

# 华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金 2019年半年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019年8月29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。

基金托管人中国建设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3月25日（基金合同生效日）起至2019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
3.3 其他指标	11
<b>§4 管理人报告</b>	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
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	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
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>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	57
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>58</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	59
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>60</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>61</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	64

---

<a href="#">§11 影响投资者决策的其他重要信息</a>	65
<a href="#">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</a>	65
<a href="#">11.2 影响投资者决策的其他重要信息</a>	65
<a href="#">§12 备查文件目录</a>	66
<a href="#">12.1 备查文件目录</a>	66
<a href="#">12.2 存放地点</a>	66
<a href="#">12.3 查阅方式</a>	66

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞量化明选	
基金主代码	006942	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年3月25日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	743,843,462.89份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞量化明选A	华泰柏瑞量化明选C
下属分级基金的交易代码:	006942	006943
报告期末下属分级基金的份额总额	742,095,732.15份	1,747,730.74份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，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。
投资策略	<p>1、股票投资策略 本基金主要利用定量投资模型，通过主动管理，使用量化方法选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。本基金股票资产的投资比例占基金资产的60-95%。</p> <p>2、债券组合投资策略 本基金债券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。本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人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。</p> <p>3、资产支持证券投资策略 在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>4、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将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>5、股指期货投资策略 在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货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、交易活跃的股指期货合约，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> <p>6、融资业务的投资策略 本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前</p>

	前提下，确定融资比例。待监管机构允许本基金参与融券交易及转融通证券出借业务后，在法律法规允许的范围内，在不改变基金的风险收益特征及对基金份额持有人无不利影响的前提下，本基金可参与相关业务，以提高组合的投资效率，从而更好地实现投资目标。具体参与投资的比例将按照届时相关法律法规的规定执行。
业绩比较基准	95%*MSCI中国A股国际指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	田青
	联系电话	021-38601777	010-67595096
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	010-67595096
传真		021-38601799	010-66275853
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200135	100033
法定代表人		贾波	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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弄上海证大五道口广场1号17层

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华泰柏瑞量化明选A	华泰柏瑞量化明选C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年3月25日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年3月25日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	3,425,293.31	4,939.40
本期利润	11,702,169.23	22,918.63
加权平均基金份额本期利润	0.0134	0.0104
本期加权平均净值利润率	1.35%	1.04%
本期基金份额净值增长率	1.58%	1.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	3,260,078.73	4,847.94
期末可供分配基金份额利润	0.0044	0.0028
期末基金资产净值	753,808,197.52	1,772,443.57
期末基金份额净值	1.0158	1.0141
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.58%	1.41%

注：1、所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。

4、本基金合同于2019年3月25日生效。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞量化明选A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.03%	0.81%	4.32%	1.10%	-1.29%	-0.29%
过去三个月	1.58%	0.58%	-2.21%	1.43%	3.79%	-0.85%
自基金合同生效起至今	1.58%	0.55%	-1.41%	1.47%	2.99%	-0.92%

华泰柏瑞量化明选C

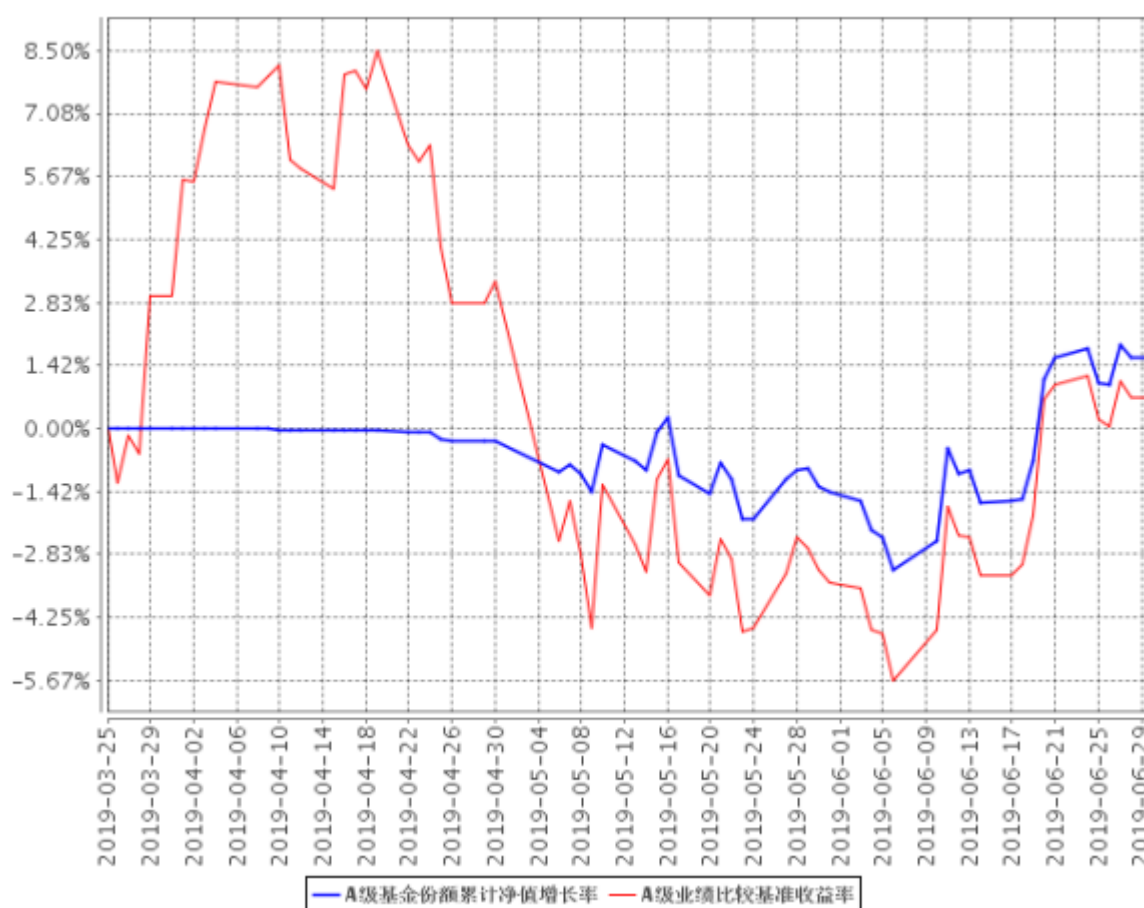
阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	------	------	--------	-----	-----



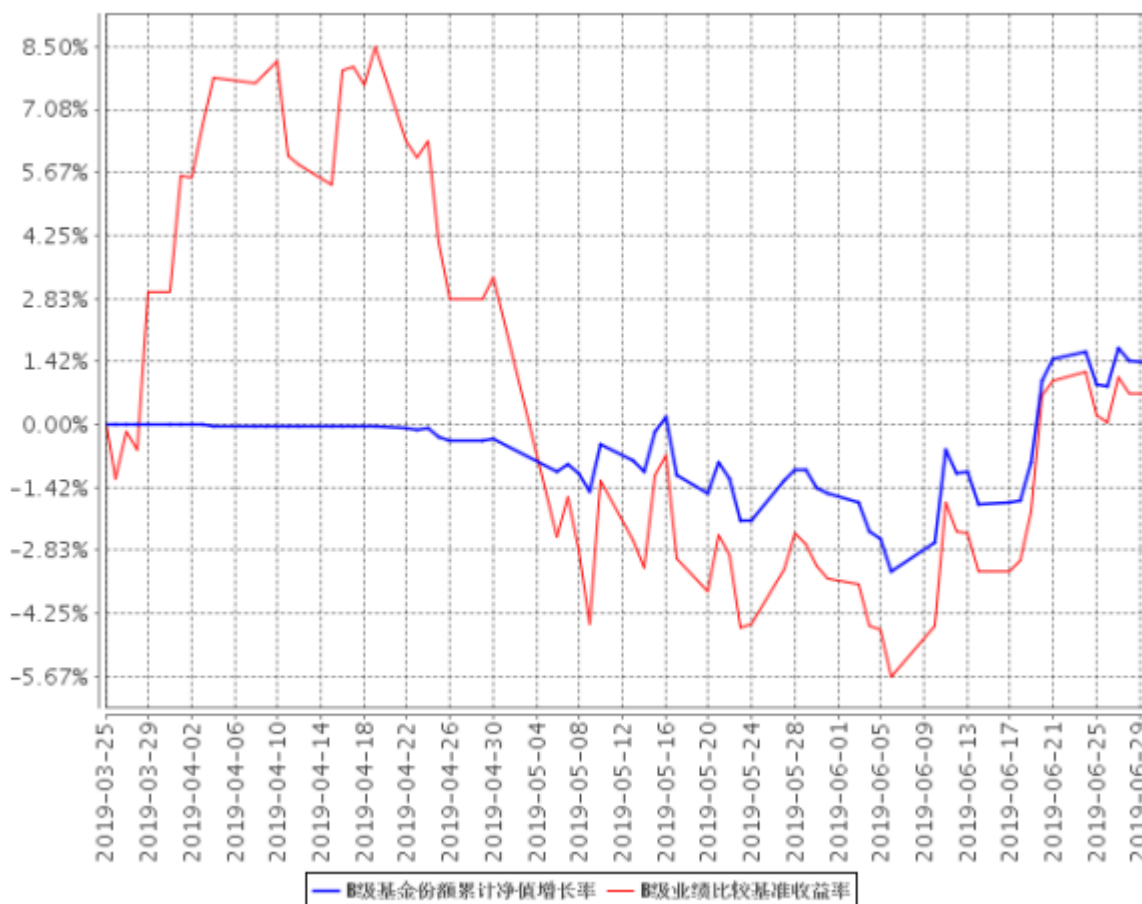
	长率①	增长率标准 差②	基准收益 率③	收益率标准 差④		
过去一个月	2.99%	0.81%	4.32%	1.10%	-1.33%	-0.29%
过去三个月	1.42%	0.58%	-2.21%	1.43%	3.63%	-0.85%
自基金合同 生效起至今	1.41%	0.55%	-1.41%	1.47%	2.82%	-0.92%

### 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

A级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



**B级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2019年3月25日至2019年6月30日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

## §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		
盛豪	量化投资部副总监、本基金的基金经理	2019年3月25日	-	11年	英国剑桥大学数学系硕士。2007年10月至2010年3月任Wilshire Associates量化研究员，2010年11月至2012年8月任Goldenberg Hehmeyer Trading Company交易员。2012年9月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。2015年1月起任量化投资部副总监，2015年10月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月至2018年11月任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月至2018年10月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。2017年3月至2018年11月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3月至2018年3月任华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年4月至2018年4月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年4月至2019年3月任华泰柏瑞睿利灵活配

					置混合型证券投资基金的基金经理。2017年6月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。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。2019年3月起任华泰柏瑞量化明选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1次。为量化投资因投资策略需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年4月上半个月，A股市场延续了一季度的上涨行情，但后半月随着香港对配资的监管，市场有所回调。五一假期之后，由于美国加征关税以及对个别中企进行技术封锁，加上今年获利资金较多，上证指数从四月中旬的高点大幅下调至2822点。一些之前被轮番炒作的板块和个股的跌幅比较大。在市场下跌期间，相对于中小市值股票，大市值股票表现较好。6月中旬，受中美贸易摩擦缓和的利好消息影响，上证指数有所反弹。

本基金成立于2019年3月25日。我们采取了谨慎的建仓策略，减少了报告期初市场下跌带来的损失。此外，我们坚持了一贯的量化选股策略，同时监控各项风险暴露，控制个股风险，模型运行比较平稳。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞量化明选A基金份额净值为1.0158元，本报告期基金份额净值增长率为1.58%；截至本报告期末华泰柏瑞量化明选C基金份额净值为1.0141元，本报告期基金份额净值增长率为1.41%；同期业绩比较基准收益率为-1.41%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前国内经济的下行压力依然较大，外部需求也有所回落。尽管如此，我们认为随着既有的保持“定力”的政策能逐步推进下去，经济结构有望得到优化，投资者和消费者的信心能将会得到逐步改善。此外，目前金融机构流动性状况总体平稳，经济、金融层面暂时没有大的系统风险。

展望2019年下半年，我们认为尽管贸易战仍将继续影响市场，但对市场的冲击与之前比已经降低。从市场点位来说，目前上证综指市盈率在近10年估值中枢接近一个标准差的位置，市净率在10年估值中枢以下接近2个标准差的位置，仍在偏低区间，A股的中长期投资价值比较确定。

目前市场点位较低，不少基本面较好股票估值比较有吸引力。我们作为基本面量化的选股策略会坚持自己的选股理念，根据模型的选股策略正常进行操作。同时继续监控各项风险暴露，比较严格地控制个股风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内基金未实施收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。



## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞量化明选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	附注号	本期末 2019年6月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	207,649,577.68
结算备付金		23,954,394.57
存出保证金		137,416.39
交易性金融资产	6.4.7.2	561,463,967.19
其中：股票投资		561,463,967.19
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	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	105,618.69
应收股利		-
应收申购款		3,986.03
递延所得税资产		-

其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		793,314,960.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30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		29,442,212.00
应付赎回款		6,566,772.90
应付管理人报酬		969,399.22
应付托管费		161,566.54
应付销售服务费		396.35
应付交易费用	6.4.7.7	525,579.33
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	68,393.12
负债合计		37,734,319.46

<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	743,843,462.89
未分配利润	6.4.7.10	11,737,178.20
所有者权益合计		755,580,641.09
负债和所有者权益总计		793,314,960.55

注：报告截止日2019年6月30日，华泰柏瑞量化明选A基金份额净值1.0158元，基金份额总额742,095,732.15份；华泰柏瑞量化明选C基金份额净值1.0141元，基金份额总额1,747,730.74份。华泰柏瑞量化明选份额总额合计为743,843,462.89份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金

本报告期：2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年3月25日(基金合同生效 日)至2019年6月30日
<b>一、收入</b>		16,389,169.16
1.利息收入		1,884,156.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,277,905.09
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		606,251.45
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,409,443.68
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-809,878.84
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.13	-
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	6,219,322.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	8,294,855.15
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	800,713.79
<b>减：二、费用</b>		4,664,081.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,445,765.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	574,294.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,460.49
4. 交易费用	6.4.7.19	584,707.26
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	6.4.7.20	57,853.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		11,725,087.86
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		11,725,087.86

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金

本报告期：2019年3月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月25日（基金合同生效日）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)	970,069,050.67	-	970,069,050.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	11,725,087.86	11,725,087.86
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)	-226,225,587.78	12,090.34	-226,213,497.44
其中：1.基金申购款	984,975.28	-7,775.73	977,199.55
2.基金赎回款	-227,210,563.06	19,866.07	-227,190,696.99
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)	743,843,462.89	11,737,178.20	755,580,641.09

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

华泰柏瑞量化明选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[2018]第1325号《关于准予华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化明选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969,420,400.50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(2019)第0155号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金基金合同》于2019年3月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为970,069,050.67份基金份额,其中认购资金利息折合648,650.17份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、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60-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为95%\*MSCI中国A股国际指数收益率+5%\*银行活期存款利率（税后）。

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

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金2019年3月25日（基金合同生效日）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3月25日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计**

##### **6.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入

方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### **6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。



#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 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) 本基金的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，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 于2017年12月26日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2017年12月26日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 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。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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 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 2019年6月30日
活期存款	207,649,577.68
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：	207,649,577.68

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	553,169,112.04	561,463,967.19	8,294,855.15
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	553,169,112.04	561,463,967.19	8,294,855.15

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

### 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：无。

#### 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 2019年6月30日
应收活期存款利息	46,347.77
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	59,209.12
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	61.80
合计	105,618.69

### 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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	525,579.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	525,579.33

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	16,264.96
预提费用	52,128.16
合计	68,393.12

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞量化明选A		
项目	本期 2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	967,664,458.17	967,664,458.17
本期申购	970,212.49	970,212.49
本期赎回(以“-”号填列)	-226,538,938.51	-226,538,938.51
- 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	742,095,732.15	742,095,732.15

金额单位：人民币元

华泰柏瑞量化明选C		
项目	本期 2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,404,592.50	2,404,592.50
本期申购	14,762.79	14,762.79
本期赎回(以“-”号填列)	-671,624.55	-671,624.55
- 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	1,747,730.74	1,747,730.74

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞量化明选A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

本期利润	3,425,293.31	8,276,875.92	11,702,169.23
本期基金份额交易产生的变动数	-165,214.58	175,510.72	10,296.14
其中：基金申购款	579.09	-8,227.03	-7,647.94
基金赎回款	-165,793.67	183,737.75	17,944.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,260,078.73	8,452,386.64	11,712,465.37

单位：人民币元

华泰柏瑞量化明选C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,939.40	17,979.23	22,918.63
本期基金份额交易产生的变动数	-91.46	1,885.66	1,794.20
其中：基金申购款	12.03	-139.82	-127.79
基金赎回款	-103.49	2,025.48	1,921.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,847.94	19,864.89	24,712.83

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
活期存款利息收入	1,027,000.42
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	250,704.51
其他	200.16
合计	1,277,905.09

#### 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 2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
卖出股票成交总额	8,572,211.46
减：卖出股票成本总额	9,382,090.30
买卖股票差价收入	-809,878.84



### **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**

注：无。

#### **6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：无。

#### **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：无。

### **6.4.7.14 贵金属投资收益**

#### **6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

#### **6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

#### **6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

#### **6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

### **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：无。

#### **6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,219,322.52
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,219,322.52

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	8,294,855.15
——股票投资	8,294,855.15
——债券投资	-
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	8,294,855.15

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
基金赎回费收入	800,489.48
转换费收入006942	224.31
合计	800,713.79

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
交易所市场交易费用	584,707.26

银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	584,707.26

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
审计费用	20,851.46
信息披露费	31,276.70
银行划款手续费	5,725.70
合计	57,853.86

#### 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

截至资产负债表日，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

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需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（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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、基金销售机构

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

### 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 2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	29,464,643.39	5.16%

注：本基金成立于2019年3月25日，无上年可比期间数据。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

#### 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 2019年3月25日(基金合同生效日)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	26,851.32	5.11%	26,851.32	5.11%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

3. 本基金成立于2019年3月25日，无上年可比期间数据。

### 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
	2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,445,765.44
其中：支付销售机构的客户维护费	1,824,424.28

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的管理人报酬

E为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。本基金成立于2019年3月25日，无上年可比期间数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	574,294.25

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。本基金成立于2019年3月25日，无上年可比期间数据。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	华泰柏瑞量化明选A	华泰柏瑞量化明选C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	12.83	12.83
合计	0.00	12.83	12.83

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.25%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

C类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支取。本基金成立于2019年3月25日，无上年可比期间数据。

#### 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：本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

本基金成立于2019年3月25日，无上年可比期间数据。

#### 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，基金管理人未投资本基金。本基金成立于2019年3月25日，无上年可比期间数据。

##### 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，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。本基金成立于2019年3月25日，无上年可比期间数据。

#### 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 2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	207,649,577.68	1,027,000.42

注：本基金成立于2019年3月25日，无上年可比期间数据。

本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，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：本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。本基金成立于2019年3月25日，无上年可比期间。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。本基金成立于2019年3月25日，无上年可比期间。

#### 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（2019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
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	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌的流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.1.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额0元，无债券作为质押。

###### 6.4.12.1.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额0元，无债券作为质押。

## 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，其预期的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人中国建设银行，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。

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2019年6月30日，本基金无债券投资。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。

#### **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。

于2019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。

#### 6.4.13.3.1 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期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上市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%。于2019年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.008%。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、债券投资及买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	207,649,577.68	-	-	-	-	-	207,649,577.68
结算备付金	23,954,394.57	-	-	-	-	-	23,954,394.57
交易性金融资产	-	-	-	-	-	561,463,967.19	561,463,967.19
应收利息	-	-	-	-	-	105,618.69	105,618.69
应收申购款	-	-	-	-	-	3,986.03	3,986.03

存出保证金	137,416.39	-	-	-	-	137,416.39
资产总计	231,741,388.64	-	-	-	-561,573,571.91	793,314,960.55
负债						
应付证券清算款					29,442,212.00	29,442,212.00
应付赎回款					6,566,772.90	6,566,772.90
应付管理人报酬					969,399.22	969,399.22
应付托管费					161,566.54	161,566.54
应付销售服务费					396.35	396.35
应付交易费用					525,579.33	525,579.33
其他负债					68,393.12	68,393.12
负债总计					37,734,319.46	37,734,319.46
利率敏感度缺口	231,741,388.64	-	-	-	-523,839,252.45	755,580,641.09

注：本基金成立于2019年3月25日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2019年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算

备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。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。

#### 6.4.13.1.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2019年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	561,463,967.19	74.31
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
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	561,463,967.19	74.31

注:本基金成立于2019年3月25日,无上年度末数据。

#### 6.4.13.1.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除MSCI中国A股国际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:人民币元)
		本期末(2019年6月30日)
	MSCI中国A股国际指数上升5%	
MSCI中国A股国际指数下降5%		-29,106,930.00

注:本基金成立于2019年3月25日,无上年度末数据。

#### 6.4.13.1.4 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

注: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	561,463,967.19	70.77
	其中：股票	561,463,967.19	70.77
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	231,603,972.25	29.19
8	其他各项资产	247,021.11	0.03
9	合计	793,314,960.55	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	993,397.00	0.13
B	采矿业	13,749,327.25	1.82
C	制造业	261,323,868.25	34.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,033,805.00	3.05
E	建筑业	14,136,208.00	1.87
F	批发和零售业	20,836,015.19	2.76
G	交通运输、仓储和邮政业	15,850,602.00	2.10
H	住宿和餐饮业	3,060,288.00	0.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,185,948.06	2.41
J	金融业	152,697,503.27	20.21
K	房地产业	20,574,064.57	2.72
L	租赁和商务服务业	5,526,901.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	73,704.00	0.01
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	11,422,335.60	1.51

S	综合	-	-
	合计	561,463,967.19	74.31

### 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投资股票。

### 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	244,300	21,647,423.00	2.87
2	600519	贵州茅台	16,800	16,531,200.00	2.19
3	600000	浦发银行	1,070,000	12,497,600.00	1.65
4	600036	招商银行	307,600	11,067,448.00	1.46
5	000425	徐工机械	2,468,500	11,009,510.00	1.46
6	000547	航天发展	1,019,800	9,749,288.00	1.29
7	601601	中国太保	262,500	9,583,875.00	1.27
8	601818	光大银行	2,339,900	8,915,019.00	1.18
9	000858	五粮液	74,300	8,763,685.00	1.16
10	600999	招商证券	510,600	8,726,154.00	1.15
11	002020	京新药业	736,325	8,482,464.00	1.12
12	601166	兴业银行	455,600	8,332,924.00	1.10
13	601838	成都银行	929,100	8,203,953.00	1.09
14	600031	三一重工	621,700	8,131,836.00	1.08
15	300628	亿联网络	75,900	8,126,613.00	1.08
16	600109	国金证券	827,800	8,046,216.00	1.06
17	002736	国信证券	596,500	7,849,940.00	1.04
18	601668	中国建筑	1,345,200	7,734,900.00	1.02
19	603160	汇顶科技	53,787	7,465,635.60	0.99
20	600050	中国联通	1,131,400	6,969,424.00	0.92
21	000568	泸州老窖	83,755	6,769,916.65	0.90
22	000672	上峰水泥	550,800	6,758,316.00	0.89
23	601928	凤凰传媒	829,500	6,694,065.00	0.89
24	600926	杭州银行	798,800	6,654,004.00	0.88
25	601633	长城汽车	802,400	6,635,848.00	0.88
26	002262	恩华药业	597,500	6,447,025.00	0.85
27	002111	威海广泰	512,962	6,437,673.10	0.85

28	603368	柳药股份	195,300	6,421,464.00	0.85
29	601111	中国国航	647,600	6,197,532.00	0.82
30	000951	中国重汽	385,200	6,182,460.00	0.82
31	600170	上海建工	1,623,700	6,105,112.00	0.81
32	000783	长江证券	768,600	6,002,766.00	0.79
33	000877	天山股份	504,600	5,863,452.00	0.78
34	000596	古井贡酒	49,200	5,830,692.00	0.77
35	600585	海螺水泥	137,300	5,697,950.00	0.75
36	600312	平高电气	727,900	5,597,551.00	0.74
37	000157	中联重科	840,200	5,049,602.00	0.67
38	600606	绿地控股	697,400	4,763,242.00	0.63
39	002092	中泰化学	558,600	4,446,456.00	0.59
40	601828	美凯龙	349,000	4,240,350.00	0.56
41	600016	民生银行	661,500	4,200,525.00	0.56
42	300741	华宝股份	131,100	4,155,870.00	0.55
43	603508	思维列控	63,000	4,100,040.00	0.54
44	300003	乐普医疗	176,100	4,053,822.00	0.54
45	600383	金地集团	329,300	3,928,549.00	0.52
46	601169	北京银行	658,900	3,894,099.00	0.52
47	600837	海通证券	266,600	3,783,054.00	0.50
48	002189	中光学	166,300	3,781,662.00	0.50
49	300016	北陆药业	432,100	3,750,628.00	0.50
50	000417	合肥百货	718,400	3,728,496.00	0.49
51	603288	海天味业	34,353	3,607,065.00	0.48
52	000166	申万宏源	711,800	3,566,118.00	0.47
53	600233	圆通速递	282,500	3,483,225.00	0.46
54	002048	宁波华翔	319,000	3,451,580.00	0.46
55	600675	中华企业	650,760	3,377,444.40	0.45
56	000923	河北宣工	195,600	3,346,716.00	0.44
57	000600	建投能源	497,600	3,333,920.00	0.44
58	002555	三七互娱	243,800	3,303,490.00	0.44
59	002851	麦格米特	164,050	3,243,268.50	0.43
60	000059	华锦股份	501,300	3,208,320.00	0.42
61	601998	中信银行	514,700	3,072,759.00	0.41
62	600754	锦江股份	124,200	3,060,288.00	0.41
63	002563	森马服饰	273,300	3,022,698.00	0.40
64	601003	柳钢股份	506,400	2,932,056.00	0.39
65	601012	隆基股份	125,588	2,902,338.68	0.38
66	603444	吉比特	13,100	2,750,476.00	0.36



67	600483	福能股份	320,100	2,740,056.00	0.36
68	600104	上汽集团	106,700	2,720,850.00	0.36
69	601628	中国人寿	95,300	2,698,896.00	0.36
70	600827	百联股份	270,700	2,655,567.00	0.35
71	600655	豫园股份	323,385	2,648,523.15	0.35
72	600188	兖州煤业	240,100	2,609,887.00	0.35
73	002440	闰土股份	209,400	2,609,124.00	0.35
74	000963	华东医药	97,499	2,531,074.04	0.33
75	600027	华电国际	661,100	2,492,347.00	0.33
76	000543	皖能电力	525,200	2,473,692.00	0.33
77	000961	中南建设	280,500	2,429,130.00	0.32
78	600398	海澜之家	267,300	2,424,411.00	0.32
79	000966	长源电力	424,900	2,409,183.00	0.32
80	000921	海信家电	189,600	2,366,208.00	0.31
81	002080	中材科技	260,110	2,356,596.60	0.31
82	603589	口子窖	36,500	2,351,330.00	0.31
83	000895	双汇发展	93,000	2,314,770.00	0.31
84	600015	华夏银行	296,100	2,279,970.00	0.30
85	600373	中文传媒	181,300	2,277,128.00	0.30
86	600028	中国石化	409,200	2,238,324.00	0.30
87	601677	明泰铝业	214,259	2,209,010.29	0.29
88	600987	航民股份	333,810	2,206,484.10	0.29
89	000671	阳光城	330,600	2,142,288.00	0.28
90	300502	新易盛	87,300	2,140,596.00	0.28
91	600570	恒生电子	29,680	2,022,692.00	0.27
92	600308	华泰股份	442,000	1,971,320.00	0.26
93	600900	长江电力	110,100	1,970,790.00	0.26
94	603313	梦百合	111,410	1,926,278.90	0.25
95	000001	平安银行	137,500	1,894,750.00	0.25
96	002568	百润股份	104,500	1,868,460.00	0.25
97	000661	长春高新	5,500	1,859,000.00	0.25
98	002146	荣盛发展	194,583	1,827,134.37	0.24
99	600011	华能国际	287,900	1,793,617.00	0.24
100	300031	宝通科技	144,800	1,789,728.00	0.24
101	601336	新华保险	32,111	1,767,068.33	0.23
102	601009	南京银行	212,400	1,754,424.00	0.23
103	600985	淮北矿业	146,700	1,663,578.00	0.22
104	600062	华润双鹤	131,700	1,660,737.00	0.22
105	300570	太辰光	72,913	1,613,564.69	0.21

106	601900	南方传媒	168,500	1,600,750.00	0.21
107	600029	南方航空	205,700	1,588,004.00	0.21
108	002925	盈趣科技	38,800	1,513,588.00	0.20
109	002087	新野纺织	372,500	1,445,300.00	0.19
110	002841	视源股份	18,300	1,418,433.00	0.19
111	600642	申能股份	234,200	1,407,542.00	0.19
112	300259	新天科技	395,100	1,402,605.00	0.19
113	600863	内蒙华电	439,100	1,378,774.00	0.18
114	002557	洽洽食品	51,700	1,305,425.00	0.17
115	000898	鞍钢股份	341,640	1,294,815.60	0.17
116	300058	蓝色光标	301,300	1,286,551.00	0.17
117	601607	上海医药	69,200	1,255,980.00	0.17
118	601211	国泰君安	63,500	1,165,225.00	0.15
119	600025	华能水电	285,600	1,162,392.00	0.15
120	600622	光大嘉宝	233,740	1,138,313.80	0.15
121	000651	格力电器	20,600	1,133,000.00	0.15
122	002601	龙蟠佰利	76,100	1,128,563.00	0.15
123	600548	深高速	115,100	1,080,789.00	0.14
124	300750	宁德时代	15,600	1,074,528.00	0.14
125	600886	国投电力	137,800	1,070,706.00	0.14
126	601699	潞安环能	133,000	1,056,020.00	0.14
127	603328	依顿电子	102,800	1,055,756.00	0.14
128	600026	中远海能	162,300	1,053,327.00	0.14
129	002236	大华股份	70,100	1,017,852.00	0.13
130	000776	广发证券	73,400	1,008,516.00	0.13
131	601328	交通银行	163,500	1,000,620.00	0.13
132	002391	长青股份	124,100	954,329.00	0.13
133	002635	安洁科技	70,300	948,347.00	0.13
134	000975	银泰资源	71,600	944,404.00	0.12
135	300433	蓝思科技	135,100	941,647.00	0.12
136	603156	养元饮品	24,920	924,033.60	0.12
137	300735	光弘科技	53,560	914,804.80	0.12
138	601288	农业银行	248,200	893,520.00	0.12
139	603505	金石资源	47,600	891,548.00	0.12
140	001965	招商公路	104,900	873,817.00	0.12
141	300394	天孚通信	31,300	864,506.00	0.11
142	600897	厦门空港	35,300	851,083.00	0.11
143	600376	首开股份	88,500	790,305.00	0.10
144	603886	元祖股份	29,700	786,753.00	0.10

145	300274	阳光电源	82,800	774,180.00	0.10
146	300296	利亚德	98,400	770,472.00	0.10
147	000876	新希望	41,900	727,803.00	0.10
148	603806	福斯特	19,500	716,235.00	0.09
149	000708	大冶特钢	55,600	706,120.00	0.09
150	600801	华新水泥	34,020	688,905.00	0.09
151	600967	内蒙一机	61,000	683,200.00	0.09
152	002007	华兰生物	22,050	672,304.50	0.09
153	000028	国药一致	15,800	660,914.00	0.09
154	000959	首钢股份	181,700	639,584.00	0.08
155	300349	金卡智能	35,100	624,078.00	0.08
156	002746	仙坛股份	39,500	611,065.00	0.08
157	300129	泰胜风能	143,700	602,103.00	0.08
158	601811	新华文轩	48,400	590,964.00	0.08
159	002128	露天煤业	67,200	581,280.00	0.08
160	600153	建发股份	64,800	575,424.00	0.08
161	603393	新天然气	24,080	563,472.00	0.07
162	600019	宝钢股份	81,100	527,150.00	0.07
163	601988	中国银行	135,700	507,518.00	0.07
164	601398	工商银行	75,600	445,284.00	0.06
165	002768	国恩股份	16,000	404,000.00	0.05
166	002110	三钢闽光	43,200	401,760.00	0.05
167	601058	赛轮轮胎	134,600	399,762.00	0.05
168	601872	招商轮船	91,100	397,196.00	0.05
169	002299	圣农发展	15,100	382,332.00	0.05
170	300420	五洋停车	69,400	381,006.00	0.05
171	000049	德赛电池	14,100	367,023.00	0.05
172	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.05
173	002376	新北洋	29,400	351,330.00	0.05
174	000550	江铃汽车	17,100	331,569.00	0.04
175	002475	立讯精密	13,200	327,228.00	0.04
176	002777	久远银海	12,241	321,938.30	0.04
177	603658	安图生物	4,600	314,456.00	0.04
178	601881	中国银河	25,100	307,475.00	0.04
179	002120	韵达股份	9,750	300,495.00	0.04
180	601229	上海银行	24,900	295,065.00	0.04
181	603533	掌阅科技	18,200	292,838.00	0.04
182	600511	国药股份	11,300	259,561.00	0.03
183	600426	华鲁恒升	17,200	255,592.00	0.03

184	000999	华润三九	8,700	255,258.00	0.03
185	000717	韶钢松山	52,700	233,461.00	0.03
186	002465	海格通信	24,300	231,822.00	0.03
187	601566	九牧王	18,500	227,920.00	0.03
188	603517	绝味食品	5,460	212,448.60	0.03
189	600061	国投资本	15,100	211,551.00	0.03
190	002090	金智科技	17,600	207,680.00	0.03
191	300144	宋城演艺	7,700	178,178.00	0.02
192	600276	恒瑞医药	2,600	171,600.00	0.02
193	600958	东方证券	15,300	163,404.00	0.02
194	002675	东诚药业	14,000	152,880.00	0.02
195	002616	长青集团	20,300	147,175.00	0.02
196	000928	中钢国际	25,000	145,250.00	0.02
197	600066	宇通客车	11,000	143,220.00	0.02
198	600362	江西铜业	8,100	127,494.00	0.02
199	002608	江苏国信	14,600	124,538.00	0.02
200	601788	光大证券	10,100	115,342.00	0.02
201	601117	中国化学	19,000	114,380.00	0.02
202	600795	国电电力	44,400	112,776.00	0.01
203	600643	爱建集团	11,600	111,128.00	0.01
204	000301	东方盛虹	18,800	103,212.00	0.01
205	002543	万和电气	7,500	100,650.00	0.01
206	600297	广汇汽车	22,200	99,012.00	0.01
207	000333	美的集团	1,842	95,526.12	0.01
208	300481	濮阳惠成	6,900	88,044.00	0.01
209	600340	华夏幸福	2,600	84,682.00	0.01
210	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
211	002677	浙江美大	6,000	78,960.00	0.01
212	603018	中设集团	5,920	73,704.00	0.01
213	002648	卫星石化	4,900	72,912.00	0.01
214	300033	同花顺	700	68,852.00	0.01
215	600048	保利地产	5,100	65,076.00	0.01
216	002382	蓝帆医疗	4,300	59,426.00	0.01
217	601098	中南传媒	4,600	58,144.00	0.01
218	000401	冀东水泥	3,300	58,113.00	0.01
219	002434	万里扬	8,400	57,036.00	0.01
220	300340	科恒股份	3,400	55,454.00	0.01
221	300529	健帆生物	800	49,880.00	0.01
222	600409	三友化工	8,600	48,676.00	0.01

223	601222	林洋能源	10,300	48,307.00	0.01
224	600481	双良节能	12,300	45,510.00	0.01
225	600160	巨化股份	5,700	40,527.00	0.01
226	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
227	002155	湖南黄金	3,700	37,259.00	0.00
228	002129	中环股份	3,800	37,088.00	0.00
229	601611	中国核建	4,700	36,566.00	0.00
230	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
231	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
232	002179	中航光电	910	30,448.60	0.00
233	600663	陆家嘴	1,800	27,900.00	0.00
234	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
235	002444	巨星科技	2,700	26,946.00	0.00
236	600009	上海机场	300	25,134.00	0.00
237	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00
238	600339	中油工程	4,000	16,880.00	0.00
239	300207	欣旺达	1,400	16,128.00	0.00
240	600566	济川药业	300	9,033.00	0.00
241	002123	梦网集团	200	2,828.00	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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	19,752,275.64	2.61
2	600519	贵州茅台	15,121,796.20	2.00
3	600000	浦发银行	12,144,925.00	1.61
4	000425	徐工机械	10,850,647.69	1.44
5	600036	招商银行	10,474,209.48	1.39
6	000547	航天发展	10,328,854.25	1.37
7	601818	光大银行	9,363,858.92	1.24
8	002020	京新药业	8,978,950.90	1.19
9	601601	中国太保	8,912,003.00	1.18
10	601166	兴业银行	8,442,711.00	1.12
11	600999	招商证券	8,370,335.00	1.11
12	601838	成都银行	8,173,391.00	1.08

13	600109	国金证券	7,913,095.50	1.05
14	601668	中国建筑	7,913,061.00	1.05
15	000858	五 粮 液	7,521,827.46	1.00
16	600031	三一重工	7,411,965.64	0.98
17	000951	中国重汽	7,411,951.57	0.98
18	002736	国信证券	7,381,933.76	0.98
19	300628	亿联网络	7,224,213.00	0.96
20	601633	长城汽车	6,973,945.00	0.92

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 累计卖出金额超期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300389	艾比森	1,993,105.78	0.26
2	600873	梅花生物	1,671,496.53	0.22
3	600282	南钢股份	1,138,588.00	0.15
4	601138	工业富联	927,328.00	0.12
5	600623	华谊集团	550,211.00	0.07
6	000967	盈峰环境	335,281.00	0.04
7	603458	勘设股份	317,064.15	0.04
8	600338	西藏珠峰	292,000.00	0.04
9	600569	安阳钢铁	261,868.00	0.03
10	300130	新国都	208,623.00	0.03
11	000951	中国重汽	173,842.00	0.02
12	000676	智度股份	157,864.00	0.02
13	600598	北大荒	139,376.00	0.02
14	300115	长盈精密	124,975.00	0.02
15	601000	唐山港	63,281.00	0.01
16	603915	国茂股份	59,668.95	0.01
17	300781	因赛集团	35,321.87	0.00
18	600704	物产中大	15,694.00	0.00
19	600057	厦门象屿	8,463.00	0.00

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	562,551,202.34
卖出股票收入（成交）总额	8,572,211.46

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

注：无。

## 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：无。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

注：无。

## 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：无。

## 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：无。

## 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：无。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：无。

## 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：无。

### 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：无。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：无。

## 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票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。

### 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	137,416.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	105,618.69
5	应收申购款	3,986.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	247,021.11

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 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

份额级别	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
华泰柏瑞	8,248	89,972.81	5,595,618.15	0.75%	736,500,114.00	99.25%



量化明选A						
华泰柏瑞量化明选C	169	10,341.60	0.00	0.00%	1,747,730.74	100.00%
合计	8,402	88,531.71	5,595,618.15	0.75%	738,247,844.74	99.25%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华泰柏瑞量化明选A	19.76	0.0000%
	华泰柏瑞量化明选C	1,985.50	0.1136%
	合计	2,005.26	0.0003%

### 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	份额级别	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	华泰柏瑞量化明选A	0
	华泰柏瑞量化明选C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞量化明选A	0
	华泰柏瑞量化明选C	0
	合计	0

### § 9开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞量化明选A	华泰柏瑞量化明选C
基金合同生效日（2019年3月25日）基金份额总额	967,664,458.17	2,404,592.50
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	970,212.49	14,762.79
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	226,538,938.51	671,624.55
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	742,095,732.15	1,747,730.74

## §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。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 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	
爱建证券	2	192,640,892.70	33.76%	179,389.11	34.13%	-
西南证券	1	164,373,253.19	28.81%	153,084.45	29.13%	-

华西证券	1	122,162,970.92	21.41%	113,752.93	21.64%	-
华泰证券	7	29,464,643.39	5.16%	26,851.32	5.11%	-
方正证券	4	22,277,634.87	3.90%	20,301.88	3.86%	-
海通证券	1	21,686,418.23	3.80%	15,857.04	3.02%	-
民生证券	2	17,932,891.14	3.14%	16,342.60	3.11%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 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) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、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
爱建证券	-	-	420,000,000.00	26.17%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	1,185,000,000.00	73.83%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

### 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中国银行定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年6月27日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年6月25日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加上海好买基金为旗下部分基金代销机构同时开通基金定投、转换及参加费率优惠等业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年6月18日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下华泰柏瑞量化明选混合A类在华西证券开通基金定投业务及定投手续费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年6月1日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加世纪证券有限责任公司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	证监会指定报刊和公司网站	2019年5月25日
6	华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资、费率优惠等业务公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年4月23日
7	华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金-基金合同生效公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年3月26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

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。

## §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弄证大五道口广场1号楼17层

### 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

2019年8月29日