华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金
2018 年半年度报告

2018 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 25 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。

基金托管人中国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。

本基金名称自 2015 年 8 月 6 日起，由“华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞量化增强混合”，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》。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2

1.1 重要提示.....2

1.2 目录.....3

§2 基金简介.....6

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.....7

2.5 其他相关资料.....7

§3 主要财务指标和基金净值表现.....8

3.1 主要会计数据和财务指标.....8

3.2 基金净值表现.....8

3.3 其他指标.....9

§4 管理人报告.....10

4.1 基金管理人及基金经理情况.....10

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....12

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....12

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.....13

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....14

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....14

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....14

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.....15

§5 托管人报告.....16

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....16

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.....16

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.....16

§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....17

6.1 资产负债表.....17

6.2 利润表.....18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....19
6.4 报表附注.....20
§7 投资组合报告.....43
7.1 期末基金资产组合情况.....43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....43
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.....44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....50
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.....51
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.....51
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.....51
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.....51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....52
7.12 投资组合报告附注.....52
§8 基金份额持有人信息.....54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....54
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.....54
§9 开放式基金份额变动.....55
§10 重大事件揭示.....56
10.1 基金份额持有人大会决议.....56
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.....56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....56
10.4 基金投资策略的改变.....56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....56
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.....56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....56
10.8 其他重大事件.....59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....63

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 63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....63
§12 备查文件目录.....64
12.1 备查文件目录.....64
12.2 存放地点.....64
12.3 查阅方式.....64

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞量化增强混合
基金主代码	000172
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 8 月 2 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,407,890,315.97 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型混合投资基金，在力求有效控制投资风险的前提下，力争实现达到 或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 本基金力争将对业绩比较基准的年化跟踪误差控制在 8%以内。
投资策略	本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 指数。以增强指数投资收益为目的的股票投资策略如下：利用定量投资模型（如：多因子 alpha、风险估测、交易成本等模型），选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在严格控制组合预期跟踪误差的基础上，力求超越标的指数投资回报。一般情况下，本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 85%。债券投资策略:将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。同时运用金融衍生工具投资策略和融资融券和转融资转融券。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率＋2.5%(指年收益率，评价时按期间折算)
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200135	100818
法定代表人		贾波	陈四清

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	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 层及基金托管人住所

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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-26,089,465.19
本期利润	-605,952,418.90
加权平均基金份额本期利润	-0.1626
本期加权平均净值利润率	-11.39%
本期基金份额净值增长率	-9.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	167,870,279.12
期末可供分配基金份额利润	0.0381
期末基金资产净值	5,491,699,264.53
期末基金份额净值	1.246
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	137.96%

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	-4.62%	1.31%	-7.09%	1.22%	2.47%	0.09%
过去三个月	-7.00%	1.09%	-8.88%	1.08%	1.88%	0.01%
过去六个月	-9.88%	1.16%	-11.15%	1.10%	1.27%	0.06%
过去一年	-3.70%	0.94%	-1.53%	0.91%	-2.17%	0.03%
过去三年	-2.03%	1.55%	-13.93%	1.41%	11.90%	0.14%

自合同生效日至今	137.96%	1.49%	74.33%	1.43%	63.63%	0.06%

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 2013 年 8 月 2 日至 2018 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十四条（二）投资范围：本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%；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率不低于基金资产净值的 5%。

3.3 其他指标

注：无。

§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		
田汉卿	副总经理、本基金的基金经理	2013 年 8 月 2 日	-	16 年	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。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起任华泰柏瑞港股通量化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。

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%的同日反向交易共 2 次，系因为量化投资策略需要。

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

本报告期内，受外围市场调整、中兴事件、中美贸易战以及去杠杆等事件的影响，A 股市场回调压力增大。并且受大额质押爆仓、财务造假曝光等黑天鹅事件频发等因素影响，市场风险偏好降低，大市值因子本报告期表现较好。

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。

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 1.246 元；本报告期基金份额净值增长率为-9.88%，业绩比较基准收益率为-11.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年下半年，我们认为经历了一月份以来，尤其是 6 月份的深度调整之后， 在不发生系统风险的前提下， A 股市场具备了更好的投资价值。

下半年境外境内的不确定性因素仍然存在。境外面临全球央行进一步收紧流动性对各类资产价格的影响，境内面临金融去杠杆和监管趋严的影响。我们认为尽管有中美贸易摩擦升级、美股牛市终结等外部风险，但 A 股大概率可以走出独立行情，经过上半年的下跌以后，在不发生系统性风险的情况下，股票市场向下风险应该比较有限了。站在当前的时点，我们对后市比较乐观，认为 A 股股票是当前国内大类资产中风险收益特征最好的资产。

本基金还是坚持利用量化选股策略，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、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 12 次；每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 25%；基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，收益分配基准日可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。本基金于 2018 年 6 月 26 日进行利润分配，每 10 份基金份额派发现金红利 0.63 元，利润分配合计 274,981,482.47 元，其中现金形式发放总额为 217,755,834.23 元。截止本报告期末，本基金可分配收益为 167,870,279.12 元。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞量化增强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：华泰柏瑞量化增强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	6.4.7.1	193,347,408.99	166,301,754.21
结算备付金		115,739,388.47	15,436,273.03
存出保证金		8,918,390.03	1,573,094.42
交易性金融资产	6.4.7.2	5,053,233,198.39	4,966,973,790.19
其中：股票投资		4,933,203,198.39	4,767,615,790.19
基金投资		-	-
债券投资		120,030,000.00	199,358,000.00
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	-	-
应收证券清算款		146,370,227.67	548,092.17
应收利息	6.4.7.5	4,129,388.43	4,494,223.92
应收股利		-	-
应收申购款		1,242,124.82	8,494,356.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,522,980,126.80	5,163,821,584.29
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,202,282.17	-
应付赎回款		5,310,995.91	99,400,758.42
应付管理人报酬		4,406,800.17	5,009,371.09
应付托管费		1,101,700.01	1,252,342.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,032,852.45	8,429,500.50

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	226,231.56	785,947.88
负债合计		31,280,862.27	114,877,920.67
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,407,890,315.97	3,477,471,460.93
未分配利润	6.4.7.10	1,083,808,948.56	1,571,472,202.69
所有者权益合计		5,491,699,264.53	5,048,943,663.62
负债和所有者权益总计		5,522,980,126.80	5,163,821,584.29

注：1.报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.246 元，基金份额总额 4,407,890,315.97 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化增强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		-548,343,374.68	599,372,142.52
1.利息收入		3,660,504.90	1,827,065.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,414,085.73	1,227,709.56
债券利息收入		2,160,454.79	498,148.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		85,964.38	101,207.19
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		26,098,137.08	323,049,031.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-31,172,400.58	276,203,863.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	301,840.00	191,839.27
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	2,857,281.55	-
股利收益	6.4.7.16	54,111,416.11	46,653,329.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-579,862,953.71	272,532,131.30
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	1,760,937.05	1,963,914.10
减：二、费用		57,609,044.22	45,436,445.32
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	26,373,664.59	21,740,037.76
2．托管费	6.4.10.2.2	6,593,416.19	5,435,009.40
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	24,386,379.17	18,031,964.79
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		10,286.21	-
7．其他费用	6.4.7.20	245,298.06	229,433.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-605,952,418.90	553,935,697.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-605,952,418.90	553,935,697.20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞量化增强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）	3,477,471,460.93	1,571,472,202.69	5,048,943,663.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-605,952,418.90	-605,952,418.90
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）	930,418,855.04	393,270,647.24	1,323,689,502.28
其中：1.基金申购款	2,158,982,722.32	951,654,327.31	3,110,637,049.63
2.基金赎回款	-1,228,563,867.28	-558,383,680.07	-1,786,947,547.35
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-274,981,482.47	-274,981,482.47

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）	4,407,890,315.97	1,083,808,948.56	5,491,699,264.53
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）	2,317,143,270.01	914,299,262.17	3,231,442,532.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	553,935,697.20	553,935,697.20
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）	460,100,635.04	181,533,783.44	641,634,418.48
其中：1.基金申购款	1,714,259,914.57	809,602,943.30	2,523,862,857.87
2.基金赎回款	-1,254,159,279.53	-628,069,159.86	-1,882,228,439.39
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）	2,777,243,905.05	1,649,768,742.81	4,427,012,647.86

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

华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金(原名为华泰柏瑞量化指数增强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[2013]610 号《关于核准华泰柏瑞量化指数增强股票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《华泰柏瑞量化指数增强股票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 333,108,260.81 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(2013)第 441 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 8 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 333,186,365.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 78,104.91 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金名称自 2015 年 8 月 6 日起，由“华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞量化增强混合”，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》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化增强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，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货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(须符合中国证监会相关规定)。本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%；现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比率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＋2.5%。

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》、《华泰柏瑞量化增强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 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 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 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	193,347,408.99
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	193,347,408.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		5,277,538,854.58	4,933,203,198.39	-344,335,656.19
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	119,652,440.00	120,030,000.00	377,560.00
	合计	119,652,440.00	120,030,000.00	377,560.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,397,191,294.58	5,053,233,198.39	-343,958,096.19

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位： 人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	56,570,700.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	56,570,700.00	-	-	

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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	88,413.27
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	62,047.61
应收债券利息	4,021,452.05
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-42,982.20
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	457.70
合计	4,129,388.43

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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	8,032,852.45
银行间市场应付交易费用	-
合计	8,032,852.45

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13,000.89
预提费用	213,230.67
合计	226,231.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,477,471,460.93	3,477,471,460.93
本期申购	2,158,982,722.32	2,158,982,722.32
本期赎回(以"-"号填列)	-1,228,563,867.28	-1,228,563,867.28
- 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	4,407,890,315.97	4,407,890,315.97

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	376,402,992.08	1,195,069,210.61	1,571,472,202.69
本期利润	-26,089,465.19	-579,862,953.71	-605,952,418.90
本期基金份额交易产生的变动数	92,538,234.70	300,732,412.54	393,270,647.24
其中：基金申购款	233,195,096.95	718,459,230.36	951,654,327.31
基金赎回款	-140,656,862.25	-417,726,817.82	-558,383,680.07
本期已分配利润	-274,981,482.47	-	-274,981,482.47
本期末	167,870,279.12	915,938,669.44	1,083,808,948.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	934,774.55
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	469,174.51
其他	10,136.67
合计	1,414,085.73

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	7,805,400,850.99
减：卖出股票成本总额	7,836,573,251.57
买卖股票差价收入	-31,172,400.58

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 2018年1月1日至2018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	301,840.00
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	301,840.00

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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	82,560,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	79,698,160.00
减：应收利息总额	2,560,000.00
买卖债券差价收入	301,840.00

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

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期末无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	2,857,281.55

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	54,111,416.11
基金投资产生的股利收益	-
合计	54,111,416.11

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-575,967,093.71
——股票投资	-576,337,253.71
——债券投资	370,160.00
——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	-3,895,860.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-

合计	-579,862,953.71

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,309,676.64
转换费收入	451,260.41
合计	1,760,937.05

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金财产。

2、本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用的 25%的部分归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	24,386,379.17
银行间市场交易费用	-
合计	24,386,379.17

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	64,464.96
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	23,067.39
银行间账户服务费	9,000.00
合计	245,298.06

6.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产

生收入、发生费用；(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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
中国银行股份有限公司	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：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

无。

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

金额单位：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

	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	4,000,392,303.35	24.42%	2,642,877,478.96	21.85%

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 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	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	3,702,896.44	24.50%	3,702,896.44	46.10%
关联方名称	上年度可比期间 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	2,438,091.50	21.86%	-	-

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 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	26,373,664.59	21,740,037.76
其中：支付销售机构的客户维护费	1,748,778.00	1,424,273.62

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%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×1% / 当年天数。

6.4.10.2.2 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	6,593,416.19	5,435,009.40

6.4.10.2.3 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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(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：本报告期内与上年度可比期间，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。

6.4.10.5 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 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
中国银行股份有限公司	193,347,408.99	934,774.55	292,862,765.16	867,364.56

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

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

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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2018 年 6 月 26 日	-	2018 年 6 月 26 日	0.6300	217,755,834.23	57,225,648.24	274,981,482.47	
合计	-	-		0.6300	217,755,834.23	57,225,648.24	274,981,482.47	

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（ 2018 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
603706	东方环宇	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

6.4.12.2 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	停牌日期	停牌	期末估值单	复牌日期	复牌开盘单	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称		原因	价		价				
601390	中国中铁	2018 年 5 月 7 日	重大资产重组	7.47	2018 年 8 月 20 日	7.25	5,927,695	46,173,170.33	44,279,881.65	-
300118	东方日升	2018 年 5 月 7 日	重大资产重组	10.80	2018 年 8 月 7 日	9.63	3,643,698	43,932,834.30	39,351,938.40	-
601727	上海电气	2018 年 6 月 6 日	重大资产重组	6.34	2018 年 8 月 7 日	5.71	5,866,000	35,309,648.51	37,190,440.00	-
002102	冠福股份	2018 年 6 月 1 日	重大资产重组	4.07	-	-	7,448,000	31,249,970.49	30,313,360.00	-
000825	太钢不锈	2018 年 4 月 16 日	重大资产重组	6.00	-	-	4,816,774	24,796,488.50	28,900,644.00	-
002668	奥马电器	2018 年 6 月 15 日	重大资产重组	20.10	-	-	542,700	11,842,823.00	10,908,270.00	-

注：本基金截至 2016 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。

6.4.12.3 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

本基金本报告期内无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期内无交易所市场债券正回购。

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，其预期风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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相对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“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和法律监察部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；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中国银行，因而与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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	0.0	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	120,030,000.00	0.00
合计	120,030,000.00	0.00

注：未评级的债券包括政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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证券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开放式基金共同持有一家公司发行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，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 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 2018 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易

的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	193,347,408.99	-	-	-	-	-	193,347,408.99
结算备付金	115,739,388.47	-	-	-	-	-	115,739,388.47
存出保证金	1,017,164.03	-	-	-	-	7,901,226.00	8,918,390.03
交易性金融资	120,030,000.00	-	-	-	-	4,933,203,198.39	5,053,233,198.39

产							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	150,266,087.67	150,266,087.67
应收利息	-	-	-	-	-	4,129,388.43	4,129,388.43
应收申购款	-	-	-	-	-	1,242,124.82	1,242,124.82
其他资产	-	-	-	-	-	-3,895,860.00	-3,895,860.00
资产总计	430,133,961.49	-	-	-	-	5,092,846,165.31	5,522,980,126.80
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	12,202,282.17	12,202,282.17
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,310,995.91	5,310,995.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,406,800.17	4,406,800.17
应付托管费	-	-	-	-	-	1,101,700.01	1,101,700.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,032,852.45	8,032,852.45
其他负债	-	-	-	-	-	226,231.56	226,231.56
负债总计	-	-	-	-	-	31,280,862.27	31,280,862.27
利率敏感度缺口	430,133,961.49	-	-	-	-	5,061,565,303.04	5,491,699,264.53
上年度末 2017 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	166,301,754.21	-	-	-	-	-	166,301,754.21
结算备付金	15,436,273.03	-	-	-	-	-	15,436,273.03
存出保证金	1,573,094.42	-	-	-	-	-	1,573,094.42
交易性金融资产	79,984,000.00	-	119,374,000.00	-	-	4,767,615,790.19	4,966,973,790.19
应收证券清算款	-	-	-	-	-	548,092.17	548,092.17
应收利息	-	-	-	-	-	4,494,223.92	4,494,223.92
应收申购款	-	-	-	-	-	8,494,356.35	8,494,356.35
资产总计	263,295,121.66	-	119,374,000.00	-	-	4,781,152,462.63	5,163,821,584.29
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	99,400,758.42	99,400,758.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,009,371.09	5,009,371.09
应付托管费	-	-	-	-	-	1,252,342.78	1,252,342.78
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,429,500.50	8,429,500.50
其他负债	-	-	-	-	-	785,947.88	785,947.88
负债总计	-	-	-	-	-	114,877,920.67	114,877,920.67
利率敏感度缺口	263,295,121.66	-	119,374,000.00	-	-	4,666,274,541.96	5,048,943,663.62

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.19%(2017 年 12 月 31 日：3.95%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%；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率不低于基金资产净值的 5%。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，测试本基金面临的潜在价格风险，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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	4,933,203,198.39	89.83	-	-
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	120,030,000.00	2.19	-	-
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	5,053,233,198.39	92.02	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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（ 2018 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2017 年 12 月 31 日 ）
	沪深 300 指数上升 5%	25,290.00	24,572.00
	沪深 300 指数下降 5%	-25,290.00	-24,572.00

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	4,933,203,198.39	89.32
	其中：股票	4,933,203,198.39	89.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	120,030,000.00	2.17
	其中：债券	120,030,000.00	2.17
	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	309,086,797.46	5.60
8	其他各项资产	160,660,130.95	2.91
9	合计	5,522,980,126.80	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	15,979,189.69	0.29
B	采矿业	52,557,929.74	0.96
C	制造业	2,386,508,698.62	43.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	112,436,302.07	2.05
E	建筑业	244,391,672.70	4.45

F	批发和零售业	133,991,083.94	2.44
G	交通运输、仓储和邮政业	109,211,661.33	1.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	288,242,963.50	5.25
J	金融业	1,318,380,238.47	24.01
K	房地产业	169,852,771.80	3.09
L	租赁和商务服务业	30,312,110.24	0.55
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	56,161,054.34	1.02
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	15,177,521.95	0.28
S	综合	-	-
	合计	4,933,203,198.39	89.83

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	601318	中国平安	5,013,058	293,664,937.64	5.35
2	601288	农业银行	39,884,600	137,203,024.00	2.50
3	601006	大秦铁路	13,302,273	109,211,661.33	1.99
4	000651	格力电器	2,127,087	100,292,152.05	1.83
5	000338	潍柴动力	10,559,532	92,395,905.00	1.68
6	601398	工商银行	17,104,097	90,993,796.04	1.66
7	601186	中国铁建	10,400,722	89,654,223.64	1.63
8	002304	洋河股份	673,551	88,639,311.60	1.61
9	601788	光大证券	7,024,263	77,126,407.74	1.40
10	601800	中国交建	6,460,119	73,580,755.41	1.34
11	600104	上汽集团	2,095,099	73,307,514.01	1.33
12	600519	贵州茅台	98,350	71,939,091.00	1.31

13	600516	方大炭素	2,871,372	70,004,049.36	1.27
14	601997	贵阳银行	5,515,714	68,174,225.04	1.24
15	603589	口子窖	1,098,236	67,486,602.20	1.23
16	600050	中国联通	13,665,497	67,234,245.24	1.22
17	000418	小天鹅Ａ	937,497	65,015,416.95	1.18
18	600015	华夏银行	8,639,448	64,363,887.60	1.17
19	601009	南京银行	8,234,438	63,652,205.74	1.16
20	601328	交通银行	10,997,719	63,126,907.06	1.15
21	600276	恒瑞医药	812,120	61,526,211.20	1.12
22	600027	华电国际	15,389,100	60,325,272.00	1.10
23	000858	五 粮 液	767,371	58,320,196.00	1.06
24	600741	华域汽车	2,424,618	57,511,938.96	1.05
25	000951	中国重汽	4,276,431	56,833,767.99	1.03
26	603568	伟明环保	2,216,594	56,079,828.20	1.02
27	601366	利群股份	5,981,492	55,448,430.84	1.01
28	601238	广汽集团	4,968,394	55,347,909.16	1.01
29	600406	国电南瑞	3,339,766	52,768,302.80	0.96
30	600801	华新水泥	3,492,185	52,487,540.55	0.96
31	002373	千方科技	3,936,307	51,368,806.35	0.94
32	600309	万华化学	1,124,500	51,074,790.00	0.93
33	000528	柳　　工	4,527,078	48,485,005.38	0.88
34	002449	国星光电	4,480,404	47,671,498.56	0.87
35	601003	柳钢股份	5,865,143	46,451,932.56	0.85
36	601601	中国太保	1,448,411	46,131,890.35	0.84
37	600208	新湖中宝	11,916,200	45,519,884.00	0.83
38	601390	中国中铁	5,927,695	44,279,881.65	0.81
39	002422	科伦药业	1,360,874	43,684,055.40	0.80
40	600926	杭州银行	3,861,670	42,825,920.30	0.78
41	002013	中航机电	5,619,906	42,542,688.42	0.77
42	601998	中信银行	6,747,033	41,899,074.93	0.76
43	600016	民生银行	5,924,500	41,471,500.00	0.76
44	300113	顺网科技	2,364,681	41,169,096.21	0.75
45	600031	三一重工	4,577,200	41,057,484.00	0.75
46	600816	安信信托	5,668,429	41,039,425.96	0.75
47	600486	扬农化工	717,706	40,141,296.58	0.73
48	300118	东方日升	3,643,698	39,351,938.40	0.72
49	002146	荣盛发展	4,368,950	38,140,933.50	0.69
50	601727	上海电气	5,866,000	37,190,440.00	0.68
51	600837	海通证券	3,911,636	37,043,192.92	0.67

52	002174	游族网络	1,826,077	36,338,932.30	0.66
53	000002	万　科Ａ	1,409,572	34,675,471.20	0.63
54	600585	海螺水泥	1,008,416	33,761,767.68	0.61
55	601618	中国中冶	10,067,900	33,526,107.00	0.61
56	600332	白云山	874,500	33,274,725.00	0.61
57	002736	国信证券	3,636,879	33,095,598.90	0.60
58	600999	招商证券	2,416,717	33,060,688.56	0.60
59	600023	浙能电力	7,082,200	33,003,052.00	0.60
60	000581	威孚高科	1,464,678	32,384,030.58	0.59
61	000519	中兵红箭	4,149,413	32,240,939.01	0.59
62	000553	沙隆达Ａ	2,038,645	32,230,977.45	0.59
63	002391	长青股份	2,504,987	32,013,733.86	0.58
64	000425	徐工机械	7,544,071	31,986,861.04	0.58
65	601128	常熟银行	5,591,623	31,984,083.56	0.58
66	600887	伊利股份	1,144,300	31,925,970.00	0.58
67	600036	招商银行	1,198,793	31,696,086.92	0.58
68	600705	中航资本	6,525,269	30,473,006.23	0.55
69	600337	美克家居	5,193,391	30,433,271.26	0.55
70	002102	冠福股份	7,448,000	30,313,360.00	0.55
71	300482	万孚生物	420,555	29,438,850.00	0.54
72	000825	太钢不锈	4,816,774	28,900,644.00	0.53
73	000413	东旭光电	4,710,152	28,543,521.12	0.52
74	000975	银泰资源	2,796,694	28,358,477.16	0.52
75	300038	梅泰诺	2,539,160	27,067,445.60	0.49
76	300427	红相股份	1,853,509	26,690,529.60	0.49
77	601229	上海银行	1,544,594	24,342,801.44	0.44
78	002402	和而泰	2,890,100	23,987,830.00	0.44
79	000537	广宇发展	2,415,096	23,281,525.44	0.42
80	600518	康美药业	982,200	22,472,736.00	0.41
81	603609	禾丰牧业	2,367,536	22,349,539.84	0.41
82	601628	中国人寿	983,091	22,139,209.32	0.40
83	603288	海天味业	298,029	21,946,855.56	0.40
84	000703	恒逸石化	1,470,620	21,882,825.60	0.40
85	601908	京运通	4,285,300	19,626,674.00	0.36
86	601222	林洋能源	3,926,143	19,552,192.14	0.36
87	002773	康弘药业	374,872	19,497,092.72	0.36
88	002677	浙江美大	1,113,229	19,370,184.60	0.35
89	000100	TCL 集团	6,647,200	19,276,880.00	0.35
90	000823	超声电子	2,730,004	19,273,828.24	0.35

91	002626	金达威	1,097,757	19,046,083.95	0.35
92	000591	太阳能	4,818,967	17,637,419.22	0.32
93	000952	广济药业	1,217,499	17,495,460.63	0.32
94	000596	古井贡酒	191,192	16,974,025.76	0.31
95	002299	圣农发展	1,031,581	15,979,189.69	0.29
96	300122	智飞生物	348,200	15,926,668.00	0.29
97	603368	柳药股份	462,756	15,631,897.68	0.28
98	601231	环旭电子	1,632,734	14,808,897.38	0.27
99	600978	宜华生活	2,120,360	14,482,058.80	0.26
100	002027	分众传媒	1,501,650	14,370,790.50	0.26
101	600511	国药股份	524,908	14,146,270.60	0.26
102	600373	中文传媒	1,072,727	13,784,541.95	0.25
103	600862	中航高科	2,195,989	13,505,332.35	0.25
104	002640	跨境通	872,773	13,109,050.46	0.24
105	002001	新 和 成	685,188	12,991,164.48	0.24
106	600056	中国医药	687,932	12,568,517.64	0.23
107	000902	新洋丰	1,345,505	12,378,646.00	0.23
108	000333	美的集团	235,055	12,274,572.10	0.22
109	603111	康尼机电	1,832,373	12,111,985.53	0.22
110	600339	中油工程	2,601,042	11,678,678.58	0.21
111	002294	信立泰	300,400	11,165,868.00	0.20
112	600376	首开股份	1,579,026	11,100,552.78	0.20
113	002668	奥马电器	542,700	10,908,270.00	0.20
114	600426	华鲁恒升	619,722	10,900,909.98	0.20
115	000813	德展健康	1,321,073	10,885,641.52	0.20
116	600566	济川药业	225,154	10,850,171.26	0.20
117	601888	中国国旅	162,118	10,442,020.38	0.19
118	600219	南山铝业	3,703,500	10,036,485.00	0.18
119	002537	海联金汇	1,009,400	9,528,736.00	0.17
120	600708	光明地产	2,215,700	9,527,510.00	0.17
121	000547	航天发展	1,112,200	8,686,282.00	0.16
122	002706	良信电器	1,316,950	8,612,853.00	0.16
123	002600	领益智造	1,659,300	8,611,767.00	0.16
124	600308	华泰股份	1,661,213	8,272,840.74	0.15
125	002095	生 意 宝	224,300	8,050,127.00	0.15
126	300021	大禹节水	1,495,400	7,746,172.00	0.14
127	600338	西藏珠峰	372,100	7,709,912.00	0.14
128	002117	东港股份	474,300	7,033,869.00	0.13
129	002518	科士达	671,000	6,689,870.00	0.12

130	300349	金卡智能	307,787	5,921,821.88	0.11
131	600057	厦门象屿	1,102,064	5,499,299.36	0.10
132	002035	华帝股份	223,665	5,464,135.95	0.10
133	600282	南钢股份	1,168,100	5,163,002.00	0.09
134	300274	阳光电源	516,200	4,630,314.00	0.08
135	603993	洛阳钼业	731,000	4,597,990.00	0.08
136	601607	上海医药	174,549	4,171,721.10	0.08
137	601633	长城汽车	423,608	4,159,830.56	0.08
138	600438	通威股份	508,000	3,505,200.00	0.06
139	600606	绿地控股	452,877	2,961,815.58	0.05
140	300369	绿盟科技	273,000	2,921,100.00	0.05
141	601636	旗滨集团	648,900	2,887,605.00	0.05
142	300003	乐普医疗	77,300	2,835,364.00	0.05
143	600094	大名城	482,800	2,780,928.00	0.05
144	601211	国泰君安	188,419	2,777,296.06	0.05
145	002061	浙江交科	263,500	2,758,845.00	0.05
146	600567	山鹰纸业	553,500	2,136,510.00	0.04
147	600622	光大嘉宝	259,270	1,864,151.30	0.03
148	000156	华数传媒	144,500	1,392,980.00	0.03
149	300383	光环新网	98,800	1,324,908.00	0.02
150	300009	安科生物	65,891	1,215,030.04	0.02
151	300308	中际旭创	18,700	1,122,748.00	0.02
152	600655	豫园股份	110,600	1,045,170.00	0.02
153	600483	福能股份	123,100	845,697.00	0.02
154	601991	大唐发电	198,600	601,758.00	0.01
155	000040	东旭蓝天	58,600	591,860.00	0.01
156	000050	深天马 A	38,652	549,631.44	0.01
157	002385	大北农	113,900	470,407.00	0.01
158	600028	中国石化	32,800	212,872.00	0.00
159	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.00
160	601818	光大银行	25,976	95,072.16	0.00
161	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.00
162	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
163	002766	索菱股份	2,200	26,136.00	0.00
164	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
165	600398	海澜之家	1,600	20,384.00	0.00
166	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00
167	300338	开元股份	500	6,785.00	0.00
168	600729	重庆百货	160	5,272.00	0.00

169	601877	正泰电器	200	4,464.00	0.00
170	600273	嘉化能源	236	2,138.16	0.00
171	000921	海信科龙	126	1,305.36	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	601318	中国平安	126,000,006.17	2.50
2	601288	农业银行	119,130,547.61	2.36
3	000528	柳　　工	102,271,196.30	2.03
4	000651	格力电器	101,249,513.41	2.01
5	002304	洋河股份	95,590,116.14	1.89
6	601997	贵阳银行	89,688,388.42	1.78
7	600801	华新水泥	88,231,136.83	1.75
8	601800	中国交建	88,218,067.87	1.75
9	600516	方大炭素	87,385,771.07	1.73
10	000858	五 粮 液	86,351,305.75	1.71
11	002422	科伦药业	85,731,773.27	1.70
12	002373	千方科技	85,034,596.60	1.68
13	601788	光大证券	82,345,423.39	1.63
14	002146	荣盛发展	81,977,115.47	1.62
15	601225	陕西煤业	81,407,855.45	1.61
16	002626	金达威	79,194,900.46	1.57
17	600050	中国联通	76,088,086.15	1.51
18	601238	广汽集团	74,495,662.06	1.48
19	002736	国信证券	73,866,383.03	1.46
20	600015	华夏银行	72,441,242.04	1.43

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	601288	农业银行	159,959,672.78	3.17
2	600036	招商银行	146,924,655.20	2.91
3	600030	中信证券	133,901,693.84	2.65
4	600519	贵州茅台	132,176,849.90	2.62
5	000651	格力电器	131,924,248.98	2.61
6	601318	中国平安	102,583,176.30	2.03
7	601601	中国太保	97,633,888.00	1.93
8	000333	美的集团	95,052,208.65	1.88
9	600585	海螺水泥	92,768,598.83	1.84
10	600383	金地集团	92,728,284.43	1.84
11	600028	中国石化	91,204,005.56	1.81
12	000002	万　科Ａ	90,781,098.93	1.80
13	600029	南方航空	90,222,844.03	1.79
14	601377	兴业证券	83,899,970.51	1.66
15	601225	陕西煤业	81,532,762.61	1.61
16	601166	兴业银行	81,138,242.06	1.61
17	601818	光大银行	79,348,179.63	1.57
18	300274	阳光电源	78,923,397.08	1.56
19	000776	广发证券	77,929,508.49	1.54
20	600664	哈药股份	73,909,303.62	1.46

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	8,578,497,913.48
卖出股票收入（成交）总额	7,805,428,390.99

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

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	120,030,000.00	2.19
	其中：政策性金融债	120,030,000.00	2.19
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	120,030,000.00	2.19

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	170410	17 农发 10	1,000,000	100,030,000.00	1.82
2	170207	17 国开 07	200,000	20,000,000.00	0.36

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

7.10.1 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（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1809	IF1809	51	52,674,840.00	-3,895,860.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-3,895,860.00
股指期货投资本期收益（元）					2,857,281.55
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-3,895,860.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

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。

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	8,918,390.03
2	应收证券清算款	146,370,227.67
3	应收股利	-

4	应收利息	4,129,388.43
5	应收申购款	1,242,124.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	160,660,130.95

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。

§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
43,289	101,824.72	3,833,945,410.09	86.98%	573,944,905.88	13.02%

8.2 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	4,366,742.34	0.0991%

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

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	10~50

注：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份额总量的数量区间为100 万份以上。

本基金基金经理持有本开放式基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含）。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2013 年 8 月 2 日 ）基金份额总额	333,186,365.72
本报告期期初基金份额总额	3,477,471,460.93
本报告期基金总申购份额	2,158,982,722.32
减:本报告期基金总赎回份额	1,228,563,867.28
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	4,407,890,315.97

§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			
华泰证券	2	4,000,392,303.35	24.42%	3,702,896.44	24.50%	-
招商证券	1	2,620,562,780.01	16.00%	2,388,122.18	15.80%	-
银河证券	1	1,950,028,039.32	11.90%	1,816,070.87	12.01%	-
中信证券	1	1,573,295,843.17	9.60%	1,465,209.57	9.69%	-
广发证券	1	1,370,981,631.62	8.37%	1,276,790.14	8.45%	-
国信证券	1	1,075,207,690.11	6.56%	979,840.13	6.48%	-
方正证券	1	646,635,978.95	3.95%	589,280.21	3.90%	-
中金公司	1	580,375,920.87	3.54%	540,498.32	3.58%	-
东方证券	1	482,936,071.87	2.95%	449,758.14	2.98%	-
太平洋证券	1	480,150,960.14	2.93%	437,564.31	2.89%	-
中原证券	1	452,651,036.69	2.76%	421,554.24	2.79%	-
国金证券	1	377,796,685.34	2.31%	344,287.52	2.28%	-
东北证券	1	300,810,839.12	1.84%	274,130.76	1.81%	-
海通证券	1	251,422,293.90	1.53%	229,121.37	1.52%	-
国泰君安	1	174,165,794.62	1.06%	158,717.71	1.05%	-
申银万国	1	44,368,941.10	0.27%	41,320.18	0.27%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	190,000,000.00	100.00%	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-

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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 6 月 30 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停浙江金观诚基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 6 月 29 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加上海爱建财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 6 月 28 日
4	华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金 A 类恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 6 月 28 日
5	华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金 2018 年分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 6 月 23 日
6	华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金 A 类暂停大额申购业务（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 6 月 23 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加深圳信诚基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 6 月 21 日

	通基金转换、定投业务的公告		
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有中兴通讯（000063）估值调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 6 月 20 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加和耕传承基金销售有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 6 月 7 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加扬州国信嘉利基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 6 月 5 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有长期停牌证券估值调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 4 月 24 日
12	华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 4 月 21 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有中兴通讯（000063）估值调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 4 月 20 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加深圳盈信基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及参加费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 4 月 13 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 4 月 2 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 3 月 31 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 3 月 31 日
18	华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金 2017 年年报	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 3 月 28 日
19	华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金 2017 年年报摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 3 月 28 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有长期停牌证券估值调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 3 月 24 日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 54 只证券投资基金修改基	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 3 月 23 日

	金合同和托管协议的公告		
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 3 月 14 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有长期停牌证券估值调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 2 月 8 日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加东亚银行手机银行渠道定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 1 月 31 日
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加北京展恒基金销售股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 1 月 30 日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加江苏银行为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 1 月 27 日
27	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加通华财富（上海）基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换及参加费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 1 月 25 日
28	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加上海有鱼基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及参加费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 1 月 25 日
29	华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 1 月 22 日
30	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开通基金转换业务并参加转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 1 月 19 日
31	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有长期停牌证券估值调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 1 月 12 日
32	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加新纪元期货股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及参加费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 1 月 9 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	20180101-20180615	820,363,348.07	0.00	0.00	820,363,348.07	18.61%
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

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2018 年 8 月 25 日