

华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金

金

2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 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

报告送出日期：2017 年 10 月 25 日

§ 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。

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 2017 年 10 月 24 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。

本报告中的财务资料未经审计。

自 2017 年 8 月 28 日至 2017 年 9 月 26 日华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，自 2017 年 9 月 27 日起，本基金由“华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金”转型为“华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞嘉利混合”，基金代码保持不变。关于转型的详细内容见我公司 2017 年 8 月 28 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于以通讯方式召开华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。

本报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 2017 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	华泰柏瑞嘉利混合
交易代码	004358
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 27 日
报告期末基金份额总额	200,372,898.98 份
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	本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的

	风险收益特征进行深入分析,合理预测各类资产的价格变动趋势,确定不同资产类别的投资比例。在此基础上,积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化,动态调整各大类资产之间的投资比例,在保持总体风险水平相对平稳的基础上,获取相对较高的基金投资收益。本基金以股票类资产为主要投资工具,通过精选个股获取资产的长期增值;通过适度的大类资产配置来降低组合的风险。
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,预期风险高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金
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

转型前:

基金简称	华泰柏瑞国企改革混合
交易代码	004358
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 2 月 16 日
报告期末基金份额总额	200,372,907.72 份
投资目标	本基金将深入挖掘国企改革所带来的投资机会,精选受益于国企改革的相关证券,在有效控制风险前提下,力求超越业绩比较基准的投资回报,争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化,判断证券市场的发展趋势,结合国企改革主题相关行业的发展状况包括相关行业的国家政策变化情况及行业发展状况等行业状况、公司价值性和成长性分析,综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上,采用动态调整策略,在市场上涨阶段中,适当增加权益类资产配置比例,在市场下行周期中,适当降低权益类资产配置比例,在严格控制投资组合风险的前提下,调整投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例,力求实现基金财产的长期稳定增值,从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。
业绩比较基准	中证国有企业改革指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	预期风险高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2017 年 9 月 27 日 — 2017 年 9 月 30 日 ）
1. 本期已实现收益	1,359,258.43
2. 本期利润	412,153.58
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0021
4. 期末基金资产净值	232,269,817.90
5. 期末基金份额净值	1.1592

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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2017 年 7 月 1 日 — 2017 年 9 月 26 日 ）
1. 本期已实现收益	12,910,419.33
2. 本期利润	10,711,561.75
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0535
4. 期末基金资产净值	231,857,674.45
5. 期末基金份额净值	1.1571

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。

3.2 基金净值表现（转型后）

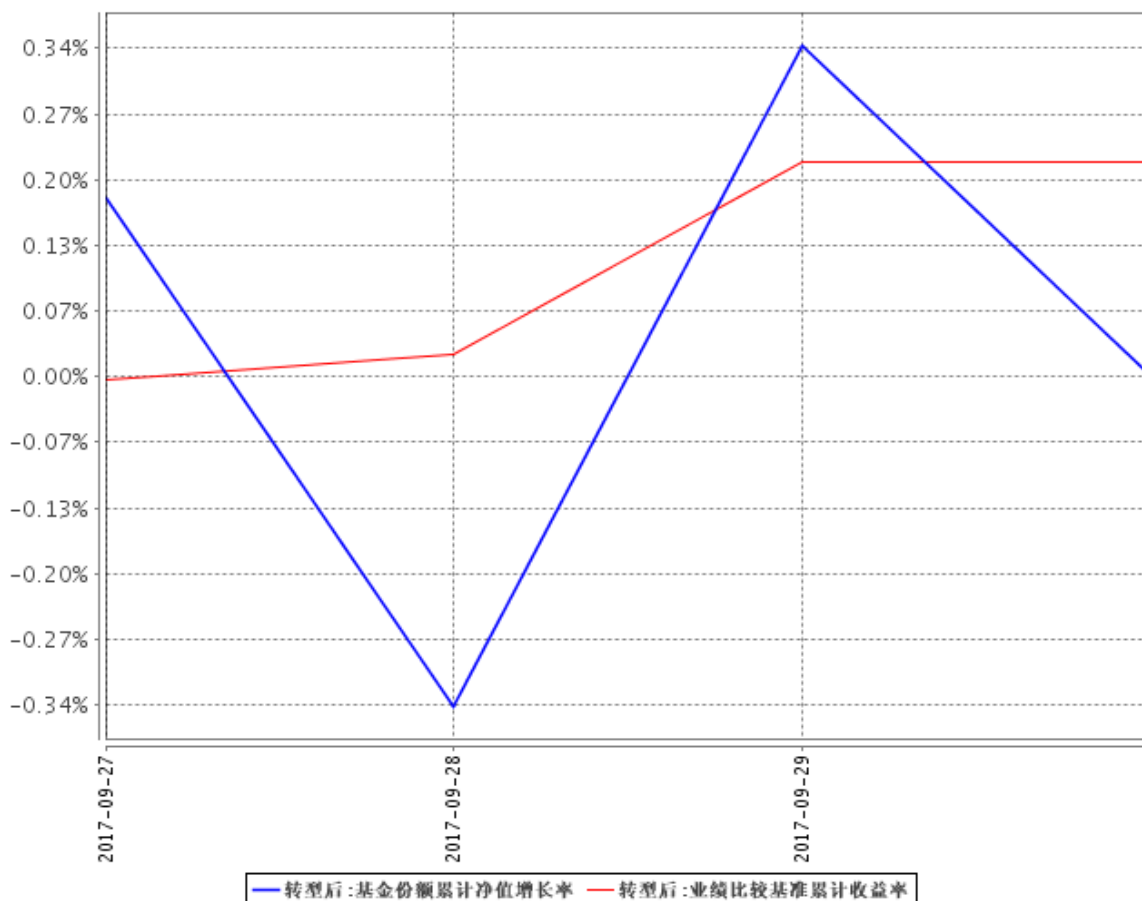
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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

2017/9/27-2017/9/30	0.18%	0.29%	0.22%	0.09%	-0.04%	0.20%
---------------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

3.2.2 自基金转型以来基金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 2017 年 9 月 27 日至 2017 年 9 月 30 日。本基金自 2017 年 9 月 27 日，由“华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金”转型为“华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金”，基金转型起至本报告期末不满一年。

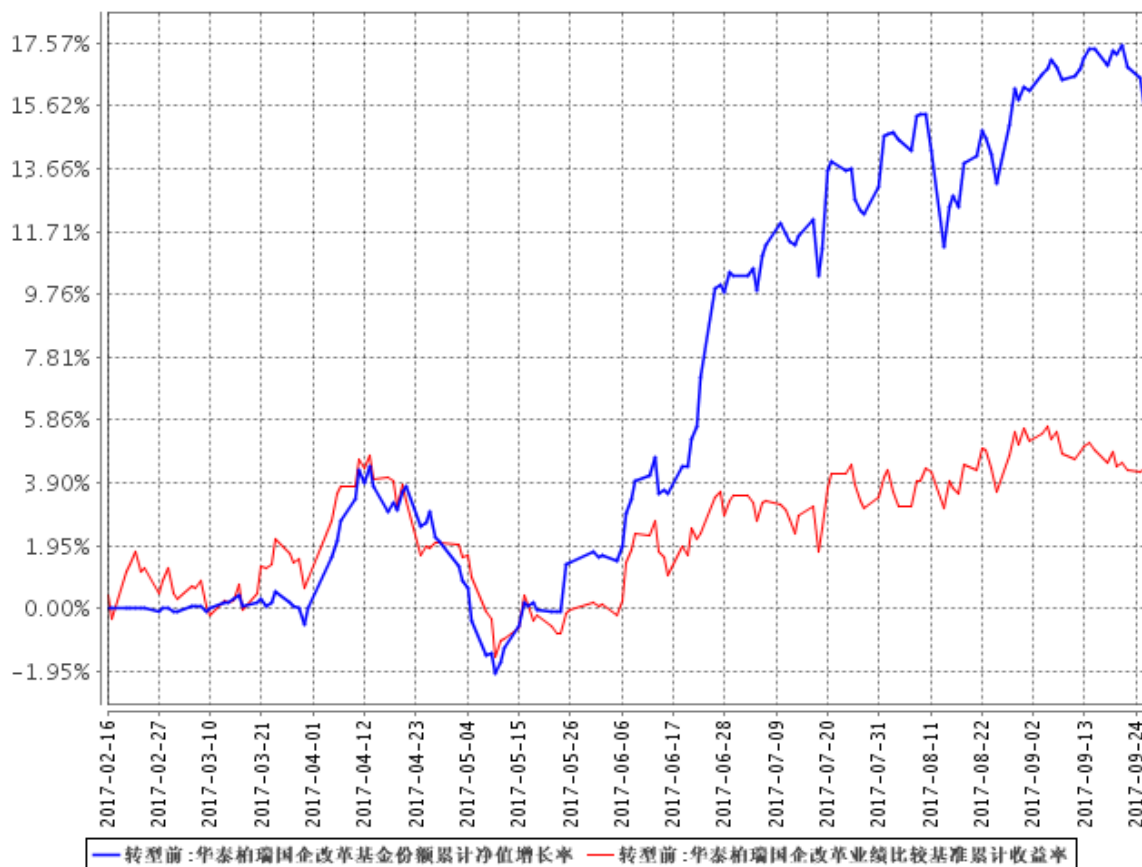
3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
2017/7/1-2017/9/26	4.85%	0.72%	0.84%	0.35%	4.01%	0.37%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华泰柏瑞国企改革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：注：1、图示日期为 2017 年 2 月 16 日至 2017 年 9 月 26 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，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围中规定的各项比例：本基金持有的股票占基金资产的比例为 0%-95%，投资于消费相关行业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保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
盛豪	量化投资部 副总监、本 基金的基金 经理	2017年3月1 日	-	9年	英国剑桥大学数学系 硕士。2007年10月 至2010年3月任 Wilshire Associates 量化研 究员，2010年11月 至2012年8月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。 2012年9月加入华泰 柏瑞基金管理有限公 司，历任量化投资部 研究员、基金经理助 理。2015年1月起任 量化投资部副总监， 2015年10月起任华 泰柏瑞量化优选灵活 配置混合型证券投资 基金和华泰柏瑞量化 驱动灵活配置混合型 证券投资基金的基金 经理。2016年12月 起任华泰柏瑞行业竞 争优势灵活配置混合 型证券投资基金的基 金经理。2017年3月 起任华泰柏瑞国企改 革主题灵活配置混合 型证券投资基金、华 泰柏瑞盛利灵活配置 混合型证券投资基金 和华泰柏瑞惠利灵活 配置混合型证券投资 基金的基金经理。 2017年4月起任华泰 柏瑞泰利灵活配置混 合型证券投资基金、 华泰柏瑞锦利灵活配 置混合型证券投资基 金、华泰柏瑞裕利灵 活配置混合型证券投资 基金和华泰柏瑞睿 利灵活配置混合型证

					<p>券投资基金的基金经理。2017 年 6 月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
杨景涵	本基金的基金经理	2017 年 2 月 16 日	-	13 年	<p>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 月起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 月起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 月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月起任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金和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 月起任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资</p>

					<p>基金的基金经理。2016 年 12 月起任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和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 月起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和华泰柏瑞国企改革主题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。</p>
--	--	--	--	--	---

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
盛豪	量化投资部 副总监、本 基金的基金 经理	2017 年 3 月 1 日	-	9 年	英国剑桥大学数学系 硕士。2007 年 10 月 至 2010 年 3 月任 Wilshire Associates 量化研

				<p>究员，2010 年 11 月至 2012 年 8 月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。2012 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。2015 年 1 月起任量化投资部副总监，2015 年 10 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起任华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月起任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔</p>
--	--	--	--	--

					法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
杨景涵	本基金的基金经理	2017 年 2 月 16 日	-	13 年	<p>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 月于中国人寿保险公司，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 月起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 月起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 月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月起任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金和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 月起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 月起任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</p>

					<p>资基金和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 月起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和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 月起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。</p>
--	--	--	--	--	--

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次集中交易室对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模

块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度市场热点较多，以钢铁为代表的上游周期类股在供给侧改革和环保限产的双重效应下，延续了 6 月以来的反弹行情，新能源汽车和 5G 通信受益于相关政策也涨幅较大，但各种题材分散且短期内快速波动，我们对部分行业以及热点暴露都进行了控制，降低了组合的主动风险。

本报告期内，基金经理择机加仓，目前股票仓位在九成以上。基金精选国企改革相关概念股，本报告期内表现符合预期。

结合 7 月中旬中央经济工作会议对经济稳中求进的定调，展望 2017 最后一个季度，我们认为除非受境外市场拖累，股市向下风险应该有限。

尽管 17 年境外不确定性因素仍然会有，但我们认为在不发生系统风险的前提下，A 股市场四季度向下风险应该有限。根本的驱动因素还是大量资金依然缺少更好的投资方向，而 A 股市场仍是一个不错的选择。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型前一日（2017 年 9 月 26 日），本基金份额净值为 1.1571 元，2017 年 7 月 1 日至 2017 年 9 月 26 日期间，基金净值上涨 4.85%，同期本基金的业绩比较基准上涨 0.84%。

本报告期末，本基金份额净值为 1.1592 元，2017 年 9 月 27 日至 2017 年 9 月 30 日期间，基金净值上涨 0.18%，同期本基金的业绩比较基准上涨 0.22%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

转型后:

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	213,538,538.14	91.62
	其中:股票	213,538,538.14	91.62
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	19,443,806.54	8.34
8	其他资产	89,846.02	0.04
9	合计	233,072,190.70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	6,569,135.61	2.83
C	制造业	81,940,506.57	35.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,449,890.44	1.05
E	建筑业	7,380,949.80	3.18
F	批发和零售业	4,172,620.45	1.80
G	交通运输、仓储和邮政业	13,747,456.91	5.92
H	住宿和餐饮业	113,040.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,110,067.72	1.34
J	金融业	61,257,544.90	26.37
K	房地产业	16,271,592.25	7.01
L	租赁和商务服务业	8,922,252.00	3.84
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,651,165.00	1.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	593,304.99	0.26
R	文化、体育和娱乐业	791,400.50	0.34

S	综合	3,567,611.00	1.54
	合计	213,538,538.14	91.94

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：注：本基金本报告期内未持有沪港通投资股票。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000415	渤海金控	992,800	6,572,336.00	2.83
2	600383	金地集团	564,100	6,470,227.00	2.79
3	002385	大北农	1,026,536	6,323,461.76	2.72
4	600585	海螺水泥	228,800	5,713,136.00	2.46
5	000002	万科A	212,337	5,573,846.25	2.40
6	601006	大秦铁路	560,500	4,904,375.00	2.11
7	601318	中国平安	88,300	4,782,328.00	2.06
8	000725	京东方A	1,041,700	4,583,480.00	1.97
9	601997	贵阳银行	306,300	4,505,673.00	1.94
10	600741	华域汽车	198,501	4,476,197.55	1.93

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

注：注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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

5.9.2 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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	45,213.92
2	应收证券清算款	40,724.87
3	应收股利	-
4	应收利息	3,907.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	89,846.02

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	213,281,759.05	91.70
	其中：股票	213,281,759.05	91.70
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	19,141,517.64	8.23
8	其他资产	171,818.34	0.074
9	合计	232,595,095.03	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	6,701,993.61	2.89
C	制造业	80,992,481.05	34.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,248,726.04	0.97
E	建筑业	6,982,472.40	3.01
F	批发和零售业	4,182,354.84	1.80
G	交通运输、仓储和邮政业	14,167,722.13	6.11
H	住宿和餐饮业	3,156,283.56	1.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,479,304.34	26.52
J	金融业	16,301,507.12	7.03
K	房地产业	9,078,021.96	3.92

L	租赁和商务服务业	3,134,040.00	1.35
M	科学研究和技术服务业	549,940.05	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	788,225.95	0.34
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	3,518,686.00	1.52
	合计	213,281,759.05	91.99

5.2.2 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持有沪港通投资股票。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000415	渤海金控	1,007,600	6,690,464.00	2.89
2	600383	金地集团	571,700	6,666,022.00	2.88
3	002385	大北农	1,026,536	6,323,461.76	2.73
4	600585	海螺水泥	228,800	5,790,928.00	2.50
5	000002	万科A	212,337	5,682,138.12	2.45
6	601006	大秦铁路	560,500	4,994,055.00	2.15
7	601318	中国平安	88,300	4,790,275.00	2.07
8	601997	贵阳银行	306,300	4,557,744.00	1.97
9	000651	格力电器	116,100	4,458,240.00	1.92
10	000725	京东方A	1,041,700	4,343,889.00	1.87

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

注：注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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

5.9.2 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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	45,213.92
2	应收证券清算款	124,275.31
3	应收股利	-
4	应收利息	2,329.11
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	171,818.34

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2017年9月27日）基金份 额总额	200,372,898.98
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份 额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回 份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动 份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	200,372,898.98

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	200,239,007.35
报告期期间基金总申购份额	186,322.15
减：报告期期间基金总赎回份额	52,421.78
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-
报告期期末基金份额总额	200,372,907.72

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

注：无。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

注：无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2017.07.01-2017.09.30	200,018,000.00	-	-	200,018,000.00	99.82%
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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

10.1 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。

10.2 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

10.3 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
2017 年 10 月 25 日