

华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金

[2015]第四季度报告

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:2016年1月21日
§ 1 重要提示
基金管理人的董事及董事会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本基金合同规定，于2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、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。
本报告期的财务数据未经审计。
本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞消费成长混合
交易代码	000109
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年10月20日
报告期末基金份额总额	706,870,085.81份
投资目标	通过深入研究，本基金主要投资于消费行业相关的成长性公司，在有效控制风险的前提下，力争为投资者创造高于业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金采用“自上而下”、“自下而上”相结合的方法进行投资操作。在宏观和行业分析的基础上，精选具有持续竞争优势的个股，同时精选估值合理的品种，力求在把握大类资产配置比例的同时，获得超越基准的投资回报。
业绩比较基准	中证消费指数*90%+中证债券指数*20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，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

主要财务指标	单位:人民币元			
	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)	本期		
1.本期已实现收益	286,228,273.29			
2.期利润	259,097,376.99			
3.加权平均基金份额本期利润	0.0369			
4.期末基金份额净值	1,039,900,903.14	1.348		
5.期末基金资产净值	1,039,900,903.14	1.348		
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，计算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. 基金净值表现				
3.2 本基金报告期内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	净值增长率① 净值增长率差② 过去三个月 32.16%	业绩比较基准③ 业绩比较基准差④ 1.20% 21.90%	①-③ 1.42% 10.77% 1.00%	②-④
3.2.2 自基金成立以来本基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较				
图:华泰柏瑞消费成长混合基金2015年10月20日至2015年12月31日净值走势图				

注:1.图表日期为2015年10月20日至2015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，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分(二)投资范围的有关规定：本基金持有的股票占基金资产的比例为0%-95%，投资于消费相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的80%;每个交易日在扣除股指期货合约后的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介			
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限
方伟	基金经理	2015年6月30日	-
			12

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内本基金的运作符合相关法律、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《证券投资基金公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后环节严格执行不同基金经理的利益输送。首先投资部和研究部通过科学的规定流程来确保公平对待不同的投资组合。其交易行为对投资组合的合规性、合理性及合理性进行独立审核，在交易过程中由投资交易系统的公平交易模块，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分析评估。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内无下列情况：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股票当日涨跌幅偏离值达到±5%的5%

4.4 报告期内基金的证券投资和衍生品交易情况
4.4.1 报告期内基金的证券投资情况
4.4.2 报告期内基金的衍生品交易情况
2015年第四季度，沪深300指数上涨17.27%，中证500指数上涨24.81%，创业板指数上涨29.33%。市场杠杆上涨，迎来大幅反弹。投资策略上，本基金抓住了成长股反弹的机会，基金净值快速提升。

4.4.2 报告期内基金的证券投资
截至本报告期末，本基金份额净值1.348元，本基金报告期净值上涨32.16%，同期本基金的业绩比较基准上涨21.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
四季末市场偏好回升驱动股价反弹，但金融板块的股票受到抑制，市场估值难以超越6月底高点。站在2016年底，成长股继续上涨的动力减弱。

展望2016年，在经济“供给侧结构性改革”的引导下，大概率继续保持“L”型趋势；汇率改革带来的流动性波动对市场构成影响；信用利差风险在2016年也面临考验；证券市场将迎来注册制改革后面临大幅度扩容；市场高估面临一定的压力。

本基金尽力顺应股市的“赚钱效应”，为投资人继续收获超额收益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预说明
无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.2 基金产品概况

5.3 主要财务指标和基金净值表现

5.4 报告期内基金的利润分配情况

5.5 报告期内基金的组合报告

5.6 报告期末基金资产组合情况

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.8 备查文件目录

5.9 重要提示

基金管理人的董事及董事会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。基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、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。

本报告期的财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31止。

§ 2 基金产品概况

5.10 基金的财务指标

5.11 基金的净值表现

5.12 基金的组合报告

5.13 基金的年度报告

5.14 基金的半年度报告

5.15 基金的季度报告

5.16 基金的月度报告

5.17 基金的公告

5.18 基金的临时公告

5.19 基金的澄清公告

5.20 基金的年度报告

5.21 基金的半年度报告

5.22 基金的季度报告

5.23 基金的月度报告

5.24 基金的公告

5.25 基金的临时公告

5.26 基金的年度报告

5.27 基金的半年度报告

5.28 基金的季度报告

5.29 基金的月度报告

5.30 基金的公告

5.31 基金的临时公告

5.32 基金的年度报告

5.33 基金的半年度报告

5.34 基金的季度报告

5.35 基金的月度报告

5.36 基金的公告

5.37 基金的临时公告

5.38 基金的年度报告

5.39 基金的半年度报告

5.40 基金的季度报告

5.41 基金的月度报告

5.42 基金的公告

5.43 基金的临时公告

5.44 基金的年度报告

5.45 基金的半年度报告

5.46 基金的季度报告

5.47 基金的月度报告

5.48 基金的公告

5.49 基金的临时公告

5.50 基金的年度报告

5.51 基金的半年度报告

5.52 基金的季度报告

5.53 基金的月度报告

5.54 基金的公告

5.55 基金的临时公告

5.56 基金的年度报告

5.57 基金的半年度报告

5.58 基金的季度报告

5.59 基金的月度报告

5.60 基金的公告

5.61 基金的临时公告

5.62 基金的年度报告

5.63 基金的半年度报告

5.64 基金的季度报告

5.65 基金的月度报告

5.66 基金的公告

5.67 基金的临时公告

5.68 基金的年度报告

5.69 基金的半年度报告

5.70 基金的季度报告

5.71 基金的月度报告

5.72 基金的公告

5.73 基金的临时公告

5.74 基金的年度报告

5.75 基金的半年度报告

5.76 基金的季度报告

5.77 基金的月度报告

5.78 基金的公告

5.79 基金的临时公告

5.80 基金的年度报告

5.81 基金的半年度报告

5.82 基金的季度报告

5.83 基金的月度报告

5.84