华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金 2017年年度报告摘要

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
送出日期:2018年3月28日

§1 重要提示

1.1 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的法律责任。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。

基金托管人中国建设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。

本报告期自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

基金简称	华泰柏瑞多策略混合
基金主代码	003175
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月29日
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
报告期末基金份额总额	59,215,945.59份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过深入研究,本基金对股票、债券等金融资产进行灵活配置,在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上,追求基金资产的长期稳定增值,力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上,结合政策面、市场资金面等情况,在经济周期不同阶段,依据市场不同表现,采用多种投资策略和交易手段进行大类资产配置和股票的行业配置,在消除单一策略可能失效风险的同时,保证整体投资业绩的持续性。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
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

2.3 基金管理人和基金托管人

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	田青
	联系电话	021-38601777	010-67595096
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	010-67595096
传真		021-38601799	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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弄证大五道口广场1号楼17层

§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9月29日(基金合同生效日)~2016年12月31日
本期已实现收益	33,518,428.92	11,488,551.67
本期利润	37,460,748.60	5,164,302.83
加权平均基金份额本期利润	0.2632	0.0117
本期基金份额净值增长率	25.22%	0.20%
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	0.2547	0.0025
期末基金资产净值	74,298,516.65	340,131,878.09
期末基金份额净值	1.2547	1.0020

3.2 基金净值表现

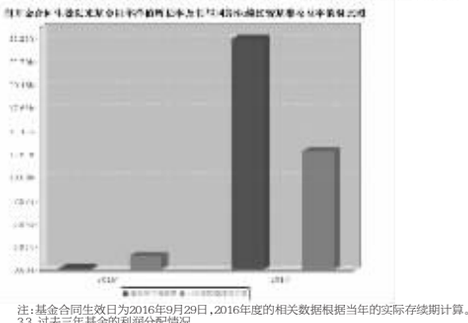
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-1.77%	0.90%	3.10%	0.48%	-4.87%	0.42%
过去六个月	10.92%	0.82%	6.04%	0.42%	4.88%	0.40%
过去一年	25.22%	0.70%	12.98%	0.38%	12.24%	0.32%
自基金合同生效起至今	25.47%	0.67%	14.73%	0.39%	10.74%	0.28%

3.2.2 自基金合同生效以来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

注:1、图示日期为2016年9月29日至2017年12月31日。

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



注:基金合同生效日为2016年9月29日,2016年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金未实施过利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准,于2004年11月18日成立的合资基金管理公司,注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司(原AIGGIC)和苏州新区高新技术产业股份有限公司,出资比例分别为49%、49%和2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞大添宝货币市场基金、华泰柏瑞凝利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选30灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金。截至2017年12月31日,公司基金管理规模为826.34亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方伟	本基金的基金经理	2016年9月29日	-	14年	经济学硕士。2003年9月至2005年1月任上海金信研究所研究员;2005年1月至2007年2月任万家基金管理有限公司高级研究员;2007年2月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2014年8月起任华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金的基金经理。2015年4月至2016年8月任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月起任华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月至2016年8月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年8月起任华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年3月至2017年6月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月起任华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
杨景颢	本基金的基金经理	2016年9月29日	-	13年	中山大学经济学硕士,特许金融分析师(CFA),金融风险管理师(FRM)。2004年至2006年于平安资产管理有限公司,任投资分析师;2006年至2009年9月于生命人寿保险公司,历任投连投资经理、投资经理、基金投资部负责人。2009年10月加入本公司,任专户投资部投资经理。2014年6月至2015年4月任研究部总监助理。2015年4月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月至2017年12月任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年8月至2017年12月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月至2017年12月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月起任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金的基金经理。2017年1月起任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月起任华泰柏瑞价值精选30灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年5月起任华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定,在严格控制风险的基础上,忠实履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内,本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,建立了科学完善的公平交易管理制度,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核,对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块;对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对投资组合的交易进行日常监控和分析评估,同时对投资组合的交易价差在不同时间窗(如日内、3日、5日)进行分析,综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能,确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离,实行集中交易制度,由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务,为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况,不同业务类别的投资经理之间互不干扰,独立做出投资决策。公司机构设置合理,公平交易的相关管理制度健全,投资决策流程完善,各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待,不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现,报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查,交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制,风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内,该制度执行情况良好,无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中,均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量5%的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金2017年全年,采取积极进取的策略,保持权益资产的高仓位,以精选个股为主要获利手段,较为成功的取得了较佳的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.2547元;本报告期基金份额净值增长率为25.22%,业绩比较基准收益率为12.98%。

4.5 管理人对宏观经济、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,使股市迎来较佳的投资机会。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,伴随出现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权益收益的重要手段。本基金将灵活参与权益市场,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更好的净值表现。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017年度,本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时,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,确保各项法规和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序,通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法,独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核,发现问题及时提出改进建议并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监察工作,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进行事先合规性设置,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、交易过程是否符合规定的程序;通过以上措施,保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程,保证了基金投资组合符合相关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,确保各项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、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现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)促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求,公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度,促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4)通过各种合规培训提高员工合规意识

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前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理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。

通过以上工作的开展,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,本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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流程,定期评估估值技术的合理性,每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人,基金经理不参与估值流程。参与人员的相关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。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定,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%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。本报告期内,本基金未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

注:无。

4.10报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注:无。

§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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§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
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第21070号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人:
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞多策略混合基金”)的财务报表,包括2017年12月31日的资产负债表,2017年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 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在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞多策略混合基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况。
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。审计报告的“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。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,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多策略混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	华泰柏瑞多策略混合基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞多策略混合基金的持续经营能力,按篇与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞多策略混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞多策略混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对华泰柏瑞多策略混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞多策略混合基金不能持续经营。 (五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 / 曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
审计报告日期	2018年3月26日

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2017年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资 产:			
银行存款		4,340,287.83	18,901,503.47
结算备付金		440,030.89	5,357,753.78
存出保证金		56,791.86	98,386.10
交易性金融资产		70,123,050.12	317,146,365.55
其中:股票投资		69,895,850.12	317,146,365.55
基金投资		-	-
债券投资		227,200.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	3,311,681.89
应收利息		1,219.15	7,116.48
应收股利		-	-
应收申购款		71,934.23	23,084.09
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		75,033,314.08	344,845,891.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,370,647.25
应付赎回款		149,317.46	508,562.62
应付管理人报酬		93,665.98	460,121.63
应付托管费		15,610.99	76,686.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		235,893.14	1,151,725.67
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		240,309.86	146,269.16
负债合计		734,797.43	4,714,013.27
所有者权益:			
实收基金		59,215,945.59	339,299,749.19
未分配利润		15,082,571.06	832,128.90
所有者权益合计		74,298,516.65	340,131,878.09
负债和所有者权益总计		75,033,314.08	344,845,891.36

注:1,报告截止日2017年12月31日,基金份额总额为59,215,945.59份,份额净值为1.2547元。

7.2 利润表

会计主体:华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入		43,436,193.66	9,043,372.34
1.利息收入		547,028.61	820,974.40
其中:存款利息收入		159,183.82	570,715.68
债券利息收入		73.28	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		387,771.51	250,258.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		38,233,396.84	13,885,240.81
其中:股票投资收益		35,836,193.20	13,664,585.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益		17,109.85	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		2,380,093.79	220,655.00
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		3,942,319.68	-6,324,248.84
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		713,448.53	661,405.97
减:二、费用		5,975,445.06	3,879,069.51
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	2,386,358.22	1,711,078.80
2. 托管费	7.4.8.2.2	397,726.40	285,179.81
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		2,937,361.35	1,731,941.68
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		253,999.09	150,869.22
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		37,460,748.60	5,164,302.83
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		37,460,748.60	5,164,302.83

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	339,299,749.19	832,128.90	340,131,878.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	37,460,748.60	37,460,748.60
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-280,083,803.60	-23,210,306.44	-303,294,110.04
其中:1.基金申购款	50,302,037.43	11,200,129.48	61,502,166.91
2.基金赎回款	-330,385,841.03	-34,410,435.92	-364,796,276.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	59,215,945.59	15,082,571.06	74,298,516.65
项目	上年度可比期间 2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	501,356,007.15	-	501,356,007.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	5,164,302.83	5,164,302.83
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-162,056,257.96	-4,332,173.93	-166,388,431.89
其中:1.基金申购款	4,521,564.81	128,877.72	4,650,442.53
2.基金赎回款	-166,577,822.77	-4,461,051.65	-171,038,874.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	339,299,749.19	832,128.90	340,131,878.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

韩勇 房伟力 赵银云

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)[2016]617号文《关于准予华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币501,000,298.64元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1213号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年9月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为501,356,007.15份基金份额,其中认购资金利息折合347,708.51份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的0-95%,其中基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金和到期日在1年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率X60%+上证国债指数收益率X40%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2018年3月26日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布(证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行))的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自2017年12月26日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财政税法规和实务操