

# 华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

2019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：2019年8月29日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之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2019年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞创新升级混合
基金主代码	000566
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月6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	443,980,063.08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，本基金追求基金资产的长期增值，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	本基金将采取积极、主动的资产配置策略，精选与经济结构调整与转型主题直接相关，具备长期盈利能力提升的上市公司，力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证TMT产业主题指数收益率×20%+中证新兴产业指数收益率×40%+中债总指数（全价）收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，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

### 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	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### §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(2019年1月1日 - 2019年6月30日 )
本期已实现收益	92,030,295.28
本期利润	154,190,819.81
加权平均基金份额本期利润	0.3805
本期基金份额净值增长率	18.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日 )
期末可供分配基金份额利润	0.9996
期末基金资产净值	997,829,167.31
期末基金份额净值	2.247

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。

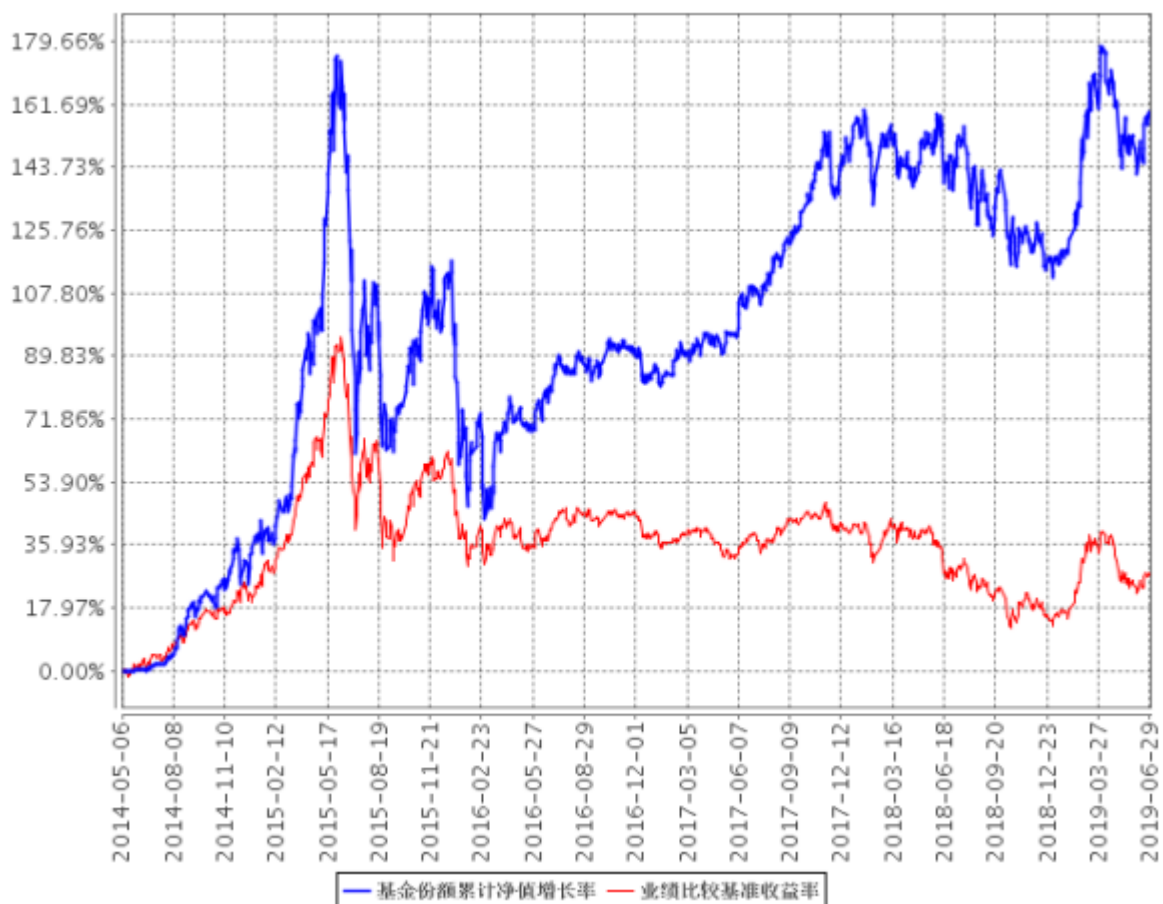
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	3.31%	1.15%	2.04%	0.79%	1.27%	0.36%
过去三个月	-4.06%	1.50%	-6.60%	1.07%	2.54%	0.43%
过去六个月	18.89%	1.51%	11.36%	1.09%	7.53%	0.42%
过去一年	4.85%	1.42%	-1.50%	1.05%	6.35%	0.37%
过去三年	44.14%	1.12%	-9.56%	0.81%	53.70%	0.31%
自基金合同生效起至今	159.02%	1.67%	27.32%	1.10%	131.70%	0.57%

##### 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：1. 图示日期为2014年5月6日至2019年6月30日。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于2004年11月18日成立的合资基金管理公司，注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为49%、49%和2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选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、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选30灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活

配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞现代服务业混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞核心优势混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金。截至2019年6月30日，公司基金管理规模为1030.82亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张慧	投资部总监助理、本基金的基金经理	2014年5月6日	-	12年	经济学硕士，12年证券从业经历。2007年7月至2010年6月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010年6月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理，2013年9月至2018年5月任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理，2014年5月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2015年2月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年1月起任投资部副总监。2018年1月起任投资部副总监及华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。2019年3月起任投资研究部副总监。

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3次。系基于基本面分析，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

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

1季度政策环境较去年有较大的改善，这也是带动市场环境整体走暖的主要原因。从数据上来看，我们看到社会融资规模数据从2月份开始出现同比改善。但2季度开始，货币政策环境边际趋紧是导致市场出现调整的第一个触发因素。央行及政治局会议在4月份对未来货币政策的表态较去年底的全面放松有一定的收紧，同时“包商”事件对固定收益市场的风险偏好也造成较大的



打压，这些均导致了之后的短端利率在2季度有明显的上行，其中1年期国债利率由1季度末的2.4%一度回升至2.7%的水平，而7天shibor利率回升至2.8%的水平。货币政策的边际收紧，导致A股市场估值出现收缩，市场在3200点左右开始震荡回落。

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

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

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

本基金在报告期内继续保持行业及个股景气度选股的思路，整体来说行业上增加了对消费类行业的配置比例，但保持了之前计算机、机械以及新能源车、电子等成长型行业配置的个股，对净值有一定拖累。对金融板块进行了一定程度的增配，减少了地产行业的配置。

#### 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2.247元；本报告期基金份额净值增长率为18.89%，业绩比较基准收益率为11.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

但从坏的一面来看，经济下行、盈利下行的压力短期内尚未见到缓解。2季度工业企业利润单月出现同比负增长，工业增加值快速回落，且6月PMI数据未见改观，这些都意味着整个A股2季度的企业盈利增速较1季度可能还会有一定程度的下行。展望3季度，领先的下游消费品需求未见

好转，地产去化率在6月开始显著恶化，汽车、家电未见好转，因此我们预计3季度国内宏观经济可能仍将小幅下行。

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

操作方面，由于指数变动的空间不大，本基金仍将保持目前的仓位水平，更加注重在中报季对公司业绩质量的判断，自下而上挖掘个股，在组合方面剔除一些季报低于预期的品种，加入一些具备业绩持续超预期能力的个股及细分子行业，力争获得超额收益。

#### **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**

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”）在华泰柏瑞创新升级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：华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	163,232,841.37	122,850,795.18
结算备付金	2,757,450.97	3,067,973.20
存出保证金	410,309.82	331,452.91
交易性金融资产	829,190,242.49	643,402,089.22
其中：股票投资	829,190,242.49	643,402,089.22
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	17,531,451.63	2,423,429.67
应收利息	32,796.28	31,724.33
应收股利	-	-
应收申购款	2,076,974.47	15,441,999.12
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,015,232,067.03	787,549,463.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	13,593,796.69	4,380,470.84
应付赎回款	240,937.97	6,754,324.41
应付管理人报酬	1,064,243.94	976,724.60
应付托管费	177,373.97	162,787.44
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,147,669.72	1,539,345.57
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	178,877.43	376,887.89

负债合计	17,402,899.72	14,190,540.75
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	443,980,063.08	409,266,487.39
未分配利润	553,849,104.23	364,092,435.49
所有者权益合计	997,829,167.31	773,358,922.88
负债和所有者权益总计	1,015,232,067.03	787,549,463.63

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值2.247元，基金份额总额443,980,063.08份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年6月30日
<b>一、收入</b>	169,184,423.12	-118,468.15
1.利息收入	489,645.47	213,635.56
其中：存款利息收入	470,944.61	213,635.33
债券利息收入	1.34	0.23
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	18,699.52	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	105,767,826.06	21,256,067.92
其中：股票投资收益	101,955,930.03	18,066,431.55
基金投资收益	-	-
债券投资收益	371.88	489.96
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,811,524.15	3,189,146.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	62,160,524.53	-21,714,439.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	766,427.06	126,267.85
<b>减：二、费用</b>	14,993,603.31	5,921,366.88
1. 管理人报酬	6,459,316.61	2,976,688.25
2. 托管费	1,076,552.76	496,114.64
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	7,251,157.45	2,251,755.94
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	206,576.49	196,808.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”</b>	154,190,819.81	-6,039,835.03

号填列)		
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	154,190,819.81	-6,039,835.03

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	409,266,487.39	364,092,435.49	773,358,922.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	154,190,819.81	154,190,819.81
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）	34,713,575.69	35,565,848.93	70,279,424.62
其中：1.基金申购款	219,348,981.25	251,303,644.22	470,652,625.47
2.基金赎回款	-184,635,405.56	-215,737,795.29	-400,373,200.85
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）	443,980,063.08	553,849,104.23	997,829,167.31
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	137,391,947.61	205,933,854.24	343,325,801.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,039,835.03	-6,039,835.03
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）	49,063,629.22	68,872,124.84	117,935,754.06
其中：1.基金申购款	73,375,175.75	105,979,239.86	179,354,415.61
2.基金赎回款	-24,311,546.53	-37,107,115.02	-61,418,661.55

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）	-	-55,575,215.68	-55,575,215.68
五、期末所有者权益（基金净值）	186,455,576.83	213,190,928.37	399,646,505.20

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

华泰柏瑞创新升级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]88号《关于核准华泰柏瑞创新升级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《华泰柏瑞创新升级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267,666,871.23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224号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金合同》于2014年5月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为267,739,518.28份基金份额,其中认购资金利息折合72,647.05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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞创新升级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)。本基金持有的股票占基金资产的比例为30%-95%,其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的80%;债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-70%,其中,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,本基金保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为中证TMT产业主题指数收益率×20%+中证新兴产业指数收益率×40%+中债总指数(全价)收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2019年8月29日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金2019年1月1日至2019年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **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:

(1) 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。

(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。

(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。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。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

注：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(“华泰柏瑞基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	97,142,839.91	2.02%	-	-

#### 6.4.8.1.2 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。

#### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券股份有限公司	88,526.56	2.00%	82,807.47	3.86%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-

### 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 2019年1月1日至2019年6月30 日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,459,316.61	2,976,688.25
其中：支付销售机构的客户维护费	555,241.85	768,278.36

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1.5%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×1.5% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,076,552.76	496,114.64

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.3 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。

#### 6.4.8.3 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。

#### 6.4.8.4 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

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。

##### 6.4.8.4.2 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：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。

#### 6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018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	163,232,841.37	425,309.58	61,146,341.16	198,385.11

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。

#### 6.4.8.6 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

#### 6.4.8.7 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。

#### 6.4.9 期末（2019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

6.4.12.1.1 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
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.1.1 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。

###### 6.4.9.1.2 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。

#### 6.4.10 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	829,190,242.49	81.67
	其中：股票	829,190,242.49	81.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	165,990,292.34	16.35
8	其他各项资产	20,051,532.20	1.98
9	合计	1,015,232,067.03	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	141,575.28	0.01
B	采矿业	847,545.08	0.08
C	制造业	457,984,664.01	45.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	180,479.88	0.02
E	建筑业	13,503,117.75	1.35
F	批发和零售业	1,315,108.93	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	11,851,003.03	1.19
H	住宿和餐饮业	13,089.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	110,505,926.48	11.07
J	金融业	118,735,013.22	11.90
K	房地产业	38,702,741.59	3.88
L	租赁和商务服务业	13,648.20	0.00
M	科学研究和技术服务业	23,490,569.16	2.35
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	30,322,001.19	3.04
R	文化、体育和娱乐业	21,583,759.25	2.16
S	综合	-	-
	合计	829,190,242.49	83.10

## 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	600519	贵州茅台	61,357	60,375,288.00	6.05
2	601318	中国平安	570,459	50,548,371.99	5.07
3	601012	隆基股份	2,138,772	49,427,020.92	4.95
4	600036	招商银行	1,330,717	47,879,197.66	4.80
5	000661	长春高新	131,084	44,306,392.00	4.44
6	000902	新洋丰	3,951,549	42,400,120.77	4.25
7	000002	万科A	1,391,443	38,696,029.83	3.88
8	000333	美的集团	665,693	34,522,838.98	3.46
9	000651	格力电器	498,696	27,428,280.00	2.75
10	002851	麦格米特	1,328,100	26,256,537.00	2.63

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人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	601318	中国平安	104,614,911.64	13.53
2	601012	隆基股份	68,546,323.07	8.86
3	000002	万科A	65,892,617.40	8.52
4	600030	中信证券	64,910,788.29	8.39
5	600050	中国联通	64,511,595.58	8.34
6	600519	贵州茅台	57,397,779.50	7.42
7	601398	工商银行	56,238,392.00	7.27
8	000651	格力电器	55,222,344.29	7.14
9	600036	招商银行	47,332,282.77	6.12
10	600048	保利地产	45,065,302.46	5.83
11	601186	中国铁建	44,958,319.95	5.81
12	000625	长安汽车	38,405,307.43	4.97

13	603583	捷昌驱动	38,049,389.67	4.92
14	300271	华宇软件	36,191,670.77	4.68
15	000661	长春高新	35,504,349.04	4.59
16	600886	国投电力	35,232,391.95	4.56
17	300725	药石科技	34,768,164.05	4.50
18	600547	山东黄金	34,712,383.44	4.49
19	000333	美的集团	34,061,590.10	4.40
20	300525	博思软件	33,229,955.92	4.30
21	300015	爱尔眼科	32,611,559.07	4.22
22	002332	仙琚制药	28,700,039.52	3.71
23	601231	环旭电子	28,579,385.52	3.70
24	600872	中炬高新	28,441,883.48	3.68
25	601211	国泰君安	26,506,034.69	3.43
26	601166	兴业银行	25,895,428.00	3.35
27	300413	芒果超媒	25,852,306.33	3.34
28	600233	圆通速递	25,821,689.68	3.34
29	603517	绝味食品	25,167,985.20	3.25
30	600705	中航资本	25,019,833.17	3.24
31	600132	重庆啤酒	24,778,048.60	3.20
32	300284	苏文科	24,638,717.30	3.19
33	300253	卫宁健康	24,295,793.52	3.14
34	000902	新洋丰	22,978,592.76	2.97
35	600763	通策医疗	22,830,792.20	2.95
36	002648	卫星石化	22,784,457.85	2.95
37	002597	金禾实业	22,194,148.23	2.87
38	002677	浙江美大	21,749,971.48	2.81
39	002851	麦格米特	21,619,482.78	2.80
40	002468	申通快递	21,602,912.24	2.79
41	603369	今世缘	21,160,394.52	2.74
42	300572	安车检测	20,442,355.94	2.64
43	601668	中国建筑	19,995,344.00	2.59
44	000858	五粮液	19,794,353.20	2.56
45	300438	鹏辉能源	19,791,037.53	2.56
46	300130	新国都	19,779,265.85	2.56
47	300047	天源迪科	19,300,679.89	2.50
48	600570	恒生电子	19,056,874.00	2.46

49	601233	桐昆股份	18,682,919.98	2.42
50	600887	伊利股份	18,177,908.33	2.35
51	600837	海通证券	18,098,927.00	2.34
52	300760	迈瑞医疗	17,955,477.44	2.32
53	603939	益丰药房	17,814,189.92	2.30
54	002353	杰瑞股份	17,754,892.12	2.30
55	603605	珀莱雅	17,747,515.00	2.29
56	300059	东方财富	17,198,439.00	2.22
57	300014	亿纬锂能	17,061,083.42	2.21
58	002223	鱼跃医疗	17,028,778.20	2.20
59	002236	大华股份	16,738,258.15	2.16
60	002812	恩捷股份	16,732,973.82	2.16
61	601799	星宇股份	16,657,888.12	2.15
62	603060	国检集团	16,479,639.99	2.13

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	601398	工商银行	77,709,969.40	10.05
2	600030	中信证券	73,994,262.48	9.57
3	600547	山东黄金	65,604,952.01	8.48
4	601318	中国平安	60,457,363.34	7.82
5	600048	保利地产	58,396,289.82	7.55
6	300760	迈瑞医疗	54,384,919.80	7.03
7	600050	中国联通	45,241,308.78	5.85
8	000002	万科A	44,034,434.23	5.69
9	600886	国投电力	43,890,374.75	5.68
10	300413	芒果超媒	40,466,305.66	5.23
11	000625	长安汽车	38,590,847.48	4.99
12	600271	航天信息	34,676,342.21	4.48
13	601231	环旭电子	33,681,319.20	4.36
14	601186	中国铁建	32,648,094.87	4.22
15	300365	恒华科技	32,559,720.78	4.21
16	601006	大秦铁路	32,237,632.54	4.17
17	600763	通策医疗	32,230,962.04	4.17
18	002032	苏泊尔	31,015,932.84	4.01



19	000661	长春高新	30,318,670.95	3.92
20	601211	国泰君安	29,657,661.38	3.83
21	002648	卫星石化	29,284,489.27	3.79
22	300130	新国都	28,562,286.12	3.69
23	300271	华宇软件	27,958,164.01	3.62
24	600132	重庆啤酒	27,696,224.99	3.58
25	603337	杰克股份	26,768,302.03	3.46
26	603043	广州酒家	26,670,785.42	3.45
27	002468	申通快递	26,628,496.93	3.44
28	600705	中航资本	26,096,945.50	3.37
29	300572	安车检测	25,997,855.71	3.36
30	601166	兴业银行	25,984,797.00	3.36
31	603583	捷昌驱动	25,942,852.41	3.35
32	000651	格力电器	25,618,920.80	3.31
33	002851	麦格米特	25,297,233.74	3.27
34	002120	韵达股份	24,878,172.20	3.22
35	603517	绝味食品	24,248,882.90	3.14
36	002511	中顺洁柔	24,132,861.39	3.12
37	300284	苏交科	23,886,477.48	3.09
38	600233	圆通速递	23,880,910.56	3.09
39	300546	雄帝科技	23,687,590.07	3.06
40	002117	东港股份	23,502,288.65	3.04
41	002332	仙琚制药	23,336,071.53	3.02
42	603369	今世缘	22,634,688.87	2.93
43	600161	天坛生物	21,487,468.46	2.78
44	600900	长江电力	21,390,446.16	2.77
45	600872	中炬高新	20,929,370.60	2.71
46	000902	新洋丰	20,213,245.53	2.61
47	601668	中国建筑	19,621,266.32	2.54
48	600406	国电南瑞	19,502,849.43	2.52
49	600674	川投能源	19,443,600.44	2.51
50	600104	上汽集团	19,251,168.74	2.49
51	603605	珀莱雅	19,227,617.93	2.49
52	601012	隆基股份	19,169,097.28	2.48
53	600837	海通证券	19,008,877.00	2.46
54	002677	浙江美大	18,890,336.47	2.44
55	601233	桐昆股份	18,849,888.59	2.44
56	601799	星宇股份	18,627,963.03	2.41

57	601939	建设银行	18,494,746.13	2.39
58	300725	药石科技	18,326,305.51	2.37
59	002223	鱼跃医疗	18,177,428.48	2.35
60	300438	鹏辉能源	18,111,132.11	2.34
61	002236	大华股份	17,678,586.30	2.29
62	300059	东方财富	17,169,511.46	2.22
63	002812	恩捷股份	16,702,360.13	2.16
64	600054	黄山旅游	16,684,419.36	2.16
65	300047	天源迪科	16,172,350.62	2.09

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	2,414,901,217.37
卖出股票收入（成交）总额	2,393,229,518.66

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，不考虑其他交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本报告期末投资的前十名证券中，中国证券监督管理委员会湖北监管局对新洋丰(000902) 出具警示函，对公司在公司网站及其他媒体发布信息先于指定媒体，违反《上市公司信息披露管理办法》第六条第二款规定，按照《上市公司信息披露管理办法》第五十九条规定，对公司予以警示。对该股票投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

报告期内基金投资的其他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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	410,309.82
2	应收证券清算款	17,531,451.63
3	应收股利	-
4	应收利息	32,796.28
5	应收申购款	2,076,974.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,051,532.20

### 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：本基金本报告期末持有前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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
9,837	45,133.69	363,394,790.17	81.85%	80,585,272.91	18.15%

### 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	3,281,084.79	0.7390%

### 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	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年5月6日）基金份额总额	267,739,518.28
本报告期期初基金份额总额	409,266,487.39
本报告期期间基金总申购份额	219,348,981.25
减：本报告期期间基金总赎回份额	184,635,405.56
本报告期末基金份额总额	443,980,063.08

## §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

2019年3月11日，公司股东批准Anthony Gerard Fasso先生为公司董事。  
2019年4月4日，公司股东批准王永筠女士为公司监事。  
2019年4月15日，经公司董事会批准刘万方先生为公司副总经理。  
2019年5月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。  
上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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

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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	3	883,226,321.00	18.38%	822,545.47	18.56%	-
西藏东方财富	2	746,161,495.12	15.53%	686,443.43	15.49%	-

富						
瑞银证券	2	427,451,152.78	8.89%	398,083.87	8.98%	-
申港证券	2	423,742,126.35	8.82%	386,157.61	8.71%	-
兴业证券	3	363,352,923.33	7.56%	334,023.88	7.54%	-
国泰君安	1	324,977,543.24	6.76%	302,649.85	6.83%	-
申万宏源	2	293,499,972.13	6.11%	270,523.22	6.10%	-
中信建投	3	239,568,326.78	4.99%	218,319.35	4.93%	-
光大证券	2	177,610,845.75	3.70%	162,264.02	3.66%	-
中信证券	1	171,449,151.92	3.57%	156,242.84	3.53%	-
东北证券	1	156,067,994.49	3.25%	145,343.72	3.28%	-
民生证券	1	152,929,374.08	3.18%	139,365.05	3.14%	-
中银国际	3	108,700,051.05	2.26%	101,231.22	2.28%	-
华泰证券	3	97,142,839.91	2.02%	88,526.56	2.00%	-
信达证券	1	83,750,565.27	1.74%	76,321.35	1.72%	-
东方证券	3	75,147,609.59	1.56%	68,481.52	1.55%	-
安信证券	2	28,102,294.53	0.58%	26,171.31	0.59%	-
海通证券	2	27,667,885.33	0.58%	25,766.60	0.58%	-
广发证券	2	25,106,415.00	0.52%	23,109.73	0.52%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-



国金证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

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
长江证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	4,073.22	100.00%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	70,000,000.00	100.00%	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-

国都证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

## §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

无。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019年8月29日