华泰柏瑞量化驱动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

基金合同生效日期：2010-04-30

§1 重要提示
§2 基金简介
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 审计报告
§7 投资组合报告
§8 基金份额持有人户数及持有人结构情况
§9 开放式基金持有人大会决议
§10 影响投资者决策的其他重要信息
§11 备查文件目录

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事会成员保证所载内容的真实性、准确性和完整性，并对其中的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏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03月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现和利润分配情况的内容，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，也不保证最低投资收益。

基金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及其更新。

本报告财务数据和净值表现截止至2019年03月31日。

本报告中财务数据未经审计。

§2 基金简介

基金基本情况

项目	内容
基金名称	华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合
基金主代码	001074
交易代码	001074
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010-04-30
报告期末基金份额总额	386,324,366.00份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合A	华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	001074	000011
报告期末下属分级基金的份额总额	386,324,366.00份	0.00份

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	2019年1季度（2019-01-02 - 2019-03-31）	
	华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合A	华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合C
本期已实现盈利	-10,315,295.40	-1,970.14
加权平均基金份额本期利润	-0.026,200.40	-22,100.40
本期基金份额净值增长率	-0.026,200.40	-0.026,200.40
期末可供分配利润	-0.026,200.40	-22,100.40
期末可供分配基金份额利润	0.000,000.00	0.000,000.00
期末基金资产净值	386,324,366.00	0.00
期末基金份额净值	1.000,000.00	1.000,000.00

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、本期已实现盈利是指本期利润扣减本期公允价值变动损益后的余额，本期利润为零或为负数的，本期已实现盈利为零。

基金净值表现

本报告期末基金份额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	-0.026,200.40	0.000,000.00	-0.026,200.40	0.000,000.00	0.000,000.00	0.000,000.00