

华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金

[2015] 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:2015年10月27日

§ 1.1 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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，确认本报告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
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。
本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基本产品概况

基金简称	华泰柏瑞量化先行混合
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	281,364,280.24份

投资目标

以定量分析为主,结合基本面研究,力求实现价值增值。

投资策略

本基金将通过量化分析,结合基本面研究,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

值。

投资策略

1)股票投资策略,以价值低估为王,结合行业公司基本面

分析,以期获得全市场投资中的各种投资机会,先行业

后个股,先大盘后小盘,先周期性行业后非周期性行业

的选股思路。2)债券投资策略,以主动性的资产配置,确

保资产的稳定性,通过资产配置,实现资产的保值增值。

3)消极投资策略,通过资产配置,追求资产的长期增值,

通过资产配置,追求资产的长期增值,通过资产配置,确

保资产的稳定性,通过资产配置,实现资产的保值增值。

4)金融衍生品投资

5)货币市场投资

6)买入返售金融资产

7)其他投资

8)合计

9)报告期末按行业分类的股票投资组合

10)报告期末按行业分类的债券投资组合

11)报告期末按行业分类的资产支持证券投资组合

12)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资组合

13)报告期末按行业分类的权证投资组合

14)报告期末按行业分类的股指期货投资组合

15)报告期末按行业分类的国债期货投资组合

16)报告期末按行业分类的股票期权投资组合

17)报告期末按行业分类的其他投资组合

18)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

19)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

20)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

21)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

22)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

23)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

24)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

25)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

26)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

27)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

28)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

29)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

30)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

31)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

32)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

33)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

34)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

35)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

36)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

37)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

38)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

39)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

40)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

41)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

42)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

43)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

44)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

45)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

46)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

47)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

48)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

49)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

50)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

51)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

52)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

53)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

54)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

55)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

56)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

57)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

58)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

59)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

60)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

61)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

62)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

63)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

64)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

65)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

66)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

67)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

68)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

69)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

70)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

71)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

72)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

73)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

74)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

75)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

76)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

77)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

78)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

79)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

80)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

81)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

82)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

83)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

84)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

85)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

86)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

87)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

88)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

89)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

90)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

91)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

92)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

93)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

94)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

95)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

96)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

97)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

98)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

99)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

100)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

101)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

102)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

103)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

104)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

105)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

106)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

107)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

108)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

109)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

110)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

111)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

112)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

113)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

114)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

115)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

116)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

117)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

118)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

119)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

120)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

121)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

122)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

123)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

124)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

125)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

126)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

127)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

128)报告期末按行业分类的股票期权投资基金组合

129)报告期末按行业分类的其他投资基金组合

130)报告期末按行业分类的资产支持证券投资基金组合

131)报告期末按行业分类的黄金衍生品投资基金组合

132)报告期末按行业分类的权证投资基金组合

133)报告期末按行业分类的股指期货投资基金组合

134)报告期末按行业分类的国债期货投资基金组合

135)报告期末按行业分类的