

华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金

[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

报告送出日期:2016年1月21日

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。

基金托管人和中国建设银行股份有限公司对本基金合同约定，于2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等重要内容，确认复核内容不存在虚假记载、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。

本基金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日止。

§ 1 基金产品概况

基金简称 华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金

交易代码 000077

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2010-12-17

报告期末基金资产净值 270,431,037,028.00

投资目标 利用宏观及行业分析，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较基准的投资回报。

基金资产配置比例 1.股票资产占基金资产的比例为60%—95%，其中投资于本基金所管理的其他基金资产的比例不超过20%；

2.固定收益类资产、现金类资产及具有稳定收益预期的资产占基金资产的比例为5%—40%；

3.其余资产不得超过基金总资产的5%；

4.本基金投资于股票的平均市值不得超过基金资产净值的50%；

5.本基金投资于债券的比例不低于基金资产净值的50%；

6.本基金投资于货币市场工具的比例不得超过基金资产净值的5%；

7.本基金投资于权证的比例不得超过基金资产净值的3%；

8.本基金投资于股指期货的比例不得超过基金资产净值的10%；

9.本基金投资于国债期货的比例不得超过基金资产净值的30%；

10.本基金投资于资产支持证券的比例不得超过基金资产净值的20%；

11.本基金投资于股票型基金的比例不得超过基金资产净值的50%；

12.本基金投资于债券型基金的比例不得超过基金资产净值的50%；

13.本基金投资于货币型基金的比例不得超过基金资产净值的5%；

14.本基金投资于商品基金的比例不得超过基金资产净值的5%；

15.本基金投资于其他基金的比例不得超过基金资产净值的50%；

16.本基金投资于境外基金的比例不得超过基金资产净值的50%；

17.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

18.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

19.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

20.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

21.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

22.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

23.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

24.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

25.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

26.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

27.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

28.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

29.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

30.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

31.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

32.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

33.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

34.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

35.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

36.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

37.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

38.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

39.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

40.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

41.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

42.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

43.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

44.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

45.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

46.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

47.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

48.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

49.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

50.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

51.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

52.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

53.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

54.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

55.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

56.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

57.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

58.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

59.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

60.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

61.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

62.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

63.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

64.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

65.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

66.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

67.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

68.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

69.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

70.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

71.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

72.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

73.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

74.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

75.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

76.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

77.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

78.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

79.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

80.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

81.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

82.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

83.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

84.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

85.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

86.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

87.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

88.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

89.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

90.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

91.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

92.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

93.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

94.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

95.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

96.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

97.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

98.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

99.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

100.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

101.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

102.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

103.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

104.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

105.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

106.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

107.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

108.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

109.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

110.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

111.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

112.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

113.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

114.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

115.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

116.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

117.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

118.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

119.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

120.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

121.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

122.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

123.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

124.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

125.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

126.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

127.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

128.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

129.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

130.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

131.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

132.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

133.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

134.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

135.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

136.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

137.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

138.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

139.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

140.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

141.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

142.本基金投资于境外债券市场的比例不得超过基金资产净值的50%；

143.本基金投资于境外货币市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

144.本基金投资于境外商品市场的比例不得超过基金资产净值的5%；

145.本基金投资于境外