

华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金

2017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:兴业银行股份有限公司

送出日期:2018年3月28日

\$1 重要提示

1.1 基金管理人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。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字确认,并由董事长签发。

基金管理人的董事长、董事、监事、高级管理人员、基金经理和基金投资决策核心人员在本年度报告编制期间内没有从事可能损害基金份额持有人利益的兼职活动。

基金管理人和基金托管人承诺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。

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产,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及其更新。

本年度报告财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

截至报告期末,本基金未向基金份额持有人分配利润。

本基金报告自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细情况,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 华泰柏瑞睿利混合
基金代码 003656
基金运作方式 约定开放式
基金合同生效日 2016年1月21日
基金管理人 华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人 兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额 198,977,505.97份
下属分级基金的基金简称: 华泰柏瑞睿利混合A
华泰柏瑞睿利混合C
下属分级基金的交易代码: 003656
报告期末下属分级基金的份额总额 198,360,362.88份 117,123.09份

2.2 基金产品说明

投资目标 在有效控制风险和保持资产流动性前提下,通过积极的投资管理资产配置,实现基金的长期稳定增值。

(一) 资产配置策略:本基金将结合宏观经济指标,在投资期限内定期对资产配置进行调整,根据各资产的市场地位和预期收益能力,在股票、债券、货币市场工具等大类资产之间进行动态调整。

(二) 股票投资策略:本基金将根据行业景气度变化为基础,从基本面分析入手,分析经济基本面及行业分析,根据行业景气度变化,适时调整股票仓位,并动态优化行业配置。

(三) 债券投资策略:本基金将综合运用久期策略、收益率曲线策略、息差策略、骑乘策略、杠杆策略、信用策略、利率债与信用债配置策略、可转债投资策略、新股申购策略等,在严格控制风险的前提下,力争获得超越基准的收益。

(四) 权证投资策略:权证为本基金的金融衍生工具,其投资原则

有关于有计划地使用,有利于加强风险管理。本基金对权证投资的原则是控制风险、稳健投资。

(五) 货币市场工具投资策略:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

(六) 其他金融工具投资策略:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

投资策略 交易制度等品种对投资进行定位。

五、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

六、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

七、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

八、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

九、交易制度等品种对投资进行定位。

十、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

十一、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

十二、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

十三、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

十四、交易制度等品种对投资进行定位。

十五、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

十六、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

十七、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

十八、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

十九、交易制度等品种对投资进行定位。

二十、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

二十一、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

二十二、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

二十三、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

二十四、交易制度等品种对投资进行定位。

二十五、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

二十六、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

二十七、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

二十八、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

二十九、交易制度等品种对投资进行定位。

三十、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

三十一、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

三十二、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

三十三、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

三十四、交易制度等品种对投资进行定位。

三十五、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

三十六、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

三十七、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

三十八、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

三十九、交易制度等品种对投资进行定位。

四十、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

四十一、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

四十二、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

四十三、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

四十四、交易制度等品种对投资进行定位。

四十五、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

四十六、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

四十七、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

四十八、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

四十九、交易制度等品种对投资进行定位。

五十、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

五十一、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

五十二、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

五十三、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

五十四、交易制度等品种对投资进行定位。

五十五、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

五十六、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

五十七、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

五十八、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

五十九、交易制度等品种对投资进行定位。

六十、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

六十一、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

六十二、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

六十三、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

六十四、交易制度等品种对投资进行定位。

六十五、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

六十六、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

六十七、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

六十八、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

六十九、交易制度等品种对投资进行定位。

七十、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

七十一、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

七十二、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

七十三、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

七十四、交易制度等品种对投资进行定位。

七十五、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

七十六、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

七十七、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

七十八、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

七十九、交易制度等品种对投资进行定位。

八十、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

八十一、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

八十二、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

八十三、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

八十四、交易制度等品种对投资进行定位。

八十五、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

八十六、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

八十七、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

八十八、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

八十九、交易制度等品种对投资进行定位。

九十、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

九十一、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

九十二、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

九十三、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

九十四、交易制度等品种对投资进行定位。

九十五、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性等,评估其风险收益特征,并将其纳入相应资产类别进行管理。

九十六、权证投资:本基金将根据权证的定价模型,结合权证的理论价值、标的股票的基本面、权证的波动率等参数,选择买入或卖出权证。

九十七、货币市场工具:本基金将根据宏观经济形势及资金面的变化,适时调整货币市场工具的配置比例。

九十八、其他金融工具:本基金将根据法律法规的规定,参与股指期货、国债期货等金融工具的投资。

九十九、交易制度等品种对投资进行定位。

一百、资产支持证券:本基金将根据资产支持证券的性质,通过分析资产池的构成、发行条款、基础资产的属性