

华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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。

基金托管人农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 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 2021 年 7 月 27 日（基金合同生效日）起至 2021 年 9 月 30 日。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 华泰柏瑞远见智选混合 |
| 基金主代码 | 012748 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 7 月 27 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,135,403,864.55 份 |
| 投资目标 | 本基金结合指标与基本面研究，选择质地优良的成长性公司在合理控制组合风险及考虑流动性的前提下，追求超越业绩比较基准投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置：本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。</p> <p>2、股票投资策略：本基金采取定性分析、定量分析相结合的方式，利用选股指标与公司基本面的深入研究，选择质地优良、成长性突出个股构建投资组合，并合理控制组合的风险暴露，在控制风险的同时最大程度获得收益。</p> <p>3、存托凭证投资策略：本基金将根据投资目标和股票策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>4、债券组合投资策略：本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> |

| | | |
|-----------------|--|---------------------|
| | <p>5、资产支持证券投资策略：在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>6、股指期货投资策略：在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。</p> <p>7、融资业务的投资策略：本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。</p> | |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%+中债综合指数收益率*20%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险与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 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华泰柏瑞远见智选混合 A | 华泰柏瑞远见智选混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012748 | 012749 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3, 710, 414, 175. 72 份 | 424, 989, 688. 83 份 |

§ 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（2021 年 7 月 27 日-2021 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|--------------------------------------|-------------------|
| | 华泰柏瑞远见智选混合 A | 华泰柏瑞远见智选混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 35, 255, 492. 14 | 3, 734, 755. 44 |
| 2. 本期利润 | 36, 644, 201. 52 | 3, 891, 641. 01 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0099 | 0. 0092 |
| 4. 期末基金资产净值 | 3, 747, 058, 377. 24 | 428, 881, 329. 84 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1. 0099 | 1. 0092 |

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 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

华泰柏瑞远见智选混合 A

| 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 | 0.99% | 0.73% | 4.61% | 0.94% | -3.62% | -0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.99% | 0.73% | 4.61% | 0.94% | -3.62% | -0.21% |

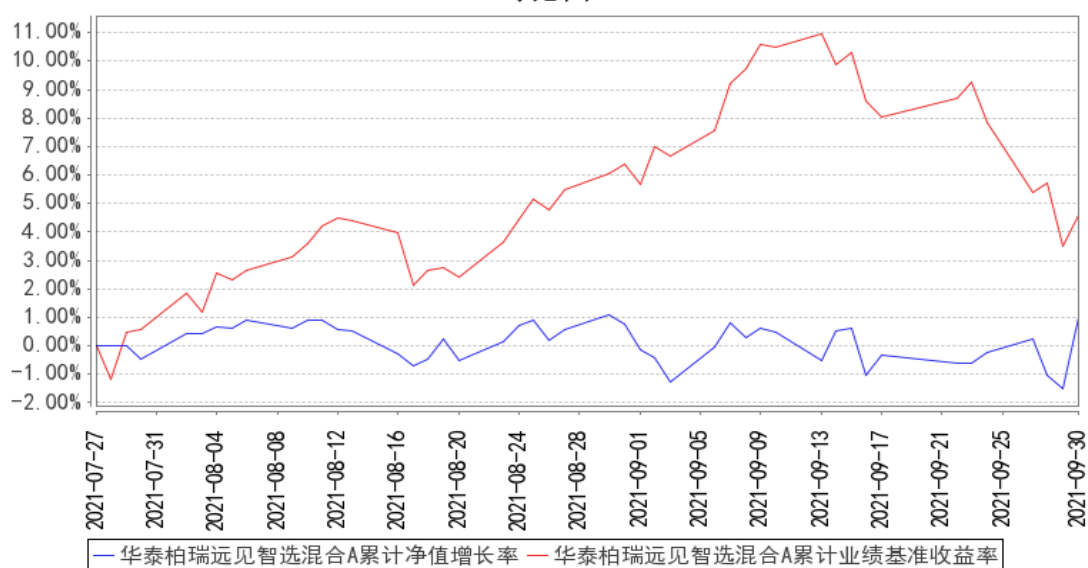
华泰柏瑞远见智选混合 C

| 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 | 0.92% | 0.73% | 4.61% | 0.94% | -3.69% | -0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.92% | 0.73% | 4.61% | 0.94% | -3.69% | -0.21% |

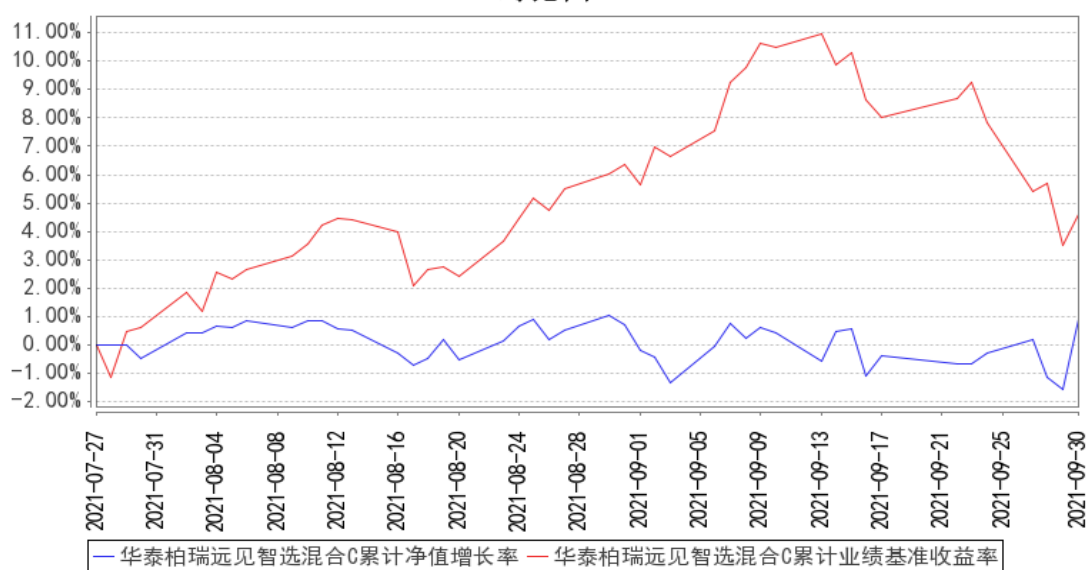
注：过去三个月业绩实际计算期间为 2021 年 7 月 27 日（基金合同生效日）起至 2021 年 9 月 30 日。

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

华泰柏瑞远见智选混合A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



华泰柏瑞远见智选混合C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：注：1、图示日期为 2021 年 7 月 27 日（基金合同生效日）起至 2021 年 9 月 30 日。

2、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。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

§ 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 | 投资三部副总监、 | 2021 年 7 月 27 日 | - | 13 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 |

| | | | | |
|--|--------------|--|--|---|
| | 本基金的 基金经理 | | | 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，现任公司投资三部副总监。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 6 月起任华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起任华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--------------|--|--|---|

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

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，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，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，系产品特殊投资策略，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度宏观经济稳健中增速略有回落，二季度 PMI 仍处于需求扩张阶段，但受国内新冠疫情反复以及火电供给影响，九月份 PMI 在疫情后首次回到 50 以下。工业增加值增速在三季度逐月回落，但仍处于历史平均水平。受供给因素及用电需求增速较快双重影响，国内动力煤及国际天然气价格在三季度涨幅较大，影响了市场对后续通胀的预期，但明年初该供需紧张将大幅缓解。三季度市场的增量资金结构有所变化，一定程度加剧了涨幅较大板块的波动，而前期跌幅较大且质地较好的消费成长品种重新受市场关注。基金处于建仓期，在期间以配置新能源方向以及成长与估值匹配的消费品种为主。

四季度将继续关注国内电力供给对需求的影响，部分省份“双降”压力可能会较三季度末有所缓解。国内货币政策仍将维持整体稳健并适度灵活，年底前出现流动性紧张的概率并不大。海外需求虽然高峰已过，但仍处于复苏之后的合理水平。欧美央行的货币政策不会急转向，仍在与市场反复沟通货币收紧的长期性，意图让市场充分预期以避免市场出现大幅波动。预计四季度国内外新能源车的需求仍然较好，且国内发展可再生能源的推进政策继续落地，长期我们仍然看好新能源板块的整体投资机会，在市场情绪回归理性后，该板块中的优质成长公司的投资价值更加明显。我们继续坚定看好新能源汽车、光伏设备、医疗服务、食品饮料中的优质成长性公司，这类公司的基本面仍维持较好的发展趋势。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类和 C 类份额净值分别为 1.0099 元和 1.0092 元，分别上涨 0.99% 和 0.92%，同期本基金的业绩比较基准上涨 4.61%。

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 | 2,365,059,046.36 | 40.86 |
| | 其中：股票 | 2,365,059,046.36 | 40.86 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 1,439,000,000.00 | 24.86 |
| | 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 | 1,983,487,696.47 | 34.27 |
| 8 | 其他资产 | 531,446.45 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 5,788,078,189.28 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 81,201,740.00 | 1.94 |
| C | 制造业 | 2,046,611,080.85 | 49.01 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 84,568,125.00 | 2.03 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 63,712.78 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,345.12 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 813,151.20 | 0.02 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 28,584.49 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | 151,769,306.92 | 3.63 |
| | 合计 | 2,365,059,046.36 | 56.64 |

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股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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 | 300014 | 亿纬锂能 | 4,008,480 | 396,959,774.40 | 9.51 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|----------------|------|
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 705,700 | 371,007,661.00 | 8.88 |
| 3 | 002812 | 恩捷股份 | 588,523 | 164,857,062.76 | 3.95 |
| 4 | 601877 | 正泰电器 | 2,745,260 | 155,381,716.00 | 3.72 |
| 5 | 000009 | 中国宝安 | 7,912,894 | 151,769,306.92 | 3.63 |
| 6 | 002709 | 天赐材料 | 970,300 | 147,602,036.00 | 3.53 |
| 7 | 002460 | 赣锋锂业 | 642,844 | 104,745,001.36 | 2.51 |
| 8 | 600809 | 山西汾酒 | 321,240 | 101,351,220.00 | 2.43 |
| 9 | 300724 | 捷佳伟创 | 723,227 | 99,371,389.80 | 2.38 |
| 10 | 300529 | 健帆生物 | 1,596,179 | 93,472,242.24 | 2.24 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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：无。

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是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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情形，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是否超出基金合同规定的备选股票库

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情形。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 381,099.72 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 150,346.73 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 531,446.45 |

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：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华泰柏瑞远见智选混合 A | 华泰柏瑞远见智选混合 C |
|-----------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2021年7月27日)基金 | 3,710,414,175.72 | 424,989,688.83 |

| | | |
|------------------------------------|------------------|----------------|
| 份额总额 | | |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | | - |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 3,710,414,175.72 | 424,989,688.83 |

§ 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

注: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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日