

华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金

2016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:中国工商银行股份有限公司
公告日期:2017年3月29日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、监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的法律责任。本年度报告经公告后，方能正式生效。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同的规定，于2017年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产配置数据等内容，并发表复核意见。

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表现，投资有风险，投资人在作出投资决策前应仔细阅读基金合同、基金招募说明书及基金定期报告。

本年度报告财务数据已经审计。普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。

本报告书摘要自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称 华泰柏瑞惠利
基金代码 000340
基金运作方式 到期赎回开放式
基金合同生效日 2015年05月06日

基金管理人 华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人 中国工商银行股份有限公司

报告期内基金的总资产 3,987,022,760.05 元
货币市场基金余额 3,987,022,760.05 元
报告期末基金的总资产 3,987,022,760.05 元

2.2 基金产品情况

投资目标 在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值，同时兼顾短期的流动性，力争在风险与收益之间取得平衡。

投资策略 本基金在严格遵守法律法规的前提下，根据宏观经济形势、政策环境变化和市场情况，通过资产配置、行业选择、个股精选等方法，在股票、债券、货币市场工具等大类资产之间进行动态配置，力求在风险与收益之间取得平衡。

投资范围 本基金的投资范围包括具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可分离交易债券、央行票据、短期融资券、中期票据、资产支持证券、权证、证券投资基金、公募基金、货币市场基金、银行存款、货币市场基金、股指期货、国债期货、股票期权、权证及其他金融衍生品）、商品期货（仅限于与本基金投资相关的商品期货品种）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

投资限制 除法律法规或基金合同另有约定外，本基金不得投资于股票、权证以外的金融衍生品种。

风险收益特征 本基金为混合型基金，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于股票基金。

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 中国工商银行股份有限公司

姓名 赵云景 周伟力
信息披露负责人 赵云景 021-30010577
联系电话 010-66100579
电子邮箱 custodian@htcfo.com
客户服务电话 400-899-0001
021-30010577
传真 010-66100578

2.4 会计核算方式

基金管理人指定的管理人互联网网址 http://www.htcfo.com
基金年度报告披露地点 上海市浦东新区陆家嘴环路1000号国金中心10号楼10层

3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

基金单位：人民币元
3.1.1 期间数据和指标 2016年 2015年同期
2015年05月06日至2016年12月31日
华泰柏瑞惠利 A 华泰柏瑞惠利 C

本期已实现收益 69,172,326.71 67,440.00
已实现收益 30,336,071.00 30,336,071.00
本期利润 -86,227,567.07 -14,147.08
本期利润占比 -2.10% -2.05%
本期利润增长比率 -21.56% 2.10%
-180%
本期利润和利润增长比率 2016年05月 2016年05月
-0.0011 -0.0043
0.0091
-0.0028
-0.0028

期末可供分配利润 3,082,790,413.00 620,610.00
4,069,162,929.00 683,006.26

基金份额净值 0.9999 1.001
1.001 1.001
0.9999
0.9999

注:1.上述基金业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的费用，计算入账后实行后收益抵扣原则，因此对本期收益影响为零；
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 其他重要信息

3.2.1 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
华泰柏瑞惠利A

阶段 份额净值 份额净值增长率 累计份额净值增长率 累计份额净值增长率标准差
1-3 ①-③
②-④

过去三个月 -1.38% 0.01% 0.04% 0.01% -4.02% 0.60%

过去六个月 -1.77% 0.02% 0.28% 0.01% -3.06% 0.61%

过去一年 -2.10% 0.09% 0.24% 0.01% -4.69% 0.80%

日均份额净值增长率 -0.10% 0.00% 0.27% 0.01% -0.37% 0.60%

成立以来回报率 -4.30% 0.72% 4.27% 0.01% -40.97% 0.67%

3.2.2 基金累计回报率以基金份额累计净值增长率变动幅度及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
华泰柏瑞惠利A

阶段 份额净值 份额净值增长率 累计份额净值增长率 累计份额净值增长率标准差
1-3 ①-③
②-④

过去三个月 -3.20% 0.01% 0.04% 0.01% -4.17% 0.60%

过去六个月 -3.60% 0.02% 0.28% 0.01% -5.33% 0.61%

过去一年 -4.00% 0.09% 0.24% 0.01% -6.00% 0.80%

日均份额净值增长率 -0.10% 0.00% 0.27% 0.01% -0.37% 0.60%

成立以来回报率 -4.30% 0.72% 4.27% 0.01% -40.97% 0.67%

3.2.3 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞惠利A

阶段 份额净值 份额净值增长率 累计份额净值增长率 累计份额净值增长率标准差
1-3 ①-③
②-④

过去六个月 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

过去一年 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

日均份额净值增长率 -0.10% 0.00% 0.27% 0.01% -0.37% 0.60%

成立以来回报率 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

3.2.4 基金份额净值增长率变动幅度及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞惠利C

阶段 份额净值 份额净值增长率 累计份额净值增长率 累计份额净值增长率标准差
1-3 ①-③
②-④

过去三个月 -0.38% 0.01% 0.04% 0.01% -0.42% 0.60%

过去六个月 -0.67% 0.02% 0.28% 0.01% -1.33% 0.61%

过去一年 -1.20% 0.09% 0.24% 0.01% -2.40% 0.80%

日均份额净值增长率 -0.10% 0.00% 0.27% 0.01% -0.37% 0.60%

成立以来回报率 -0.38% 0.01% 0.04% 0.01% -0.76% 0.67%

3.2.5 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞惠利A

阶段 份额净值 份额净值增长率 累计份额净值增长率 累计份额净值增长率标准差
1-3 ①-③
②-④

过去六个月 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

过去一年 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

日均份额净值增长率 -0.10% 0.00% 0.27% 0.01% -0.37% 0.60%

成立以来回报率 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

3.2.6 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞惠利C

阶段 份额净值 份额净值增长率 累计份额净值增长率 累计份额净值增长率标准差
1-3 ①-③
②-④

过去六个月 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

过去一年 -1.58% 0.01% 0.04% 0.01% -3.16% 0.60%

日均份额净值增长率 -0.10% 0.00% 0.27% 0.01% -0.37% 0.60%

成立以来回报率 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

3.2.7 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞惠利

阶段 份额净值 份额净值增长率 累计份额净值增长率 累计份额净值增长率标准差
1-3 ①-③
②-④

过去六个月 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

过去一年 -1.58% 0.01% 0.04% 0.01% -3.16% 0.60%

日均份额净值增长率 -0.10% 0.00% 0.27% 0.01% -0.37% 0.60%

成立以来回报率 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

3.2.8 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞惠利

阶段 份额净值 份额净值增长率 累计份额净值增长率 累计份额净值增长率标准差
1-3 ①-③
②-④

过去六个月 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

过去一年 -1.58% 0.01% 0.04% 0.01% -3.16% 0.60%

日均份额净值增长率 -0.10% 0.00% 0.27% 0.01% -0.37% 0.60%

成立以来回报率 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

3.2.9 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞惠利

阶段 份额净值 份额净值增长率 累计份额净值增长率 累计份额净值增长率标准差
1-3 ①-③
②-④

过去六个月 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

过去一年 -1.58% 0.01% 0.04% 0.01% -3.16% 0.60%

日均份额净值增长率 -0.10% 0.00% 0.27% 0.01% -0.37% 0.60%

成立以来回报率 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

3.2.10 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞惠利

阶段 份额净值 份额净值增长率 累计份额净值增长率 累计份额净值增长率标准差
1-3 ①-③
②-④

过去六个月 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

过去一年 -1.58% 0.01% 0.04% 0.01% -3.16% 0.60%

日均份额净值增长率 -0.10% 0.00% 0.27% 0.01% -0.37% 0.60%

成立以来回报率 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

3.2.11 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞惠利

阶段 份额净值 份额净值增长率 累计份额净值增长率 累计份额净值增长率标准差
1-3 ①-③
②-④

过去六个月 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

过去一年 -1.58% 0.01% 0.04% 0.01% -3.16% 0.60%

日均份额净值增长率 -0.10% 0.00% 0.27% 0.01% -0.37% 0.60%

成立以来回报率 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

3.2.12 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华泰柏瑞惠利

阶段 份额净值 份额净值增长率 累计份额净值增长率 累计份额净值增长率标准差
1-3 ①-③
②-④

过去六个月 -0.95% 0.01% 0.04% 0.01% -1.90% 0.60%

过去一年 -1.58% 0.01% 0.04% 0.01% -3.16% 0.60%

日均份额净值增长率 -0.10% 0.00