

华泰柏瑞新金融地产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：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、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

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	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	49
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	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	59

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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞新金融地产
基金主代码	005576
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年3月8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	117,253,139.65份
基金合同存续期	不定期

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，把握金融地产相关的行业投资机会，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	本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面等情况，在经济周期不同阶段，依据市场不同表现，在大类资产中进行配置，把握金融地产相关行业的投资机会，保证整体投资业绩的持续性。
业绩比较基准	沪深300金融地产行业指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%。
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。本基金可能投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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	tianqingl.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	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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	20,893,966.68
本期利润	67,101,727.80
加权平均基金份额本期利润	0.2976
本期加权平均净值利润率	30.44%
本期基金份额净值增长率	19.09%
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	3,444,316.03
期末可供分配基金份额利润	0.0294
期末基金资产净值	120,697,455.68
期末基金份额净值	1.0294
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	2.94%

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。

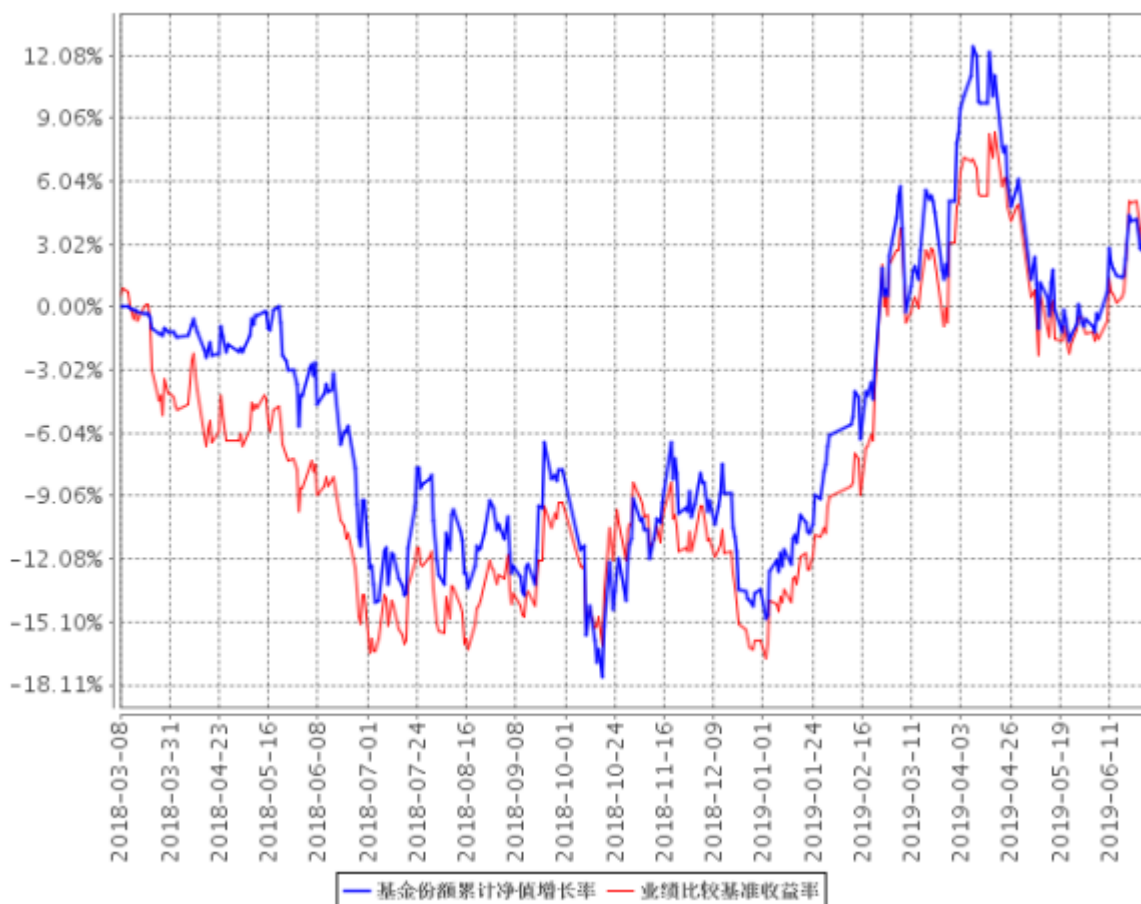
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.56%	0.88%	5.44%	0.99%	-1.88%	-0.11%
过去三个月	-2.04%	1.27%	0.95%	1.22%	-2.99%	0.05%
过去六个月	19.09%	1.36%	23.83%	1.35%	-4.74%	0.01%
过去一年	13.48%	1.42%	20.73%	1.30%	-7.25%	0.12%
自基金合同生效起至今	2.94%	1.30%	4.09%	1.23%	-1.15%	0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为2018年3月8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。

§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		
杨景涵	本基金的基金经理	2018年3月8日	-	15年	中山大学经济学硕士。特许金融分析师（CFA），金融风险管理师（FRM）。2004年至2006年于平安资产管理有限公司，任投资分析师；2006年至2009年9月于生命人寿保险公司，历任投连投资经理、投资经理、基金投资部负责人。2009年10月加入本公司，任专户投资部投资经理。2014年6月至2015年4月任研究部总监助理。2015年4月至2018年4月任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月至2017年12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。2016年8月至2017年12月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月至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。2016年9月起任华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年11月至2017年12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。2016年12月至2018年4月任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起任华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月

					<p>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1月至2018年3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和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月起任华泰柏瑞价值精选30灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2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9月起任华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年3月起任华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年6月起任华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

本基金2019年二季度,采取进取的策略,保持权益资产的正常仓位,以权益、固定收益和打新三者为获利手段。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0294元;本报告期基金份额净值增长率为19.09%,业绩比较基准收益率为23.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年下半年,宏观经济预期将持续承受下行压力,但政策亦将保持定力,不会轻易通过刺激政策提振经济,而会以改革开放为手段促进经济结构调整。随着对中美关系的重新定义、国内经济韧性的重新认识、上市公司业绩增长质量和数量的重新理解以及市场结构的重新调整,股票市场有望逐步修复前期较为不切实际的一些预期,包括一些行业的过度乐观预期和另一些行业的过度悲观预期,投资者将会认识到过度追捧某些资产和过度看空某些资产都是充满风险的,尤其是当这些看多看空的观点和短期政策联系过于紧密,趋势过分集中,投资资产过度拥挤的时候,就带来了市场结构性的投资机会。我们认为对于真正的专业投资者来说,当下是比较好的选股获得超额收益的时机,部分原因是因为过去2-3年持续累积的不平衡市场结构,部分因为一些行业持续受到与基本面走势不相称的压制。我们预期下半年股票组合将会获得相当不错的超额收

益。本基金将灵活参与权益市场的各种机会，审慎投资，精选个股，降低风险，努力在2019年下半年为投资者带来相对更好的净值表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制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的真实、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：华泰柏瑞新金融地产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	4,270,761.34	17,341,869.39
结算备付金		2,742,010.28	40,723.60
存出保证金		68,282.80	77,159.28
交易性金融资产	6.4.7.2	113,726,185.63	306,332,305.02
其中：股票投资		111,726,786.43	305,127,025.02
基金投资		-	-
债券投资		1,999,399.20	1,205,280.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		17,559.01	-
应收利息	6.4.7.5	22,553.39	37,542.86
应收股利		928,039.20	-
应收申购款		952.36	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		121,776,344.01	323,829,600.15
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		-	-
应付证券清算款		17,299.67	13.47
应付赎回款		574,801.05	-
应付管理人报酬		148,543.40	426,858.34
应付托管费		24,757.25	71,143.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	133,890.51	142,349.95
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	179,596.45	360,000.00
负债合计		1,078,888.33	1,000,364.81

所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	117,253,139.65	373,485,479.15
未分配利润	6.4.7.10	3,444,316.03	-50,656,243.81
所有者权益合计		120,697,455.68	322,829,235.34
负债和所有者权益总计		121,776,344.01	323,829,600.15

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.0294元，基金份额总额117,253,139.65份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞新金融地产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3月8日(基金 合同生效日)至2018 年6月30日
一、收入		69,875,673.23	-44,891,794.21
1.利息收入		62,667.47	1,442,495.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	50,608.17	257,003.39
债券利息收入		12,059.30	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,185,492.15
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		23,357,907.23	4,468,921.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,455,908.03	-1,127,315.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-5,400.00	-
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	1,907,399.20	5,596,237.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	46,207,761.12	-50,946,739.23
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	247,337.41	143,527.66
减：二、费用		2,773,945.43	3,431,527.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,653,801.27	2,209,688.50
2. 托管费	6.4.10.2.2	275,633.55	368,281.42
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	641,729.82	729,951.55
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	202,780.79	123,606.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		67,101,727.80	-48,323,321.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		67,101,727.80	-48,323,321.92

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞新金融地产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）	373,485,479.15	-50,656,243.81	322,829,235.34
二、本期经营活动产生	-	67,101,727.80	67,101,727.80

的基金净值变动数（本期利润）			
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）	-256,232,339.50	-13,001,167.96	-269,233,507.46
其中：1.基金申购款	3,587,882.01	143,536.36	3,731,418.37
2.基金赎回款	-259,820,221.51	-13,144,704.32	-272,964,925.83
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）	117,253,139.65	3,444,316.03	120,697,455.68
项目	上年度可比期间 2018年3月8日（基金合同生效日）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）	472,493,533.19	-	472,493,533.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-48,323,321.92	-48,323,321.92
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）	82,807,983.53	-3,280,486.32	79,527,497.21
其中：1.基金申购款	125,083,653.31	-4,502,888.08	120,580,765.23
2.基金赎回款	-42,275,669.78	1,222,401.76	-41,053,268.02
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）	555,301,516.72	-51,603,808.24	503,697,708.48

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

华泰柏瑞新金融地产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[2017]2430号《关于准予华泰柏瑞新金融地产灵活

配置混合型证券投资基金注册的批复》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《华泰柏瑞新金融地产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472,007,305.69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(2018)第0166号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年3月8日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为472,493,533.19份基金份额，其中认购资金利息折合486,227.50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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞新金融地产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，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、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）。本基金持有的股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；投资于本基金界定的新金融地产概念相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%；投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；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金融地产行业指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%。

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日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	4,270,761.34
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：	4,270,761.34

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	112,189,621.42	111,726,786.43	-462,834.99
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,999,720.10	1,999,399.20
	银行间市场	-	-
	合计	1,999,720.10	1,999,399.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	114,189,341.52	113,726,185.63	-463,155.89

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	1,059.30

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	164.67
应收债券利息	20,895.37
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	434.05
合计	22,553.39

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

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	133,890.51
银行间市场应付交易费用	-
合计	133,890.51

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	1,077.96
预提费用	178,518.49
合计	179,596.45

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	373,485,479.15	373,485,479.15
本期申购	3,587,882.01	3,587,882.01
本期赎回(以“-”号填列)	-259,820,221.51	-259,820,221.51
- 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	117,253,139.65	117,253,139.65

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-19,016,468.46	-31,639,775.35	-50,656,243.81
本期利润	20,893,966.68	46,207,761.12	67,101,727.80
本期基金份额交易产生的变动数	7,193,446.29	-20,194,614.25	-13,001,167.96
其中：基金申购款	-33,180.34	176,716.70	143,536.36
基金赎回款	7,226,626.63	-20,371,330.95	-13,144,704.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,070,944.51	-5,626,628.48	3,444,316.03

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	46,723.03
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	3,353.98
其他	531.16
合计	50,608.17

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	300,296,077.70
减：卖出股票成本总额	278,840,169.67
买卖股票差价收入	21,455,908.03

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	-5,400.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-5,400.00

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	1,245,360.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,205,400.00
减：应收利息总额	45,360.00
买卖债券差价收入	-5,400.00

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：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1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,907,399.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,907,399.20

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	46,207,761.12
——股票投资	46,207,962.02
——债券投资	-200.90
——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	46,207,761.12

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	246,448.77
转换费收入	888.64
合计	247,337.41

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	641,729.82
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	641,729.82

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	5,662.30
银行间账户服务费	18,600.00
合计	202,780.79

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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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3月8日(基金合同生效日)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	65,147,723.37	19.26%	111,080,823.94	19.07%

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内与上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	63,911.18	21.61%	49,483.38	36.96%
关联方名称	上年度可比期间 2018年3月8日(基金合同生效日)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	110,037.02	20.08%	90,909.76	20.02%

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。

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3月8日(基金合同生效日) 至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,653,801.27	2,209,688.50
其中：支付销售机构的客户维护费	923,798.05	1,304,256.17

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

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3月8日(基金合同生效日) 至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	275,633.55	368,281.42

注：支付基金托管人建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间与关联方未进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年3月8日(基金合同生效日)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
建设银行	4,270,761.34	46,723.03	28,456,147.56	232,405.74

注：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：本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（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：截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期内无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期内无交易所市场债券正回购。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期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

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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2019年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2018年12月31日：同）。

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	0.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	1,999,399.20	0.00
合计	1,999,399.20	0.00

注：未评级的债券包括国债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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股票不得超过该上市公司可流通股股票的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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的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0.028%。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	4,270,761.34	-	-	-	-	-	4,270,761.34
结算备付金	2,742,010.28	-	-	-	-	-	2,742,010.28
存出保证金	68,282.80	-	-	-	-	-	68,282.80
交易性金融资产	-	-	1,999,399.20	-	-	111,726,786.43	113,726,185.63
应收证券清算款	-	-	-	-	-	17,559.01	17,559.01
应收利息	-	-	-	-	-	22,553.39	22,553.39
应收股利	-	-	-	-	-	928,039.20	928,039.20
应收申购款	-	-	-	-	-	952.36	952.36
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,081,054.42	-	1,999,399.20	-	-	112,695,890.39	121,776,344.01
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	17,299.67	17,299.67
应付赎回款	-	-	-	-	-	574,801.05	574,801.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	148,543.40	148,543.40
应付托管费	-	-	-	-	-	24,757.25	24,757.25
应付交易费用	-	-	-	-	-	133,890.51	133,890.51
其他负债	-	-	-	-	-	179,596.45	179,596.45
负债总计	-	-	-	-	-	1,078,888.33	1,078,888.33
利率敏感度缺口	7,081,054.42	-	1,999,399.20	-	-	111,617,002.06	120,697,455.68

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	17,341,869.39	-	-	-	-	-	17,341,869.39
结算备付金	40,723.60	-	-	-	-	-	40,723.60
存出保证金	77,159.28	-	-	-	-	-	77,159.28
交易性金融资产	-	-	1,205,280.00	-	-	305,127,025.02	306,332,305.02
应收利息	-	-	-	-	-	37,542.86	37,542.86
资产总计	17,459,752.27	-	1,205,280.00	-	-	305,164,567.88	323,829,600.15
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	13.47	13.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	426,858.34	426,858.34
应付托管费	-	-	-	-	-	71,143.05	71,143.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	142,349.95	142,349.95
其他负债	-	-	-	-	-	360,000.00	360,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,000,364.81	1,000,364.81
利率敏感度缺口	17,459,752.27	-	1,205,280.00	-	-	-304,164,203.07	322,829,235.34

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2019年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为1.66%（2018年12月31日：0.37%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018年12月31日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019/6/30	
	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
交易性金融资产	26,063,871.89	26,063,871.89
应收股利	928,039.20	928,039.20
资产合计	26,991,911.09	26,991,911.09
以外币计价的负债		
负债合计	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	26,991,911.09	26,991,911.09
项目	上年度末 2018/12/31	

	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
交易性金融资产	62,595,575.53	62,595,575.53
应收股利	-	-
资产合计	62,595,575.53	62,595,575.53
以外币计价的负债		
负债合计	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	62,595,575.53	62,595,575.53

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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
	1. 所有外币相对人民币升值5%	增加1349596	增加3129779
	2. 所有外币相对人民币贬值5%	减少1349596	减少3129779

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；投资于本基金界定的新金融地产概念相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%；投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；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		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	111,726,786.43	92.57	305,127,025.02	94.52
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	111,726,786.43	92.57	305,127,025.02	94.52

6.4.13.1.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300金融地产行业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金融地产行业指数上升5%	4,468,948.00	15,481,205.00
沪深300金融地产行业指数下降5%	-4,468,948.00	-15,481,205.00	

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	111,726,786.43	91.75
	其中：股票	111,726,786.43	91.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,999,399.20	1.64
	其中：债券	1,999,399.20	1.64
	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	7,012,771.62	5.76
8	其他各项资产	1,037,386.76	0.85
9	合计	121,776,344.01	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币26,063,871.89元，占基金资产净值的比例为21.59%。

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	74,081.40	0.06
C	制造业	127,409.68	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	12,277,960.25	10.17
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.03
J	金融业	30,225,964.02	25.04
K	房地产业	42,917,895.43	35.56
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	85,662,914.54	70.97

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	5,195,008.06	4.30
E 金融	16,311,248.61	13.51
F 医疗保健	-	-
G 工业	4,557,615.22	3.78
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	26,063,871.89	21.59

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	600340	华夏幸福	226,883	7,389,579.31	6.12
2	601668	中国建筑	1,210,007	6,957,540.25	5.76
3	601166	兴业银行	374,000	6,840,460.00	5.67
4	601009	南京银行	804,000	6,641,040.00	5.50
5	002146	荣盛发展	693,763	6,514,434.57	5.40
6	01988	民生银行	1,317,800	6,271,358.28	5.20
7	601155	新城控股	156,987	6,249,652.47	5.18
8	06099	招商证券	725,200	6,143,260.43	5.09
9	601288	农业银行	1,592,505	5,733,018.00	4.75
10	000002	万科A	198,000	5,506,380.00	4.56
11	600068	葛洲坝	854,000	5,320,420.00	4.41
12	000671	阳光城	816,000	5,287,680.00	4.38
13	601328	交通银行	863,000	5,281,560.00	4.38
14	000069	华侨城A	757,000	5,261,150.00	4.36
15	01171	兖州煤业股份	809,000	5,195,008.06	4.30
16	600325	华发股份	655,868	5,122,329.08	4.24

17	01618	中国中冶	2,479,000	4,557,615.22	3.78
18	601318	中国平安	38,400	3,402,624.00	2.82
19	06030	中信证券	140,000	2,004,921.07	1.66
20	600383	金地集团	133,000	1,586,690.00	1.31
21	600000	浦发银行	114,781	1,340,642.08	1.11
22	00998	中信银行	258,000	1,009,937.65	0.84
23	601818	光大银行	239,000	910,590.00	0.75
24	06818	中国光大银行	280,000	881,771.18	0.73
25	600968	海油发展	20,868	74,081.40	0.06
26	603915	国茂股份	2,229	51,868.83	0.04
27	601066	中信建投	2,000	42,160.00	0.03
28	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.03
29	603217	元利科技	584	39,268.16	0.03
30	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.03
31	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.02
32	603863	松炆资源	403	9,301.24	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	000671	阳光城	8,070,699.00	2.50
2	06178	光大证券	4,899,332.00	1.52
3	601668	中国建筑	4,351,770.00	1.35
4	000581	威孚高科	3,568,707.21	1.11
5	601328	交通银行	2,746,360.00	0.85
6	601288	农业银行	2,342,610.00	0.73
7	06030	中信证券	2,015,230.31	0.62
8	601318	中国平安	1,599,510.00	0.50
9	600325	华发股份	1,587,638.00	0.49
10	600383	金地集团	1,556,930.00	0.48
11	601818	光大银行	1,018,140.00	0.32
12	00998	中信银行	1,003,001.33	0.31
13	002146	荣盛发展	962,418.63	0.30
14	06818	中国光大银行	879,107.79	0.27

15	000666	经纬纺机	348,920.00	0.11
16	600068	葛洲坝	311,520.00	0.10
17	600000	浦发银行	252,720.00	0.08
18	000069	华侨城A	239,050.00	0.07
19	601298	青岛港	109,487.50	0.03
20	002948	青岛银行	94,522.24	0.03

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	002142	宁波银行	23,785,978.40	7.37
2	601155	新城控股	22,221,923.28	6.88
3	600383	金地集团	19,521,260.07	6.05
4	601318	中国平安	18,152,169.93	5.62
5	000059	华锦股份	16,504,355.31	5.11
6	000002	万科A	16,110,327.00	4.99
7	600325	华发股份	16,003,051.55	4.96
8	002146	荣盛发展	15,674,331.39	4.86
9	000069	华侨城A	15,510,808.00	4.80
10	600000	浦发银行	14,877,540.51	4.61
11	600340	华夏幸福	13,631,456.18	4.22
12	600068	葛洲坝	13,233,597.68	4.10
13	01988	民生银行	13,181,995.28	4.08
14	601009	南京银行	12,956,534.22	4.01
15	601166	兴业银行	10,418,946.63	3.23
16	06099	招商证券	8,516,737.01	2.64
17	06818	中国光大银行	7,090,577.14	2.20
18	01776	广发证券	6,420,325.69	1.99
19	06178	光大证券	4,752,961.32	1.47
20	000581	威孚高科	4,426,533.31	1.37

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	39,231,969.06
卖出股票收入（成交）总额	300,296,077.70

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	1,999,399.20	1.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,999,399.20	1.66

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	019611	19国债01	20,010	1,999,399.20	1.66

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，中国建筑（601668）于2019年3月24日公告下属子公司中国建筑第二工程局有限公司所承建的扬州中航宝胜海洋工程电缆项目发生突发事故，项目部立即启动应急预案，及时向有关部门和公司进行报告，相关负责人配合政府有关部门开展应急救援工作。按照《生产安全事故报告和调查处理条例》规定，本次事故属于较大安全事故，由江苏省应急管理厅成立事故调查组进行调查，并判定事故责任，目前事故正在调查之中，尚未认定责任主体。本项目工程施工合同额约为1.48亿元，本次事故预计不会对公司生产经营及业绩产生重大影响，对公司当期损益也无较大影响。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。

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前十名证券的其他发行主体，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	68,282.80
2	应收证券清算款	17,559.01
3	应收股利	928,039.20
4	应收利息	22,553.39
5	应收申购款	952.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,037,386.76

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：报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,919	61,101.17	0.00	0.00%	117,253,139.65	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	9.88	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年3月8日）基金份额总额	472,493,533.19
本报告期期初基金份额总额	373,485,479.15
本报告期期间基金总申购份额	3,587,882.01
减：本报告期期间基金总赎回份额	259,820,221.51
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	117,253,139.65

§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。

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	
海通证券	2	101,496,598.72	30.01%	73,340.82	24.79%	-
南京证券	1	67,622,406.19	20.00%	62,975.73	21.29%	-
华泰证券	5	65,147,723.37	19.26%	63,911.18	21.61%	-
方正证券	1	36,588,859.67	10.82%	33,343.59	11.27%	-
爱建证券	1	31,624,111.56	9.35%	29,451.65	9.96%	-
民生证券	2	22,690,197.60	6.71%	20,677.55	6.99%	-
西藏东方财富	2	4,858,820.34	1.44%	4,525.09	1.53%	-
华西证券	1	4,139,227.35	1.22%	3,854.95	1.30%	-
西南证券	1	3,963,866.09	1.17%	3,691.46	1.25%	-
浙商证券	1	38,977.08	0.01%	36.32	0.01%	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-

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
海通证券	1,999,720.10	100.00%	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-

富						
华西证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

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
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加中信期货有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年4月26日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金2019年劳动节期间非港股通交易日暂停申购赎回等业务安排的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年4月24日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加大通证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年4月8日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加北京百度百盈基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定期定额投资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4月4日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年3月30日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于	证监会指定报刊和公司网站	2019年3月28日

	增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换及参加费率优惠等业务的公告		
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加广发银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金定投业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年3月27日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加中银国际证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年3月27日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加国盛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、申购定投费率优惠业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年3月19日
13	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
14	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3月2日
15	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
16	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
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加北京君德汇富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及参加费率优惠等业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年2月19日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加泰信财富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及参加费率优惠等业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年2月19日
19	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
20	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

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

-

§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