

华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资  
基金  
2018年年度报告摘要

2018年12月31日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019年3月27日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月26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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞创新动力混合
基金主代码	000967
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月6日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	116,792,259.91份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，本基金追求基金资产的长期增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略，精选与经济结构调整与转型主题直接相关，具备长期盈利能力提升的上市公司，力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数（全价）收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942

### 2.4 信息披露方式

登载基金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>
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层及托管人住所

## § 3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-2,592,968.78	26,121,246.32	-6,345,647.58
本期利润	-19,585,187.35	41,958,154.64	-31,503,675.64
加权平均基金份额本期利润	-0.1841	0.3179	-0.1825
本期基金份额净值增长率	-12.89%	30.39%	-13.98%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.2370	0.4198	0.0887
期末基金资产净值	144,471,178.31	169,432,617.06	162,362,426.85
期末基金份额净值	1.237	1.420	1.089

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

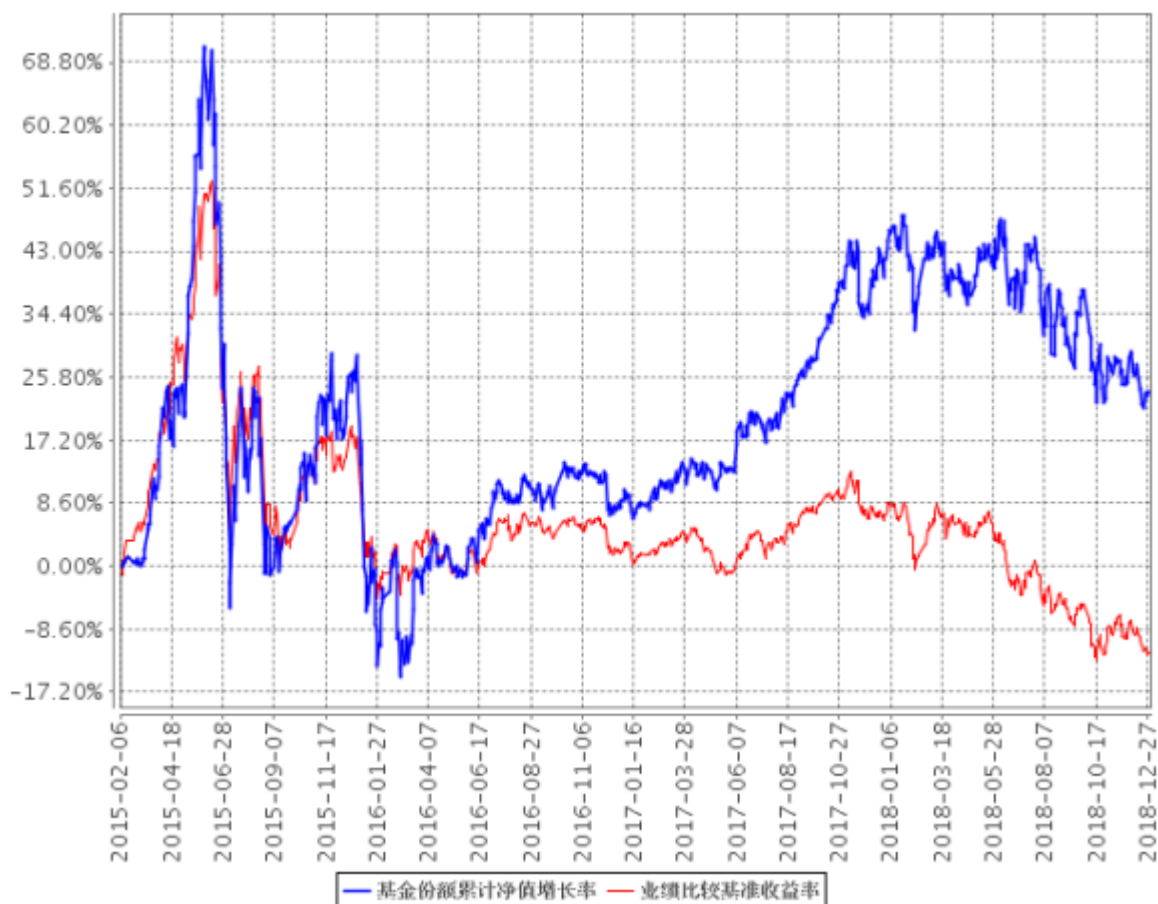
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-10.10%	1.26%	-7.60%	1.05%	-2.50%	0.21%
过去六个月	-11.89%	1.33%	-10.89%	0.95%	-1.00%	0.38%
过去一年	-12.89%	1.31%	-16.32%	0.89%	3.43%	0.42%
过去三年	-2.29%	1.39%	-22.78%	0.85%	20.49%	0.54%
自基金合同生效起至今	23.70%	1.75%	-11.97%	1.13%	35.67%	0.62%

#### 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

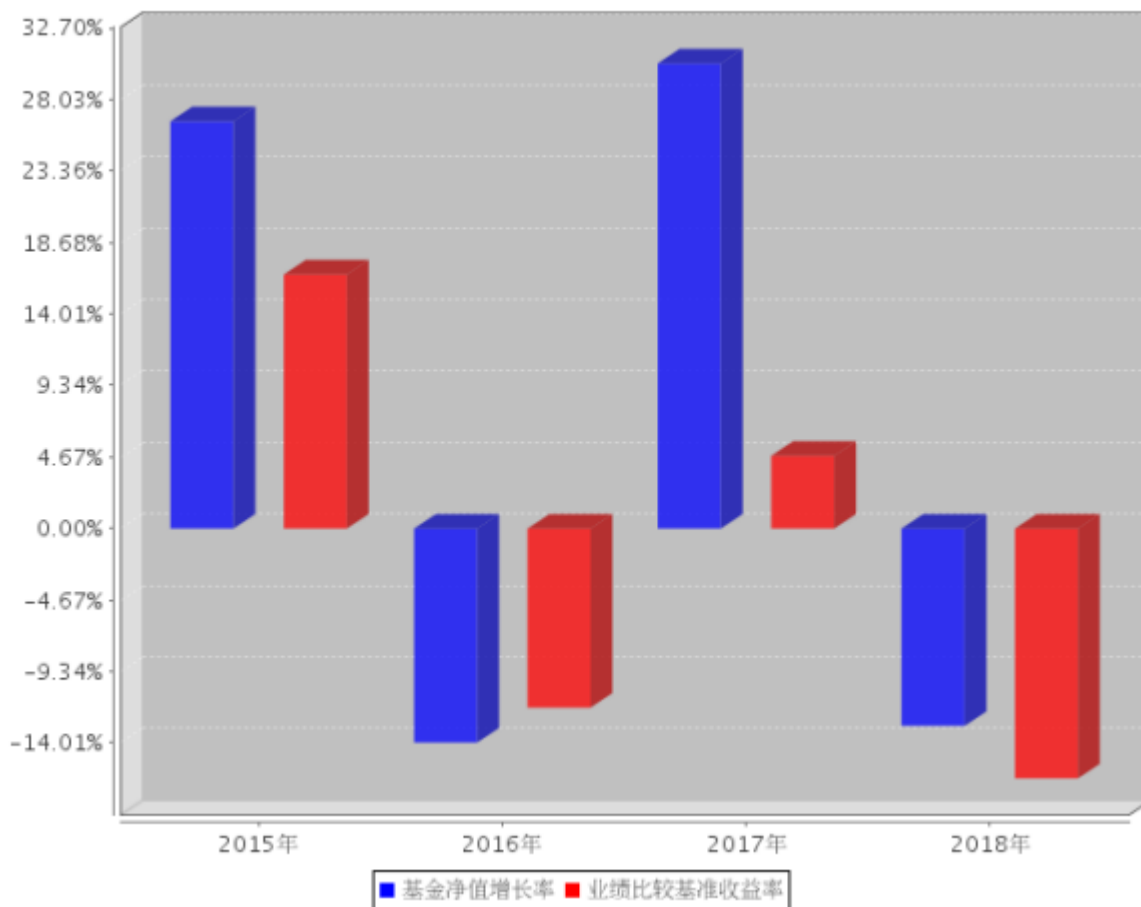
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为2015年2月6日至2018年12月31日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2015年按实际存续期计算（实际存续期为2015年2月6日至2015年12月31日）。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于2004年11月18日成立的合资基金管理公司，注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为49%、49%和2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞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发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选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。

截至2018年12月31日，公司基金管理规模为980.05亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张慧	投资部总监助理、本基金的基金经理	2015年2月6日	-	11年	经济学硕士，11年证券从业经历。2007年7月至2010年6月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010年6月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理，2013年9月至2018年5月任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理，2014年5月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2015年2月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年1月起任投资部总监助理。2018年1月起任投资部副总监及华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。
吴邦栋	本基金的基金经理	2018年3月14日	-	7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



					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。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3日、5日）进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

##### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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

18年市场呈现单边下行的态势，1月份上涨之后，指数持续处于震荡下跌趋势中。其中沪深300下跌25.31%，创业板指下跌28.65%，中证500下跌33.32%。全年当中风格切换较多，但总体跌幅接近，也均具备一些细分行业机会。主板方面，以银行为代表的高股息股票资产具有相对收益，而成长风格上，5G、新能源汽车等主题的表现十分活跃。

宏观和金融政策环境在去年下半年开始，已经有所改善。一方面10月下旬市场快速下跌之后，存在股权质押问题的小股票越来越多，甚至开始蔓延至一些杠杆率较高的行业龙头。针对这一现象，一行三会及地方政府组织各类纾困计划，对部分出现股权质押、现金流问题的优质民营企业给予帮助。另一方面，11-12月召开的政治局会议、中央经济工作会议对财政政策给予积极态度，同时强调改善货币政策的疏导机制，将稳增长再次放到较为重要的位置，这意味着2019年宽货币的政策可能开始主要向信用端关注，未来更加注重流动性支持实体经济的有效性上。

经济及企业盈利等基本面上看，2018年下半年开始逐渐加剧，这也是政策转向脚步加快的主要原因之一。从企业盈利来看，工业企业盈利单月增长快速回落，目前11月同比数据已经进入负增长区间。而宏观数据上，消费数据的回落速度显著加快，以汽车为首的可选消费品成为了主要的拖累项。我们预计未来半年内，国内宏观经济仍将受到金融去杠杆的滞后性影响，呈现下滑的态势。

行业上看，大多数行业跌幅较大，一方面银行等高股息资产相对跌幅较少；另一方面，下半年开始与政策对冲相关性较大的行业有一定表现。传统行业方面，房地产、建筑两大宏观经济投资体量占比较大的行业跌幅较小，主要受到基建预期提速，房地产监管口风有所松动等利好的影

响。另外值得关注的是，市场对于所谓“新兴基建”的追捧也较高，主要体现在通信、电力设备两个行业上，具体而言，是对5G、特高压投资未来给予较高的期望。

本基金在报告期内保持仓位基本未变，结构相对均衡。我们坚持从2-3个季度的中期视角选股，不追逐短期交易，坚持精选细分景气行业，自下而上挖掘个股。随着以ROE衡量的企业盈利在3季度见顶，组合过去持有的大部分白马股的业绩也在3季度见顶，未来面临盈利下修风险，如果该类股票估值调整不充分，则股价有一定下行压力。根据行业和公司景气度的变化，本基金对持仓结构和个股进行了调整，增持了成长，减持了消费和医药，对于逆周期和对冲经济下滑的品种也有少量的布局。

#### 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1.237元；本报告期基金份额净值增长率为-12.89%，业绩比较基准收益率为-16.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在中央经济工作会议中，我们看到了19年财政和货币政策已确认有节制的转向，制造业高质量发展和促进形成国内市场是重点工作。市场的分歧在于：1. 19Q1经济和盈利压力较大。2. 货币和信用的通道尚未打通。我们认为19年重点关注的就是本轮宽信用的“抓手”是什么，这将影响对经济和结构性机会的判断。从逆向的角度看，数据越差、效果越不明显，政策越易加码。

展望2019年，我们认为流动性环境有进一步改善的空间。年初央行继续显示出宽松的货币指引，全面降准的时间点较之前的市场预期有一定提前，同时对商业银行的中小微企业贷款给予全面的政策扶持，预示着政策层面对于今年宽信用的实施是非常重要的。从市场化利率角度来看，国债收益率进一步降低至3.12%左右，短端利率持续压低在2%略多的水平，这些都给了金融机构很强的利率下行预期指引。我们预计今年商业银行“早投放早受益”的经营冲动会强于往年，因此1季度无论从银行间流动性市场，还是信用端信贷企稳的角度看，都存在一定的预期修复空间。

从市场层面看，全部A股的PB在历史低点附近，一定程度上隐含了企业盈利的下修。以银行为例，四大行的估值基本处在历史最低PB水平，而股息率4%、5%以上的权重股不少，相比于日益降低的10年期国债收益率而言具有一定吸引力。同时，这些权重股的估值水平也制约了市场下行的空间。

维持19年看好的方向：1. 具备估值切换空间的景气平稳或景气上行的公司，尤其是受益于利率下行的领域；2. 预期反转的行业，包括估值反转和基本面反转两类；3. 早周期的行业估值调整

较为充分，经济预期见底后具有弹性，如券商、地产、汽车。4. 需求相对稳定，成本能够下降的公司，其中需求稳定最为关键；5. 高股息低波动率的龙头公司，利率下行背景下也有一定收益空间；6. 在盈利先行指标见底后，估值和业绩调整充分的可选消费和周期成长公司。本基金将继续重视盈利的可持续性，以及估值的相对合理性，在立足于绝对收益的基础之上，挖掘具备市值成长空间的个股，力争获取超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多12次；每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的25%；基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，收益分配基准日可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满3个月，收益可不分配。截止本报告期末，本基金可分配收益为27,678,918.40元。

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

注：无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞创新动力混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第21818号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人；
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞创新动力基金”)的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了华泰柏瑞创新动力基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞创新动力基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华泰柏瑞创新动力基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞创新动力基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞创新动力基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞创新动力基金的财务报告过</p>

---

	程。
--	----

<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞创新动力基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞创新动力基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>



注册会计师的姓名	单峰	曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼	
审计报告日期	2019年3月26日	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	24,648,685.29	17,493,250.02
结算备付金		619,487.90	477,004.64
存出保证金		50,962.91	54,392.29
交易性金融资产	7.4.7.2	120,252,264.23	153,570,928.67
其中：股票投资		120,252,264.23	153,570,628.67
基金投资		-	-
债券投资		-	300.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		467,822.81	1,599,902.57
应收利息	7.4.7.5	5,838.59	4,207.06
应收股利		-	-
应收申购款		1,255.03	137,804.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		146,046,316.76	173,337,489.88
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年12月31日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		779,976.72	635,463.27
应付赎回款		74,863.51	2,581,359.31
应付管理人报酬		186,390.89	208,363.95
应付托管费		31,065.13	34,727.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	292,828.88	230,455.06
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	210,013.32	214,503.92
负债合计		1,575,138.45	3,904,872.82

<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	116,792,259.91	119,331,466.42
未分配利润	7.4.7.10	27,678,918.40	50,101,150.64
所有者权益合计		144,471,178.31	169,432,617.06
负债和所有者权益总计		146,046,316.76	173,337,489.88

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额净值1.237元，基金份额总额116,792,259.91份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
<b>一、收入</b>		-15,161,212.87	47,121,826.13
1. 利息收入		175,278.70	128,202.07
其中：存款利息收入	7.4.7.11	175,278.69	128,176.37
债券利息收入		0.01	25.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,615,564.10	31,107,654.07
其中：股票投资收益	7.4.7.12	51,636.87	29,545,884.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	36.40	3,273.88
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,563,890.83	1,558,495.52

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-16,992,218.57	15,836,908.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	40,162.90	49,061.67
<b>减：二、费用</b>		4,423,974.48	5,163,671.49
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,171,982.15	2,390,551.12
2. 托管费	7.4.10.2.2	361,997.03	398,425.22
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,658,025.23	2,141,202.75
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	7.4.7.20	231,970.07	233,492.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-19,585,187.35	41,958,154.64
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-19,585,187.35	41,958,154.64

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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）	119,331,466.42	50,101,150.64	169,432,617.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-19,585,187.35	-19,585,187.35

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）	-2,539,206.51	-2,837,044.89	-5,376,251.40
其中：1. 基金申购款	29,892,640.71	10,625,628.15	40,518,268.86
2. 基金赎回款	-32,431,847.22	-13,462,673.04	-45,894,520.26
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）	116,792,259.91	27,678,918.40	144,471,178.31
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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）	149,136,577.18	13,225,849.67	162,362,426.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,958,154.64	41,958,154.64
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）	-29,805,110.76	-5,082,853.67	-34,887,964.43
其中：1. 基金申购款	20,374,093.48	6,492,649.16	26,866,742.64
2. 基金赎回款	-50,179,204.24	-11,575,502.83	-61,754,707.07
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）	119,331,466.42	50,101,150.64	169,432,617.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞创新动力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[2014]1362号《关于核准华泰柏瑞创新动力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《华泰柏瑞创新动力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2,312,478,960.89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(2015)第102号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年2月6日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,312,980,881.15份基金份额，其中认购资金利息折合501,920.26份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞创新动力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)、债券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和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的相关规定)。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。基金的投资组合比例为：本基金持有的股票占基金资产的比例为0%-95%，其中投资于创新动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的80%；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，本基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在1年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值5%。本基金的业绩比较基准为中证新兴产业指数收益率 $\times$ 60%+中债总指数(全价)收益率 $\times$ 40%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2019年3月26日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞创新动力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7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

#### 7.4.4.1 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。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 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。

本基金持有的债券投资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。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卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 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。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。

#### 7.4.4.5 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(主要为权证投资)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。

#### 7.4.4.6 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。当本基金依法有权抵销债权债务且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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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；处置时其公允价值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也可按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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也可按直线法计算。

#### 7.4.4.11 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(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)为正数，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(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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 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。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

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）》，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，本基金自2017年12月26日起改为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。

##### **7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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) 对于内地投资者持有的基金类别，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。

### 7.4.7 关联方关系

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
PineBridgeInvestmentLLC	基金管理人的股东

苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司

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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	58,403,183.77	5.35%	149,917,158.27	10.67%

###### 7.4.8.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31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	53,223.48	5.29%	25,930.32	8.86%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	136,619.59	10.56%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，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。权证交易不计佣金。

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。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日

	日	
当期发生的基金应支付的管理费	2,171,982.15	2,390,551.12
其中：支付销售机构的客户维护费	921,218.03	1,093,626.01

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	361,997.03	398,425.22

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金合同生效日（2015年2月6日）持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	11,927,394.96	4,848,690.59
期间申购/买入总份额	0.00	7,078,704.37
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	4,800,000.00	0.00
期末持有的基金份额	7,127,394.96	11,927,394.96
期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.1026%	9.9952%

注：1. 期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	24,648,685.29	165,940.34	17,493,250.02	116,054.79

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

### 7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末没有在银行间市场债券正回购交易中抵押的债券。



### 7.4.9.1.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末没有在交易所市场债券正回购交易中抵押的债券。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为120,202,118.43元，属于第二层次的余额为50,145.80元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次143,680,362.27元，第二层次9,885,078.40元，第三层次5,488.00元)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

第三层次资产变动如下：

交易性金融资产

权益工具投资

2018年1月1日5,488.00

购买-

到期-

转入-

转出-5,488.00

当期利得总额-

计入损益的利得-

2018年12月31日-

2018年12月31日仍持有的资产计入2018年度损益的未实现利得或损失的变动

——公允价值变动损益-

交易性金融资产

权益工具投资

2017年1月1日

购买-

到期-

转入5,488.00

转出-

当期利得总额-

计入损益的利得-

2017年12月31日5,488.00

2017年12月31日仍持有的资产计入2017年度损益的未实现利得或损失的变动  
——公允价值变动损益-20,227.03

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值按照市净率定价模型确定。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	120,252,264.23	82.34
	其中：股票	120,252,264.23	82.34
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	25,268,173.19	17.30
8	其他各项资产	525,879.34	0.36
9	合计	146,046,316.76	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	41,410.00	0.03
B	采矿业	5,944,770.03	4.11
C	制造业	64,007,056.93	44.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,964,295.84	6.90
E	建筑业	9,935.10	0.01
F	批发和零售业	16,158.93	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	7,953,479.42	5.51
H	住宿和餐饮业	2,954.28	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,679,572.98	6.70
J	金融业	8,927,291.04	6.18
K	房地产业	2,995,313.22	2.07
L	租赁和商务服务业	42,803.76	0.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,918,582.00	2.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,772,592.70	1.23
R	文化、体育和娱乐业	5,976,048.00	4.14
S	综合	-	-
	合计	120,252,264.23	83.24

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期内未投资港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	1,365,141	7,221,595.89	5.00
2	300760	迈瑞医疗	55,900	6,105,398.00	4.23
3	000902	新洋丰	677,939	6,074,333.44	4.20
4	300413	芒果超媒	160,400	5,936,404.00	4.11
5	600547	山东黄金	195,548	5,915,327.00	4.09
6	002032	苏泊尔	92,050	4,832,625.00	3.35
7	002511	中顺洁柔	507,100	4,320,492.00	2.99
8	600271	航天信息	187,257	4,286,312.73	2.97
9	601006	大秦铁路	516,495	4,250,753.85	2.94
10	603043	广州酒家	153,649	4,160,814.92	2.88

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www. Huatai-pb. com网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	600028	中国石化	23,230,355.09	13.71
2	601398	工商银行	22,838,589.00	13.48
3	600271	航天信息	12,728,461.99	7.51
4	600900	长江电力	12,510,747.20	7.38
5	601288	农业银行	11,982,678.00	7.07
6	002078	太阳纸业	10,913,244.13	6.44
7	002027	分众传媒	10,883,821.50	6.42
8	300003	乐普医疗	10,542,983.93	6.22
9	000661	长春高新	10,175,633.80	6.01
10	000596	古井贡酒	9,813,375.81	5.79
11	600886	国投电力	9,742,434.00	5.75
12	600872	中炬高新	9,362,667.87	5.53

13	002032	苏泊尔	9,332,364.95	5.51
14	600887	伊利股份	9,191,584.08	5.42
15	000977	浪潮信息	8,779,667.52	5.18
16	601318	中国平安	8,730,624.19	5.15
17	600519	贵州茅台	8,728,646.00	5.15
18	000902	新洋丰	8,579,744.69	5.06
19	000538	云南白药	7,672,592.91	4.53
20	002304	洋河股份	7,574,087.72	4.47
21	600036	招商银行	6,819,908.00	4.03
22	600104	上汽集团	6,624,306.00	3.91
23	002025	航天电器	6,623,327.71	3.91
24	600547	山东黄金	6,576,169.91	3.88
25	600436	片仔癀	6,417,061.83	3.79
26	002821	凯莱英	6,247,300.00	3.69
27	300760	迈瑞医疗	6,137,434.00	3.62
28	603939	益丰药房	6,021,884.44	3.55
29	300413	芒果超媒	5,962,433.49	3.52
30	002179	中航光电	5,892,703.64	3.48
31	601006	大秦铁路	5,861,367.00	3.46
32	300059	东方财富	5,593,854.40	3.30
33	600674	川投能源	5,556,313.66	3.28
34	600845	宝信软件	5,355,462.07	3.16
35	600161	天坛生物	5,333,892.64	3.15
36	600867	通化东宝	5,167,672.35	3.05
37	002120	韵达股份	5,165,379.30	3.05
38	600352	浙江龙盛	4,872,011.00	2.88
39	600760	中航沈飞	4,801,408.60	2.83
40	601088	中国神华	4,608,105.35	2.72
41	300365	恒华科技	4,554,011.00	2.69
42	603337	杰克股份	4,550,007.57	2.69
43	603043	广州酒家	4,544,035.24	2.68
44	600308	华泰股份	4,320,590.00	2.55
45	002511	中顺洁柔	4,282,994.60	2.53
46	000063	中兴通讯	4,229,811.60	2.50
47	600559	老白干酒	4,089,153.48	2.41
48	300347	泰格医药	3,828,963.80	2.26

49	002851	麦格米特	3,698,955.80	2.18
50	300130	新国都	3,644,910.43	2.15
51	600276	恒瑞医药	3,638,698.00	2.15
52	002222	福晶科技	3,594,685.00	2.12
53	002466	天齐锂业	3,581,560.00	2.11
54	601636	旗滨集团	3,520,994.53	2.08
55	600703	三安光电	3,510,478.00	2.07
56	000488	晨鸣纸业	3,475,514.00	2.05
57	600406	国电南瑞	3,405,984.01	2.01
58	603658	安图生物	3,402,117.39	2.01

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。

#### 8.4.2 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	600028	中国石化	22,432,809.42	13.24
2	601398	工商银行	18,619,450.75	10.99
3	000596	古井贡酒	16,676,034.80	9.84
4	600887	伊利股份	14,282,280.50	8.43
5	600872	中炬高新	13,318,242.08	7.86
6	002027	分众传媒	12,932,574.26	7.63
7	000636	风华高科	11,796,621.65	6.96
8	000858	五粮液	10,854,092.62	6.41
9	002304	洋河股份	10,682,156.74	6.30
10	601288	农业银行	10,508,536.91	6.20
11	002078	太阳纸业	9,626,644.14	5.68
12	002507	涪陵榨菜	9,513,924.89	5.62
13	600703	三安光电	9,141,905.89	5.40
14	600845	宝信软件	8,966,201.74	5.29
15	000977	浪潮信息	8,945,914.20	5.28
16	601318	中国平安	8,769,778.58	5.18
17	600521	华海药业	8,667,017.28	5.12
18	300003	乐普医疗	8,579,086.61	5.06
19	000661	长春高新	8,508,285.12	5.02
20	600900	长江电力	8,275,377.09	4.88
21	000538	云南白药	8,239,129.82	4.86

22	600886	国投电力	8,086,475.45	4.77
23	600271	航天信息	7,950,019.54	4.69
24	600519	贵州茅台	7,831,406.36	4.62
25	600436	片仔癀	7,039,429.53	4.15
26	600036	招商银行	6,578,009.63	3.88
27	600867	通化东宝	6,570,922.38	3.88
28	601636	旗滨集团	6,450,919.24	3.81
29	603816	顾家家居	6,134,406.54	3.62
30	300232	洲明科技	6,130,773.81	3.62
31	000786	北新建材	5,898,287.46	3.48
32	300059	东方财富	5,763,147.98	3.40
33	603939	益丰药房	5,726,467.25	3.38
34	002179	中航光电	5,036,040.52	2.97
35	600352	浙江龙盛	5,023,945.58	2.97
36	002032	苏泊尔	5,013,898.60	2.96
37	600256	广汇能源	4,968,818.19	2.93
38	600702	舍得酒业	4,967,587.44	2.93
39	002025	航天电器	4,959,619.48	2.93
40	601088	中国神华	4,883,660.87	2.88
41	600760	中航沈飞	4,710,062.50	2.78
42	002821	凯莱英	4,546,387.10	2.68
43	300335	迪森股份	4,379,768.62	2.58
44	002120	韵达股份	4,300,738.15	2.54
45	300065	海兰信	4,166,143.27	2.46
46	002139	拓邦股份	4,016,619.90	2.37
47	603658	安图生物	3,975,587.54	2.35
48	000581	威孚高科	3,778,194.45	2.23
49	000488	晨鸣纸业	3,757,917.98	2.22
50	600308	华泰股份	3,712,409.56	2.19

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。

### 8.4.3 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	538,389,017.12
卖出股票收入（成交）总额	554,780,569.86



### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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。

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	50,962.91
2	应收证券清算款	467,822.81
3	应收股利	-
4	应收利息	5,838.59
5	应收申购款	1,255.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	525,879.34

#### **8.12.4 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。

#### **8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：无。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
3,046	38,342.83	22,271,673.91	19.07%	94,520,586.00	80.93%

### 9.2 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	6,834.01	0.0059%

### 9.3 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、基金投资和研究人员持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年2月6日）基金份额总额	2,312,980,881.15
本报告期期初基金份额总额	119,331,466.42
本报告期期间基金总申购份额	29,892,640.71
减:本报告期期间基金总赎回份额	32,431,847.22
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	116,792,259.91

## § 11重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 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

报告期内，2018年8月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2018年8月20日，公司任命李晓西先生为公司副总经理，李晓西先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试，其任命已在中国证券投资基金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 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。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为60000元人民币，该事务所已向本基金提供了4年的审计服务。

### 11.6 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、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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		
		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	
广发证券	2	176,614,803.46	16.18%	162,663.31	16.16%	-
海通证券	2	122,843,115.75	11.26%	112,976.27	11.23%	-
华安证券	2	98,238,345.99	9.00%	91,490.95	9.09%	-
长江证券	1	97,455,393.77	8.93%	90,759.87	9.02%	-
国都证券	1	60,477,640.44	5.54%	56,322.25	5.60%	-
华泰证券	2	58,403,183.77	5.35%	53,223.48	5.29%	-

兴业证券	2	57,391,999.26	5.26%	52,302.03	5.20%	-
西藏东方财富	2	51,329,714.75	4.70%	47,347.59	4.70%	-
光大证券	2	43,492,632.51	3.99%	39,776.47	3.95%	-
华鑫证券	1	42,477,612.10	3.89%	38,710.23	3.85%	-
齐鲁证券	1	40,639,640.48	3.72%	37,848.77	3.76%	-
银河证券	1	31,500,509.46	2.89%	29,337.79	2.92%	-
瑞银证券	2	29,753,661.08	2.73%	27,281.06	2.71%	-
安信证券	2	29,373,947.99	2.69%	27,356.20	2.72%	-
新时代证券	2	20,437,010.58	1.87%	18,883.95	1.88%	-
万联证券	2	19,995,124.79	1.83%	18,221.46	1.81%	-
中信建投	2	19,979,047.60	1.83%	18,237.75	1.81%	-
东方证券	3	14,052,248.36	1.29%	12,805.97	1.27%	-
中银国际	3	13,778,486.88	1.26%	12,831.29	1.27%	-
中投证券	1	11,564,183.88	1.06%	10,538.49	1.05%	-
华创证券	1	11,028,734.76	1.01%	10,050.52	1.00%	-
华融证券	1	9,891,466.35	0.91%	9,014.03	0.90%	-
国元证券	1	7,950,207.37	0.73%	7,403.81	0.74%	-
国泰君安	1	7,938,255.77	0.73%	7,392.78	0.73%	-
西南证券	1	7,241,626.66	0.66%	6,743.31	0.67%	-
恒泰证券	1	5,162,653.15	0.47%	4,807.98	0.48%	-
民生证券	1	2,311,374.00	0.21%	2,106.36	0.21%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 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
广发证券	336.45	100.00%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-



## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019年3月27日