华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
送出日期:2019年3月27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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月26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及其更新。

本年度报告财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞鼎利混合	
基金主代码	004010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月22日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	400,080,479.01份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞鼎利混合A	华泰柏瑞鼎利混合C
下属分级基金的交易代码:	004010	004011
报告期末下属分级基金的份额总额	399,834,499.58份	245,979.43份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极灵活的合理资产配置,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争基金资产的持续稳健增值。	
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,在投资过程中实现风险和收益的优化平衡。根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的分析与比较,对股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整。本基金股票投资以定性和定量分析为基础,从基本面分析入手,结合宏观经济走势及市场分析,根据市场估值与流动性优选个股,重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中的股票。	
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	
	华泰柏瑞鼎利混合A	华泰柏瑞鼎利混合C

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	曾麓燕
	联系电话	021-38601777	021-52629999-212040
	电子邮箱	csr@huatai-pb.com	015292@cib.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95561
传真		021-38601799	021-62535823

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年		2017年		2016年12月22日(基金合同生效日)-2016年12月31日	
	华泰柏瑞鼎利混合A	华泰柏瑞鼎利混合C	华泰柏瑞鼎利混合A	华泰柏瑞鼎利混合C	华泰柏瑞鼎利混合A	华泰柏瑞鼎利混合C
本期已实现收益	12,760,672.44	6,851.18	26,924,187.15	928.38	62,110.15	5.67
本期利润	14,562,151.02	1,668.39	26,812,942.36	823.31	62,110.15	5.67
加权平均基金份额本期利润	0.0364	0.0059	0.0695	0.0601	0.0003	0.0002
本期基金份额净值增长率	3.62%	6.10%	6.75%	6.75%	0.03%	0.02%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.0003	0.0246	0.0057	0.0056	0.0003	0.0002
期末基金资产净值	401,428,556.99	253,054.88	402,097,549.93	10,247.64	200,069,598.41	23,039.83
期末基金份额净值	1.0040	1.0288	1.0057	1.0056	1.0003	1.0002

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 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

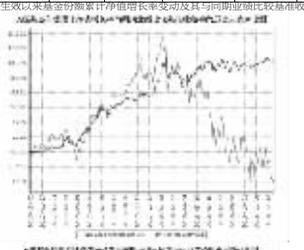
华泰柏瑞鼎利混合A

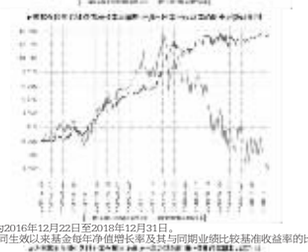
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.42%	0.07%	-5.31%	0.81%	5.73%	-0.74%
过去六个月	0.67%	0.16%	-5.87%	0.74%	6.54%	-0.58%
过去一年	3.62%	0.20%	-11.02%	0.66%	14.64%	-0.46%
自基金合同生效起至今	10.66%	0.16%	-3.30%	0.52%	13.96%	-0.36%

华泰柏瑞鼎利混合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
过去三个月	0.39%	0.08%	-5.31%	0.81%	5.70%	-0.73%
过去六个月	0.59%	0.16%	-5.87%	0.74%	6.46%	-0.58%
过去一年	6.10%	0.26%	-11.02%	0.66%	17.12%	-0.40%
自基金合同生效起至今	13.29%	0.20%	-3.30%	0.52%	16.59%	-0.32%

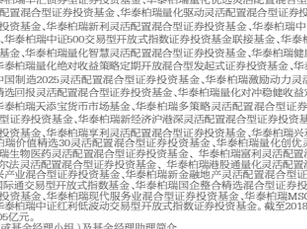
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:1、图示日期为2016年12月22日至2018年12月31日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:基金合同生效日为2016年12月22日,2016年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

华泰柏瑞鼎利混合A

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.3810	15,233,651.56	41.12	15,233,692.68	
2017	0.6200	24,789,519.06	69.02	24,789,588.08	
2016	-	-	-	-	
合计	1.0010	40,023,170.62	110.14	40,023,280.76	

单位:人民币元

华泰柏瑞鼎利混合C

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.3810	8,226.48	408.76	8,635.24	
2017	0.6200	1,121.64	0.00	1,121.64	
2016	-	-	-	-	
合计	1.0010	9,348.12	408.76	9,756.88	

§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AIGGIC)和苏州新区高新技术产业股份有限公司,出资比例分别为49%、49%和2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极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、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、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、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创业升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极价值混合型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞瑞利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞荣利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选30灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞稳股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞现代服务业混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金。截至2018年12月31日,公司基金管理规模为980.05亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴邦栋	本基金的基金经理	2018年4月2日	-	7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月起任华泰柏瑞创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月任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年4月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
杨景福	本基金的基金经理	2016年12月22日	2018年4月2日	14年	中山大学经济学硕士。特许金融分析师(CFA),金融风险管理师(FRM)。2004年至2006年于平安资产管理有限公司,任投资分析师;2006年至2009年9月于生命人寿保险公司,历任投连投资经理、投资经理、基金投资部负责人。2009年10月加入本公司,任专户投资部投资经理。2014年6月至2015年4月任研究部总监助理。2015年4月至2018年4月任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月至2017年12月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年8月至2017年12月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月至2018年11月任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月起任华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年11月至2017年12月任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月至2018年4月任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起任华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年1月至2018年3月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月起任华泰柏瑞价值精选30灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月至2018年3月任华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月起任华泰柏瑞价值精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月至2018年11月任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
罗远航	本基金的基金经理	2017年3月24日	-	7年	清华大学应用经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司交易员、研究员、基金经理。2017年1月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2017年3月至2018年4月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年4月起任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定,在严格控制风险的基础上,忠实履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益,在本报告期内,基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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,建立了科学完善的公平交易管理制度,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。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,对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块;对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同账户。风险管理部对投资组合的交易进行日常监控和分析评估。同时对投资组合的交易价差在不同时间窗(如日内、3日、5日)进行分析,综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能,确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司转投资管理职能和交易执行职能完全隔离,实行集中交易制度,由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务,为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理职门业务的情况。不同业务类别的投资经理之间互不干扰,独立做出投资决策。公司机构设置合理,公平交易的相关管理制度健全,投资决策流程完善,各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待,不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现,投告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与预警指标与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查,交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制,风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内,该制度执行情况良好,无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中,均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5%的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

18年市场呈现单边下行的态势,1月份上涨之后,指数持续处于震荡下跌趋势中。其中沪深300下跌25.31%,创业板指下跌28.65%,中证500下跌33.32%。全年当中风格切换较多,但总体跌幅接近,也均具备一些细分行业机会。主板方面,以银行为代表的高股息股票资产具有相对收益,而成长风格上,5G、新能源汽车等主题的表现十分活跃。

宏观和金融政策环境在去年下半年开始,已经有所改善。一方面10月下旬市场快速下跌之后,存在股权质押问题的小股票越来越多,甚至开始蔓延至一些杠杆率较高的行业龙头。针对这一现象,一行三会及地方政府组织各类纾困计划,对部分出现股权质押、现金流问题的优质民营企业给予帮助。另一方面,11-12月召开的政治局会议、中央经济工作会议对财政政策给予积极态度,同时强调改善货币政策的疏导机制,将稳增长再次放到较为重要的位置,这意味着2019年宽货币的政策可能开始主要向信用端关注,未来更加注重流动性支持实体经济的有效性上。

经济及企业盈利等基本面上看,2018年下半年开始逐渐加剧,这也是政策转向脚步加快的主要原因之一。从企业盈利来看,工业企业盈利单月增长快速回落,目前11月同比数据已经进入负增长区间。而宏观数据上,消费数据的回落速度显著加快,以汽车为首的可选消费品成为了主要的拖累项。我们预计未来半年内,国内宏观经济仍将受到金融去杠杆的滞后性影响,呈现下滑的态势。

行业上看,大多数行业跌幅较大,一方面银行等高股息资产相对跌幅较少;另一方面,下半年开始与政策对冲相关性较大的行业有一定表现。传统行业方面,房地产、建筑两大宏观经济投资体量占比较大的行业跌幅较小,主要受到基建预期提速,房地产监管口风有所松动等利好的影响。另外值得关注的是,市场对于所谓“新兴基建”的追捧也较高,主要体现在通信、电力设备两个行业上,具体而言,是对5G、特高压投资未来给予较高的期望。

出于绝对收益的考虑,本基金在报告期内对股票持仓比例已经了一定的下调。结构上,最终仍有以高分红、高ROE现金流汇报、低PB的价值蓝筹组合作为主要的配置结构。行业分布上,主要集中在银行地产以及部分的消费白马中。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞鼎利混合A基金份额净值为1.0040元,本报告期基金份额净值增长率为3.62%;截至本报告期末华泰柏瑞鼎利混合C基金份额净值为1.0288元,本报告期基金份额净值增长率为6.10%;同期业绩比较基准收益率为-11.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019,我们认为流动性环境有进一步改善的空间,而股指不宜过度悲观。年初以来,央行继续显示出宽松的货币指引,全面降准的时间点较之前的市场预期有一定的提前,同时对商业银行给予中小微企业的贷款给予全面的政策扶持。我们关注到政策层面对于今年宽信用的实施方针是非常重视的。从市场化利率角度来看,无风险的国债收益率进一步降低至3.12%左右,短端利率持续压低在2%略多的水平,这些都给了金融机构很强的利率下行预期指引。我们预计今年商业银行“早投放早受益”的经营冲动会强于往年,因此无论从银行间流动性市场,还是信用端信贷企稳的角度看,今年都存在一定货币预期修复的空间。从市场层面看,截止至12月底上证收于2500点以下的较低位置,除了少数较为集中的主题估值过高以外,整体市场估值仍处在偏低位置,以银行为例,四大行的估值基本处在历史最低PB水平,而股息分红方面,4%.5%以上的个股比比皆是,相比于日益降低的10年期国债收益率,部分行业的投资性价比非常高。操作方面,一方面小幅增加权益股票的配置比例。另一方面,选股和组合结构上,1季度本基金的操作主要在参考三个方面的思路下,再精选个股:1.对于超细收益较大,短期无盈利支撑,交易较为拥挤的主题,在组合中尽量回避;2.在年报分红前,关注高股息类资产的绝对收益机会。由于宏观盈利的下降趋势,需要在其中有所甄别,尽量选择盈利周期稳定,或盈利仍有逆周期改善的品种和个股配置;3.关注长期景气度改善的成长方向,并做到买入时点,与估值业绩匹配相符合,继续重视盈利的可持续性,以及估值的相对合理性,在立足于绝对收益的基础之上,挖掘具备所值成长空间的个股。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2018年度,本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时,始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求,继续致力于内控机制的完善,加强内部风险的控制与防范,确保各项法规和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行,公司监察部门按照规定的权限和程序,通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法,独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核,发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改,同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内,基金管理人内部监察稽核主要工作如下:

(1)全面开展基金运作合规监察工作,确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有:严格执行集中交易制度,各基金相互独立,交易指令由中央交易室统一执行完成;对基金投资交易系统进行事先合规性设置,并由风险控制部门进行实时监控,杜绝出现违规行为;严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序;通过以上措施,保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程,保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定,确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2)开展定期和专项监察稽核工作,确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动,对稽核中发现问题及时发出合规提示函,要求相关部门限期整改,并对改进情况安排后续跟踪检查,确保各项业务开展合法合规。

(3)促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求,公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度,促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4)通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等,有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展,在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形,基金运作整体合法合规。在今后的工作中,本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范各种风险,为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,基金管理人严格执行基金估值控制流程,定期评估估值技术的合理性,每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人,基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%,若(基金合同)生效不满3个月可不进行收益分配。本报告期内,本基金符合分红条件,于2018年12月20日进行分配,每10份基金份额共派发红利0.381元,利润分配合计15,242,327.02元,其中现金形式发放总额为15,241,878.04元,再投资形式发放总额为449.88元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注:无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对报告期内财务会计报告等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第21855号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞鼎利混合基金”)的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞鼎利混合基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞鼎利混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	华泰柏瑞鼎利混合基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞鼎利混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞鼎利混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞鼎利混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告,合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对华泰柏瑞鼎利混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们将出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞鼎利混合基金不能持续经营。 (五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	申峰 曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
审计报告日期	2019年3月26日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华泰柏瑞利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		2,991,482.65	2,192,190.00
结算备付金		-	361,889.75
存出保证金		44,381.37	15,057.33
交易性金融资产		463,324,950.03	391,045,786.31
其中:股票投资		20,032,663.63	64,077,660.71
基金投资		-	-
债券投资		443,292,286.40	326,968,125.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	7,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		9,134,271.79	3,190,440.88
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		475,495,085.84	403,805,364.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		73,039,714.44	-
应付证券清算款		-	1,008,840.00
应付赎回款		4,827.49	-
应付管理人报酬		209,645.83	207,892.48
应付托管费		52,411.45	51,973.14
应付销售服务费		51.28	3.45
应付交易费用		76,311.29	62,857.63
应交税费		18,312.24	-
应付利息		52,199.95	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		360,000.00	366,000.00
负债合计		73,813,473.97	1,697,566.70
所有者权益:			
实收基金		400,080,479.01	399,842,319.36
未分配利润		1,601,132.86	2,265,478.21
所有者权益合计		401,681,611.87	402,107,797.57
负债和所有者权益总计		475,495,085.84	403,805,364.27

注:1.报告截止日2018年12月31日,基金份额总额400,080,479.01份,其中A类基金份额399,834,499.58份,A类基金份额净值1.0040元,C类基金份额245,979.43份,C类基金份额净值1.0288元。

7.2 利润表

会计主体:华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入		20,292,088.59	30,977,237.42
1.利息收入		17,522,168.29	13,802,309.84
其中:存款利息收入	7.4.7.11	79,093.29	604,241.11
债券利息收入		17,388,671.68	13,020,