华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:2018年8月25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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月21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、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞盛利混合		
基金主代码	002069		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017年3月3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	173,492,833.12份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞盛利混合A	华泰柏瑞盛利混合C	
下属分级基金的交易代码:	002069	002070	
报告期末下属分级基金的份额总额	173,492,561.23份	1,271.89份	

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,前瞻性地把握不同时期投资市场、债券市场和银行间市场等潜在的投资机会,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	本基金为混合型基金,以获取长期稳定收益为目标,根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势,判断当前所处的经济周期,进而对未来做出科学预测。在此基础上,结合对流动性及资金流向的分析,综合股市和债市估值及风险分析进行大类资产配置。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。	

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈辉	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs400889000@huatai-pb.com	tcsf@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	基金管理人及基金托管人住所

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金规模	华泰柏瑞盛利混合A	华泰柏瑞盛利混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	4,198,641.00	65.77
本期利润	-5,400,508.07	-68.48
加权平均基金份额本期利润	-0.0500	-0.0514
本期基金份额净值增长率	-4.56%	-4.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1233	0.1111
期末基金资产净值	194,717,036.02	1,413.15
期末基金份额净值	1.1223	1.1111

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞盛利混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.47%	1.05%	-3.70%	0.64%	0.23%	0.41%
过去三个月	-5.85%	0.82%	-4.52%	0.57%	-1.33%	0.25%
过去六个月	-4.56%	0.68%	-5.47%	0.57%	0.91%	0.11%
过去一年	6.34%	0.63%	-1.46%	0.47%	7.80%	0.16%
自基金合同生效起至今	12.23%	0.58%	1.26%	0.44%	10.97%	0.14%

华泰柏瑞盛利混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.48%	1.05%	-3.70%	0.64%	0.22%	0.41%
过去三个月	-5.91%	0.82%	-4.52%	0.57%	-1.39%	0.25%
过去六个月	-4.72%	0.68%	-5.47%	0.57%	0.75%	0.11%
过去一年	5.32%	0.63%	-1.46%	0.47%	6.78%	0.16%
自基金合同生效起至今	11.11%	0.58%	1.26%	0.44%	9.85%	0.14%

注:本基金的业绩基准指标"沪300指数收益率"和"中债综合指数收益率"按50%、50%之比例进行,并每日进行再平衡。

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

注:1.A图示日期为2017年3月3日至2018年6月30日。C图示日期为2017年3月3日至2018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AXA亚洲)和苏州新区高新技术产业股份有限公司,出资比例分别为40%、40%和20%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛利混合型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300指数增强型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞新兴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、华泰柏瑞强债增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞丰利债券型证券投资基金、华泰柏瑞价值优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞新动力混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利混合型证券投资基金、华泰柏瑞新兴成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300指数增强型证券投资基金、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、华泰柏瑞季季红