

华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金2019年第1季度报告

2019-03-31

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2019-04-20

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。
基金托管人中国工商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。
本报告如有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，华泰柏瑞基金一定追赔，基金的过往业绩并不预示其未来表现。
本报告自2019年1月1日起至2019年3月31日止。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes fields like 基金简称 (Fund Name), 场内简称 (Intra-market Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Fund Contract Effective Date), 报告期末基金份额总额 (Total Fund Assets at Reporting End), 投资策略 (Investment Strategy), 业绩比较基准 (Benchmark), 风险收益特征 (Risk and Return Characteristics), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian).

主要财务指标

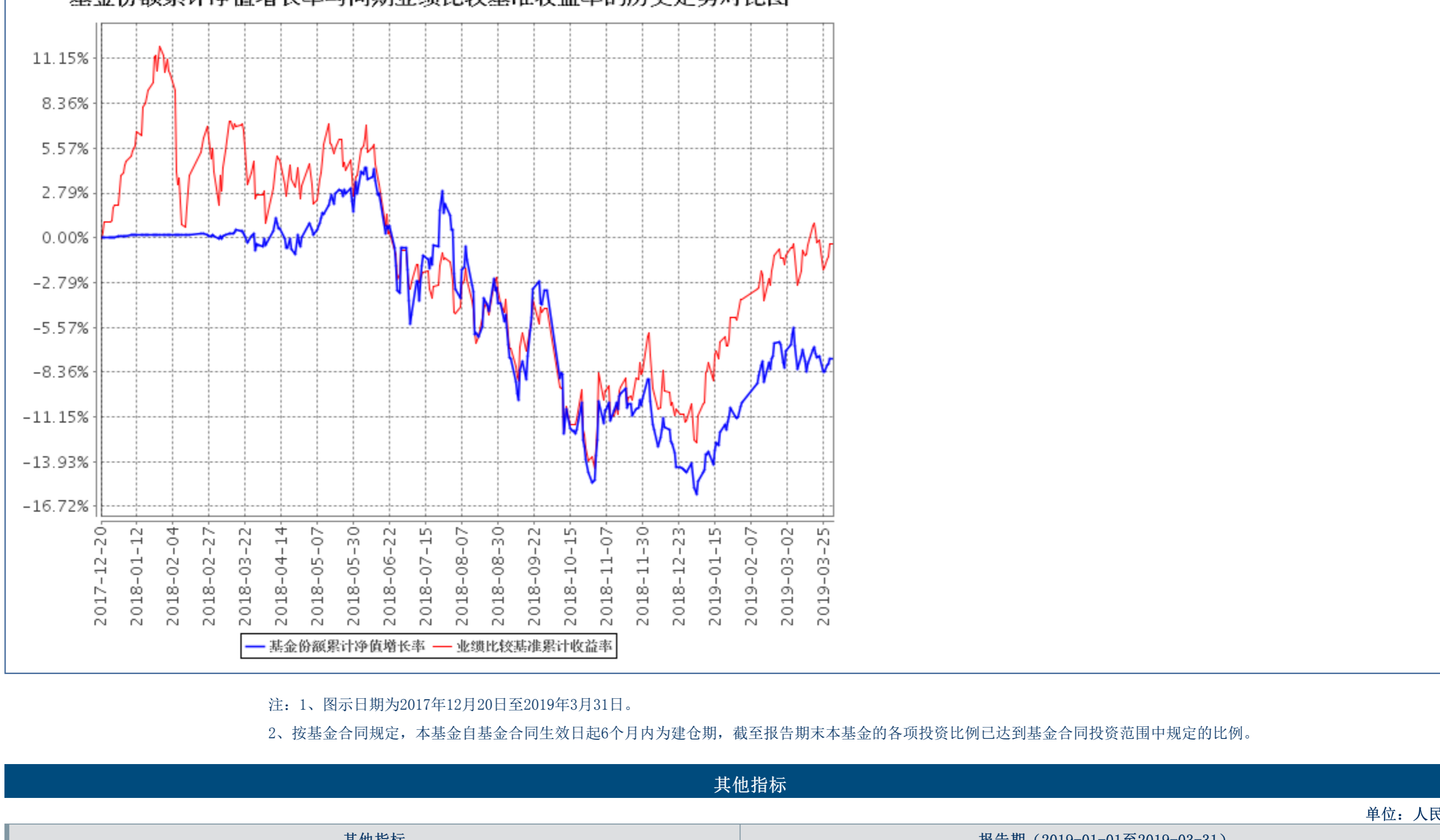
Table with columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators), 报告期 (2019-01-01 至 2019-03-31) (Reporting Period), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan). Includes 本期已实现收益 (Realized Income), 本期利润 (Current Profit), 加权平均基金份额本期利润 (Weighted Average Profit per Share), 期末基金份额净值 (Net Asset Value per Share at Reporting End), 期末基金份额净值 (Net Asset Value per Share at Reporting End).

注：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。

基金净值表现

Table with columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Value Growth Rate), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Standard Deviation), 业绩比较基准收益率③ (Benchmark Return Rate), 业绩比较基准收益率标准差④ (Benchmark Return Rate Standard Deviation), ①-③ (Difference 1-3), ②-④ (Difference 2-4). Includes 过去三个月 (Last 3 Months).

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



注：1、图示日期为2017年12月20日至2019年3月31日。
2、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，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资合同中规定的比例。

其他指标

Table with columns: 其他指标 (Other Indicators), 报告期 (2019-01-01 至 2019-03-31) (Reporting Period), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan). Includes 其他指标 (Other Indicators).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金基金经理期限 (Term as Fund Manager), 证券从业年限 (Years of Securities Industry Experience), 说明 (Remarks). Lists fund managers 田欣璐 and 顾霖 with their respective roles and backgrounds.

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金运作符合相关法律法规、法规以及基金合同约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

公平交易专项说明

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和流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能存在的利益输送。首先投资部和研究部通过规范化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交叉审核，在交易过程中用投资交易系统集中的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内公平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。

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8%。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年第一季度，港股市场整体呈现单边上涨行情，宏观经济和金融市场的下行压力下，年初中国央行宣布降准释放准备金，同时美联储也推出了自三月下旬开始加息的信号，三月FOMC会议结果进一步印证了今年美国货币政策保持谨慎的概率有限，流动性压力得到缓解，推动全球主要股票市场预期未来反弹。港股市场在一月和二月连续上涨，受港股市场的影响，港股也出现了一定程度的题材炒作现象，如5G建设、家电下乡、猪肉股等。进入三月份，港股上市公司年报的陆续披露，市场重新关注基本面因素，炒作风气有所收敛。
报告期内我们并没有跟随市场追热点，仍坚持一贯的量化选股策略，严格控制行业和个股的暴露，保持组合的分散性。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.9245 元，本报告期份额净值增长率为 7.54%，同期业绩比较基准增长率为 11.14%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号 (No.), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in RMB Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets). Lists various asset categories like 权益类投资 (Equity Investment), 固定收益投资 (Fixed Income Investment), 贵金属投资 (Precious Metals Investment), etc.

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币60,617,410.84元，占基金资产净值的比例为71.31%。

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号 (No.), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Lists industry categories such as 农林牧渔 (Agriculture, Forestry, Animal Husbandry, and Fishing), 采矿业 (Mining), etc.

注：注：本基金本报告期末持有境内股票。

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Lists industry categories such as 基础材料 (Basic Materials), 消费电子 (Consumer Electronics), etc.

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

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

Table with columns: 序号 (No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Lists the top 10 stocks by fair value.

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号 (No.), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Lists bond types such as 国家债券 (Government Bonds), 央行票据 (Central Bank Bills), etc.

注：注：本基金本报告期末持有债券。

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

Table with columns: 序号 (No.), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity in Tens of Thousand), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注：注：本基金本报告期末持有资产支持证券。

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

Table with columns: 序号 (No.), 贵金属代码 (Precious Metals Code), 贵金属名称 (Precious Metals Name), 数量 (份) (Quantity in Lots), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注：注：本基金本报告期末未有贵金属投资。

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

Table with columns: 序号 (No.), 权证代码 (Warrant Code), 权证名称 (Warrant Name), 数量 (份) (Quantity in Lots), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注：注：本基金本报告期末未有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position Size (Buy/Sell)), 合约市值 (元) (Contract Market Value in RMB Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in RMB Yuan), 风险指标 (Risk Indicator).

注：注：本基金本报告期末未有国债期货。

本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未有股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未有国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position Size (Buy/Sell)), 合约市值 (元) (Contract Market Value in RMB Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in RMB Yuan), 风险指标 (Risk Indicator).

注：注：本基金本报告期末未有国债期货。

本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未有国债期货。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体，没有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。

申明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

基金投资的十只股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

其他资产构成

Table with columns: 序号 (No.), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in RMB Yuan). Lists assets such as 存出保证金 (Outstanding Margin), 应收证券清算款 (Receivable Settlements), etc.

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：注：本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目 (Item), 数量 (份) (Quantity in Shares). Lists 报告期初基金份额总额 (Total Fund Assets at Reporting Start), 报告期间基金份额总额 (Total Fund Assets during Reporting Period), etc.

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

Table with columns: 项目 (Item), 基金份额 (Fund Shares). Lists 报告期初管理人持有的本基金份额 (Fund Shares Held by Manager at Reporting Start), etc.

注：注：无。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号 (No.), 交易方式 (Transaction Mode), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Quantity in Shares), 交易金额 (元) (Transaction Amount in RMB Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

注：注：无。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with columns: 项目 (Item), 持有份额数量 (Number of Shares Held), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Held), 发起份额数量 (Number of Shares Issued), etc.

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

Table with columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (No.), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval when Holding Share Proportion Reached or Exceeded 20%), 期初份额 (Initial Shares), etc.

注：本基金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。

影响投资决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- 1. 本基金的中国证监会注册募集文件
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

存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场17层

查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费复印相关资料。投资者对本报告如有疑问，可咨询本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（免长话费）021-3878-4638 公司网址：www.httai-ph.com