

华泰柏瑞量化优选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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金管理人华泰柏瑞银行股份有限公司根据本基金合同约定，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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告的财务数据未经审计。

本报告自2019年4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 基金名称 (华泰柏瑞量化优选混合), 基金代码 (000877), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2014-12-17), 截至期末基金份额总额 (458,811,540.94), 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准 (85%*沪深300指数收益率+15%*银行活期存款利率(税后)), 风险收益特征, 基金管理人 (华泰柏瑞基金管理有限公司), 基金托管人 (中国建设银行股份有限公司).

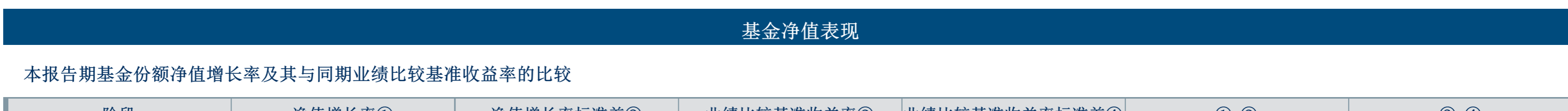
主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 报告期 (2019-01-01至2019-03-31), 单位: 人民币元. Includes 本期已实现收益 (21,005,435.91), 本期利润 (146,429,487.61), 加权平均基金份额本期利润 (0.3233), 期末基金资产净值 (714,173,418.66), 期末基金份额净值 (1.5566).

注：1、所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: 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. Columns: 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.



注：截止日期为2019年12月17日2019年3月31日。

其他指标

Table with columns: 其他指标, 报告期 (2019-01-01至2019-03-31), 单位: 人民币元.

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金基金经理年限 (Tenure), 证券从业年限 (Securities industry experience), 说明 (Remarks). Lists 戚晓 (Qi Xiaohao) and 田汉卿 (Tian Hanqing) as fund managers.

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金的投资运作符合相关法律法规、基金合同及托管协议的约定，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

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流程及控制，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冲突。

异常交易行为的专项说明
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未超过该证券当日成交量5%的同日反向交易共3次，为投资策略需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

报告期内基金的投资策略和运作分析

16年初断崖式下跌市场大幅下跌，自2月以来大盘整体走势为窄幅震荡向上。本报告期初大盘蓝筹股在险资举牌、经济基本面数据转好等多重利好下稳步上升，但是从保监会对保险公司加强监管开始市场出现一定的调整，12月债市出现一定的波动，在流动性紧张的情况下，股市在四季度头两个月的涨幅因此大部分被抹去了。本基金正常运作，量化模型运行平稳，投资组合获取了与预期基本吻合的超额收益，主动风险也相对较低。

报告期内基金的投资表现

截至本报告期末基金份额净值为1.5566元；本报告期基金份额净值增长率为26.37%，业绩比较基准收益率为27.06%。

报告期内基金持有人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), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage). Lists 权益类投资 (659,878,706.02), 固定收益投资 (15,012,000.00), 贵金属投资, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 其他资产.

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), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage). Lists various industry categories like 农林牧渔, 采矿业, 制造业, etc.

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), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage). Lists 基础材料, 消费品, 医药, etc.

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), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage). Lists 中国平安, 中国建筑, 农业银行, etc.

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), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage). Lists 国家债券, 央行票据, 金融债券, etc.

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), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage). Lists 18国债01.

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。

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。

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。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Quantity), 合约市值 (元) (Contract Value), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change), 风险说明 (Risk). Shows no active positions.

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Quantity), 合约市值 (元) (Contract Value), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change), 风险说明 (Risk). Shows no active positions.

注：注：本基金本报告期末未持有国债期货。

本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况
本基金本报告期末未受到任何调查或处罚。

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股票。

其他资产构成
Table with columns: 序号 (No.), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount). Lists 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

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。

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。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目 (Item), 数量 (Value). Lists 报告期初基金份额总额, 报告期申购基金份额, 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基金份额变动情况
Table with columns: 项目 (Item), 基金份额 (Shareholding). Lists 报告期初前10名持有本基金基金份额, etc.

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 Type), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (股) (Quantity), 交易金额 (元) (Amount), 适用费率 (Applicable Rate). Shows no transactions.

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), 持有份额总数 (Total Shares), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage), 发起份额总数 (Initiated Shares), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period).

报告期内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), 期初份额 (Initial Shares), 申购份额 (Purchase Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Current Shares), 份额占比 (Percentage).

注：本基金本报告期内未有一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

影响投资者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

存放地点

上海市浦东新区民生路1199号证大五道口17层1714室

查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费复印。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（免长话费）021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com