

华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告

2023 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：2023 年 04 月 22 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 2023 年 4 月 21 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,345,104,327.19 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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -76,116,939.02 |
| 2. 本期利润 | -138,226,204.38 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0409 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,617,493,748.86 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.4835 |

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。

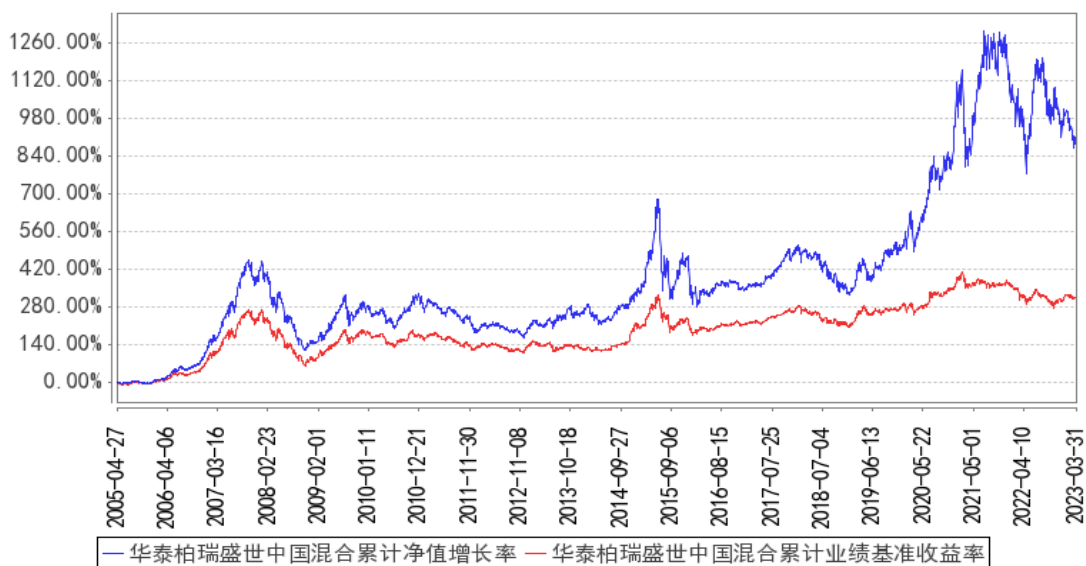
3.2 基金净值表现

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

| 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 | -7.85% | 1.06% | 3.42% | 0.58% | -11.27% | 0.48% |
| 过去六个月 | -8.51% | 1.41% | 4.73% | 0.75% | -13.24% | 0.66% |
| 过去一年 | -9.17% | 1.78% | -1.21% | 0.79% | -7.96% | 0.99% |
| 过去三年 | 60.68% | 1.96% | 14.73% | 0.84% | 45.95% | 1.12% |
| 过去五年 | 71.06% | 1.81% | 15.85% | 0.89% | 55.21% | 0.92% |
| 自基金合同 生效起至今 | 887.94% | 1.64% | 318.54% | 1.14% | 569.40% | 0.50% |

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

华泰柏瑞盛世中国混合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 2023 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 | 主动权益投资副总监、投资三部副总监、本基金的基金经理 | 2018 年 5 月 3 日 | - | 15 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，2022 年 1 月起任公司主动权益投资副总监。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。2022 年 2 月起任华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞低碳经济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

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值（元） | 任职时间 |
|----|----------|---------|------------------|-------------|
| - | 公募基金 | 6 | 5,395,967,320.02 | 2018年5月3日 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 347,518,611.84 | 2021年11月02日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 7 | 5,743,485,931.86 | - |

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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价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%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度国内宏观经济在疫情政策放松后，出现环比显著改善，其中制造业 PMI 显著回升到 51 以上，非制造业 PMI 回升到 54 以上高位，并创疫情以来的新高。1 月与 2 月工业增加值合并同比有大幅改善。国内货币政策期间仍延续适度宽松的基调，短期利率仍处于较低位置。随着经济恢复常态，资本市场转向交投活跃，除外资布局与经济相关性高与消费复苏板块外，包括人工智能、信创、电子等板块受到资金的持续关注。而之前超额收益显著的新能源、军工等成长板块表现相对较弱。基金在期间增持了信创、人工智能应用与算力、传媒与游戏中的估值相对合理标的，并保持了对业绩确定性强的新能源头部公司，包括动力电池头部公司、储能类优势公司的一定配置，以及消费中成长性白酒与医美消费类头部公司。

展望二季度，国内货币政策预计仍以适度宽松为基调，货币政策调节的空间仍然存在。随着商务与消费场景的全面恢复，以及去年二季度的低基数效应，预计国内经济同比增速将比较突出，受益于此，市场中与经济相关度高的权重板块与消费板块，其估值处于均值水平之下，具备突出的投资价值。随着美联储在二季度进入加息末期，前期受全球资产配置压制的成长板块或将迎来一定的估值修复，特别是前期调整幅度较大的生物医药板块。我们积极看好与经济活动高度相关行业的估值修复机会，以及新能源中业绩确定性高的优质头部公司，以及受益全球成长风格占优的生物医药等优质公司。

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 0.4835 元。本报告期内基金份额净值增长率-7.85%，本基金的业绩比较基准增长率 3.42%。

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 | 1,449,880,200.22 | 86.43 |
| | 其中：股票 | 1,449,880,200.22 | 86.43 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 87,754,724.14 | 5.23 |
| | 其中：债券 | 87,754,724.14 | 5.23 |
| | 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 | 99,596,097.14 | 5.94 |
| 8 | 其他资产 | 40,242,136.14 | 2.40 |
| 9 | 合计 | 1,677,473,157.64 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 869,295,590.05 | 53.74 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 7,642,579.33 | 0.47 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| 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 | 450,493,945.09 | 27.85 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 4,918,320.00 | 0.30 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 117,529,765.75 | 7.27 |
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,449,880,200.22 | 89.64 |

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投资股票。

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 | 002368 | 太极股份 | 2,274,356 | 95,932,336.08 | 5.93 |
| 2 | 300274 | 阳光电源 | 793,900 | 83,248,354.00 | 5.15 |
| 3 | 300759 | 康龙化成 | 1,337,863 | 65,515,151.11 | 4.05 |
| 4 | 300896 | 爱美客 | 114,800 | 64,144,500.00 | 3.97 |
| 5 | 000568 | 泸州老窖 | 215,256 | 54,845,076.24 | 3.39 |
| 6 | 300624 | 万兴科技 | 605,100 | 46,102,569.00 | 2.85 |
| 7 | 300308 | 中际旭创 | 778,505 | 45,853,944.50 | 2.83 |
| 8 | 600199 | 金种子酒 | 1,625,300 | 45,102,075.00 | 2.79 |
| 9 | 300031 | 宝通科技 | 2,104,800 | 43,632,504.00 | 2.70 |
| 10 | 688297 | 中无人机 | 761,754 | 43,183,834.26 | 2.67 |

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 | 87,754,724.14 | 5.43 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 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 | 87,754,724.14 | 5.43 |

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 | 019674 | 22 国债 09 | 489,000 | 49,786,282.36 | 3.08 |
| 2 | 019679 | 22 国债 14 | 375,000 | 37,968,441.78 | 2.35 |

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，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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 522,029.24 |
| 2 | 应收证券清算款 | 39,353,145.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 366,961.90 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 40,242,136.14 |

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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 3,411,235,951.40 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 101,007,169.59 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 167,138,793.80 |
| 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 | 3,345,104,327.19 |

§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

2023 年 04 月 22 日