

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

2018年第三季度报告

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 基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标 报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*95%+银行活期存款收益率*5%



注:1. A股报告期自2015年7月1日起至2018年9月30日, C股报告期自2015年7月1日起至2018年9月30日

基金经理人 华泰柏瑞基金管理有限公司 基金经理人姓名 中国工商银行股份有限公司

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*95%+银行活期存款收益率*5%

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*95%+银行活期存款收益率*5%

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*95%+银行活期存款收益率*5%

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*95%+银行活期存款收益率*5%

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况说明 报告期内本基金的各项运作均符合法律法规、基金合同及基金托管协议的约定,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 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,通过科学严谨的投资决策流程,严格执行公平交易制度,确保不同投资组合的公平交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 三季度受中美贸易摩擦影响,市场整体仍表现不佳,人气低迷,上证指数出现多日成交额在1000亿以下,期间沪深300为代表性的大盘蓝筹股相对抗跌,三季度下跌2.05%,而以中证500、中证1000和创业板指为代表的中小盘指数仍处于估值低位的过程中,分别下跌了7.90%、11.06%和12.16%。

4.5 报告期内基金的投资组合报告 截至本报告期末华泰柏瑞沪深300ETF联接基金资产净值为741,202元,本报告期末基金份额净值增长率为-0.62%,截至本报告期末华泰柏瑞沪深300ETF联接基金资产净值为741,434元,本报告期末基金份额净值增长率为-0.72%,同期业绩比较基准收益率为-1.92%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 截至本报告期末,本基金持有人人数或基金资产净值均未触及基金合同约定的预警标准。

5.1 报告期内基金资产组合情况 序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

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

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合 5.4.1 报告期末按品种分类的境内债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.5 投资组合报告 5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

5.5.3 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

5.5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合 5.5.4.1 报告期末按品种分类的境内债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.5.5 投资组合报告 5.5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.5.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.5.5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

5.5.5.3 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

5.5.5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合 5.5.5.4.1 报告期末按品种分类的境内债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

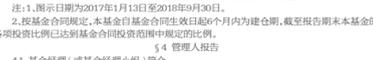
华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金 基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标 报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*50%+中证全指金融服务指数收益率*50%



注:1. A股报告期自2015年7月1日起至2018年9月30日, C股报告期自2015年7月1日起至2018年9月30日

基金经理人 华泰柏瑞基金管理有限公司 基金经理人姓名 中国工商银行股份有限公司

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*50%+中证全指金融服务指数收益率*50%

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*50%+中证全指金融服务指数收益率*50%

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*50%+中证全指金融服务指数收益率*50%

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*50%+中证全指金融服务指数收益率*50%

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*50%+中证全指金融服务指数收益率*50%

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况说明 报告期内本基金的各项运作均符合法律法规、基金合同及基金托管协议的约定,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 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,通过科学严谨的投资决策流程,严格执行公平交易制度,确保不同投资组合的公平交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 三季度受中美贸易摩擦影响,市场整体仍表现不佳,人气低迷,上证指数出现多日成交额在1000亿以下,期间沪深300为代表性的大盘蓝筹股相对抗跌,三季度下跌2.05%,而以中证500、中证1000和创业板指为代表的中小盘指数仍处于估值低位的过程中,分别下跌了7.90%、11.06%和12.16%。

4.5 报告期内基金的投资组合报告 截至本报告期末华泰柏瑞泰利混合A基金资产净值为9,081.9元,本报告期末基金份额净值增长率为1.28%,截至本报告期末华泰柏瑞泰利混合C基金资产净值为9,036.7元,本报告期末基金份额净值增长率为-1.91%,同期业绩比较基准收益率为-0.40%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 截至本报告期末,本基金持有人人数或基金资产净值均未触及基金合同约定的预警标准。

5.1 报告期内基金资产组合情况 序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

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

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合 5.4.1 报告期末按品种分类的境内债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.5 投资组合报告 5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

5.5.3 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

5.5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合 5.5.4.1 报告期末按品种分类的境内债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金 基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标 报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*20%+中证消费服务指数收益率*80%



注:1. A股报告期自2015年7月1日起至2018年9月30日, C股报告期自2015年7月1日起至2018年9月30日

基金经理人 华泰柏瑞基金管理有限公司 基金经理人姓名 中国工商银行股份有限公司

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*20%+中证消费服务指数收益率*80%

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*20%+中证消费服务指数收益率*80%

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*20%+中证消费服务指数收益率*80%

基金业绩比较基准 沪深300指数收益率*20%+中证消费服务指数收益率*80%

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况说明 报告期内本基金的各项运作均符合法律法规、基金合同及基金托管协议的约定,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 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,通过科学严谨的投资决策流程,严格执行公平交易制度,确保不同投资组合的公平交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 三季度受中美贸易摩擦影响,市场整体仍表现不佳,人气低迷,上证指数出现多日成交额在1000亿以下,期间沪深300为代表性的大盘蓝筹股相对抗跌,三季度下跌2.05%,而以中证500、中证1000和创业板指为代表的中小盘指数仍处于估值低位的过程中,分别下跌了7.90%、11.06%和12.16%。

4.5 报告期内基金的投资组合报告 截至本报告期末华泰柏瑞消费成长混合A基金资产净值为3,964.7元,本报告期末基金份额净值增长率为10.58%,业绩比较基准收益率为-8.88%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 截至本报告期末,本基金持有人人数或基金资产净值均未触及基金合同约定的预警标准。

5.1 报告期内基金资产组合情况 序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

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

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合 5.4.1 报告期末按品种分类的境内债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.5 投资组合报告 5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

5.5.3 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

5.5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合 5.5.4.1 报告期末按品种分类的境内债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

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 基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金 基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金 基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司