华泰柏瑞新兴灵活配置混合型证券投资基金2019年第1季度报告

2019-04-19

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：2019-04-19

重要提示

重要提示

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%-95%，其中，投入港股通标的股票的比例为基金资产净值的0%-50%。本基金投资于港股通标的股票的比例不超过港股通标的股票市值总量的50%。本基金投资于港股通标的股票，面临市场风险、汇率风险、流动性风险等特有风险。

本报告期内，基金管理人在严格控制风险的前提下，通过自上而下的宏观分析，结合自下而上的个股精选，精选具有长期投资价值的上市公司，力求在长期内为基金资产实现稳健增值。

本报告期内，基金管理人在严格控制风险的前提下，通过自上而下的宏观分析，结合自下而上的个股精选，精选具有长期投资价值的上市公司，力求在长期内为基金资产实现稳健增值。

报告期内，投资组合主要投资策略没有明显改变。

基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞新兴灵活
交易代码	000309
基金主代码	001137
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011-04-20
报告期末基金份额总额	1,121,101,101.31
投资目标	在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增长。在保证基金资产安全性、流动性的基础上，通过有效的主动性管理，力争实现基金资产的长期稳定增长。
投资策略	1、资产配置策略 本基金根据宏观经济、证券市场及其它金融市场的发展趋势，在股票、债券、现金等大类资产间进行合理配置，以期在风险可控的前提下，实现基金资产的长期稳定增长。 2、股票投资策略 本基金采用自下而上、自上而下相结合的方法，在宏观经济分析、证券市场趋势分析、行业分析、公司基本面分析的基础上，综合考虑公司的盈利能力、成长性、估值水平、流动性、公司治理结构等因素，精选具有长期投资价值的上市公司，力求实现基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+中证全债指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为股票型开放式基金，其风险收益特征一般情况下高于债券型基金、混合型基金、货币市场基金。
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
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞新兴灵活A	华泰柏瑞新兴灵活C
下属分级基金的交易代码	001137	001980
报告期末下属分级基金的份额总额	121,101,101.31	1,000,000.00

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-01-01）-2019-03-31		报告期末最近三个月（2019-01-01）-2019-03-31	
	华泰柏瑞新兴灵活A	华泰柏瑞新兴灵活C	华泰柏瑞新兴灵活A	华泰柏瑞新兴灵活C
本期收入/营业总收入	6,108,901.30	0.00	6,108,901.30	0.00
本期利润	1,128,708.39	0.00	1,128,708.39	0.00
加权平均基金利润率本期利润	0.9102%	0.00%	0.9102%	0.00%
期末基金资产净值	121,101,101.31	1,000.00	121,101,101.31	1,000.00
期末基金份额总额	121,101,101.31	1,000.00	121,101,101.31	1,000.00

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的有关费用，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数额。其他收入=子公司本期投资收益+公允价值变动损益+其他业务收入+其他综合收益-公允价值变动损益。

基金管理人对报告期内基金运作遵守有关法律法规情况的说明

本报告期内，华泰柏瑞新兴灵活A基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差异情况

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	0.91%	0.79%	0.72%	0.15%	0.19%	0.64%

本报告期内，华泰柏瑞新兴灵活C基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差异情况

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	0.00%	0.00%	0.72%	0.15%	-0.72%	-0.15%

本报告期内，华泰柏瑞新兴灵活A基金份额累计净值增长率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	0.91%	0.79%	0.72%	0.15%	0.19%	0.64%

本报告期内，华泰柏瑞新兴灵活C基金份额累计净值增长率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	0.00%	0.00%	0.72%	0.15%	-0.72%	-0.15%

注：自2011年4月20日（基金合同生效日）起至报告期末，本基金的累计净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注：1、2011年4月20日为本基金合同生效日，2011年12月31日为2011年12月31日，2012年12月31日为2012年12月31日，2013年12月31日为2013年12月31日，2014年12月31日为2014年12月31日，2015年12月31日为2015年12月31日，2016年12月31日为2016年12月31日，2017年12月31日为2017年12月31日，2018年12月31日为2018年12月31日，2019年3月31日为2019年3月31日。

2、图中的“业绩比较基准”指沪深300指数收益率×80%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+中证全债指数收益率×10%。

管理人在报告期内履行职责情况的说明

本报告期内，华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“本公司”）共计召开了1次董事会会议，1次总经理办公会。

本报告期内，本公司共计召开了1次公司内部风险管理委员会会议，1次公司内部风险管理委员会会议，1次公司内部风险管理委员会会议，