

华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

§ 1 重要提示

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：2019年1月21日

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公司基金合同规定，于2019年1月18日复核了本报告中的财务数据、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。

本报告期间2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：华泰柏瑞多策略混合

交易代码：000317

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年9月6日

报告期末基金份额总额：60,163,710,609份

投资目标：通过深入研究，精选具有投资价值的股票，力争实现基金资产的长期增值。

投资策略：本基金在综合分析宏观经济、行业政策、市场环境、估值水平、公司治理、盈利能力、成长性、估值水平、流动性等指标的基础上，精选具有投资价值的股票，力争实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准：沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

风险收益特征：本基金为混合型基金，预期风险与收益高于货币市场基金，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

单位：人民币元

主要财务指标	报告期：2018年10月1日 - 2018年12月31日
1.本期已实现收益	-107,356.44
2.本期利润	-70,865,246.02
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1306
4.期末基金份额净值	0.8748,361.52
5.期末可供分配基金份额利润	0.0017

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将低于所列数字。

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。

3.2.1 本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(%) 业绩比较基准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去六个月 -11.00% 3.67% -0.07% 0.06% -0.13% 0.06%

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的比较

注1：图示日期为2016年9月29日至2018年12月31日。

2.按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起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

截至本报告期末，本基金份额净值为0.8617元，下跌11.96%，同期本基金的业

绩比较基准下跌6.93%。

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)	占基金资产的比例(%)
1	权证投资	54,781,247.25	0.21
2	其他投资	54,781,247.25	0.21
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	-	-
5	其中：债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	黄金投资	-	-
8	股票	-	-
9	买入返售金融资产	-	-
10	应收票据	-	-
11	应收账款	-	-
12	其他应收款	-	-
13	应付票据	-	-
14	应付账款	-	-
15	应付职工薪酬	-	-
16	应付股利	-	-
17	应付利息	-	-
18	应付手续费及佣金	-	-
19	应付交易费用	-	-
20	其他应付款	-	-
21	预收款项	-	-
22	其他流动负债	-	-
23	递延所得税负债	-	-
24	其他负债	-	-
25	合计	169,434,166.69	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

5.2.1.1 行业类别

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	4,569,746.74	7.00
C	制造业	17,784,360.47	30.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	交通运输、仓储和邮政业	5,369,128.00	9.26
F	批发和零售业	-	-
G	住宿和餐饮业	-	-
H	金融业	-	-
I	信息技术业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	休闲娱乐业	-	-
M	科学研究、技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,543,399.00	4.46
S	综合	-	-
T	合计	54,781,247.25	94.70

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.2.1 行业类别

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	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	交通运输、仓储和邮政业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	住宿和餐饮业	-	-
H	金融业	-	-
I	信息技术业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	休闲娱乐业	-	-
M	科学研究、技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	0.00	0.00

5.2.3 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合

5.2.3.1 行业类别

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	002146	盈趣科技	371,000	2,949,460.00	5.10
2	002611	中坚科技	249,000	2,796,503.00	4.77
3	601009	南京银行	417,020	2,699,763.26	4.67
4	002142	宁波银行	164,000	2,600,000.00	4.63
5	000026	广发银行	427,000	2,647,400.00	4.68
6	000008	民生银行	406,400	2,600,442.00	4.61
7	000022	招商银行	762,000	2,600,002.00	4.61
8	00166	兴业银行	174,000	2,600,600.00	4.49
9	000006	浦发银行	410,000	2,591,200.00	4.49
10	000009	中信银行	426,900	2,583,032.00	4.41

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.2.4.1 行业类别

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	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	交通运输、仓储和邮政业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	住宿和餐饮业	-	-
H	金融业	-	-
I	信息技术业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	休闲娱乐业	-	-
M	科学研究、技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	0.00	