

华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金 2017年年度报告摘要

2017年12月31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
送出日期:2018年3月26日

§1 重要提示
1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金服务机构在本报告中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2018年3月27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。
本年度报告自2017年1月1日起至2017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

基金名称	华泰柏瑞鼎利混合
基金代码	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	399,842,319.36
基金合同期限	不定期
下属分级基金的基本情况	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 A 类基金份额总额	399,832,128.64
报告期末 C 类基金份额总额	10,190.72

2.2 基金产品说明
投资目标
本基金为混合型基金,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合理平衡,根据各类资产的市场价值和预期收益构成投资组合,对股票、债券、货币市场工具等在不同资产类别上的配置进行动态调整。本基金股票投资以定性分析和定量分析为基础,以基本面分析为主,结合宏观经济趋势及市场分,根据市场估值与成长特性综合判断,重点配置业绩优良、市值较大、流动性好、具有成长性的蓝筹股,在可预期的未来保持仓位稳定,适时调整持仓比例。
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,低于股票型基金与商品基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

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 陈旻 联系电话 021-38601777 电子邮箱 csh00880001@ujsai-pbcom	姓名 陈旻 联系电话 021-5829999-212040 电子邮箱 015292@ib.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
信息披露年度报告正文的官方网站网址
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 号民生大厦 10 楼 1 号

§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	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
本期已实现收益	26,964,187.15	828.38	62,110.15
本期利润	26,812,942.36	828.38	62,110.15
加权平均基金份额本期利润	0.0666	0.0661	0.0003
本期基金份额净值增长率	6.75%	6.75%	0.03%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0057	0.0056	0.0003
期末基金资产净值	402,097,549.93	10,247.64	200,069,598.41
期末基金份额净值	1.0057	1.0056	1.0003

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损益。
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	业绩比较基准增长率②	份额净值增长率-业绩比较基准增长率③	①-③	②-④
过去三个月	0.75%	0.11%	1.96%	0.40%	-1.21%
过去六个月	3.22%	0.12%	4.24%	0.35%	-0.23%
过去一年	6.75%	0.12%	8.60%	0.32%	-0.20%
自基金合同生效起至今	6.79%	0.11%	8.68%	0.32%	-0.21%

华泰柏瑞鼎利混合 C

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准增长率②	份额净值增长率-业绩比较基准增长率③	①-③	②-④
过去三个月	0.84%	0.11%	1.96%	0.40%	-1.12%
过去六个月	3.29%	0.12%	4.24%	0.35%	-0.95%
过去一年	6.75%	0.11%	8.60%	0.32%	-0.23%
自基金合同生效起至今	6.77%	0.11%	8.68%	0.32%	-0.21%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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
华泰柏瑞鼎利混合 A



注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)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 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
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
华泰柏瑞鼎利混合 A



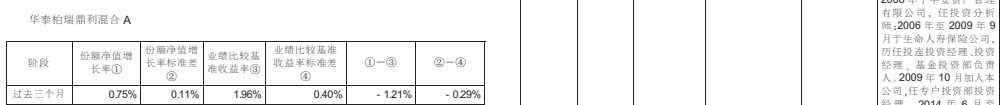
注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)投资范围中规定的各项比例,本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞鼎利混合 C



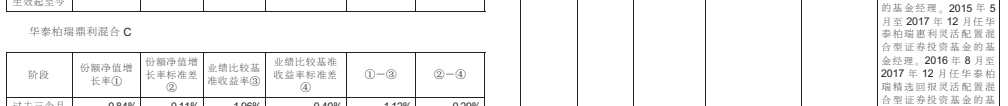
注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)投资范围中规定的各项比例,本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞鼎利混合 C



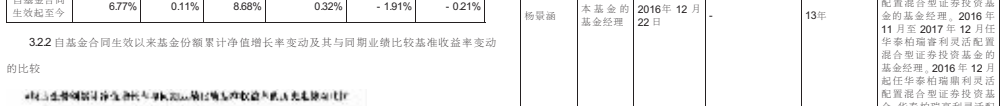
注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)投资范围中规定的各项比例,本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞鼎利混合 C



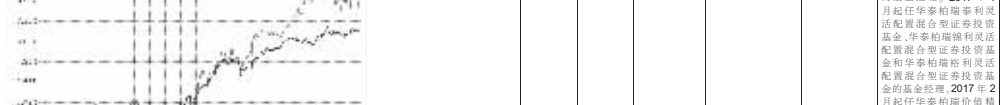
注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)投资范围中规定的各项比例,本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞鼎利混合 C



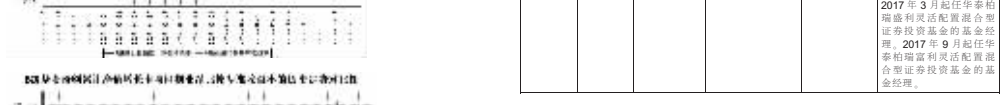
注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)投资范围中规定的各项比例,本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞鼎利混合 C



注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)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 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
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
华泰柏瑞鼎利混合 C



注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)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 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
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
华泰柏瑞鼎利混合 C



注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)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 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
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
华泰柏瑞鼎利混合 C



注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)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 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
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
华泰柏瑞鼎利混合 C



注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)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 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
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
华泰柏瑞鼎利混合 C



注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)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 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
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
华泰柏瑞鼎利混合 C



注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)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 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
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
华泰柏瑞鼎利混合 C



注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)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 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
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
华泰柏瑞鼎利混合 C



注:1、图示日期为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日。
2、按基金合同第二部分(二)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 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
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
华泰柏瑞鼎利混合 C



率为 6.75%,截至本报告期末华泰柏瑞鼎利混合 C 基金份额净值为 1.0056 元,本报告基金份额净值增长率为 6.75%,同期业绩比较基准收益率为 8.60%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望 2018 年,尽管市场风险有一定上升,但需求复苏叠加供给侧改革深入推进,使股市面临较好的投资机会。货币政策仍将保持中性,政府把防控风险放在首要位置,世界经济持续复苏,伴随贸易争端的概率正在加大,我们认为权益投资市场仍然存在不错的结构性投资机会,但依然需要保持对风险的警惕,防范系统性风险的短期冲击。精选个股将成为下半年获取收益的重要手段。固定收益市场将呈现风险偏好,本基金将灵活参与权益市场,新股市场以长期收益为导向,审慎投资,精选个股,降低风险,努力在 2018 年为投资者带来相对较好的净值表现。

4.6 管理人内部有关基金业务的监察稽核工作情况
2017 年度,本基金管理人秉承以人为本的理念,在追求最大利益的同时,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,确保各项法规和制度的落实,保证基金合同得到严格履行。公司监督部门按照规定的权限和程序,通过实时监测、现场检查、重点抽查和人员询问等方式,独立地开展基金业务和公司管理的合规性稽核,发现问题及时通过建议书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检查工作,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、交易过程是否符合合规程序,通过以上措施,保证了投资运作流程决策程序与业务流,保证了基金投资符合相关法律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、后运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动,对稽核中发现的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)促进公司各项内部稽核制度的完善
按照相关法规,证监会等监管机构的相关规定和公司业务发展的需要,公司法务监察部及时要求各部门制定或修改相应制度,促进公司各项内部管理制度进一步完善。

(4)通过各种专业培训提升合规意识
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合规培训,对全体员工开展行为合规培训,对基金投资管理业务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。

通过以上的工作开展,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,本基金管理人承诺一如既往地秉承诚实信用、勤勉尽责的原则继续运用基金资产,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 管理人对于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制度,定期评估估值技术的合理性,每日将估值结果报银行托管人复核并对外披露。参与估值流程的部门和人员包括负责运营的副经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人,基金估值不存在估值程序变更。参与人员的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,已采用的估值技术及相关参数数据来源均来自独立第三方。

4.8 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
根据基金合同的约定,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%,(或“基金合同”)生效不满 3 个月不进行收益分配。本报告期内,本基金符合分红条件,于 2017 年 12 月 8 日进行分红,每 10 份基金份额再次派发现金红利 0.62 元,利润分配合计 24,790,709.72 元,其中现金形式发放总额为 24,790,640.7 元,再投资发放总额为 69.02 元。

4.9 管理人对于会计师事务所出具非标准审计报告所涉事项的说明
无。

4.10 报告期内管理人对于基金持有人人数或基金资产净值预警情形的说明
报告期内,因赎回等原因,本基金存在连续 60 个工作日基金份额持有人人数低于 200 人的情形,但无基金资产净值低于 5000 万元的情形,本基金管理人已于 2017 年 7 月 19 日就“关于华泰柏瑞鼎利混合 C 类基金份额持有人人数 60 个工作日内少于 200 人情况及相关解决方案的报告”上报中国证监会,截止本报告期末,本基金份额持有人人数已满 200 人。

§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约定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害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约定,对基金管理人和本基金的投资运作、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,未发现其在任何报告期内基金份额持有人利益的行为;基金管理人报告期内,严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规,在重要方面的运作均符合基金合同的约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、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
审计意见说明	普华永道中天审字(2018)第 21072 号

6.2 审计报告的主要内容

审计报告标题
审计报告收件人
华泰柏瑞鼎利混合 C 类基金份额持有人

审计意见
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财务报表附注中列示的中国证券监督管理委员会《关于华泰柏瑞鼎利混合 C 类基金份额持有人人数 60 个工作日内少于 200 人情况及相关解决方案的报告》(以下简称“华泰柏瑞鼎利混合 C 类基金份额持有人人数 60 个工作日内少于 200 人报告”)编制,公允反映了华泰柏瑞鼎利混合 C 类基金份额持有人人数 60 个工作日内少于 200 人报告期末的财务状况和所有者权益情况。

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,审计过程中,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。我们认为,我们执行的审计准则是恰当的,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 C 类基金份额持有人,并履行了职业道德方面的责任。

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,审计过程中,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。我们认为,我们执行的审计准则是恰当的,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 C 类基金份额持有人,并履行了职业道德方面的责任。

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,审计过程中,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。我们认为,我们执行的审计准则是恰当的,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 C 类基金份额持有人,并履行了职业道德方面的责任。

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,审计过程中,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。我们认为,我们执行的审计准则是恰当的,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 C 类基金份额持有人,并履行了职业道德方面的责任。

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,审计过程中,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。我们认为,我们执行的审计准则是恰当的,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 C 类基金份额持有人,并履行了职业道德方面的责任。

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,审计过程中,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。我们认为,我们执行的审计准则是恰当的,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 C 类基金份额持有人,并履行了职业道德方面的责任。

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,审计过程中,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。我们认为,我们执行的审计准则是恰当的,为发表审计意见提供了基础。