华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金

2019 第二季度 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16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。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞创新动力混合
交易代码	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
报告期末基金份额总额	89,458,455.88份
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%+中债总指数收益率×40%
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
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	5,501,294.74
2.本期利润	-4,417,588.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0497
4.期末基金资产净值	133,409,903.84
5.期末基金份额净值	1.491

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。

3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-3.37%	1.50%	-5.84%	1.00%	2.47%	0.50%

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

注:图示日期为2015年2月6日至2019年6月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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		
张慧	投资研究部副总监,本基金的基金经理	2015年2月6日	-	12年	经济学硕士,12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4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月起任华泰柏瑞价新动力灵活配置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。2018年1月起任投资部副总监。2018年1月起任投资部副总监及华泰柏瑞价值精选股票型产品混合型证券投资基金的基金经理。2019年3月起任投资研究部副总监。
吴邦栋	本基金的基金经理	2018年3月14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月起任华泰柏瑞价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月任华泰柏瑞价值精选股票型证券投资基金和华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年4月起任华泰柏瑞价值精选股票型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

本报告期内,本基金交易部对投资指令的合规性、及时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中的公平交易模块,确保公平交易的实施。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

报告期内没有发生本基金存在异常交易行为的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年,金融市场和宏观经济一波三折。市场对经济和风险资产在年初预期较悲观,央行降准继续压低债券收益率。而后,地方债大量发行前置和财政支出发力导致经济预期和股市在4月达到了年内高位。经济和股市的回升,伴随货币政策边际收紧,导致债券收益率上行。5月中美贸易磋商反复、银行破刚兑事件引发风险偏好回落,债券收益率也跟随下行。信用债方面,上半年以来违约不停。违约主体数量维持在较高水平,民企贡献新增主体的半数,并且向大型企业蔓延。市场的表现看,一季度宽信用政策密集出台、流动性支撑推动利差修复。二季度,随着外部风险缓释,叠加全球降息预期,国内货币政策降准降息预期升温信用利差依然维持在下行通道。债券市场整体呈现震荡格局。

收益率宽幅震荡。策略上,基金保持适当的久期与适中的杠杆水平,有效规避信用风险,同时把握时机博取资本利得。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金A类和B类份额净值分别为1.0552元和1.0292元,分别上涨0.81%和0.74%,同期本基金的业绩比较基准下降0.11%。

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

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	113,521,368.89	84.54
	其中:股票	113,521,368.89	84.54
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	19,113,956.77	14.23
8	其他资产	1,642,063.83	1.22
9	合计	134,277,389.49	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	39,403.30	0.03
B	采矿业	137,410.63	0.10
C	制造业	60,899,758.67	45.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,807.39	0.02
E	建筑业	1,840,661.50	1.38
F	批发和零售业	1,639,699.10	1.23
G	交通运输、仓储和邮政业	2,836,098.12	2.13
H	住宿和餐饮业	1,312.54	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,361,307.44	10.76
J	金融业	19,141,901.79	14.35
K	房地产业	2,637,754.40	1.98
L	租赁和商务服务业	3,544.30	0.00
M	科学研究和技术服务业	3,134,153.92	2.35
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	4,057,180.19	3.04
R	文化、体育和娱乐业	2,763,375.60	2.07
S	综合	-	-
	合计	113,521,368.89	85.09

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:本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	600519	贵州茅台	10,680	10,509,120.00	7.88
2	600036	招商银行	200,531	7,215,105.38	5.41
3	601012	隆基股份	285,720	6,602,989.20	4.95
4	601318	中国平安	73,624	6,523,822.64	4.89
5	000661	长春高新	17,431	5,891,678.00	4.42
6	000902	新洋丰	529,612	5,682,736.76	4.26
7	000333	美的集团	89,121	4,621,815.06	3.46
8	600763	通策医疗	43,658	3,867,662.22	2.90
9	000651	格力电器	66,729	3,670,095.00	2.75
10	002851	麦格米特	170,440	3,369,598.80	2.53

5.4 报告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。

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: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 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,中国证券监督管理委员会湖北监管局对新洋丰(000902)出具警示函,对公司在公司网站及其他媒体发布信息先于指定媒体,违反《上市公司信息披露管理办法》第六条第二款规定,按照《上市公司信息披露管理办法》第五十九条规定,对公司予以警示。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证券的发行主体,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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	76,027.54
2	应收证券清算款	1,559,103.91
3	应收股利	-
4	应收利息	3,373.42
5	应收申购款	3,558.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,642,063.83

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:本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	97,595,473.33
报告期期间基金总申购份额	8,633,453.99
减:报告期期间基金总赎回份额	16,770,471.44
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	89,458,455.88

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	7,127,394.96
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	7,127,394.96
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

注:1. 期间买入/申购总份额含转换入份额,期间卖出/赎回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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2019年4月22日	7,127,394.96	10,892,057.64	0.25%
合计			7,127,394.96	10,892,057.64	

注: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。

§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

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 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

9.3 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7月17日

华泰柏瑞货币市场证券投资基金

2019 第二季度 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16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。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞货币
交易代码	460006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年5月6日
报告期末基金份额总额	4,735,980,345.44份
投资目标	在有效保持基金资产安全和高流动性的前提下,追求超过业绩基准的稳健投资收益。
投资策略	本基金采取主动的投资管理策略对短期货币市场工具进行投资。在投资中将充分利用现代金融工程理论以及数量分析方法来提高投资决策的及时性与合理性,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,获得稳健的投资收益。
业绩比较基准	当期银行活期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金较高流动性、低风险的品种。其预期风险和预期收益率都低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞货币A / 华泰柏瑞货币B
下属分级基金的交易代码	460006 / 460106
报告期末下属分级基金的份额总额	3,449,032,946.80份 / 1,286,947,398.64份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	华泰柏瑞货币A	华泰柏瑞货币B
1. 本期已实现收益	15,494,125.22	18,156,444.66
2.本期利润	15,494,125.22	18,156,444.66
3.期末基金资产净值	3,449,032,946.80	1,286,947,398.64

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

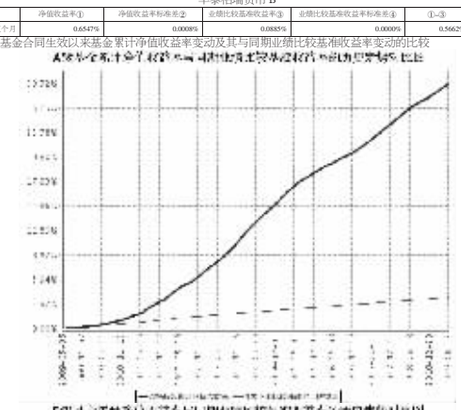
华泰柏瑞货币A

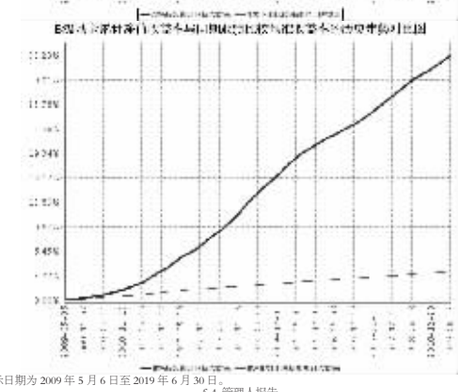
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5959%	0.0008%	0.0885%	0.0000%	0.5074%	0.0008%

华泰柏瑞货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6547%	0.0008%	0.0885%	0.0000%	0.5662%	0.0008%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:图示日期为2009年5月6日至2019年6月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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		
郑睿	固定收益部副总监,本基金的基金经理	2012年6月29日	-	14年	14年证券、基金从业经验,经济学硕士,曾任职于国信证券股份有限公司,平安资产管理有限责任公司。2008年3月至2010年4月任中海基金管理有限公司交易员,2010年加入华泰柏瑞基金管理有限公司,任债券研究员。2012年6月起任华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金经理。2013年7月至2017年11月任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的基金经理。2015年7月起任固定收益部副总监。2015年7月起任华泰柏瑞交易型货币市场证券投资基金的基金经理。2016年9月起任华泰柏瑞天添宝货币市场基金的基金经理。
朱向韬	本基金的基金经理	2016年7月19日	-	7年	北京大学计算数学硕士。2012年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任固定收益部研究员、基金经理助理。2016年7月起任华泰柏瑞货币市场证券投资基金和华泰柏瑞交易型货币市场证券投资基金的基金经理。2019年2月起任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。其次交易部对投资指令的合规性、及时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中的公平交易模块,确保公平交易的实施。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

2019年二季度经历了一轮对宏观经济从乐观到担忧的过程,在此期间债券市场收益率先上后下。

4月1日公布了3月份的PMI数据,显示51.5,相比2月份明显提高。接下来公布的进出口数据、通胀数据、增长类经济数据也均明显超预期。3月份社会融资规模达到了2.86万亿,一季度社融增量合计超过了8万亿,而去年同期不超过6万亿。同时股票市场从3000点继续上涨,权益市场的乐观预期叠加宏观数字的大幅改善,同期人民银行也重提控制货币供给总闸门,货币政策边际转向收紧,三个因素令债券市场出现了调整压力:10年国开收益率从3月底的3.58%附近上行到最高3.88%附近,幅度达到30bp。在这期间货币市场资金利率也有明显的上行,R1M加权利率从2.5%上行到了最高3.05%。在这段时间里,货币基金逐渐有资金赎回,因此提高了5日流动性资产的比例,并适当配置了一些长期限的资产。

进入到5月份,关于中美贸易谈判的不利消息传来,反转了对宏观经济的乐观预期,公布的4月份经济数字也有明显的下滑,风险偏好大幅回落,债券收益率重新开始下行。5月24日人民银行公告包商银行由于出现重大信用风险将被接管,市场对银行风险的担忧迅速蔓延,一级市场中AA+及以下评级的银行同业存单募集量大幅降低,这部分银行开始限制对非银的融出,导致非银的回购跟不上,市场上违约事件增多,又继续导致同业风险偏好的进一步下降。在这段时间里,高等级信用债和利率债的收益率短暂地小幅上行之后继续大幅度下行,央行公开市场开始持续投放资金,DR.007从2.6~2.8%下行到了2.2%附近。货币基金在这段时间之内大幅度配置了跨6月底的资产,提高静态收益率。

三季度和四季度宏观经济信用扩张的压力仍在。为了达到十九大制定的2020年全面建成小康的经济目标,今年的GDP增速不能够低于6.1%,未来刺激经济的政策也会继续推出,今年以来减税降费的作用在下半年也会逐渐体现,宏观经济继续大幅度回落的风险非常有限。同时,人民银行出于控制系统性金融风险和支持小微企业的政策目的,资金面也并不会明显收紧。短期来看,资金面超宽松的情况不会持续,DR.001将会回归到2%以上,DR.007也将回归到2.5~2.8%区间之内。整体上短端利率三季度的波动幅度预计会低于二季度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期华泰柏瑞货币A的基金份额净值收益率为0.5959%,本报告期华泰柏瑞货币B的基金份额净值收益率为0.6547%,同期业绩比较基准收益率为0.0885%。

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

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	固定收益投资	2,248,680,746.74	42.13
	其中:债券	2,248,680,746.74	42.13
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,145,369,918.05	21.46
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,913,346,962.32	35.85
4	其他资产	29,627,667.00	0.56
5	合计	5,337,025,294.11	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	7.65
	其中:买断式回购融资	0.00
序号	项目	金额(元) / 占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	397,732,361.13 / 8.40
	其中:买断式回购融资	0.00 / 0.00

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:无。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	50
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	78
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	55.91	4.22
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	34.18	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	5.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	12.48	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		107.85	4.22

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	279,512,625.36	5.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,008,624.64	0.63
	其中:政策性金融债	30,008,624.64	0.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	670,229,503.27	14.15
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,268,929,993.47	26.79
8	其他	-	-
9	合计	2,248,680,746.74	47.48
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111913030	19新商银行CD030	2,000,000	199,061,251.16	4.20
2	111915035	19民生银行CD035	2,000,000	196,488,318.36	4.15
3	199916	19贴现国债16	1,800,000	179,768,468.66	3.80
4	011900700	19津能热SCP005	1,000,000	100,059,699.94	2.11
5	071900024	19东北证券CP003	1,000,000	100,018,551.09	2.11
6	011900768	19恒金SCP002	1,000,000	100,005,318.20	2.11
7	071900039	19天风证券CP001	1,000,000	100,000,171.67	2.11
8	111815346	18民生银行CD346	1,000,000	99,855,119.34	2.11
9	111809320	18浦发银行CD320	1,000,000	99,824,683.27	2.11
10	111996593	19宁波银行CD074	1,000,000	99,755,602.77	2.11

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0565%
报告期内偏离度的最低值	-0.0085%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0163%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:无。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:无。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额资产净值保持在人民币1.00元。

5.9.2 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19民生银行CD035和18民生银行CD346的发行主体中国民生银行股份有限公司作出行政处罚决定,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;同业投资违规授受担保;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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,273.85
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	24,547,504.15
4	应收申购款	5,066,889.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	29,627,667.00

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华泰柏瑞货币A	华泰柏瑞货币B
报告期期初基金份额总额	320,967,340.67	4,251,522,259.71
报告期期间基金总申购份额	16,312,773,325.99	167,907,292.17
报告期期间基金总赎回份额	13,184,707,719.86	3,132,482,153.24
报告期期末基金份额总额	3,449,032,946.80	1,286,947,398.64

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 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

9.3 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7月17日

华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金

2019 第二季度 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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16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。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞稳本增利债券
交易代码	519519
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年12月3日
报告期末基金份额总额	51,921,784.22份
投资目标	在控制本金下跌风险的前提下,充分利用资本市场各类资产定价不准确产生的投资机会,实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金将以固定收益类资产投资为基础,以其投资收益为保障,参照固定比例组合保险机制(CPPI)对风险类资产上限进行动态调整,以有效保障投资组合本金的安全。
业绩比较基准	中债综合指数×80%+一年期银行定期存款税后收益率×20%
风险收益特征	本基金属主动管理的债券型证券投资基金,为证券投资基金中的较低风险较低收益品种,其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金、高于货币市场基金。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞稳本增利债券A / 华泰柏瑞稳本增利债券B
下属分级基金的交易代码	519519 / 460003
报告期末下属分级基金的份额总额	41,055,822.29份 / 10,865,961.93份

注:友邦华泰中短期债券投资基金基金合同于2006年4月13日生效,并于2007年12月3日转型为友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金。本基金名称自2010年4月30日起,由"友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金"更名为"华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金",基金简称为"华泰柏瑞稳本增利债券",基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见2010年4月30日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	华泰柏瑞稳本增利债券A	华泰柏瑞