末基金从业人员持有本基金份额为 0。

2、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 0。

3、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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年9月20日）基金份额总额	200,898,913.94
本报告期期初基金份额总额	550,421,746.81
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	50,341,646.99
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	500,080,099.82

## § 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，基金管理人及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		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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
信达证券	2	167,127,353.62	100.00%	159,553.09	100.00%	-

### 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
信达证券	-	-	191,400,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 24 日
2	华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 29 日
3	华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 29 日
4	华泰柏瑞基金关于华泰柏瑞爱利混合基金份额净值计算位数变更及修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 29 日
5	华泰柏瑞基金关于聘任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 25 日
6	华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 19 日

## § 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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	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	持有份额	份额占比
机构	1	20170101~20170630	200,020,000.00	-	50,000,000.00	150,020,000.00	30.00
	2	20170101~20170630	349,600,798.40	-	-	349,600,798.40	69.91
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资产规模过小，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

注：无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层及托管人住所

### 12.3 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日