

华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月26日
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...

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业资格, 说明. Lists board members and management.

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析
报告期内,受中美贸易摩擦和国内去杠杆,以及一系列事件的影响,A股市场总体呈现震荡下行,市场风险偏好降低...

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期:2018年7月1日至2018年9月30日
1.本期已实现收益 786,198,300.43
2.本期公允价值变动收益 -113,728,108.24

4.2 管理人对于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、法规以及基金合同的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.5 投资组合报告
4.5.1 报告期末基金资产组合情况
单位:人民币元
1 权益投资 2,609,064,094.31 94.18

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:1.揭示日期为2017年5月28日至2018年9月30日
注:2.按投资组合报告,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均已达到基金合同投资范围内规定的比例。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 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,通过科学严谨的投资决策流程,从事前、事中和事后各环节严格控制不同基金之间可能的利益冲突...

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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
报告送出日期:2018年10月26日
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...

华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期:2018年7月1日至2018年9月30日
1.本期已实现收益 5,640,692.04
2.本期公允价值变动收益 -113,728,108.24

4.2 管理人对于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、法规以及基金合同的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.5 投资组合报告
4.5.1 报告期末基金资产组合情况
单位:人民币元
1 权益投资 174,309,810.63 80.81

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:1.揭示日期为2015年6月29日至2018年9月30日
注:2.按基金合同规定,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均已达到基金合同投资范围内规定的比例。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 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,通过科学严谨的投资决策流程,从事前、事中和事后各环节严格控制不同基金之间可能的利益冲突...

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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
报告送出日期:2018年10月26日
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...

华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期:2018年7月1日至2018年9月30日
1.本期已实现收益 -53,281,407.28
2.本期公允价值变动收益 -8,121,948.38

4.2 管理人对于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、法规以及基金合同的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.5 投资组合报告
4.5.1 报告期末基金资产组合情况
单位:人民币元
1 权益投资 667,749,265.09 90.26

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:1.揭示日期为2015年6月29日至2018年9月30日
注:2.按基金合同规定,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均已达到基金合同投资范围内规定的比例。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 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,通过科学严谨的投资决策流程,从事前、事中和事后各环节严格控制不同基金之间可能的利益冲突...

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内,受中美贸易摩擦和国内去杠杆,以及一系列事件的影响,A股市场总体呈现震荡下行,市场风险偏好降低...

4.6 报告期内基金持有人或或基金资产净值预警说明
截至报告期末,本基金份额净值为0.0630元,本报告期份额净值增长率为-1.20%。

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.1.0.1 本期国债期货投资策略
5.1.0.2 报告期末本基金未投资国债期货
5.1.0.3 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)
1 应付保证金 1,694,360.00

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
注:无
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:无

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)
1 应付保证金 113,728,108.24

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
注:无
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:无

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)
1 应付保证金 25,014,956.45

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
注:无
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:无

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)
1 应付保证金 474,010.01

5.1.1.4 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。

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)
1 应付保证金 1,527,960.00

5.1.1.4 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。

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)
1 应付保证金 1,527,960.00

5.1.1.4 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。