华泰柏瑞盛世中国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。

本基金名称自2015年8月6日起,由“华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金”,基金简称为“华泰柏瑞盛世中国混合”,基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司2015年8月6日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分投票型基金更名并修改基金合同的公告》。

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	华泰柏瑞盛世中国混合
基金主代码	460001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年4月27日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,080,728,896.38份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品简况

投资目标	主要通过股票选择,辅以适度的大类资产配置调整,追求管理资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票类资产为主要投资工具,通过精选个股获取资产的长期增值;以债券类资产作为降低组合风险的策略性投资工具,通过适当的大类资产配置来降低组合的系统性风险。
业绩比较基准	标普中国A股300指数×70%+中信国债指数×30%(2005/4/27-2015/8/5) 标普中国A股300指数×70%+中证全债指数×30%(2015/8/6-至今)
风险收益特征	较高风险,较高收益

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs40088800010@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942

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	基金管理人及基金托管人住所

§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	2015年
本期已实现收益	233,196,533.18	-164,975,591.40	2,077,656,963.65
本期利润	413,377,602.57	-440,700,024.01	1,710,011,393.27
加权平均基金份额本期利润	0.1231	-0.1218	0.4597
本期基金份额净值增长率	30.11%	-20.78%	31.63%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0470	0.0205	0.4229
期末基金资产净值	1,604,590,909.61	1,582,256,745.02	2,299,109,558.16
期末基金份额净值	0.5208	0.4406	0.9626

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.本期已实现收益指期末可供分配的已实现收益。
3.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

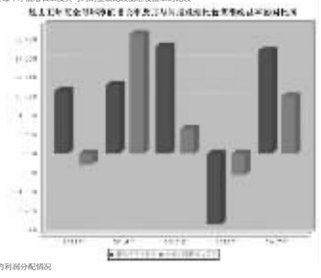
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.57%	1.01%	4.01%	0.57%	3.56%	0.44%
过去六个月	17.70%	0.84%	7.85%	0.49%	9.85%	0.35%
过去一年	30.11%	0.79%	16.95%	0.45%	13.16%	0.34%
过去三年	35.67%	1.90%	17.63%	1.15%	18.04%	0.75%
过去五年	93.14%	1.68%	53.83%	1.06%	39.31%	0.63%
自基金合同生效起至今	486.84%	1.58%	267.19%	1.23%	219.65%	0.35%

注:本基金的业绩基准由标普中国A股300指数和中证全债指数按照70%与30%之比构建,并每日进行再平衡。

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:图示日期为2006年4月27日至2017年12月31日。
按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三条中“(二)投资范围”以及“(八)投资组合”中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为基金净资产的0%-40%。

3.2.3 过去五年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:按合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三条中“(二)投资范围”以及“(八)投资组合”中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为基金净资产的0%-40%。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	0.4700	58,686,117.09	93,720,239.23	152,406,356.32	注:-
2016	3.1400	6,116,972,561.52	410,041,808.06	6,527,014,369.58	注:-
2015	-	-	-	-	注:-
合计	3.6100	6,175,658,678.61	503,762,047.29	6,679,420,725.90	注:-

§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AIG投)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%、40%和11%。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、华泰柏瑞全球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、华泰柏瑞利银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、华泰柏瑞盛世先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞强证券投资基金、华泰柏瑞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、华泰柏瑞信用债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、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞化增保险分型证券投资基金、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、华泰柏瑞创新开放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、华泰柏瑞和税优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新兴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、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿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、华泰柏瑞稳益动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞稳定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、华泰柏瑞央企交易市场基金、华泰柏瑞爱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、华泰柏瑞盈稳多利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、华泰柏瑞行业领先价值灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业领先成长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、华泰柏瑞增利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞和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、华泰柏瑞盛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、华泰柏瑞盛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。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)及基金投资总监简介

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		
张慧	投资部总监 助理,本基金的基金经理	2013年9月16日	-	10年	经济学硕士,10年证券从业经历。2007年7月至2010年6月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010年6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。2013年9月起任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理,2014年5月起任华泰柏瑞创新开放混合型证券投资基金的基金经理,2015年2月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年1月2月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年1月起任投资部总监助理。

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 公平交易制度和执行情况

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、投资黑幕和不公平交易行为,以投资决策和交易执行的公平性为核心内容,对投资决策、交易执行、信息管理、人员管理、监察稽核等方面进行全面、有效地控制和监督,并通过事后的交易量、价差、成交率、投资业绩等方面的统计分析,对可能存在的不公平交易和利益输送行为进行监测和分析评估,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回购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重点监控和检查,交易部负责对异常交易进行日常监控,并定期向投资决策委员会报告异常交易行为的事件性质和控制、风险管理情况及异常交易进行的事后补救措施和效果。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中购等交易中,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%的同日反向交易共1次,系因策略调仓需要,后续交易日还有持续实施。

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

17年市场呈现分化行情,各领域的龙头公司受到市场追捧,低市盈率个股整体上跑赢了高市盈率个股,在盈利和估值的双击下,绩优股趋势上行。全年沪深300指数上涨21.8%,中证500指数略涨0.25%,而创业板指数大跌10.7%。

1季度政治环境较为稳定,但随外围元素不断变化,市场外围元素的影响,这导致人民币贬值的状况改善,而外资金额一定的回流趋势,市场新旧动能交替,行业轮动元素不断变化,市场风格切换频繁。行业轮动的驱动力来源于,一是国内经济数据的变化,二是外围元素的变化,三是国内政策的变化。这几个因素的变化,会导致市场风格的切换。2月之后,由于市场担心经济见顶回落,以及供给的释放加大,行业轮动转向了消费和成长白马方向。以白酒、医药和电子为代表的行业在3月份保持了较大的超额收益。

进入2季度之后,金融“去杠杆”环境恶化,市场外围风险的加大,导致市场风格快速转变,6月之后,由于国内经济数据的变化,市场逐渐企稳,市场表现出先弱后转的走势。投资者普遍选择业绩确定性较高的行业,消费类行业和大市值公司受到资金的青睐。

3季度政治环境较2季度稳定,央行在监管方面和,金融监管强调市场风险,金融监管强调市场风险,同时,2季度美元指数持续走低,加上人民币升值,使得海外资金有一定的回流趋势,周期、消费、成长及金融风格均有较动表现,其中煤炭周期股表现最为抢眼,7-8月份,在“需求不被替于预期”叠加“供给收缩性于预期”的双重刺化下,周期品价格快速上涨,带动上游煤炭、钢铁、有色金属等行业迎来一波年内最大“涨价”行情,而市场风格偏好的提升使得成长股大幅上涨,带动了中证500指数和创业板指数的大幅上涨。

4季度,市场先抵抗积,大部分个股在国庆第二周开始调整,白马股的上涨则延续到了11月中旬。随着年末政应和货币新规的影响,市场整体一定回落,个股和行业分化剧烈,消费和金融板块了正收益,而小盘题材股,周期股跌幅较明。

本基金在报告期内对仓位方面没有做过多调整,行业结构上以消费行业和电子等成长白马为基础配置,在3季度初期参与了钢铁、煤炭、有色等周期性行业的波段行情。在8月之后,逐步兑现这类股票的收益,增配了食品、白酒、成长以及金融类股票的比例,主题投资方面参与较少。在本季度操作以持仓结构的调整与优化为主。基金组合以有成长空间或可能发生价值重估以及和国气度较高的消费品为基础持仓,金融中相对看好银行的盈利修复,没有在11月下旬的调整中有一定回落,总别年末时基金净值基本回到年内高点。

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0.5208元,本报告期基金份额净值增长率为30.11%,业绩比较基准收益率为16.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望展望

展望18年,我们认为预期收益率要较17年降低,投资者面临的环境是经济温和放缓和政策边际中性偏紧,经济被性价比较强,供给侧改革的结果是企业盈利将继续一个上升的基种中枢波动,但需求回落的趋势较为确定,金融去杠杆会松懈,但不发生较真风险的原则是政策的底线,实体经济的盈利改善不可能将的,长期利率高位震荡,10年的国债收益率在3.5%-4%之间,预期收益的结构性机会,市场机会。

1月份市场表现整复了相对估值最低的银行、地产、券商,接着行情继续板块变动的消费、周期板块,随着美国方工数据的公作,最终演变为对全球通胀上行的极度担心。叠加金融去杠杆,市场全面下跌。

我们认为,在估值逻辑表现得更为重要了,18年的宏观逻辑会呈现逐级回落的态势,这对于全国A股的盈利增速水平会产生不利的影响,但不至于回到12-13年的通缩水平。一方面,但供给改革改善的动态调整,使得传统行业盈利的韧性强于过去,另一方面,无公心的行业的供给侧改革的中期逻辑会持续,这对于所有行业整体的盈利水平,因此,结构性的部分龙头和个股会凸显优势。

另外,我们需要关注全球宏观环境在18年的变化,这将影响今年年轮行情的高度。我们看到不仅美联储加息预期在逐步抬升,欧洲、日本也均有退出宽松计划的意图。对国内而言,信贷呈现出开始平量稳的态势,并且短期内很难出现预期的信号。这些政治性因素的现象,导致估值的扩张空间有限,因此对于期间波动带来的投资大幅度化,需要注意投资的节奏,这个会给投资带来较大的机会。

目下而上来看,业绩导向的风格将会延续,对估值的容忍度将会降低,精选细分赛气行业,挖掘个股是我们投资思路。我们认为大消费+大金融是18年较好的基础性配置,业绩成长股和大成长属性且具备估值收缩能力的估值值周期反具有弹性。不同于17年的趋势延续,我们认为反转周期在18年可能较好,操作方面,目前本基金持仓结构相对均衡,以业绩成长+消费升级为主,金融机周期为辅,我们预期长期加大金融行业配比,择机减持周期股。随着财报披露逐步明朗,我们将对组合的行业和公司构成做进一步优化,通过精选行业和个股获取超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金投资管理制度工作规则

2017年度,公司本基金管理人在方基金的制度方面,对外将合规运作、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,通过定期进行检查、现场检查、重点抽查和入员调查等方法,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,确保基金投资决策、交易、信息披露、估值、清算等业务的合规性。

主要措施有:严格执行管理人内部制度,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,并由风控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或,要求相关部门限期整改,并对改进情况安排回访跟踪检查,确保各项业务开展合法合规。

(3)配合公司各项内部管理制度的检查

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的合规意识

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,对全体入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。

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,基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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。

4.8 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,基金收益分配每年至多4次,全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的90%,基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本期末,基金可供分配利润为144,780,415.03元。本报告期内,本基金符合分红条件,于2017年1月24日、2017年11月13分别进行了每10份基金份额派发现金红利0.47元,利润分配合计152,406,356.32元。

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

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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《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有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全履职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《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规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内),投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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21073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	华泰柏瑞盛世中国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盛世中国混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞盛世中国基金”)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公布(以下简称“中国证监会”)、中国财政部及中国证监会联协会以下简称“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盛世中国基金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。 按照中国证注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞盛世中国基金,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	华泰柏瑞盛世中国基金的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盛世中国基金的持续经营能力,披露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盛世中国基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人的治理层负责监督华泰柏瑞盛世中国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盛世中国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。如果我们确认这种重大不确定性存在,我们需要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盛世中国基金不能持续经营。 (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,包括内部控制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:华泰柏瑞盛世中国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		109,028,222.48	177,037,637.84
结算备付金		4,018,583.21	7,788,541.10
存出保证金		456,323.60	887,432.95
交易性金融资产		1,496,035,721.26	1,413,409,461.03
其中:股票投资		1,436,313,521.26	1,413,409,461.03
基金投资		-	-
债券投资		59,722,200.00	-
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		5,420,670.86	42,400,162.29
应收利息		1,030,836.58	53,762.05
应收股利		-	-
应收申购款		259,557.24	50,910.83
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,616,249,915.23	1,641,627,908.09
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		4,010,645.49	-
应付赎回款		1,650,891.80	1,398,855.23
应付管理人报酬		2,009,117.27	2,124,734.64
应付托管费		334,852.88	354,122.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,186,265.21	3,728,290.90
应交税费		214,950.00	214,950.00
应付利息		-	-
应付利润		-	50,277,454.02
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,252,282.97	1,272,746.80
负债合计		11,659,005.62	59,371,163.07
所有者权益:			
实收基金		1,289,191,382.98	1,502,824,140.62
未分配利润		315,399,526.63	79,432,604.40
所有者权益合计		1,604,590,909.61	1,582,256,745.02
负债和所有者权益总计		1,616,249,915.23	1,641,627,908.09

注:报告截止日2017年12月31日,基金份额净值0.5208元,基金份额总额3,080,728,896.38份。

7.2 利润表
会计主体:华泰柏瑞盛世中国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1月1日至2016年12月31日
一.收入		460,633,630.16	-384,578,901.59
1.利息收入		2,376,144.44	4,453,442.13
其中:存款利息收入		1,319,928.71	4,213,460.48
债券利息收入		1,005,465.46	144,934.43
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		50,750.27	95,047.22
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		277,772,746.86	-123,920,466.67
其中:股票投资收益		261,375,485.29	-136,208,554.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益		129,152.92	5,608,530.00
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		16,268,108.65	6,679,557.45
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		180,181,069.39	-275,724,432.61
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		303,669.47	10,612,555.56
减:二.费用		47,256,027.59	56,121,122.42
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	23,564,463.72	27,703,834.56
2. 托管费	7.4.8.2.2	3,927,410.61	4,617,305.87
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		19,308,732.47	23,323,794.26
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		455,420.79	476,187.73
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)		413,377,602.57	-440,700,024.01
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)		413,377,602.57	-440,700,024.01

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:华泰柏瑞盛世中国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)	1,502,824,140.62	79,432,604.40	1,582,256,745.02
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	413,377,602.57	413,377,602.57
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)	-213,632,757.64	-25,004,324.02	-238,637,081.66
其中:1.基金申购款	152,956,812.85	20,110,281.13	173,067,093.98
2.基金赎回款	-366,589,570.49	-45,114,605.15	-411,704,175.64
四.本期向基金分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)	-	-152,406,356.32	-152,406,356.32
五.期末所有者权益(基金净值)	1,289,191,382.98	315,399,526.63	1,604,590,909.61
	上年度可比期间 2016年1月1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)	999,308,449.31	1,299,801,108.85	2,299,109,558.16
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-440,700,024.01	-440,700,024.01
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)	503,515,691.31	5,747,345,889.14	6,250,861,580.45
其中:1.基金申购款	8,539,202,351.72	6,266,294,053.16	14,805,496,404.88
2.基金赎回款	-8,035,686,660.41	-518,948,164.02	-8,554,634,824.43
四.本期向基金分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)	-	-6,527,014,369.58	-6,527,014,369.58
五.期末所有者权益(基金净值)	1,502,824,140.62	79,432,604.40	1,582,256,745.02

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:
赵慧元 刘传万 赵慧元
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
华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金(原名为光华新泰盛世中国混合型证券投资基