

华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

财茂敦且短期快速波动,我们对于部分行业以及热点暴露都进行了控制,降低了组合的主动风险。

基金采用股票债券均衡配置,精选行业个股,本报告期内表现符合预期。

结合今年中央经济工作会议以及对经济稳中求进的定调,展望2017最后一个月度,我们认为除非受境外市场拖累,股市向下风险应该有限。

尽管17年海外不确定性因素仍然会有,但我们认为在不发生系统风险的前提下,A股市场四季度向下风险应该有限。根本的驱动因素还是大量资金依然缺少更好的投资方向,而股市场仍是一个不错的选择。

45 报告期末,本基金份额净值为1.1732元,本报告期份额净值增长率为4.38%,同期业绩比较基准收益率为3.74%。

46 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注: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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	143,726,607.70	60.87
2	其中:股票	143,726,607.70	60.87
3	固定收益投资	96,054,000.00	39.71
4	其中:债券	96,054,000.00	39.71
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其他资产	-	-
10	合计	239,780,607.70	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

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,374,432.60	1.54
C	制造业	74,788,508.65	20.26
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	3,688,287.19	1.44
K	金融业	7,153,880.00	2.81
F	交通运输业	2,267,340.46	0.89
G	信息技术业	8,464,470.81	3.41
I	房地产业	5,236,769.00	2.26
J	建筑业	12,189,422.00	4.96
M	医药、生物及健康产业	12,428,218.72	4.96
N	其他行业	5,527,789.24	2.29
M	科技研发和信息技术服务	769,332.00	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	1,903,344.00	0.76
O	国防军工、修船和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	文化和旅游工作	639,656.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	2,399,420.06	0.94
S	综合	1,084,422.06	0.46
合计		143,726,607.70	60.87

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未通过港股通投资股票。

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

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

5.4 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

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。

5.6 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。

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货头寸和损益情况。

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货头寸和损益情况。

5.9 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有期权投资。

5.10 报告期末本基金投资的融资融券交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有融资融券。

5.11 投资组合报告附注

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情况,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.12 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

§ 6 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 基金的中国证监会批准募集文件

2. 基金合同《基金合同》

3. 基金的投资托管协议

4. 基金管理人《招募说明书》

5. 基金管理人业务资格批件、营业执照

6. 基金的公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问,可咨询海基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线:400-888-0001(免长途费) 021-3878 4638 公司网址:www.huatai-phcom

华泰柏瑞基金管理有限公司 2017年10月25日

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

5.4 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

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

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。

5.6 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。

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货头寸和损益情况。

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货头寸和损益情况。

5.9 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有期权投资。

5.10 报告期末本基金投资的融资融券交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有融资融券。

5.11 投资组合报告附注

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.12 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 基金的中国证监会批准募集文件

2. 基金合同《基金合同》

3. 基金的投资托管协议

4. 基金管理人《招募说明书》

5. 基金管理人业务资格批件、营业执照

6. 基金的公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问,可咨询海基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线:400-888-0001(免长途费) 021-3878 4638 公司网址:www.huatai-phcom

华泰柏瑞基金管理有限公司 2017年10月25日

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

5.4 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

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

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。

5.6 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。

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货头寸和损益情况。

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货头寸和损益情况。

5.9 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有期权投资。

5.10 报告期末本基金投资的融资融券交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有融资融券。

5.11 投资组合报告附注

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.12 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 基金的中国证监会批准募集文件

2. 基金合同《基金合同》

3. 基金的投资托管协议

4. 基金管理人《招募说明书》

5. 基金管理人业务资格批件、营业执照

6. 基金的公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问,可咨询海基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线:400-888-0001(免长途费) 021-3878 4638 公司网址:www.huatai-phcom

华泰柏瑞基金管理有限公司 2017年10月25日

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

5.4 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

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

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。

5.6 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。

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货头寸和损益情况。

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货头寸和损益情况。

5.9 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有期权投资。

5.10 报告期末本基金投资的融资融券交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有融资融券。

5.11 投资组合报告附注

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.12 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 基金的中国证监会批准募集文件

2. 基金合同《基金合同》

3. 基金的投资托管协议

4. 基金管理人《招募说明书》

5. 基金管理人业务资格批件、营业执照

6. 基金的公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问,可咨询海基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线:400-888-0001(免长途费) 021-3878 4638 公司网址:www.huatai-phcom

华泰柏瑞基金管理有限公司 2017年10月25日

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

5.4 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

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

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。

5.6 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。

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货头寸和损益情况。

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货头寸和损益情况。

5.9 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有期权投资。

5.10 报告期末本基金投资的融资融券交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有融资融券。

5.11 投资组合报告附注

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.12 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 基金的中国证监会批准募集文件

2. 基金合同《基金合同》

3. 基金的投资托管协议

4. 基金管理人《招募说明书》

5. 基金管理人业务资格批件、营业执照

6. 基金的公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问,可咨询海基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线:400-888-0001(免长途费) 021-3878 4638 公司网址:www.huatai-phcom

华泰柏瑞基金管理有限公司 2017年10月25日

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

5.4 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

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

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。

5.6 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。

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货头寸和损益情况。

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货头寸和损益情况。

5.9 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有期权投资。

5.10 报告期末本基金投资的融资融券交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有融资融券。

5.11 投资组合报告附注

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.12 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 基金的中国证监会批准募集文件

2. 基金合同《基金合同》

3. 基金的投资托管协议

4. 基金管理人《招募说明书》

5. 基金管理人业务资格批件、营业执照

6. 基金的公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问,可咨询海基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线:400-888-0001(免长途费) 021-3878 4638 公司网址:www.huatai-phcom

华泰柏瑞基金管理有限公司 2017年10月25日

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。