

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

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、监事及高级管理人员不存在虚假记载、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基金合同的规定，于2017年10月24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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。
基金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。
本基金中的货币资金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、误导性陈述或重大遗漏。

§ 2 基金产品概况

基金简称 华泰柏瑞行业竞争优势混合

基金代码 000249

运作方式 封闭式

上市地 上海证券交易所

基金经理 陈立群

开始担任本基金基金经理的日期 2016年12月27日

报告期末基金资产总额 217,317,269.07元

报告期末基金份额总额 1,103,600份

报告期末基金份额净值 1.1732元

报告期末基金份额净值增长率 4.38%同期业绩比较基准收益率 3.24%

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明
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) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 143,726,697.07 60.87

2 固定收益投资 143,726,697.07 60.87

3 基金投资 - -

4 国际投资 - -

5 买入返售金融资产 - -

6 货币市场工具 - -

7 其他 - -

8 合计 287,453,394.14 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期内按行业分类的境内股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 3,914,413.60 15.4

B 制造业 74,789,096.65 32.05

C 电力、热力、燃气及生产供应业 3,658,287.19 14.4

D 建筑业 7,153,893.00 2.81

E 批发和零售业 2,267,540.46 0.89

F 交通运输、仓储和邮政业 8,664,370.91 3.40

G 住宿和餐饮业 - -

H 信息、计算机和通信业 12,189,672.00 4.79

I 采矿业 12,626,212.72 4.96

J 钢铁 6,827,700.24 2.29

M 科学研究和技术服务业 76,033.00 0.30

N 水利、环境和公共设施管理业 1,903,344.00 0.76

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 629,054.00 0.26

R 文化、体育和娱乐业 2,309,420.05 0.94

S 银行业 1,694,462.00 0.66

T 保险业 143,726,697.07 60.87

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通股票投资组合

5.3 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

序号 投资者名称 持有基金份额比例(%) 报告期末持有份额(份) 报告期末持有份额占基金总份额比例(%)

1 华泰柏瑞基金管理有限公司 100.00 287,453,394.14 100.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.4.1 报告期内按品种类别持有的债券投资组合

序号 债券代码 债券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000002 万科A 177,800 4,667,261.00 1.03

2 002449 国电南瑞 202,732 3,902,591.00 1.53

3 600033 金地集团 326,100 3,843,507.00 1.51

4 601006 大秦铁路 407,600 3,565,626.00 1.40

5 000051 精工钢构 81,900 3,104,010.00 1.22

6 000415 海螺水泥 403,300 3,067,046.00 1.20

7 601318 中国宝安 16,000 3,027,544.00 1.10

8 601390 中国中冶 323,900 2,801,736.00 1.03

9 000498 山东钢铁 318,200 2,625,150.00 1.03

10 000706 中信国安 430,300 2,517,250.00 0.99

5.4.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名债券投资明细

序号 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 万科A 4,667,261.00 1.03

2 国电南瑞 3,902,591.00 1.53

3 金地集团 3,843,507.00 1.51

4 大秦铁路 3,565,626.00 1.40

5 精工钢构 3,104,010.00 1.22

6 海螺水泥 3,067,046.00 1.20

7 中国宝安 3,027,544.00 1.10

8 中国中冶 2,801,736.00 1.03

9 山东钢铁 2,625,150.00 1.03

10 中信国安 2,517,250.00 0.99

5.4.3 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名贵金属投资明细

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 黄金 1,173,200.00 0.51

5.4.4 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名股票期权及权证投资明细

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.4.5 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名股指期货及国债期货投资明细

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.4.6 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名商品期货投资明细

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.4.7 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名其他投资品种投资明细

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.5 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名权证投资明细

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.6 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.7 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名债券投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.8 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名贵金属投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.9 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名商品期货投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.10 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名其他投资品种投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.11 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名权证投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.12 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.13 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名债券投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.14 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名贵金属投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.15 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名商品期货投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.16 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名其他投资品种投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.17 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名权证投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.18 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.19 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名债券投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.00 0.00

5.20 报告期内按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名贵金属投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 无 0.