

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2017年10月25日

§ 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞积极成长混合		
交易代码	499002		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2007年7月3日		
报告期末基金份额总额	946,941,066.00份		
投资目标	通过资产的种类和地区的风险偏好选择，投资于具有持续增长潜力的行业，精选具有稳定盈利能力的公司，特别挑选那些具有长期稳定增长潜力的公司，本基金将主要投资于具有良好发展前景的股票，开发并保持有明显盈利能力的趋势在行业中处于领先地位的公司。		
投资策略	本基金的投资策略分为两个部分：通过主动投资于具有良好发展前景的股票，为投资者创造资金的长期稳定回报；通过被动投资于指数基金，为投资者提供较低的系统性风险。本基金将主要投资于具有良好发展前景的股票，开发并保持有明显盈利能力的趋势在行业中处于领先地位的公司。		
业绩比较基准	沪深300指数×40%+中债国债指数×40%+(2007/6/29-2016/6/30)国开行债券指数×20%		
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。		
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	20,413,031.00
2.本期利润	130,904,651.42
3.期初至报告期利润累计金额(元)	1,147,406,411.36
4.期末基金资产净值	1,369.00

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 本报告期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 12.09% 1.20% 3.69% 0.47% 8.64% 0.79%

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变动的比较

注：图示期间为2007年5月29日至2017年9月30日。

4. 报告期内本基金的各投资比例已达到基金合同第十二部分（三）投资范围中规定的各项比例：本基金股票资产的投资比例占基金资产的80%-95%，在扣除股指期货合约后需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内且剩余期限不超过180天的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

5. 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间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。

6. 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，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及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益输送。首先投资部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。其次集中交易室对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核。交易过程中用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。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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本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单边交易量超过该证券当日成交量的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明细

注：本基金本报告期末未持有过沪港通投资股票的股票。

5.4 报告期内按行业分类的股票投资组合

5.4.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号 代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000001 采掘、农林、渔业 - -

2 000607 万方控股 2,096,762 27.07/11.63%

3 000002 金鸿顺 6,737,700 60,392,415.00 5.69%

4 002110 三钢闽光 2,799,940 49,390,941.40 4.30%

5 000717 新钢股份 6,270,202 43,377,054.46 3.79%

6 000705 新钢股份 6,691,130 41,634,176.70 3.62%

7 300075 银泰资源 1,899,980 34,218,761.00 2.98%

8 000793 广发证券 1,666,100 31,660,320.00 2.76%

9 000793 北新建材 1,712,000 29,444,711.00 2.07%

10 600066 中国铝业 1,167,160 28,321,200.00 2.47%

5.4.2 报告期内按债券品种分类的债券投资组合

序号 代码 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 - -

2 行业票据 - -

3 金融债 - -

4 企业债 - -

5 中期票据 - -

6 公司债 - -

7 可转债(可分离债) - -

8 汇票存单 - -

9 其他 - -

10 合计 50,060,000.00 4.36%

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债券投资明细

序号 代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1000001000 国债 6,000,000.00 6,00,000,000.00 5.67%

2 600067 万方控股 5,042,914 65,154,440.00 5.69%

3 000002 金鸿顺 6,737,700 60,392,415.00 5.69%

4 002110 三钢闽光 2,799,940 49,390,941.40 4.30%

5 000717 新钢股份 6,270,202 43,377,054.46 3.79%

6 000705 新钢股份 6,691,130 41,634,176.70 3.62%

7 300075 银泰资源 1,899,980 34,218,761.00 2.98%

8 000793 广发证券 1,666,100 31,660,320.00 2.76%

9 000793 北新建材 1,712,000 29,444,711.00 2.07%

10 600066 中国铝业 1,167,160 28,321,200.00 2.47%

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十名资产支持证券

注：本基金本报告期末未持有过沪港通投资股票的股票。

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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 备查文件目录

1. 本基金管理人的《基金合同》、《基金招募说明书》、《基金产品资料概要》、《基金托管协议》。

2. 本基金管理人关于本报告期间的公告。

3. 本基金管理人关于本报告期间的临时公告。

4. 本基金管理人关于本报告期间的季度报告。

5. 本基金管理人关于本报告期间的半年度报告。

6. 本基金管理人关于本报告期间的年度报告。

7. 本基金管理人关于本报告期间的基金资产净值公告。

8. 本基金管理人关于本报告期间的份额净值公告。

9. 本基金管理人关于本报告期间的定期报告提示性公告。

10. 本基金管理人关于本报告期间的临时公告。

11. 本基金管理人关于本报告期间的季度报告提示性公告。

12. 本基金管理人关于本报告期间的半年度报告提示性公告。

13. 本基金管理人关于本报告期间的年度报告提示性公告。

14. 本基金管理人关于本报告期间的基金资产净值公告提示性公告。

15. 本基金管理人关于本报告期间的份额净值公告提示性公告。

16. 本基金管理人关于本报告期间的定期报告提示性公告。

17. 本基金管理人关于本报告期间的临时公告提示性公告。

18. 本基金管理人关于本报告期间的季度报告提示性公告。

19. 本基金管理人关于本报告期间的半年度报告提示性公告。

20. 本基金管理人关于本报告期间的年度报告提示性公告。

21. 本基金管理人关于本报告期间的基金资产净值公告提示性公告。

22. 本基金管理人关于本报告期间的份额净值公告提示性公告。

23. 本基金管理人关于本报告期间的定期报告提示性公告。

24. 本基金管理人关于本报告期间的临时公告提示性公告。

25. 本基金管理人关于本报告期间的季度报告提示性公告。

26. 本基金管理人关于本报告期间的半年度报告提示性公告。

27. 本基金管理人关于本报告期间的年度报告提示性公告。

28. 本基金管理人关于本报告期间的基金资产净值公告提示性公告。

29. 本基金管理人关于本报告期间的份额净值公告提示性公告。

30. 本基金管理人关于本报告期间的定期报告提示性公告。

31. 本基金管理人关于本报告期间的临时公告提示性公告。

32. 本基金管理人关于本报告期间的季度报告提示性公告。

33. 本基金管理人关于本报告期间的半年度报告提示性公告。

34. 本基金管理人关于本报告期间的年度报告提示性公告。

35. 本基金管理人关于本报告期间的基金资产净值公告提示性公告。

36. 本基金管理人关于本报告期间的份额净值公告提示性公告。

37. 本基金管理人关于本报告期间的定期报告提示性公告。

38. 本基金管理人关于本报告期间的临时公告提示性公告。