

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日期：2018年03月25日

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构均不存在虚假记载、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。本年度报告正文及以后上列各附件经会计师事务所审计，并由会计师事务所出具了标准无保留意见的审计报告。基金托管人对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、申购赎回价格、基金业绩表现数据、基金费用开支等项目进行了复核。基金管理人、基金托管人及基金销售机构均不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。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预示其未来表现，投资者在阅读本年度报告前应仔细阅读本基金的招募说明书。本报告中财务数据未经审计。

本报告自2018年1月1日起至2018年6月30日止。
华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金于2018年6月10日根据法律法规不同，新增类别的C类基金份额，自2018年6月19日起计算。
本年度报告摘要自半年度报告正文中，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化智慧混合
基金代码	001244
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年03月25日
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
报告期末基金份额总额	1,232,724,789.64份
基金合同期限	不定期
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞量化智慧混合A
下属分级基金的代码	001244
报告期末下属分级基金的份额总额	1,002,790,494.80份

2.2 基金业绩说明
本基金在报告期内，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目标。
本基金业绩比较基准为：1.8%×沪深300指数收益率+0.2%×中证500指数收益率+0.2%×中证800指数收益率+0.2%×中证2000指数收益率。本基金资产配置策略为：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目标。本基金资产配置策略为：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目标。本基金资产配置策略为：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目标。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	魏钢	魏刚
联系电话	010-58861777	010-66106799
电子邮箱	010-58861777@huatai-pb.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-888-0001	95588
网址	010-36017269	010-66106798

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	魏钢	魏刚
联系电话	010-58861777	010-66106799
电子邮箱	010-58861777@huatai-pb.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-888-0001	95588
网址	010-36017269	010-66106798

3.2 基金业绩说明

项目	本期	上期
资产	96,627,244.64	18,130,203.44
负债	43,437,264.67	1,900,338.64
所有者权益	53,189,979.97	16,232,864.80
营业收入	1,069,494.62	612,903.31
营业支出	4,327,885.60	50,440,532.31
净利润	-3,258,390.98	-49,827,628.50
其他综合收益	-	-
资产总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17
负债和所有者权益总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17

3.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	魏钢	魏刚
联系电话	010-58861777	010-66106799
电子邮箱	010-58861777@huatai-pb.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-888-0001	95588
网址	010-36017269	010-66106798

3.4 基金业绩说明

项目	本期	上期
资产	96,627,244.64	18,130,203.44
负债	43,437,264.67	1,900,338.64
所有者权益	53,189,979.97	16,232,864.80
营业收入	1,069,494.62	612,903.31
营业支出	4,327,885.60	50,440,532.31
净利润	-3,258,390.98	-49,827,628.50
其他综合收益	-	-
资产总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17
负债和所有者权益总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17

3.5 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	魏钢	魏刚
联系电话	010-58861777	010-66106799
电子邮箱	010-58861777@huatai-pb.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-888-0001	95588
网址	010-36017269	010-66106798

3.6 基金业绩说明

项目	本期	上期
资产	96,627,244.64	18,130,203.44
负债	43,437,264.67	1,900,338.64
所有者权益	53,189,979.97	16,232,864.80
营业收入	1,069,494.62	612,903.31
营业支出	4,327,885.60	50,440,532.31
净利润	-3,258,390.98	-49,827,628.50
其他综合收益	-	-
资产总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17
负债和所有者权益总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17

3.7 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	魏钢	魏刚
联系电话	010-58861777	010-66106799
电子邮箱	010-58861777@huatai-pb.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-888-0001	95588
网址	010-36017269	010-66106798

3.8 基金业绩说明

项目	本期	上期
资产	96,627,244.64	18,130,203.44
负债	43,437,264.67	1,900,338.64
所有者权益	53,189,979.97	16,232,864.80
营业收入	1,069,494.62	612,903.31
营业支出	4,327,885.60	50,440,532.31
净利润	-3,258,390.98	-49,827,628.50
其他综合收益	-	-
资产总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17
负债和所有者权益总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17

注：1.A报告期内日期为2018年6月30日，C报告期内日期为2018年6月19日至2018年6月30日。
注：2.本基金基金合同生效日为2018年6月30日，按基金合同约定，本基金基金合同生效日起前6个月为封闭期，截至报告期末的基金份额净值在1.0000元至1.0005元范围内，（四）基金投资组合比例限制中规定的各项比例。股票资产的比例占基金资产的0-95%；投资于科创板股票的比例不超过基金资产净值的10%；投资于港股的股票资产占基金资产净值的比例不超过基金资产净值的10%。

基金的（基金合同）的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。基金管理人、基金托管人、基金销售机构均不存在虚假记载、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。本年度报告正文及以后上列各附件经会计师事务所审计，并由会计师事务所出具了标准无保留意见的审计报告。基金托管人对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、申购赎回价格、基金业绩表现数据、基金费用开支等项目进行了复核。基金管理人、基金托管人及基金销售机构均不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。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。

4.1 基金管理人及基金托管人
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

4.2 基金业绩说明
本基金在报告期内，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目标。
本基金业绩比较基准为：1.8%×沪深300指数收益率+0.2%×中证500指数收益率+0.2%×中证800指数收益率+0.2%×中证2000指数收益率。本基金资产配置策略为：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目标。本基金资产配置策略为：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目标。本基金资产配置策略为：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目标。

4.3 基金管理人及基金托管人
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

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	魏钢	魏刚
联系电话	010-58861777	010-66106799
电子邮箱	010-58861777@huatai-pb.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-888-0001	95588
网址	010-36017269	010-66106798

4.4 基金业绩说明

项目	本期	上期
资产	96,627,244.64	18,130,203.44
负债	43,437,264.67	1,900,338.64
所有者权益	53,189,979.97	16,232,864.80
营业收入	1,069,494.62	612,903.31
营业支出	4,327,885.60	50,440,532.31
净利润	-3,258,390.98	-49,827,628.50
其他综合收益	-	-
资产总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17
负债和所有者权益总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17

4.5 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	魏钢	魏刚
联系电话	010-58861777	010-66106799
电子邮箱	010-58861777@huatai-pb.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-888-0001	95588
网址	010-36017269	010-66106798

4.6 基金业绩说明

项目	本期	上期
资产	96,627,244.64	18,130,203.44
负债	43,437,264.67	1,900,338.64
所有者权益	53,189,979.97	16,232,864.80
营业收入	1,069,494.62	612,903.31
营业支出	4,327,885.60	50,440,532.31
净利润	-3,258,390.98	-49,827,628.50
其他综合收益	-	-
资产总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17
负债和所有者权益总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17

4.7 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	魏钢	魏刚
联系电话	010-58861777	010-66106799
电子邮箱	010-58861777@huatai-pb.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-888-0001	95588
网址	010-36017269	010-66106798

4.8 基金业绩说明

项目	本期	上期
资产	96,627,244.64	18,130,203.44
负债	43,437,264.67	1,900,338.64
所有者权益	53,189,979.97	16,232,864.80
营业收入	1,069,494.62	612,903.31
营业支出	4,327,885.60	50,440,532.31
净利润	-3,258,390.98	-49,827,628.50
其他综合收益	-	-
资产总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17
负债和所有者权益总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17

4.9 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	魏钢	魏刚
联系电话	010-58861777	010-66106799
电子邮箱	010-58861777@huatai-pb.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-888-0001	95588
网址	010-36017269	010-66106798

4.10 基金业绩说明

项目	本期	上期
资产	96,627,244.64	18,130,203.44
负债	43,437,264.67	1,900,338.64
所有者权益	53,189,979.97	16,232,864.80
营业收入	1,069,494.62	612,903.31
营业支出	4,327,885.60	50,440,532.31
净利润	-3,258,390.98	-49,827,628.50
其他综合收益	-	-
资产总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17
负债和所有者权益总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17

4.11 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	魏钢	魏刚
联系电话	010-58861777	010-66106799
电子邮箱	010-58861777@huatai-pb.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-888-0001	95588
网址	010-36017269	010-66106798

注：1.A报告期内日期为2018年6月30日，C报告期内日期为2018年6月19日至2018年6月30日。
注：2.本基金基金合同生效日为2018年6月30日，按基金合同约定，本基金基金合同生效日起前6个月为封闭期，截至报告期末的基金份额净值在1.0000元至1.0005元范围内，（四）基金投资组合比例限制中规定的各项比例。股票资产的比例占基金资产的0-95%；投资于科创板股票的比例不超过基金资产净值的10%；投资于港股的股票资产占基金资产净值的比例不超过基金资产净值的10%。

基金的（基金合同）的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。基金管理人、基金托管人、基金销售机构均不存在虚假记载、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。本年度报告正文及以后上列各附件经会计师事务所审计，并由会计师事务所出具了标准无保留意见的审计报告。基金托管人对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、申购赎回价格、基金业绩表现数据、基金费用开支等项目进行了复核。基金管理人、基金托管人及基金销售机构均不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。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。

5.1 基金管理人及基金托管人
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

5.2 基金业绩说明
本基金在报告期内，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目标。
本基金业绩比较基准为：1.8%×沪深300指数收益率+0.2%×中证500指数收益率+0.2%×中证800指数收益率+0.2%×中证2000指数收益率。本基金资产配置策略为：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目标。本基金资产配置策略为：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目标。本基金资产配置策略为：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目标。

5.3 基金管理人及基金托管人
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

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	魏钢	魏刚
联系电话	010-58861777	010-66106799
电子邮箱	010-58861777@huatai-pb.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-888-0001	95588
网址	010-36017269	010-66106798

5.4 基金业绩说明

项目	本期	上期
资产	96,627,244.64	18,130,203.44
负债	43,437,264.67	1,900,338.64
所有者权益	53,189,979.97	16,232,864.80
营业收入	1,069,494.62	612,903.31
营业支出	4,327,885.60	50,440,532.31
净利润	-3,258,390.98	-49,827,628.50
其他综合收益	-	-
资产总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17
负债和所有者权益总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17

5.5 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	魏钢	魏刚
联系电话	010-58861777	010-66106799
电子邮箱	010-58861777@huatai-pb.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-888-0001	95588
网址	010-36017269	010-66106798

5.6 基金业绩说明

项目	本期	上期
资产	96,627,244.64	18,130,203.44
负债	43,437,264.67	1,900,338.64
所有者权益	53,189,979.97	16,232,864.80
营业收入	1,069,494.62	612,903.31
营业支出	4,327,885.60	50,440,532.31
净利润	-3,258,390.98	-49,827,628.50
其他综合收益	-	-
资产总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17
负债和所有者权益总计	1,354,525,404.00	894,703,122.17

5.7 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	魏钢	魏刚
联系电话	010-58861777	010-66106799
电子邮箱	010-58861777@huatai-pb.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线</		