

# 华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金

## 2019年半年度报告摘要

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  
送出日期：2019年8月29日

### § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员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，并对本内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，未经审计。

基金托管人对本基金定期报告的数据复核无异议，但不保证基金一定盈利。

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未来的业绩表现，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摘要。

本公司没有义务将定期报告的文本提供给持有人。

本报告出自2019年1月1日至2019年6月30日。

华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金于2019年10月16日根据有关规定正式成立，新GC类份额、C类份额和A类份额于2019年10月16日开始计算。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

### § 2 基本简介

**2.1 基金的基本情况**

基金名称：华泰柏瑞量化阿尔法

基金代码：000605

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2017年9月26日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告期末基金份额总额：1,979,866,568.27份

基金类别：股票型

基金规模：1,979,866,568.27份

基金总资产：687,377,839.69元

基金总负债：-1,979,866,568.27份

基金份额净值：1.0000

基金简称：华泰柏瑞量化阿尔法

基金主要投资方向：华泰柏瑞量化阿尔法

基金投资目标：在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

投资目标：在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

投资策略：本基金通过量化分析方法，结合对宏观经济、行业政策、市场环境、资金供求等多方面的综合研究，精选具有较好成长性的股票，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

业绩比较基准：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征：股票型基金，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

华泰柏瑞量化阿尔法 A 华泰柏瑞量化阿尔法 C

2.2 基金产品声明

基金的过往业绩并不预示其未来表现，投资人应当充分了解本基金的风险收益特征。

投资目标：在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

投资策略：本基金通过量化分析方法，结合对宏观经济、行业政策、市场环境、资金供求等多方面的综合研究，精选具有较好成长性的股票，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

业绩比较基准：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征：股票型基金，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

华泰柏瑞量化阿尔法 A 华泰柏瑞量化阿尔法 C

2.3 基金管理人和基金托管人

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 中国银行股份有限公司

姓名 陈晓 朱永民

信息披露负责人 联系电话 021-36001777

电子邮箱 czd@0008800016@huatai-ph.com

客户服务电话 4008-088-0001

传真 021-36001799

010-40504942

2.4 信息披露

基金基本信息

基金名称：华泰柏瑞量化阿尔法

基金代码：000605

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2017年9月26日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告期末基金份额总额：1,979,866,568.27份

基金总资产：687,377,839.69元

基金总负债：-1,979,866,568.27份

基金份额净值：1.0000

基金简称：华泰柏瑞量化阿尔法

基金主要投资方向：华泰柏瑞量化阿尔法

基金投资目标：在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

投资目标：在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

投资策略：本基金通过量化分析方法，结合对宏观经济、行业政策、市场环境、资金供求等多方面的综合研究，精选具有较好成长性的股票，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

业绩比较基准：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征：股票型基金，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

华泰柏瑞量化阿尔法 A 华泰柏瑞量化阿尔法 C

2.5 基金管理人和基金托管人

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 中国银行股份有限公司

姓名 陈晓 朱永民

信息披露负责人 联系电话 021-36001777

电子邮箱 czd@0008800016@huatai-ph.com

客户服务电话 4008-088-0001

传真 021-36001799

010-40504942

2.6 信息披露

基金基本信息

基金名称：华泰柏瑞量化阿尔法

基金代码：000605

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2017年9月26日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告期末基金份额总额：1,979,866,568.27份

基金总资产：687,377,839.69元

基金总负债：-1,979,866,568.27份

基金份额净值：1.0000

基金简称：华泰柏瑞量化阿尔法

基金主要投资方向：华泰柏瑞量化阿尔法

基金投资目标：在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

投资目标：在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

投资策略：本基金通过量化分析方法，结合对宏观经济、行业政策、市场环境、资金供求等多方面的综合研究，精选具有较好成长性的股票，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

业绩比较基准：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征：股票型基金，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

华泰柏瑞量化阿尔法 A 华泰柏瑞量化阿尔法 C

2.7 基金管理人和基金托管人

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 中国银行股份有限公司

姓名 陈晓 朱永民

信息披露负责人 联系电话 021-36001777

电子邮箱 czd@0008800016@huatai-ph.com

客户服务电话 4008-088-0001

传真 021-36001799

010-40504942

2.8 信息披露

基金基本信息

基金名称：华泰柏瑞量化阿尔法

基金代码：000605

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2017年9月26日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告期末基金份额总额：1,979,866,568.27份

基金总资产：687,377,839.69元

基金总负债：-1,979,866,568.27份

基金份额净值：1.0000

基金简称：华泰柏瑞量化阿尔法

基金主要投资方向：华泰柏瑞量化阿尔法

基金投资目标：在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

投资目标：在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

投资策略：本基金通过量化分析方法，结合对宏观经济、行业政策、市场环境、资金供求等多方面的综合研究，精选具有较好成长性的股票，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

业绩比较基准：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征：股票型基金，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

华泰柏瑞量化阿尔法 A 华泰柏瑞量化阿尔法 C

2.9 基金管理人和基金托管人

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 中国银行股份有限公司

姓名 陈晓 朱永民

信息披露负责人 联系电话 021-36001777

电子邮箱 czd@0008800016@huatai-ph.com

客户服务电话 4008-088-0001

传真 021-36001799

010-40504942

2.10 信息披露

基金基本信息

基金名称：华泰柏瑞量化阿尔法

基金代码：000605

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2017年9月26日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告期末基金份额总额：1,979,866,568.27份

基金总资产：687,377,839.69元

基金总负债：-1,979,866,568.27份

基金份额净值：1.0000

基金简称：华泰柏瑞量化阿尔法

基金主要投资方向：华泰柏瑞量化阿尔法

基金投资目标：在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

投资目标：在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

投资策略：本基金通过量化分析方法，结合对宏观经济、行业政策、市场环境、资金供求等多方面的综合研究，精选具有较好成长性的股票，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩基准的收益。

业绩比较基准：中证500指数收益率×95