

华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

2015年第二季度报告

2015年6月30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

报告送出日期:2015年7月18日

基金代号:519001

基金名称:华泰柏瑞量化先行股票

交易代码:460009

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年6月22日

报告期末基金份额总额:246,899,90254份

投资目标:以定期做多为基本出发点,结合基本面研究,力求发现价值被低估且具有良好成长性的股票,在风险可控的前提下,追求超越市场的超额收益。

投资策略:本基金的投资策略是通过深入研究和分析,形成为大类资产配置的不同市场周期的预期和判断,从而对定性组合中股票、债券、货币市场工具以及其他金融产品进行配置,以达到资产配置的均衡。对于大类资产配置的判断,基于对宏观经济周期、货币环境、利率水平、行业景气度、公司盈利、估值水平等的分析,形成为大类资产配置的不同市场周期的预期和判断,从而对定性组合中股票、债券、货币市场工具以及其他金融产品进行配置,以达到资产配置的均衡。

业绩比较基准:沪深300指数*90%+上证国债指数*20%

风险收益特征:较高风险,较高收益

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

基金名称:华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年4月1日~2015年6月30日)

67,812,814.16

本期已实现收益

69,828,306.76

3加权平均基金份额本期利润

0.3065

4期末基金份额净值

431,998,045.08

5期末基金份额净值

1.750

注:1.本基金净值增长率不包括持有人认购或交易基金的申购费,计入费用后实际收益率要低于所列数字。
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,本期利润指根据有关法规应计利息收入和其他收益扣减必要的交易费用后的余额。
3.基金净值增长率=基金本期利润/基金期初净值+100%
4.期末基金份额净值=基金期末净资产/基金份额总数
5.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数

3.1 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年4月1日~2015年6月30日)

67,812,814.16

1本期已实现收益

69,828,306.76

3加权平均基金份额本期利润

0.3065

4期末基金份额净值

431,998,045.08

5期末基金份额净值

1.750

注:1.本基金净值增长率不包括持有人认购或交易基金的申购费,计入费用后实际收益率要低于所列数字。
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,本期利润指根据有关法规应计利息收入和其他收益扣减必要的交易费用后的余额。
3.基金净值增长率=基金本期利润/基金期初净值+100%
4.期末基金份额净值=基金期末净资产/基金份额总数
5.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数

3.21 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

单位:(%)

序号

阶段

净值增长(%)

业净值(%)

业净值(%)