

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

[2015]第四季度报告

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送达日期:2016年1月21日
§ 1 重要提示

基金管理人的董事会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，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。

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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	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
交易代码	000107
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月8日
报告期末基金份额总额	121,729,761.40份
投资目标	本基金通过量化绝对收益策略对冲投资组合的市场风险,追求投资组合的长期增值。
投资策略	本基金主要通过量化绝对收益策略对冲投资组合的市场风险,追求投资组合的长期增值。
投资范围	本基金主要通过量化绝对收益策略对冲投资组合的市场风险,追求投资组合的长期增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准,通过采用量化对冲策略消除系统性风险,因而在投资组合和一般的股票型基金,其预期风险较小。
风险收益特征	本基金为债券型基金,通过采用量化对冲策略消除系统性风险,因而在投资组合和一般的股票型基金,其预期风险较小。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)	单位:人民币元
1.本期实现的收入	1,327,030.99	
2.本期利润	1,342,400.99	
3.本期利润分配金额	496.00	
4.期末基金资产净值	122,833,496.00	
5.期末基金份额净值	1.0000	

注:1. 所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。

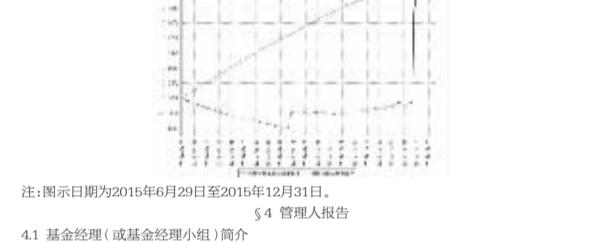
2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

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)
过去三个月	0.74%	0.00%	0.30%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:图示日期为2015年6月29日至2015年12月31日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
田汉卿	副基金经理,本基金的基金经理	2015年6月29日	12	

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定,不存在损害基金持有人利益的行为。

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,基金管理人根据《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》的要求,通过科学完备的制度及流程,在交易过程中严格执行投资交易系统的公平交易模块,确保公平交易的实施。

同时,风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内,未发生公平交易相关的重大事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金不存在异常交易行为。报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%。

§ 5 开放式基金份额变动

5.1 报告期内基金的申购赎回情况

5.1.1 申购情况

5.1.1.1 申购本基金的客户数

5.1.1.2 申购本基金的金额

5.1.1.3 申购本基金的交易费用

5.1.1.4 申购本基金的净值

5.1.1.5 申购本基金的余额

5.1.1.6 申购本基金的手续费

5.1.1.7 申购本基金的手续费率

5.1.1.8 申购本基金的申购金额

5.1.1.9 申购本基金的申购次数

5.1.1.10 申购本基金的申购间隔

5.1.1.11 申购本基金的申购频率

5.1.1.12 申购本基金的申购金额

5.1.1.13 申购本基金的申购次数

5.1.1.14 申购本基金的申购金额

5.1.1.15 申购本基金的申购次数

5.1.1.16 申购本基金的申购金额

5.1.1.17 申购本基金的申购次数

5.1.1.18 申购本基金的申购金额

5.1.1.19 申购本基金的申购次数

5.1.1.20 申购本基金的申购金额

5.1.1.21 申购本基金的申购次数

5.1.1.22 申购本基金的申购金额

5.1.1.23 申购本基金的申购次数

5.1.1.24 申购本基金的申购金额

5.1.1.25 申购本基金的申购次数

5.1.1.26 申购本基金的申购金额

5.1.1.27 申购本基金的申购次数

5.1.1.28 申购本基金的申购金额

5.1.1.29 申购本基金的申购次数

5.1.1.30 申购本基金的申购金额

5.1.1.31 申购本基金的申购次数

5.1.1.32 申购本基金的申购金额

5.1.1.33 申购本基金的申购次数

5.1.1.34 申购本基金的申购金额

5.1.1.35 申购本基金的申购次数

5.1.1.36 申购本基金的申购金额

5.1.1.37 申购本基金的申购次数

5.1.1.38 申购本基金的申购金额

5.1.1.39 申购本基金的申购次数

5.1.1.40 申购本基金的申购金额

5.1.1.41 申购本基金的申购次数

5.1.1.42 申购本基金的申购金额

5.1.1.43 申购本基金的申购次数

5.1.1.44 申购本基金的申购金额

5.1.1.45 申购本基金的申购次数

5.1.1.46 申购本基金的申购金额

5.1.1.47 申购本基金的申购次数

5.1.1.48 申购本基金的申购金额

5.1.1.49 申购本基金的申购次数

5.1.1.50 申购本基金的申购金额

5.1.1.51 申购本基金的申购次数

5.1.1.52 申购本基金的申购金额

5.1.1.53 申购本基金的申购次数

5.1.1.54 申购本基金的申购金额

5.1.1.55 申购本基金的申购次数

5.1.1.56 申购本基金的申购金额

5.1.1.57 申购本基金的申购次数

5.1.1.58 申购本基金的申购金额

5.1.1.59 申购本基金的申购次数

5.1.1.60 申购本基金的申购金额

5.1.1.61 申购本基金的申购次数

5.1.1.62 申购本基金的申购金额

5.1.1.63 申购本基金的申购次数

5.1.1.64 申购本基金的申购金额

5.1.1.65 申购本基金的申购次数

5.1.1.66 申购本基金的申购金额

5.1.1.67 申购本基金的申购次数

5.1.1.68 申购本基金的申购金额

5.1.1.69 申购本基金的申购次数

5.1.1.70 申购本基金的申购金额

5.1.1.71 申购本基金的申购次数

5.1.1.72 申购本基金的申购金额

5.1.1.73 申购本基金的申购次数

5.1.1.74 申购本基金的申购金额

5.1.1.75 申购本基金的申购次数

5.1.1.76 申购本基金的申购金额

5.1.1.77 申购本基金的申购次数

5.1.1.78 申购本基金的申购金额

5.1.1.79 申购本基金的申购次数

5.1.1.80 申购本基金的申购金额

5.1.1.81 申购本基金的申购次数

5.1.1.82 申购本基金的申购金额

5.1.1.83 申购本基金的申购次数

5.1.1.84 申购本基金的申购金额

5.1.1.85 申购本基金的申购次数

5.1.1.86 申购本基金的申购金额

5.1.1.87 申购本基金的申购次数

5.1.1.88 申购本基金的申购金额

5.1.1.89 申购本基金的申购次数

5.1.1.90 申购本基金的申购金额</p