

# 华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金 2019年第1季度报告

2019年3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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2019年4月20日

## § 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责任。

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2019年4月19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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年3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股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》。

## §2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞盛世中国混合
交易代码	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
报告期末基金份额总额	2,985,129,085.39份
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%+中证全债指数×30%
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。
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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年1月1日－2019年3月31日）
1. 本期已实现收益	145,895,385.32
2. 本期利润	274,344,775.37
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0842
4. 期末基金资产净值	1,320,732,559.13
5. 期末基金份额净值	0.4424

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。

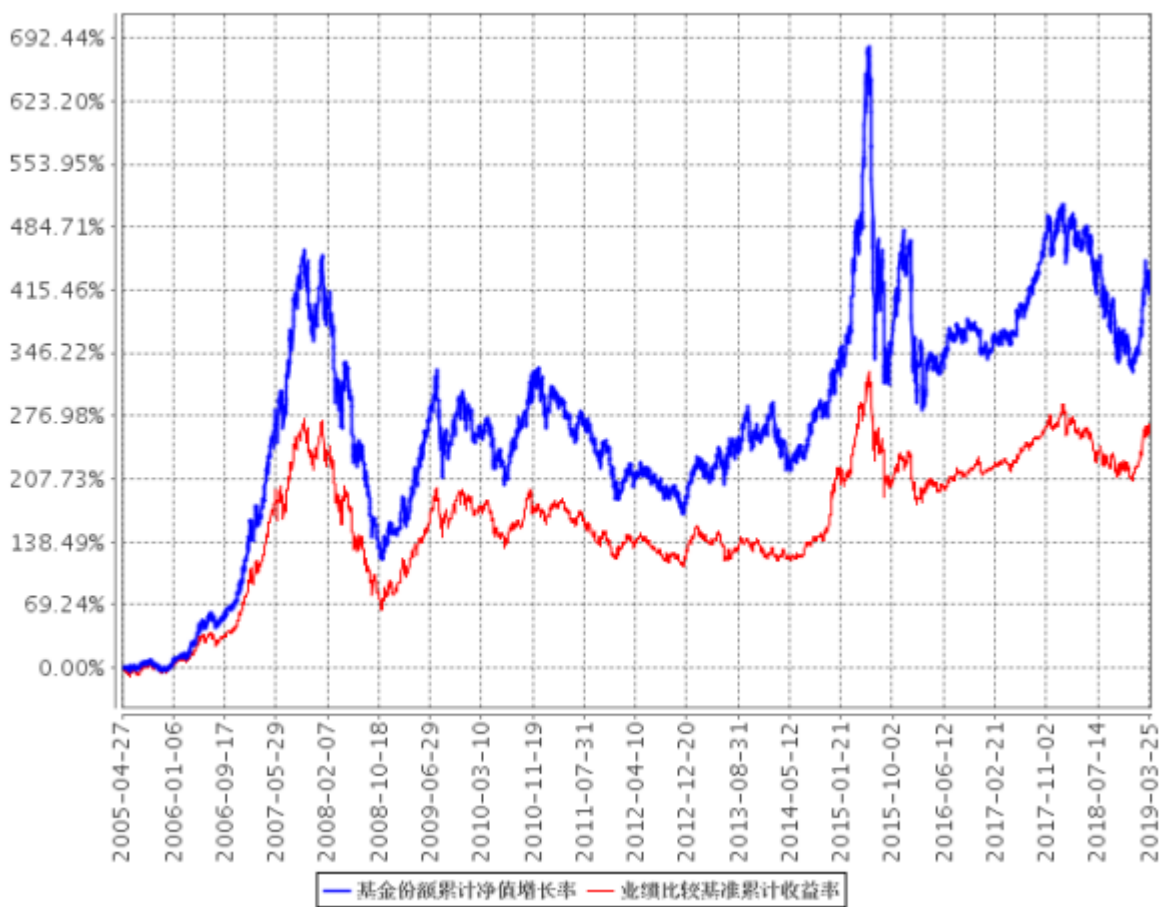
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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	净值增长率 ①	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	23.23%	1.54%	19.27%	1.03%	3.96%	0.51%

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为2005年4月27日至2019年3月31日。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
牛勇	投资部副总监、本基金的基金经理	2018年5月3日	-	11年	经济学硕士，FRM。曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008年5月加入华安基金管理有限公司任高级金融工程师，2010年9月起担

					任基金经理，2016年6月起任华安基金指数与量化投资事业部助理总监。2018年1月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任投资部副总监。2018年5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。2019年3月起任投资研究部投资总监助理。
--	--	--	--	--	---

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次集中交易室对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的，本基金合计发生2次，系因股票配置比例调整，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度央行两次下调存准率，社融增速有所回升。MSCI公司宣布扩大A股纳入新兴市场基准比例至20%，超出市场预期。一季度流动性改善，加上海外资金集中积极配置A股优质标的，市场情绪与估值水平有所恢复。3月PMI从上月49.5恢复至50.5，季节性反弹超过过往幅度，显示经济已呈现复苏特征。在市场反弹过程中，各板块基本轮涨，其中各行业中优势地位的头部公司表现较好。基金配置重点在具备业绩增长前景与行业内优势的品种。

#### 4.5 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0.4424元，累计净值为3.1665元，本报告期内基金份额净值增长率23.23%，本基金的业绩比较基准增长率19.27%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,182,099,027.62	87.77
	其中：股票	1,182,099,027.62	87.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,015,000.00	3.71
	其中：债券	50,015,000.00	3.71
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	101,168,964.89	7.51
8	其他资产	13,498,566.31	1.00
9	合计	1,346,781,558.82	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	55,645,777.20	4.21
B	采矿业	6,843,315.60	0.52
C	制造业	746,624,741.75	56.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,347,448.00	0.48
E	建筑业	4,274,280.00	0.32
F	批发和零售业	35,070.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,860,133.03	3.70
J	金融业	179,740,148.55	13.61
K	房地产业	66,209,259.14	5.01
L	租赁和商务服务业	39,009,290.24	2.95
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	391,888.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	28,117,676.11	2.13
S	综合	-	-
	合计	1,182,099,027.62	89.50

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	882,200	68,017,620.00	5.15
2	300498	温氏股份	1,262,027	51,238,296.20	3.88
3	000858	五粮液	418,334	39,741,730.00	3.01
4	000703	恒逸石化	1,953,100	29,941,023.00	2.27
5	300014	亿纬锂能	1,178,292	28,726,758.96	2.18
6	601211	国泰君安	1,414,296	28,498,064.40	2.16
7	601888	中国国旅	393,953	27,608,226.24	2.09
8	600276	恒瑞医药	394,324	25,796,676.08	1.95

9	300567	精测电子	308,516	24,968,199.88	1.89
10	600519	贵州茅台	28,486	24,326,759.14	1.84

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,015,000.00	3.79
	其中：政策性金融债	50,015,000.00	3.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,015,000.00	3.79

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	160415	16农发15	500,000	50,015,000.00	3.79

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细



注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	565,733.45
2	应收证券清算款	11,396,377.17
3	应收股利	-
4	应收利息	1,481,873.24
5	应收申购款	54,582.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	13,498,566.31

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	3,310,562,627.26
报告期期间基金总申购份额	22,793,767.74
减：报告期期间基金总赎回份额	348,227,309.61
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,985,129,085.39

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

### 9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费）021-3878 4638 公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019年4月20日