

华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

具有潜在的高回报和长期的吸引力,因此买入。

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析
 本基金2018年三季度,采取积极的策略,保持权益资产的稳定仓位,精选个股,业绩表现较为平稳。展望2018年四季度,短期市场悲观心态可能加剧,但终究将回归基本面,在宏观经济总体稳定,预期较为悲观但政策对冲不断发力情况下,股票市场或将经历一个从悲观到绝望到修复和重新充满希望的过程。我们判断目前的权益市场已经准备好了系统性的配置机会,但是价值修复过程仍将受到多因素因素的干扰出现反复波动。精选个股持有,忽略短期波动是目前的盈利手段。本基金专注于权益市场,审慎投资,精选个股,努力在2018年四季度为投资者带来更优的净值表现。

4.5 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0.8185元;本报告期基金份额净值增长率为-1.32%,同期比较基准收益率为-0.03%。

4.6 报告期内本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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	473,329,130.14	58.98
2	其中:股票	473,329,130.14	58.98
3	债券投资	-	-
4	其中:国债	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,369,262.69	2.80
8	其他资产	3,601,727.43	0.45
9	合计	500,729,220.26	62.23

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	31,174,476.58	3.91
C	制造业	80,747,706.03	10.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	64,748,448.68	8.07
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	信息技术业	-	-
J	金融业	128,441,477.88	16.01
K	房地产业	117,996,282.88	14.62
L	综合类	-	-
M	国防军工	-	-
N	有色金属业	-	-
O	其他行业	-	-
P	合计	473,329,130.14	58.98

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组

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	600188	华夏银行	2,248,967	26,068,056.84	3.28
2	000830	鲁西化工	1,770,000	25,163,480.00	3.15
3	001169	宝钢股份	1,013,000	25,727,234.00	3.22
4	000166	中国石化	4,027,800	26,660,336.00	3.34
5	601009	南钢股份	3,244,022	25,688,276.56	3.24
6	600026	山东钢铁	3,368,189	26,317,104.00	3.29
7	600073	长安汽车	2,316,000	25,268,574.00	3.16
8	300182	捷成股份	4,467,000	25,141,624.00	3.15
9	000069	华侨城A	3,493,528	25,084,234.88	3.14
10	600068	皖能股份	3,491,128	24,784,264.00	3.09

5.4 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组

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资产支持证券

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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五名贵金属投资组

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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股指期货投资组

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

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国债期货投资组

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9 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组

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.10 本期国债逆回购交易情况

注:本基金本报告期末未持有国债逆回购。

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中,南京银行(601009)于2018年1月29日

公告公开发行可转债,中国银保监会监督管理委员会江苏监管局行政决定书,对南京分行违规办理理财业务及理财销售管理的行为罚款20万元人民币。公司

对该项股票投资决策程序的说明,根据公司的基金投资管理相关制度,以相应的研

究报告为基础,结合其未来成长前景,由基金经理决定具体投资行为。

在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。

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。

5.11.2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	382,026.41
2	应收证券清算款	3,006,364.69
3	应收利息	7,190.71
4	应收股利	66,908.81
5	其他应收款	-
6	其他流动资产	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,261,222.43

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	-	-
2	股指期货	-	-
3	权证	-	-
4	其他	-	-
5	合计	-	-

5.11.4 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股指期货投资

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.5 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国债期货投资

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.11.7 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.11.8 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债券投资

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.11.9 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资产支持证

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.10 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.11.11 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股指期货

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.12 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国债期

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.13 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.11.14 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.11.15 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

注:本基金本报告期末未持有债券。

4.1 基金经理 (或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
孙宇	基金经理	2017年3月10日	-	14年	孙宇先生毕业于清华大学,获金融学硕士学位,曾任华夏基金研究员,2014年加入华泰柏瑞基金管理有限公司,曾任华泰柏瑞基金研究员,2017年3月10日起担任华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018年3月10日起担任华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月10日起担任华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月10日起担任华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金的投资运作符合相关法律法规、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和流程,从事前、事中、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、有效性及合理性进行独立审核,

在交易过程中启用交易系统中的公平交易模块,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风险分析。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,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.4 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.5 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.6 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.7 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.8 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.9 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.10 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.11 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.12 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.13 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.14 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.15 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.16 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.17 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.18 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.19 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.20 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.21 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.22 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.23 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.24 异常交易行为的专项说明

报告期内,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5%的,共1次。经事后分析,该个股的基本面相对

稳定,由于市场悲观情绪导致股价水平大幅低于内在价值,在此价格水平上该股票

4.3.25 异常交易行为的专项说明

报告期内,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