华泰柏瑞盛利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、误导性陈述或遗大遗漏,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、误导性陈述或者遗大遗漏。
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。
本年度报告财务会计报告经审计,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3月31日至12月31日。
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	华泰柏瑞盛利混合	
基金主代码	002069	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月3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	10,084,872.32份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞盛利混合A	华泰柏瑞盛利混合C
下属分级基金的交易代码:	002069	002070
报告期末下属分级基金的份额总额	10,002,418.40份	1,453.83份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,前期性地把握不同时期股票市场、债券市场和银行间市场等潜在的投资机会,为投资人获取长期稳定的投资收益。
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。根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势,判断当前所处的经济周期,进而对未来做出科学预测。在此基础上,结合对商动性及资金流向的分析,综合股市和债市估值及风险分析进行大类资产配置。
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。

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	陈辉	王永民
	联系电话	021-38961777	010-66594896
	电子邮箱	cs400@huatai-pbcom	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38961799	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-pbcom
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

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3月3日(基金合同生效日)-2017年12月31日	
	华泰柏瑞盛利混合A	华泰柏瑞盛利混合C
本期已实现收益	23,747,244.00	258.54
本期利润	24,412,569.16	307.95
加权平均基金份额本期利润	0.1283	0.1537
本期基金份额净值增长率	17.59%	16.62%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	
期末可供分配基金份额利润	0.1367	0.1272
期末基金资产净值	11,893,481.64	1,685.40
期末基金份额净值	1.1759	1.1692

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收益。

3.4 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞盛利混合A

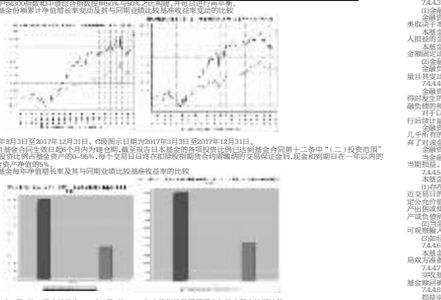
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.00%	0.05%	1.96%	0.40%	3.04%	0.15%
过去六个月	11.42%	0.05%	4.24%	0.36%	7.18%	0.21%
自基金合同生效起至今	17.59%	0.52%	7.12%	0.33%	10.47%	0.19%

华泰柏瑞盛利混合C

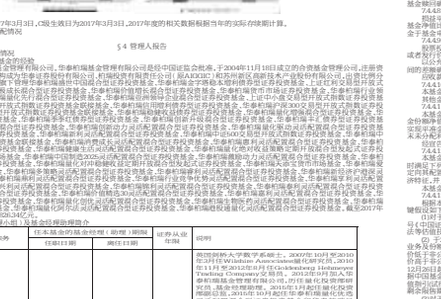
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.22%	0.05%	1.96%	0.40%	2.26%	0.19%
过去六个月	10.54%	0.05%	4.24%	0.36%	6.30%	0.23%
自基金合同生效起至今	16.62%	0.52%	7.12%	0.33%	9.50%	0.19%

注:本基金业绩基准自2017年3月30日起,沪深300指数权重由50%调整为50%,债券指数权重为50%。

3.2.2 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:1.A级类示日期为2017年3月3日至2017年12月31日。C级类示日期为2017年3月30日至2017年12月31日。
2.按照合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告日基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条中“(二)投资范围”中规定的各项比例,股票资产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,现金和债券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



注:本基金A级生效日为2017年3月3日,C级生效日为2017年3月30日,2017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:无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金投资情况
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日成立的首批基金管理公司,注册资本为2亿元人民币。目前控股股东为华安证券股份有限公司,机构投资者持股比例:国投ICBC(即国投高新技术产业投资有限公司,由国投财政部100%控股,持股比例为49.9%,49%股东)。目前公司旗下管理华泰柏瑞价值证券投资基金、华泰柏瑞盛世中国股票基金、上证红利交易型开放式指数基金、华泰柏瑞盛利混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛世精选股票基金、华泰柏瑞盛世中国A股大盘精选股票基金、华泰柏瑞盛世中国A股中盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞盛世中国A股大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、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(QDII)、华泰柏瑞量化优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新丝路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、华泰柏瑞盛世红利股票型证券投资基金、华泰柏瑞盛世精选股票型证券投资基金、华泰柏瑞盛世中国A股大盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞盛世中国A股中盘交易型开放式指数证券投资基金、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、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型