

华泰柏瑞量化优选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：中银建设银行股份有限公司
送出日期：2017年3月29日

§ 1 重要提示

1.1 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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人华泰柏瑞基金管理有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利率分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证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当仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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无保留意见的审计报告。

本报告期自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，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

基金简称	华泰柏瑞量化优选混合
基金代码	000977
基金开放方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月17日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	223,140,220.14
基金合同到期日	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标

利用定量分析模型，在充分考虑风险的前提下，追求货币的长期增值。

本基金主要通过量化选股、量化择时和量化配置等方法，实现对股票、债券等大类资产的配置，从而在控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、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、可转债、分离交易可转债、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、中小企业私募债、资产支持证券、同业存单、可转换债券、可分离交易债券）、权证、资产支持票据、公募基金、货币市场基金、银行存款、回购、同业存单、国债期货、股指期货、商品期货、期权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。

本基金不投资于股票、权证等金融衍生品。

本基金不投资于向投资者提供保本承诺或保收益的理财产品。

本基金不投资于向投资者提供保本承诺或保收益的理财产品