

华泰柏瑞鼎利灵活配置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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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。

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.....	6
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.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
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
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
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.....	51
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.....	56
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60

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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞鼎利混合	
基金主代码	004010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月22日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	201,031,607.25份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞鼎利混合A	华泰柏瑞鼎利混合C
下属分级基金的交易代码:	004010	004011
报告期末下属分级基金的份额总额	200,832,170.69份	199,436.56份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极灵活的合理资产配置，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金，以获取长期稳定收益为目标，在投资过程中实现风险和收益的优化平衡。根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的分析与比较，对股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整。本基金股票投资以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手，结合宏观经济走势及市场分析，根据市场估值与流动性优选个股，重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中的股票
业绩比较基准	沪深300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com
客户服务电话	400-888-0001	95561
传真	021-38601799	021-62535823
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	福州市湖东路154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	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码	200135	200041
法定代表人	贾波	高建平

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
----------------	-------

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

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	华泰柏瑞鼎利混合A	华泰柏瑞鼎利混合C
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)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	6,270,194.59	3,066.71
本期利润	9,466,020.31	6,979.74
加权平均基金份额本期利润	0.0294	0.0275
本期加权平均净值利润率	2.89%	2.65%
本期基金份额净值增长率	3.21%	3.07%
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	2,563,745.15	7,322.30
期末可供分配基金份额利润	0.0128	0.0367
期末基金资产净值	208,101,607.39	211,488.99
期末基金份额净值	1.0362	1.0604
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	14.20%	16.77%

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

华泰柏瑞鼎利混合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	2.12%	0.36%	2.84%	0.57%	-0.72%	-0.21%
过去三个月	1.63%	0.26%	-0.54%	0.75%	2.17%	-0.49%
过去六个月	3.21%	0.19%	13.28%	0.77%	-10.07%	-0.58%
过去一年	3.90%	0.17%	6.62%	0.76%	-2.72%	-0.59%
自基金合同生效起至今	14.20%	0.17%	9.54%	0.58%	4.66%	-0.41%

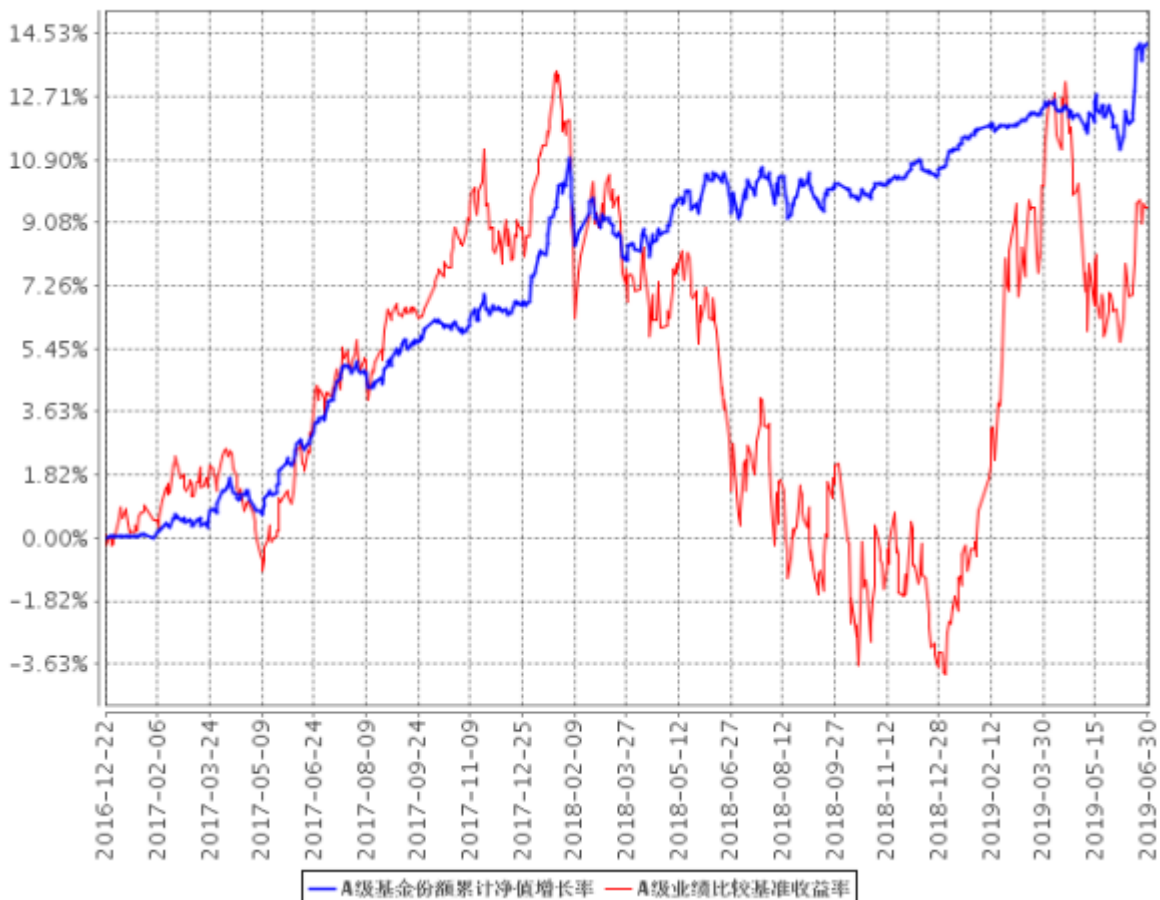
华泰柏瑞鼎利混合C

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	2.09%	0.36%	2.84%	0.57%	-0.75%	-0.21%

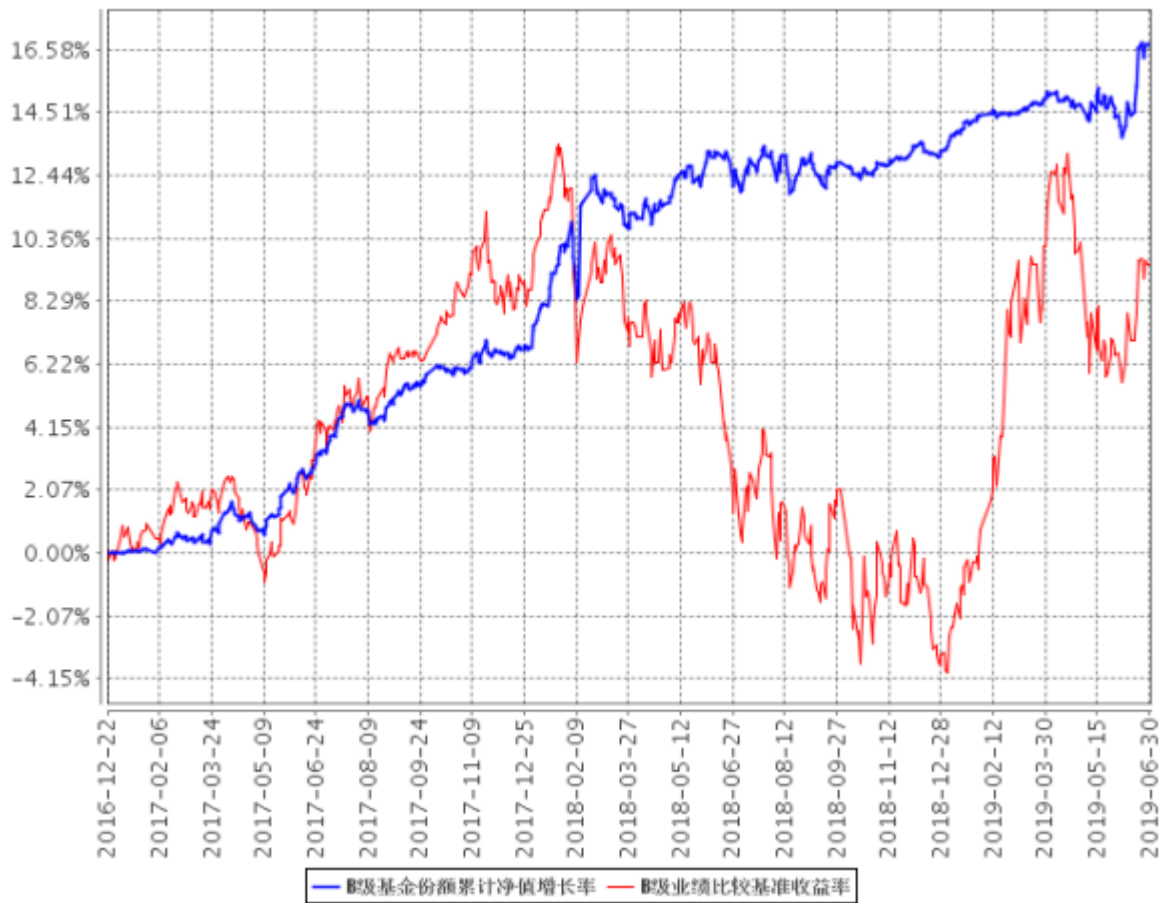
过去三个月	1.56%	0.26%	-0.54%	0.75%	2.10%	-0.49%
过去六个月	3.07%	0.19%	13.28%	0.77%	-10.21%	-0.58%
过去一年	3.68%	0.17%	6.62%	0.76%	-2.94%	-0.59%
自基金合同生效起至今	16.77%	0.20%	9.54%	0.58%	7.23%	-0.38%

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：图示日期为2016年12月22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		
罗远航	本基金的基金经理	2017年3月24日	-	8年	清华大学应用经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司交易员、研究员、基金经理。2017年1月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2017年3月至2018年4月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月至2018年11月任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月至2019年3月任华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019年2月起任华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金的基金经理。
吴邦栋	本基金的基金经理	2018年4月2日	-	8年	上海财经大学金融学硕士。曾任长江证券股份有限公司研究员、农银汇理基金管理有限公司研究员。2015年6月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任高级研究员兼基金经理助理。2018年3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4月至2018年11月任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年4月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期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没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5%的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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5个行业在2季度取得正收益，并战胜沪深300有相对收益，具体来说主要是食品饮料、餐饮旅游、银行、家电以及煤炭。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，另外周期行业2季度的表现也欠佳。

本基金在报告期内增加了上证50成分股的配置。

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鼎利混合A基金份额净值为1.0362元，本报告期基金份额净值增长率为3.21%；截至本报告期末华泰柏瑞鼎利混合C基金份额净值为1.0604元，本报告期基金份额净值增长率为3.07%；同期业绩比较基准收益率为13.28%

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、家电或未见好转，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月是中报的密集高发期，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，预计3季度维持目前仓位和持股结构不动。

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，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%，基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本报告期内本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截止本报告期末，因赎回等原因，本基金自2019年2月27日至2019年5月23日存在连续20 个工作日基金份额持有人数量低于200人的情形，但无基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§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

本托管人依据《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》与《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》，自2016年12月22日起托管华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：华泰柏瑞鼎利灵活配置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	上年度末 2018年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,244,014.04	2,991,482.65
结算备付金		1,427,930.01	-
存出保证金		82,685.95	44,381.37
交易性金融资产	6.4.7.2	242,267,608.25	463,324,950.03
其中：股票投资		68,139,208.25	20,032,663.63
基金投资		-	-
债券投资		174,128,400.00	443,292,286.40
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	3,345,238.56	9,134,271.79
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		249,367,476.81	475,495,085.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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		40,499,779.75	73,039,714.44
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	4,827.49
应付管理人报酬		101,261.41	209,645.83
应付托管费		25,315.35	52,411.45
应付销售服务费		47.79	51.28
应付交易费用	6.4.7.7	225,378.74	76,311.29
应交税费		18,000.02	18,312.24
应付利息		6,078.88	52,199.95
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	178,518.49	360,000.00
负债合计		41,054,380.43	73,813,473.97

所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	201,031,607.25	400,080,479.01
未分配利润	6.4.7.10	7,281,489.13	1,601,132.86
所有者权益合计		208,313,096.38	401,681,611.87
负债和所有者权益总计		249,367,476.81	475,495,085.84

注：报告截止日2019年6月30日，华泰柏瑞鼎利混合A基金份额净值1.0362元，基金份额总额200,832,170.69份；华泰柏瑞鼎利混合C基金份额净值1.0604元，基金份额总额199,436.56份。华泰柏瑞鼎利混合份额总额合计为201,031,607.25份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞鼎利灵活配置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	附注号	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
一、收入		12,042,898.66	14,419,691.49
1.利息收入		6,613,451.64	8,228,360.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	47,466.95	38,811.01
债券利息收入		6,565,185.97	8,135,145.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		798.72	54,403.32
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,229,695.69	6,640,413.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,106,653.46	4,868,426.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	712,547.91	728,381.36

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	410,494.32	1,043,605.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,199,738.75	-450,124.34
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	12.58	1,042.60
减：二、费用		2,569,898.61	2,609,408.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	973,502.34	1,223,866.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	243,375.54	305,966.54
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	326.91	284.34
4. 交易费用	6.4.7.19	487,796.75	270,796.05
5. 利息支出		652,234.10	589,606.38
其中：卖出回购金融资产支出		652,234.10	589,606.38
6. 税金及附加		9,293.81	14,803.20
7. 其他费用	6.4.7.20	203,369.16	204,085.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,473,000.05	11,810,283.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,473,000.05	11,810,283.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞鼎利灵活配置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)	400,080,479.01	1,601,132.86	401,681,611.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	9,473,000.05	9,473,000.05
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)	-199,048,871.76	-3,792,643.78	-202,841,515.54
其中：1.基金申购款	74,929.26	2,834.30	77,763.56
2.基金赎回款	-199,123,801.02	-3,795,478.08	-202,919,279.10
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)	201,031,607.25	7,281,489.13	208,313,096.38
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)	399,842,319.36	2,265,478.21	402,107,797.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	11,810,283.46	11,810,283.46
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)	389,244.28	23,437.56	412,681.84
其中：1.基金申购款	775,154.46	41,785.92	816,940.38
2.基金赎回款	-385,910.18	-18,348.36	-404,258.54
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)	400,231,563.64	14,099,199.23	414,330,762.87

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

华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2810号《关于核准华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,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200,025,020.14元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1676号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,030,522.42份基金份额,其中认购资金利息折合5,502.28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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、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)、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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金(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沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

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》、《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2019年6月30日
活期存款	2,244,014.04
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：	2,244,014.04

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	64,020,968.92	68,139,208.25	4,118,239.33
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	16,994,543.00	-8,143.00
	银行间市场	156,367,411.65	774,588.35

	合计	173,361,954.65	174,128,400.00	766,445.35
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		237,382,923.57	242,267,608.25	4,884,684.68

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	948.62
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	642.60
应收债券利息	3,343,610.04
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	37.30
合计	3,345,238.56

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	212,238.38
银行间市场应付交易费用	13,140.36

合计	225,378.74
----	------------

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	-
预提费用	178,518.49
合计	178,518.49

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞鼎利混合A		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	399,834,499.58	399,834,499.58
本期申购	2,013.94	2,013.94
本期赎回(以“-”号填列)	-199,004,342.83	-199,004,342.83
- 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	200,832,170.69	200,832,170.69

金额单位：人民币元

华泰柏瑞鼎利混合C		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	245,979.43	245,979.43
本期申购	72,915.32	72,915.32
本期赎回(以“-”号填列)	-119,458.19	-119,458.19
- 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	199,436.56	199,436.56

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞鼎利混合A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-117,904.74	1,711,962.15	1,594,057.41
本期利润	6,270,194.59	3,195,825.72	9,466,020.31
本期基金份额交易产生的变动数	-3,588,544.70	-202,096.32	-3,790,641.02
其中：基金申购款	24.42	8.25	32.67
基金赎回款	-3,588,569.12	-202,104.57	-3,790,673.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,563,745.15	4,705,691.55	7,269,436.70

单位：人民币元

华泰柏瑞鼎利混合C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,057.50	1,017.95	7,075.45
本期利润	3,066.71	3,913.03	6,979.74
本期基金份额交易产生的变动数	-1,801.91	-200.85	-2,002.76
其中：基金申购款	2,286.12	515.51	2,801.63
基金赎回款	-4,088.03	-716.36	-4,804.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,322.30	4,730.13	12,052.43

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	42,933.58
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	4,040.63
其他	492.74
合计	47,466.95

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1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	145,493,586.47
减：卖出股票成本总额	144,386,933.01

买卖股票差价收入	1,106,653.46
----------	--------------

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 2019年1月1日至2019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	712,547.91
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	712,547.91

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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	409,696,449.12
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	398,784,798.12
减：应收利息总额	10,199,103.09
买卖债券差价收入	712,547.91

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

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	410,494.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	410,494.32

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1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	3,199,738.75
——股票投资	4,549,587.86
——债券投资	-1,349,849.11
——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	3,199,738.75

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	12.58
合计	12.58

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	482,816.75
银行间市场交易费用	4,980.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	487,796.75

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	6,250.67
银行间账户服务费	18,600.00
合计	203,369.16

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
兴业银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	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

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	5,029,238.36	100.00%	169,658,612.80	100.00%

6.4.10.1.2 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	307,814.20	100.00%	212,238.38	100.00%
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	158,002.40	100.00%	142,387.94	100.00%
------	------------	---------	------------	---------

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	973,502.34	1,223,866.07
其中：支付销售机构的客户维护费	293.21	279.10

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0.60%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	243,375.54	305,966.54

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0.15%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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5个工作日内从基金资产中一次性支取。

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1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞鼎利混合A	华泰柏瑞鼎利混合C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	74.34	74.34
合计	0.00	74.34	74.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞鼎利混合A	华泰柏瑞鼎利混合C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	72.31	72.31
合计	0.00	72.31	72.31

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额支付销售机构销售服务费，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为每日C类基金份额应支付的销售服务费

E为前一日的C类基金份额的基金资产净值

基金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3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各基金销售机构。

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：本报告期与上年度可比期间，未与关联方进行银行间同业市场的债券和回购交易。

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 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

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	2,244,014.04	42,933.58	2,109,270.91	36,169.83

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：无。

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	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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

截至本报告期末2019年6月30日止，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款余额40,499,779.75元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111813157	18浙商银行CD157	2019年7月1日	96.78	150,000	14,517,000.00
111806200	18交通银行CD200	2019年7月1日	96.80	300,000	29,040,000.00
合计				450,000	43,557,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0元。

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兴业银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	0.0	40,364,000.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	47,123,400.00	90,401,000.00
合计	47,123,400.00	130,765,000.00

注：未评级的债券包括国债、短期融资券。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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2019年6月30日	2018年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	58,074,000.00	221,331,000.00
合计	58,074,000.00	221,331,000.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	60,651,000.00	50,892,000.00
AAA以下	8,280,000.00	8,292,000.00
未评级	0.00	32,012,286.40
合计	68,931,000.00	91,196,286.40

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，除卖出回购金融资产款余额中有40,499,779.75元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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0.016%。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产产

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	2,244,014.04	-	-	-	-	-	2,244,014.04
结算备付金	1,427,930.01	-	-	-	-	-	1,427,930.01
存出保证金	82,685.95	-	-	-	-	-	82,685.95
交易性金融资	20,112,000.00	29,040,000.00	76,313,400.00	48,663,000.00	-	68,139,208.25	242,267,608.25

产							
应收利息						3,345,238.56	3,345,238.56
资产总计	23,866,630.00	29,040,000.00	76,313,400.00	48,663,000.00		-71,484,446.81	249,367,476.81
负债							
卖出回购金融资产款	40,499,779.75						40,499,779.75
应付管理人报酬						101,261.41	101,261.41
应付托管费						25,315.35	25,315.35
应付销售服务费						47.79	47.79
应付交易费用						225,378.74	225,378.74
应付利息						6,078.88	6,078.88
应交税费						18,000.02	18,000.02
其他负债						178,518.49	178,518.49
负债总计	40,499,779.75					554,600.68	41,054,380.43
利率敏感度缺口	-16,633,149.75	29,040,000.00	76,313,400.00	48,663,000.00		-70,929,846.13	208,313,096.38
上年度末 2018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	2,991,482.65						2,991,482.65
存出保证金	44,381.37						44,381.37
交易性金融资产		59,475,000.00	314,372,286.40	59,184,000.00	10,261,000.00	20,032,663.63	463,324,950.03
应收利息						9,134,271.79	9,134,271.79
资产总计	3,035,864.02	59,475,000.00	314,372,286.40	59,184,000.00	10,261,000.00	29,166,935.42	475,495,085.84
负债							
卖出回购金融资产款	73,039,714.44						73,039,714.44
应付赎回款						4,827.49	4,827.49
应付管理人报酬						209,645.83	209,645.83
应付托管费						52,411.45	52,411.45
应付销售服务费						51.28	51.28
应付交易费用						76,311.29	76,311.29
应付利息						52,199.95	52,199.95
应交税费						18,312.24	18,312.24
其他负债						360,000.00	360,000.00
负债总计	73,039,714.44					773,759.53	73,813,473.97
利率敏感度缺口	-70,003,850.42	59,475,000.00	314,372,286.40	59,184,000.00	10,261,000.00	28,393,175.89	401,681,611.87

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
市场利率下降25个基点	364,350.00	872,859.00
市场利率上升25个基点	-362,018.00	-864,939.00

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金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0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（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。

6.4.13.4.3.1 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		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	68,139,208.25	32.71	20,032,663.63	4.99
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	68,139,208.25	32.71	20,032,663.63	4.99

6.4.13.1.3.2 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：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	沪深300指数上升5%	3,124,942.00	0.00
	沪深300指数下降5%	-3,124,942.00	0.00

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	68,139,208.25	27.32
	其中：股票	68,139,208.25	27.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	174,128,400.00	69.83
	其中：债券	174,128,400.00	69.83
	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	3,671,944.05	1.47
8	其他各项资产	3,427,924.51	1.37
9	合计	249,367,476.81	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,831,661.35	1.36
C	制造业	19,305,708.08	9.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,357,265.00	1.13
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	919,146.00	0.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	718,435.76	0.34
J	金融业	38,679,316.94	18.57
K	房地产业	2,100,098.38	1.01
L	租赁和商务服务业	1,123,560.74	0.54
M	科学研究和技术服务业	104,016.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	68,139,208.25	32.71

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	133,200	11,802,852.00	5.67
2	600519	贵州茅台	6,302	6,201,168.00	2.98
3	600036	招商银行	145,200	5,224,296.00	2.51
4	600030	中信证券	134,200	3,195,302.00	1.53
5	600887	伊利股份	73,300	2,448,953.00	1.18
6	601328	交通银行	382,700	2,342,124.00	1.12
7	600276	恒瑞医药	34,600	2,283,600.00	1.10
8	600016	民生银行	347,200	2,204,720.00	1.06
9	601288	农业银行	531,800	1,914,480.00	0.92
10	600000	浦发银行	160,500	1,874,640.00	0.90
11	601398	工商银行	299,500	1,764,055.00	0.85
12	601766	中国中车	187,700	1,518,493.00	0.73
13	601601	中国太保	38,700	1,412,937.00	0.68
14	601169	北京银行	209,100	1,235,781.00	0.59
15	601988	中国银行	312,300	1,168,002.00	0.56
16	601888	中国国旅	12,300	1,090,395.00	0.52
17	600104	上汽集团	42,500	1,083,750.00	0.52
18	600048	保利地产	83,832	1,069,696.32	0.51
19	600585	海螺水泥	25,200	1,045,800.00	0.50
20	601211	国泰君安	55,700	1,022,095.00	0.49
21	601390	中国中铁	146,400	954,528.00	0.46
22	601229	上海银行	76,000	900,600.00	0.43
23	601186	中国铁建	89,100	886,545.00	0.43
24	601818	光大银行	222,300	846,963.00	0.41
25	600309	万华化学	19,300	825,847.00	0.40
26	600028	中国石化	150,100	821,047.00	0.39
27	600690	青岛海尔	45,057	779,035.53	0.37
28	600340	华夏幸福	22,158	721,686.06	0.35
29	600019	宝钢股份	109,200	709,800.00	0.34

30	601857	中国石油	100,900	694,192.00	0.33
31	600050	中国联通	110,200	678,832.00	0.33
32	601989	中国重工	115,900	644,404.00	0.31
33	601939	建设银行	79,600	592,224.00	0.28
34	601006	大秦铁路	72,200	584,098.00	0.28
35	601336	新华保险	10,400	572,312.00	0.27
36	601628	中国人寿	20,200	572,064.00	0.27
37	601800	中国交建	45,600	516,192.00	0.25
38	601088	中国神华	23,300	474,854.00	0.23
39	600547	山东黄金	8,700	358,179.00	0.17
40	603993	洛阳钼业	90,300	357,588.00	0.17
41	600703	三安光电	31,700	357,576.00	0.17
42	600196	复星医药	13,702	346,660.60	0.17
43	600029	南方航空	43,400	335,048.00	0.16
44	600606	绿地控股	45,200	308,716.00	0.15
45	600989	宝丰能源	24,356	287,644.36	0.14
46	601138	工业富联	17,200	207,260.00	0.10
47	600968	海油发展	35,437	125,801.35	0.06
48	603259	药明康德	1,200	104,016.00	0.05
49	603267	鸿远电子	1,651	81,130.14	0.04
50	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.04
51	002955	鸿合科技	1,108	65,194.72	0.03
52	603915	国茂股份	2,523	58,710.21	0.03
53	300777	中简科技	1,156	42,540.80	0.02
54	603982	泉峰汽车	1,845	42,121.35	0.02
55	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
56	603217	元利科技	584	39,268.16	0.02
57	603863	松炆资源	1,532	35,358.56	0.02
58	603327	福蓉科技	1,323	34,014.33	0.02
59	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02
60	300781	因赛集团	727	33,165.74	0.02
61	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02
62	300780	德恩精工	935	27,676.00	0.01
63	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01

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	000002	万科A	14,945,739.36	3.72
2	601318	中国平安	10,642,680.32	2.65
3	601288	农业银行	8,541,079.00	2.13
4	601398	工商银行	8,105,342.00	2.02
5	300271	华宇软件	7,071,128.62	1.76
6	002851	麦格米特	6,168,297.00	1.54
7	600519	贵州茅台	5,646,788.26	1.41
8	600048	保利地产	5,401,166.08	1.34
9	601009	南京银行	5,138,421.59	1.28
10	600036	招商银行	5,053,728.00	1.26
11	300413	芒果超媒	4,477,477.74	1.11
12	300037	新宙邦	3,898,516.00	0.97
13	600845	宝信软件	3,166,160.16	0.79
14	600340	华夏幸福	3,037,248.08	0.76
15	600029	南方航空	2,981,685.00	0.74
16	600030	中信证券	2,715,356.00	0.68
17	600585	海螺水泥	2,497,120.45	0.62
18	600383	金地集团	2,471,467.05	0.62
19	601328	交通银行	2,348,152.00	0.58
20	600887	伊利股份	2,234,767.52	0.56

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	000002	万科A	15,250,053.98	3.80
2	601288	农业银行	8,490,390.00	2.11
3	601398	工商银行	8,397,498.00	2.09
4	300271	华宇软件	6,207,468.57	1.55
5	600048	保利地产	6,024,761.00	1.50
6	002851	麦格米特	5,692,291.02	1.42
7	601009	南京银行	5,465,501.00	1.36
8	300413	芒果超媒	4,329,811.43	1.08
9	300037	新宙邦	3,992,442.00	0.99
10	601225	陕西煤业	3,646,041.80	0.91

11	600845	宝信软件	3,218,572.49	0.80
12	601818	光大银行	3,203,767.00	0.80
13	600383	金地集团	2,775,712.48	0.69
14	600029	南方航空	2,756,029.00	0.69
15	600340	华夏幸福	2,558,355.00	0.64
16	002110	三钢闽光	2,241,325.00	0.56
17	601088	中国神华	2,134,629.00	0.53
18	600030	中信证券	2,095,576.00	0.52
19	300525	博思软件	2,086,084.50	0.52
20	601229	上海银行	1,887,930.60	0.47

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	187,943,889.77
卖出股票收入（成交）总额	145,493,586.47

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	16,986,400.00	8.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	8,280,000.00	3.97
5	企业短期融资券	30,137,000.00	14.47
6	中期票据	60,651,000.00	29.12
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	58,074,000.00	27.88
9	其他	-	-
10	合计	174,128,400.00	83.59

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	111806200	18交通银行CD200	300,000	29,040,000.00	13.94
2	111813157	18浙商银行CD157	300,000	29,034,000.00	13.94
3	101752011	17中建MTN001	200,000	20,268,000.00	9.73
4	011801961	18南方水泥SCP007	200,000	20,112,000.00	9.65
5	101900325	19首农食品MTN001	200,000	20,034,000.00	9.62

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：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，中国银行保险监督管理委员会于2018年11月9日对民生银行（600016）作出行政处罚决定，对公司贷款业务严重违反审慎经营规则罚款200万元，对相关责任人处以警告并罚款。以及对公司内控管理严重违反审慎经营规则；同业投资违规接受担保；同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；本行理财产品之间风险隔离不到位；个人理财资金违规投资；票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；为非保本理财产品提供保本承诺等行为处以罚款3160万元。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。

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	82,685.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,345,238.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,427,924.51

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：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
华泰柏瑞鼎利混合A	139	1,444,835.76	200,825,661.85	100.00%	6,508.84	0.00%
华泰柏瑞鼎利混合C	59	3,380.28	0.00	0.00%	199,436.56	100.00%
合计	196	1,025,671.47	200,825,661.85	99.90%	205,945.40	0.10%

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	华泰柏瑞鼎利混合A	411.71	0.0002%
	华泰柏瑞鼎利混合C	325.39	0.1632%
	合计	737.10	0.0004%

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	华泰柏瑞鼎利混合A	0
	华泰柏瑞鼎利混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞鼎利混合A	0
	华泰柏瑞鼎利混合C	0
	合计	0

§ 9开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞鼎利混 合A	华泰柏瑞鼎利混 合C
基金合同生效日（2016年12月22日）基金份额总额	200,007,488.26	23,034.16
本报告期期初基金份额总额	399,834,499.58	245,979.43
本报告期期间基金总申购份额	2,013.94	72,915.32
减：本报告期期间基金总赎回份额	199,004,342.83	119,458.19
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	200,832,170.69	199,436.56

§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。上述人事变动已按相关规定备案、报告。

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。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘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	

华泰证券	2	332,551,835.66	100.00%	307,814.20	100.00%	-
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

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	5,029,238.36	100.00%	229,200,000.00	100.00%	-	-
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
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年3月9日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司	证监会指定报刊和	2019年3月2日

	关于旗下基金持有的信威集团（600485）估值调整的提示性公告		
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加泉州银行股份有限公司费率优惠的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年2月27日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年2月27日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有的信威集团（600485）估值调整的提示性公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年2月15日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年1月28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	20190101-20190630	399,825,661.85	0.00	199,000,000.00	200,825,661.85	99.90%
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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019年8月29日