目录全部展开 目录全部收拢 《 - 重要提示 **中**基金产品概况 基金基本情况 **白**主要财务指标和基金净值 表现 -主要财务指标 **-**基金净值表现 **上**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 L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 **└**其他指标 **中**管理人报告 -基金经理(或基金经 理小组)简介 一管理人对报告期内本 基金运作遵规守信情 况的说明 **白**-公平交易专项说明 一公平交易制度的执 行情况 一异常交易行为的专 项说明 **中**报告期内基金的投资 策略和业绩表现说明 ─报告期内基金的投

> 资策略和运作分析 —报告期内基金的业

绩表现

说明

中投资组合报告

合情况

资组合

─报告期内管理人对本

─报告期末基金资产组

-报告期末按行业分类 的股票投资组合

-报告期末按行业分类

的港股通投资股票投

─报告期末按公允价值 占基金资产净值比例 本期已实现收益

加权平均基金份额本期利润

阶段

过去三个月

12.94%

6.47%

5.76%

2.88%

盛豪

和上涨,超额收益有所反弹。

无。

序号

2

3

5

7

8

序号

В

C

权益类投资

其中:股票

固定收益投资

其中:债券

贵金属投资

其他资产

合计

金融衍生品投资

买入返售金融资产

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

农、林、牧、渔业

电力、热力、燃气及水生产和供应业

信息传输、软件和信息技术服务业

采矿业

制造业

建筑业

金融业

教育

综合

合计

601006

601818

600015

国家债券

央行票据

金融债券

企业债券

中期票据

同业存单

其他

合计

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。

注: 本基金本报告期末未持有国债期货。

代码

国债期货投资本期公允价值变动(元)

公允价值变动总额合计(元)

兴业银行

其他资产构成

序号

1

报告期期初基金份额总额

报告期期末基金份额总额

报告期期间基金总申购份额

减:报告期期间基金总赎回份额

国债期货投资本期收益(元)

名称

本期国债期货投资政策

其中: 政策性金融债

企业短期融资券

可转债(可交换债)

序号

1

2

3

4

5

6

7

8

9

10

S

房地产业

租赁和商务服务业

卫生和社会工作

文化、体育和娱乐业

科学研究和技术服务业

水利、环境和公共设施管理业

居民服务、修理和其他服务业

批发和零售业

住宿和餐饮业

交通运输、仓储和邮政业

银行存款和结算备付金合计

资产支持证券

其中: 买断式回购的买入返售金融资产

的选股策略进行操作,等待市场基本面的回归。

量化投资部副总监、本基金的基金经

2015-10-13

本期利润

基金持有人数或基金 资产净值预警情形的

本报告中的财务资料未经审计。

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。 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。

本报告期自2019年1月1日起至2019年3月31日止。 |华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金于2018年10月16日根据收费方式分不同,新增C类份额,C类相关指标从2018年10月16日开始计算。

项目 数值 基金简称 华泰柏瑞量化驱动混合 场内简称 基金主代码 001074 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2015-03-24 报告期末基金份额总额 588, 319, 963. 38 投资目标 利用定量投资模型,在有效控制风险的前提下,追求资产的长期增值,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 本基金主要通过定量投资模型,选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合,在有效控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。但 投资策略 在极端市场情况下,为保护投资者的本金安全,股票资产比例可降至0%。 业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为: 95%*沪深300指数收益率+5%*银行活期存款利率(税后) 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 中国银行股份有限公司 下属2级基金的基金简称 华泰柏瑞量化驱动混合A 华泰柏瑞量化驱动混合C 下属2级基金的场内简称 下属2级基金的交易代码 001074 006531

基金基本情况

588, 176, 598, 08 报告期末下属2级基金的份额总额 143, 365. 30 下属2级基金的风险收益特征 主要财务指标 单位:人民币元 华泰柏瑞量化驱动混合A(元) 华泰柏瑞量化驱动混合C(元) 主要财务指标 主基金(元) 2019-01-01 - 2019-03-31 2019-01-01 - 2019-03-31

期末基金资产净值 619, 745, 041. 23 151, 724. 29 期末基金份额净值 1.0537 1.0583 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 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 1-3 阶段 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ 2-4 净值增长率① 净值增长率标准差②

20, 815, 839. 31

133, 929, 205. 48

0.2189

业绩比较基准收益率标准差④

1.48 %

(1)-(3)

-0.57 %

瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月至

2018年10月任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017

年3月至2018年11月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经

理。2017年3月至2018年3月任华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的

基金经理。2017年4月至2018年4月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资

基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置

混合型证券投资基金的基金经理。2017年4月至2019年3月任华泰柏瑞睿利灵

5, 055. 32

32, 258. 48

2-4

0.00 %

0.2109

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A

(1)-(3)2-4阶段 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 净值增长率① 过去三个月 26. 15 % 1.48 % 27.06 % 1.48 % -0.91%0.00 % 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B

业绩比较基准收益率③

27.06

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: 注: 1、A级图示日期为2015年3月24日至2019年3月31日。C级图示日期为2018年10月16日至2019年3月31日。 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A

净值增长率标准差②

1.48 %

净值增长率①

26.49 %

A级基金份额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

32.36% 25.89% 19.42%

0.00% -6.47% -12.94% -19.42% -25.89% -32.36% 2019-01-09 2016-10-28 2015-08-17 2015-10-29 2016-01-10 2016-03-23 2016-08-16 2017-10-28 2018-01-09 2018-08-16 2016-06-04 2017-01-09 2018-03-23 2017 - A级基金份额累计净值增长率 —— A级业绩比较基准累计收益率 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B B级基金份额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 23.02% 20.15% 17.27% 14.39% 11.51% 8.63%

0.00% -2.88% -5.76% 2018-12-03-2018-12-27--01-20-2019-02-05-11-01 -11-09 11-25 -01-04 2018-10-24 2019-01-12 2019-03-01 2018-11-17 2018-12-11 2018-12-19 2019-03-09 2018-2019-2019-2019--- B級基金份额累计净值增长率 --- B級业绩比较基准累计收益率 其他指标 单位:人民币元 其他指标 报告期(2019-01-01至2019-03-31) 其他指标 报告期(2019-03-31) 基金经理(或基金经理小组)简介 任本基金的基金经理期限 姓名 职务 说明 证券从业年限 任职日期 离任日期 英国剑桥大学数学系硕士。2007年10月至2010年3月任Wilshire Associates 量化研究员, 2010年11月至2012年8月任Goldenberg Hehmeyer Trading Company交易员。2012年9月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任量化投资 部研究员、基金经理助理。2015年1月起任量化投资部副总监,2015年10月 起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化驱动灵 活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月至2018年11月任华泰柏

11年

活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年6月起任华泰柏瑞精选回报 灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年9月起任华泰柏瑞量化阿 尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年12月起任华泰柏瑞港 股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019年3月起任华泰柏 瑞量化明选混合型证券投资基金的基金经理。 副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司(BGI)担任投资经理, 2012年8月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,2013年8月起任华泰柏瑞量化增 强混合型证券投资基金的基金经理,2013年10月起任公司副总经理,2014年 12月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015 年3月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量 化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月起任华泰柏瑞 量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化绝对收益 田汉卿 副总经理、本基金的基金经理 2015-03-24 17年 策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016年5月起任华泰 柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。 2017年3月至2018年11月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基 金经理。2017年5月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的 基金经理。2017年9月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基 金的基金经理。2017年12月起任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投 资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学,MBA毕业于美国加州大 学伯克利分校哈斯商学院。 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。 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。其次集中交易室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。 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 2019年1月,A股经历了比较温和的上涨,1月下旬,一些上市公司进行了大幅度的商誉减值、拨备减值等疑似"财务洗澡"的操作,为A股历史所未见。春节过后,受5G建设进度超预期、中美贸易战谈判进度超预期等 利好影响,市场情绪极度升温,主要指数开始大幅反弹,交易量也迅速扩大。题材股表现活跃,个别板块和个股出现比较明显的炒作,股价和基本面完全脱钩,例如"业绩爆雷指数"。在这种比较极端的市场情况下,我

们的基于基本面的量化选股策略也受到影响,超额收益出现回撤。3月中旬以后,市场的题材炒作逐步降温,个别过度炒作的板块出现回调,一些自去年以来长期被压制的板块和个股也出现了股价的修复,市场整体温

一季度的市场上涨,很大一部分是对去年市场过度悲观引起的超跌部分的回补,我们认为这部分回弹是合理的。从市场点位来说,目前上证综指估值仍在合理偏低区间,按道理讲不必恐高。但是,一季度出现了对于

一些基本面较差的股票和一些概念股的过度炒作,我们认为市场在一些股票的定价上出现了比较大的非理性成分,这些股票的表现是不可持续的。2019年全年来看,我们并不悲观。在全球政治环境不进一步恶化的情

况下,市场随后如果进入根据基本面进行投资的状态,后续表现应该还是可以期待的。当前有很多基本面较好的股票的估值还是很有吸引力的。我们作为基本面量化的选股策略会坚持自己的选股理念,正常根据模型

报告期内基金的业绩表现

投资组合报告

金额(元)

公允价值(元)

报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,华泰柏瑞量化驱动A份额净值为1.0537元,华泰柏瑞量化驱动C份额净值为1.0583元。本报告期内华泰柏瑞量化驱动A基金份额净值增长率为26.15%,华泰柏瑞量化驱动C基金份额净值增长率为

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内我们坚持了一贯的量化选股策略,保持较高仓位,同时监控各项风险暴露,控制个股风险,模型运行比较平稳。

26.49%。华泰柏瑞量化驱动A同期业绩比较基准增长率为27.06%,华泰柏瑞量化驱动C同期业绩比较基准增长率为27.06%。

项目

行业类别

大秦铁路

光大银行

华夏银行

债券品种

23, 083, 559. 97 8, 825, 483. 60 623, 750, 774. 11 报告期末按行业分类的股票投资组合

11, 562, 776. 99

270, 356, 257. 29

21, 854, 625. 16

15, 023, 718. 06

8, 486, 483. 69

12, 165, 544. 36

10, 017, 680. 94

182, 667, 551. 57

27, 233, 529. 32

12, 902, 211. 00

3, 623, 960. 16

2, 320. 00

576, 829, 730. 54

933, 072. 00

576, 829, 730. 54

576, 829, 730. 54

15, 012, 000. 00

15, 012, 000. 00

占基金总资产的比例(%)

占基金资产净值比例(%)

92.48

92.48

2.41

2.41

3. 70

1.41

100.00

1.87

43.61

3. 53

2.42

1.37

1.96

0.15

1.62

29.47

4.39

2.08

0.58

0.00

93.05

1.78

1.75

1.60

2.42

2.42

2.42

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) A 基础材料 B 消费者非必需品 C 消费者常用品 D能源 金融 医疗保健 G 工业 H 信息技术 I 电信服务 J 公用事业 K 房地产 注:注:本基金本报告期末未通过港股通投资股票。 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 股票代码 股票名称 公允价值(元) 序号 数量(股) 占基金资产净值比例(%) 中国平安 451, 441 34, 806, 101. 10 601318 5. 61 农业银行 3, 947, 400 2.38 601288 14, 723, 802. 00 荣盛发展 2. 26 002146 1, 247, 095 14, 029, 818. 75 000425 徐工机械 2, 994, 980 13, 177, 912. 00 2. 13 五 粮 液 137, 232 2. 10 000858 13, 037, 040. 00 三一重工 1.94 600031 942, 824 12, 049, 290. 72 海螺水泥 1.80 600585 291, 610 11, 133, 669. 80

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

公允价值 (元)

1, 321, 304

2, 643, 403

1, 204, 000

15, 012, 000. 00

15, 012, 000. 00

15, 012, 000. 00

11, 019, 675. 36

10, 837, 952. 30

9, 933, 000. 00

占基金资产净值比例(%)

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 数量(张) 序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 18农发10 150,000 15, 012, 000. 00 180410 2.42 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: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 序号 贵金属代码 贵金属名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 注: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名的前五名权证投资明细 注: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 代码 名称 合约市值(元) 风险说明 持仓量(买/卖) 公允价值变动(元) 公允价值变动总额合计(元) 股指期货投资本期收益(元) 股指期货投资本期公允价值变动(元)

注: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

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:注:本基金本报告期末未持有国债期货。

合约市值(元)

持仓量(买/卖)

公允价值变动(元)

风险指标说明

单位:人民币元

57, 200. 76

8, 597, 846. 02

155, 537. 93

14, 898. 89

8, 825, 483. 60

单位: 份

143, 817. 12

233, 531. 03

233, 982. 85

143, 365. 30

单位:份

华泰柏瑞量化驱动混合C

华泰柏瑞量化驱动混合C

适用费率

发起份额承诺持有期限

金额 (元)

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 民生银行 本基金本报告期末投资的前十名证券中,中国银行保险监督管理委员会于2018年11月9日对民生银行(600016)作出行政处罚决定,对公司贷款业务严重违反审慎经营规则罚款200万元,对相关责任人处以警告并罚 |款。以及对公司内控管理严重违反审慎经营规则;同业投资违规接受担保;同业投资、理财资金违规投资房地产,用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资;本行理财产品之间风险隔离不到位;个人理财资金违规 |投资;票据代理未明示,增信未簿记和计提资本占用;为非保本理财产品提供保本承诺等行为处以罚款3160万元。对该股票投资决策程序的说明:根据我司的基金投资管理相关制度,以相应的研究报告为基础,结合 其未来增长前景, 由基金经理决定具体投资行为。 光大银行

本基金本报告期末投资的前十名证券中,中国银行保险监督管理委员会于2018年11月9日对光大银行(601818)作出行政处罚决定,对公司内控管理严重违反审慎经营规则、以误导方式违规销售理财产品、以修改理财

合同文本或误导方式违规销售理财产品、违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务、同业投资违规接受担保、通过同业投资或贷款虚增存款规模等行为处以没收违法所得100万元,罚款1020万元,合计1120万元。

本基金本报告期末投资的前十名证券中,中国银行保险监督管理委员会于2018年4月19日对兴业银行(601166)作出行政处罚决定,对公司重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、

无授信额度或超授信额度办理同业业务、内控管理严重违反审慎经营规则及多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规、同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保、债券卖出回购业务违规出表、个人理财资

金违规投资、提供日期倒签的材料、部分非现场监管统计数据与事实不符、个别董事未经任职资格核准即履职、变相批量转让个人贷款、向四证不全的房地产项目提供融资等行为处以罚款5870万元。对该股票投资决

注: 注: 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

588, 319, 963. 38

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

华泰柏瑞量化驱动混合A

华泰柏瑞量化驱动混合A

624, 270, 929. 79

2, 808, 949. 04

38, 903, 280. 75

588, 176, 598. 08

发起份额占基金总份额比例

3 应收股利 应收利息 应收申购款 5 6 其他应收款 待摊费用 其他 合计

华泰柏瑞量化驱动混合

华泰柏瑞量化驱动混合

持有份额占基金总份额比例

对该股票投资决策程序的说明:根据我司的基金投资管理相关制度,以相应的研究报告为基础,结合其未来增长前景,由基金经理决定具体投资行为。

策程序的说明:根据我司的基金投资管理相关制度,以相应的研究报告为基础,结合其未来增长前景,由基金经理决定具体投资行为。

名称

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

存出保证金

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

项目

项目

报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)

基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期期初管理人持有的本基金份额

报告期期末管理人持有的本基金份额

项目

基金管理人固有资金

www.huatai-pb.com

报告期期间买入/申购总份额

报告期期间卖出/赎回总份额

应收证券清算款

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。

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) 注: 无。 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 序号 交易方式 交易日期 交易份额(份) 交易金额(元) 合计 注:无。

持有份额总数

基金管理人高级管理人员 -% 基金经理等人员 基金管理人股东 其他 -% 合计 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 报告期内持有基金份额变化情况 报告期末持有基金情况 投资者类别 序号 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 期初份额 申购份额 赎回份额 持有份额 份额占比 机构 20190101-20190104; 20190318-20190331 125, 000, 000. 00 0.00 5, 000, 000. 00 120, 000, 000. 00 20.40 % 个人 产品特有风险 本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回,可能导致巨额赎回,从而引发流动性风险,可能对基金产生如下影响:(1)延期办理赎回申请或暂停赎回的风 ■险。当发生巨额赎回时,投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。(2)基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现,这将对基金资产净值产生不利影

响,同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题,这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。(3)基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小,

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

发起份额总数

影响投资者决策的其他重要信息 备查文件目录

存放地点 查阅方式

■基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形,从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。(4)基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小,不能满足存续的条 **【**件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向,审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响,同时将完善流动性风险管控机制,最大限度的保护基金份额持有人 的合法权益。 无。 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

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

|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: