# 华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金更新的招募说明书(摘要)

2015年第1号

华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2014年1月14日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2014】88号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于2014年5月6日正式生效。

## 重要提示

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书在中国证监会备案，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

投资者认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日为2015年5月5日，有关财务和业绩表现数据截止日为2015年3月31日，财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人中国银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书中的投资组合报告和业绩表现进行了复核确认。

**一、基金管理人**

（一）基金管理人概况
名称：华泰柏瑞基金管理有限公司
住所：上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
法定代表人：齐亮
成立日期：2004年11月18日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178号
经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务
组织形式：有限责任公司
注册资本：贰亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人：汪莹白
联系电话：400-888-0001，（021）38601777

股权结构：柏瑞投资有限责任公司（原AIGGIC）49%、华泰证券股份有限公司49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司2%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

齐亮先生：董事长，硕士，1994-1998年任国务院发展研究中心情报中心处长、副局长，1998-2001年任中央财经领导小组办公室副局长，2001年至2004年任华泰证券股份有限公司副总裁。

吴祖芳先生：董事，硕士，1992年起至今历任华泰证券股份有限公司部门负责人、子公司负责人、总裁助理、业务总监、总经济师、副总裁。

Rajeev Mittal先生：董事，学士，1992年加入美国国际集团，2009—2011年担任柏瑞投资（欧洲分公司）总经理，新兴市场投资主管，全球固定收益研究团队主管和行政总裁（欧洲分公司），2011年至今担任柏瑞投资亚洲有限公司业务行政总裁（亚洲，日本除外）、总经理、新兴市场投资总管，全球固定收益研究团队主管。

韩勇先生：董事，博士，曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会，2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

朱小平先生，独立董事，硕士，1983至今任中国人民大学商学院教授。

陈念良先生，独立董事，1977年至今任香港陈应达律师事务所首席合伙人。

薛加玉先生，独立董事，博士，1988-1997年任江苏巨龙水泥集团有限公司团委书记、财务处长、副总经济师，1997-1999年任长城证券有限公司投资银行部副总经理，1999-2000年任亚洲控股有限公司投资银行部总经理，2000-2001年任北京华创投资管理有限公司执行总裁，2001年至今任上海德汇集团有限公司董事长、总裁。

杨科先生：独立董事，学士，2001年至今任北京市天元律师事务所律师。2010年至今任该律师事务所合伙人。

2、监事会成员

严玉珍女士：监事长，学士，1987年1月至1988年9月任罗兵咸永道（前容永道会计）高级稽核员，1988年12月至1990年4月任香港电讯（前大东电报）管理会计，1990年5月至1996年11月任宝达证券（施罗德集团）副财务总监，1996年12月至2007年9月任施罗德投资管理（香港）有限公司财务董事，2007年9月至2008年6月任交银施罗德基金管理有限公司高级总经理顾问，2008年7月至2012年9月任施罗德投资管理（香港）有限公司首席营运官，2012年9月至今任柏瑞投资亚洲有限公司首席财务官。

王桂芳女士：监事，硕士，1996-2003年任华泰证券股份有限公司西藏南路营业部总经理，2003-2006年任华泰证券股份有限公司上海总部总经理，2006年至今任华泰证券股份有限公司上海城市中心营业部总经理。

柳军先生：监事，硕士，2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利ETF基金经理助理、上证红利ETF基金经理，2010年10月起担任指数投资部副总监。2011年1月起兼任华泰柏瑞上证中小盘ETF基金、华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起担任华泰柏瑞沪深300ETF及华泰柏瑞沪深300ETF联接基金基金经理。

陈培先生：监事，硕士。2001-2004年，就职于富国基金管理有限公司，任基金会计等职。2004年6月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任基金事务部总监。

3、总经理及其他高级管理人员

韩勇先生：总经理，博士，曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会，2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

王溯舸先生：副总经理，硕士，1997-2000年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理，2001-2004年任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。

陈晖女士：督察长，硕士，1993-1999年任江苏证券有限责任公司北京代表处代表，1999-2004年任华泰证券股份有限公司北京总部总经理。

房伟力先生：副总经理，硕士，1997-2001年就职于上海证券交易所登记结算公司，2001-2004年任华泰证券有限公司部门总监，2004-2008年5月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

田汉卿女士：副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI）担任投资经理，2012 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013 年 8 月起任华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金的基金经理，2013 年 10 月起任公司副总经理，2014年12月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年3月起任华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA 毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。

高山先生，副总经理，博士。2001.5-2013.7任职于全国社会保障基金理事会投资部，任处长；2013.7起加入华泰柏瑞基金管理有限公司。本科毕业于山东大学经济管理学院，硕士毕业于中国人民银行研究生部，博士毕业于财政部财政科学研究所研究生部。

4、本基金基金经理

沈雪峰女士：经济学硕士。历任：安徽省国际信托投资公司投资银行部、股票自营部投资经理；华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员；亚洲证券资产管理总部副总经理兼固定收益证券管理总部副总经理、研究所副所长；华富基金管理公司资深研究员、基金经理、投研部副总监。后重新加入华安基金管理公司，任基金经理。2012年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013年2月起任华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金的基金经理，2014年5月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。 2014年7月起任投资部总监。2014年8月任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金的基金经理。

张慧先生：经济学硕士，8年证券从业经历。2007年7月至2010年6月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010年6月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理，2013年9月起任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金的基金经理，2014年5月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2015年2月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

主席：总经理韩勇先生；

成员：成员：副总经理王溯舸先生；副总经理田汉卿女士；副总经理高山先生；总经理助理董元星先生；投资部总监沈雪峰女士；投资部副总监吕慧建先生。

列席人员：督察长陈晖女士；投资决策委员会主席指定的其他人员。

上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

13、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
（5）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1）越权或违规经营；
（2）违反基金合同或托管协议；
（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
（6）玩忽职守、滥用职权；
（7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
（8）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
（9）贬损同行，以抬高自己；
（10）以不正当手段谋求业务发展；
（11）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
（12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
（13）其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金经理承诺

（1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
（2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
（3）不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
（4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

（1）健全性原则。内部控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

（2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

（3）独立性原则。公司在精简的基础上设立能够充分满足经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立。内部控制的检查评价部门必须独立于内部控制的建立和执行部门；

（4）相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡，消除内部控制中的盲点；

（5）防火墙原则。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；

（6）成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

2、内部控制的主要内容

（1）控制环境

董事会下设风险管理与审计委员会，全面负责公司的风险管理、风险控制和财务监控，审查公司的内控制度，并对重大关联交易进行审计；董事会下设薪酬、考核与资格审查委员会，对董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的候选人进行资格审查以确保其具有中国证监会所要求的任职资格，制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监、其他高级管理人员及基金经理的薪酬/报酬计划或方案。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会和风险控制委员会，就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议。

公司设立督察长，对董事会负责，主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查，发现重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

（2）风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

（3）控制活动

控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离、危机处理等政策、程序或措施。

自我控制以各岗位的目标责任制为基础，是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度，在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督责任，使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和法律监察部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用，建立内部控制的第三道防线。

（4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。

（5）内部监控

内部监控由公司风险管理与审计委员会、督察长、风险控制委员会和法律监察部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的法律监察部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。

3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；
（2）本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

**二、基金托管人**

（一）基本情况
名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人：田国立
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号
托管业务部总经理：李爱华
托管部门信息披露联系人：王永民
客服电话：95566
传真：（010）66594942

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2015年3月31日，中国银行已托管328只证券投资基金，其中境内基金303只，QDII基金25只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，包括风险识别，风险评估，工作程序设计与制度建设，风险检视，工作程序与制度的执行，工作程序与制度执行情况的内部监督、稽核以及风险控制工作的后评价。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2013年，中国银行同时获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

**三、相关服务机构**

（一）基金份额发售机构

基金份额发售机构包括基金管理人的直销机构和代销机构的销售网点。

1、直销机构：
华泰柏瑞基金管理有限公司
注册地址：上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号楼17层
办公地址：上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号楼17层
法定代表人：齐亮
电话：（021）38784638
传真：（021）50103016
联系人：汪莹白
客服电话：400-888-0001，（021）38784638
公司网址：www.huatai-pb.com

2、代销机构

1）中国银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
传真：（010）66594853
客服电话：95566
公司网址：www.boc.cn

2）中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市复兴门内大街55号
办公地址：北京市复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
传真：（010）66107914
客服电话：95588
公司网址：www.icbc.com.cn

3）中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区金融大街25号
法定代表人：王洪章
传真：（010）66275654
客服电话：95533
公司网址：www.ccb.com

4）哈尔滨银行股份有限公司
注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街160号
办公地址：哈尔滨市道里区尚志大街160号
法定代表人：郭志文
联系人：遇玺
电话：（0451）86779018
传真：（0451）86779018
客服电话：95537/4006095537
公司网址：www.hrbb.com.cn

5）渤海证券股份有限公司
注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：王春峰
联系人：蔡霆
电话：（022）28451991
传真：（022）28451892
客服电话：400-651-5988
公司网址：www.bhzq.com

6）财富证券有限责任公司
注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层
办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层
法定代表人：蔡一兵
联系人：郭磊
电话：（0731）84403319
传真：（0731）84403439
客服电话：（0731）84403319
公司网址：www.cfzq.com

7）长城证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址：广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
联系人：高峰
电话：（0755）83516094
传真：（0755）83515567
客服电话：（0755）33680000、400-6666-888
公司网址：www.cgws.com

8）第一创业证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人：刘学民
联系人：毛诗莉
电话：（0755）25831754
传真：（0755）23838750
客服电话：400-888-1888
公司网址：www.firstcapital.com.cn

9）东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人：刘化君
联系人：梁旭
电话：（0519）88157761
传真：（0519）88157761
客服电话：400-888-8588
公司网址：www.longone.com.cn

10）东吴证券股份有限公司
注册地址：江苏省苏州市工业园区星阳街5号
办公地址：江苏省苏州市工业园区星阳街5号
法定代表人：吴永敏
联系人：方晓丹
电话：（0512）65581136
传真：（0512）65588021
客服电话：（0512）33396288
公司网址：www.dwjq.com.cn

11）光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
联系人：周洁瑾
电话：（021）22169999
传真：（021）22169134
客服电话：95525
公司网址：www.ebscn.com

12）广发证券股份有限公司
注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广州市天河北路183号大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
电话：（020）87555888
传真：（020）87555305
客服电话：95575
公司网址：www.gf.com.cn

13）广州证券股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20层
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20层
法定代表人：邱三发
联系人：林洁茹
电话：（020）88836999
传真：（020）88836654
客服电话：961303
公司网址：www.gzs.com.cn

14）国都证券有限责任公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：常喆
联系人：黄静
电话：(010）84183333
传真：（010）84183311-3389
客服电话：400-818-8118
公司网址：www.guodu.com

15）国金证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市东城根上街95号
办公地址：四川省成都市东城根上街95号6、16、17楼
法定代表人：冉云
联系人：金喆
电话：（028）86690126
传真：（028）86690126
客服电话：4006-600109
公司网址：www.gjzq.com.cn

16）宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
联系人：李巍
电话：（010）88085858
传真：（010）88085195
客服电话：400-800-0562
公司网址：www.hysec.com

17）平安证券有限责任公司
注册地址：广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址：广东省深圳市福田区金田路大中华交易广场群楼8楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：郑舒丽
电话：（0755）22626391
传真：（0755）82400862
客服电话：95511*8
公司网址：stock.pingan.com

18）齐鲁证券有限公司
注册地址：山东省济南市经七路86号
办公地址：山东省济南市经七路86号23层
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：（0531）68889155
传真：（0531）68889752
客服电话：95538
公司网址：www.qlzq.com.cn

19）上海证券有限责任公司
注册地址：上海市西藏中路336号华旭大厦
办公地址：上海市西藏中路336号华旭大厦
法定代表人：郁忠民
联系人：张瑾
电话：（021）53519888
传真：（021）53519888
客服电话：400-891-8918，（021）962518
公司网址：www.962518.com

20）天风证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址：中国武汉武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人：余磊
联系人：崔成
电话：027-87610052
传真：027-87618863
客服电话：4008005000
公司网址：www.tfzq.com

21）天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法定代表人：林义相
联系人：林爽
电话：（010）66045529
传真：（010）66045518
客服电话：（010）66045678
公司网址：www.txsec.com或www.jjm.com.cn

22）西南证券股份有限公司
注册地址：重庆市江北区桥北苑8号
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人：余维佳
联系人：张煜
电话：（023）63786141
传真：（023）63810422
客服电话：400-809-6096
公司网址：www.swsc.com.cn

23）新时代证券有限责任公司
注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人：刘汝军
联系人：卢珊
电话：（010）83561072
传真：（010）83561094
客服电话：400-698-9898
公司网址：www.xsdzq.cn

24）信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
电话：（010）63081000
传真：（010）63080978
客服电话：400-800-8899
公司网址：www.cindasc.com

25）中航证券有限公司
注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人：王宜四
联系人：戴蕾
电话：（0791）86768681
传真：（0791）86770178
客服电话：400-886-6567
公司网址：www.avicsec.com

26）中国国际金融有限公司
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座28层
办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座28层
法定代表人：丁学东
联系人：罗文雯
电话：（021）58763575
传真：（021）68875123
客服电话：（021）58796226-3736
公司网址：www.cicc.com.cn

27）中国中投证券有限责任公司
注册地址： 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人：龙增来
联系人：刘毅
电话：（0755）82023442
传真：（0755）82026539
客服电话：400-600-8008
公司网址：www.china-invs.cn

28）中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
联系人：权唐
电话：400-8888-108
传真：（010）65182261
客服电话：400-888-8108
公司网址：www.csc108.com

29）中信证券(山东)有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层(266061)
法定代表人：杨宝林
联系人：吴忠超
电话：（0532）85022326
传真：（0532）85022605
客服电话：95548
公司网址：www.citicssd.com

30）中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
联系人：腾艳
电话：（010）60838888
传真：（010）60833739
客服电话：95558
公司网址：www.cs.ecitic.com

31）中信证券（浙江）有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人：沈强
联系人：李珊
电话：（0571）85776114
传真：（0571）85783771
客服电话：（0571）96598
公司网址：www.bigsun.com.cn

32）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
联系人：敖玲
电话：021-58788678-8201
传真：021—58787698
客服电话：400-089-1289
公司网站： www.erichfund.com

33）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室
法定代表人：杨文斌
联系人：张茹
电话：021-58870011-6702
传真：021-68596916
客服电话：400-700-9665
公司网址：http://www.ehowbuy.com

34）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号二号楼2层
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人：其实
联系人：潘世友
电话：021-54509988-7019
传真：021-64385308
客服电话：400-181-8188
公司网址：www.1234567.com.cn

35）深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：（0755）82080798
传真：（0755）82080798
客服电话：400-678-8887
公司网址：www.jjmmw.com；www.zlfund.cn

36）北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人：闫振杰
联系人：李兆贺
电话：010-62020088
传真：010-62020355
客服电话：400-888-6661
公司网址：www.myfund.com

37）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人： 凌顺平
联系人：杨翼
电话：0571-88911818
传真：0571-86800423
客服电话：4008-773-772
公司网站：www.5ifund.com

38）杭州数米基金销售有限公司
注册地址： 杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址： 浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人： 陈柏青
联系人：张裕
电话：021-60897840
传真：0571-26698533
客服电话：4000-766-123
公司网站： http://www.fund123.cn/

39）中期时代基金销售（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
法定代表人：路瑶
联系人：侯英建
电话：010-65807865
传真：010-65807864
客服电话：010-65807609
公司网站：www.cifcofund.com

40）和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：于杨
电话：021-20835779
客服电话：400-920-0022
公司网址：licaike.hexun.com

41）万银财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
法定代表人： 李招弟
联系人：刘媛
电话：（010）59393923-819
客服电话：400-808-0069
公司网址：www.wy-fund.com

42）中国国际期货有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址：北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层
法定代表人：王兵
联系人： 赵森
电话：(010) 5953 9864
公司网址： www.cifco.net
客服电话：95162、400-8888-160

43）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址： 北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人： 沈伟桦
联系人： 刘梦轩
电话：(010)-52858244
公司网址：www.yixinfund.com
客服电话：400 6099 200

44）上海大智慧财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
办公地址：上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
法定代表人： 申健
联系人： 付江
电话：（021）20219988*31781
公司网址： www.gw.com.cn
客服电话：021-20219999

45）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区金融大街35号 国际企业大厦C座9层
法定代表人：杨懿
联系人： 张燕
电话：（010）58325395
公司网址： http://8.jrj.com.cn/
客服电话：400-166-1188

46）恒丰银行股份有限公司
注册地址：山东省烟台市芝罘区南大街248号
办公地址：山东省烟台市芝罘区南大街248号
法定代表人： 蔡国华
联系人： 汪明
电话：021-38966235
公司网址： www.egbank.com.cn
客服电话：400-813-8888

47）泉州银行股份有限公司
注册地址： 泉州市云鹿路3号
办公地址： 泉州市云鹿路3号
法定代表人：傅子能
联系人： 董培姗
电话：0595-22551071
公司网址： www.qzccbank.com
客服电话：400-88-96312

48）日发资产管理(上海)有限公司
注册地址：陆家嘴花园石桥路66号东亚银行大厦1307室
办公地址：陆家嘴花园石桥路66号东亚银行大厦1307室
法定代表人：周泉恭
联系人： 杨迎雪
公司网址： www.rffund.com
客服电话：021-61600500

49）北京创金启富投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人：梁蓉
联系人： 张旭
公司网址： www.5irich.com
客服电话：400-6262-818

50）北京恒久浩信投资咨询有限公司
注册地址：北京市怀柔区怀北镇怀北路308号
办公地址：北京市朝阳区光华路7号汉威大厦B1210
法定代表人：谢亚凡
联系人： 陈冲
公司网址： www.haofunds.com
客服电话：4006-525-676

51）上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人：张晶
联系人： 朱翔宇

52）上海利得基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区峨山路91弄61号1幢12层(陆家嘴软件园10号楼)
法定代表人： 沈继伟
联系人：张裕
公司网址： http://m.leadfund.com.cn
客服电话：400-005-6355

53）北京钱景财富投资管理有限公司
住所：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人：赵荣春
联系人：魏争
公司网址： www.qianjing.com
客服电话：400-893-6885

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构
名称：华泰柏瑞基金管理有限公司
住所：上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号楼17层
法定代表人：齐亮
办公地址：上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号楼17层
电话：400-888-0001，（021）38601777
传真：（021）50103016
联系人：陈培

（三）律师事务所和经办律师
名称：上海源泰律师事务所
住所：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人：廖海
电话：（021）51150298
传真：（021）51150398
经办律师：刘佳、张兰

（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人：杨绍信
经办注册会计师：薛竞、张振波
电话：021-23238888
传真：021-23238800

**四、基金的名称**

华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

**五、基金的类型**

混合型

**六、基金的投资目标**

本基金为混合型证券投资基金，在力求有效控制投资风险的前提下，追求基金资产的长期增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。

**七、基金的投资范围**

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、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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(须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序（包括公告等）后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产投资比例占基金资产的30-95%，其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的80%；债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-70%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在1年以内的政府债券。

**八、基金的投资策略**

（一）投资策略

本基金将采取积极、主动的资产配置策略，精选与经济结构调整与转型主题直接相关，具备长期盈利能力提升的上市公司，力求实现基金资产的长期增值。

1、资产配置策略

资产配置策略是指基于宏观经济和证券市场运行环境的整体研究，结合内部和外部的研究支持，本基金管理人分析判断股票和债券估值的相对吸引力，从而决定各大类资产配置比例的调整方案，进行主动的仓位控制。

本基金为混合型基金，以股票投资为主，一般情况下本基金将保持配置的基本稳定，最高可到95%。当股票市场的整体估值水平严重地偏离了企业实际的盈利状况和预期的成长率，出现明显的价值高估，如果不及时调整将可能给基金持有人带来潜在的资本损失时，本基金将进行大类资产配置调整，降低股票资产的比例（最低为30%），同时相应提高债券等其他资产的比例。

本基金的大类资产配置策略主要是通过对股票、债券和货币市场工具等金融工具展开系统性分析，形成对不同市场周期的预测和判断，决定基金资产在各大类资产之间的投资比例，以达到追求较高收益的同时，规避市场系统性风险的目的。

2、股票投资策略

本基金所指的创新升级主题分为新兴产业的创新和传统产业的改造升级两个方面。新兴产业的创新包括两个层面的含义，一是TMT行业的技术、模式、产品等创新，二是以创新为纽带，实现TMT行业与其他新兴产业相融合。传统产业改造升级也分为两个层面的含义，一是通过对传统行业进行技术改造而实现更高效、更环保、更集约的生产方式，二是通过创新使得在传统行业中产生新的业态。本基金所指的创新升级主题所投资的行业包括TMT行业以及与之融合的新兴产业和传统行业。TMT行业包括以下两类公司：1）中信证券一级行业分类中的电子元器件、计算机、传媒及通信行业的上市公司；2）当前非主营业务提供的产品或服务隶属于TMT行业，且未来这些产品或服务有望成为主要收入或利润来源的公司。与TMT行业融合的新兴产业和传统行业包括但不限于节能环保、生物医药、生物育种、高端装备制造、新能源、新材料、新能源汽车、家用电器、金融服务、商贸零售、纺织服装、机械设备等行业。

产业结构变迁是实现经济发展的内在规律，而创新是我国实现经济转型的首要驱动力。近年来，我国工业化、城镇化快速推进，城乡居民消费结构加速升级，国内外市场需求快速增长，经济全球化不断深入，都为产业创新和转型升级提供了有利的经济环境。

改革是中国未来社会和经济发展的主旋律，包括经济体制改革、政治体制改革、文化体制改革、社会体制改革、生态体制改革和国家安全战略等内容。其中，经济体制改革是全面深化改革的重点，其核心问题是处理好政府和市场的关系，使市场在资源配置中起决定性作用和更好发挥政府作用。市场化作用配合政府导向能驱动高端设备制造、服务增长和环保发展等方面，加速产业结构的创新和转型。为了抓住这一投资机遇，本基金的投资策略将围绕“创新”加“转型升级”展开行业配置及个股选择。

产业创新是经济增长和发展的动力，中国经济旧的增长模式面临瓶颈，以TMT为代表的新兴产业逐渐发展壮大符合经济增长和产业变迁的客观规律。一方面，科技是创新的源泉之一，TMT产业将有望成为中国经济新的驱动力和支柱。另一方面，新技术与其他新兴产业日益融合，并深刻地改变着人们的生活。作为新技术发动机的TMT产业，在改变其他产业的商业模式， 提升其运行效率和竞争能力方面正发挥着重要的作用。本基金认为，TMT产业以及与之融合的新兴产业在GDP中的比重将不断提升，并反映在证券市场各个行业间的市值变化之中。

产业转型升级具有两个层面的含义：一是指对于传统产业技术落后、高能耗高污染、粗放型生产、产能过剩等是当前产业发展的现状，通过信息技术改造、调整生产方式和商业模式、改善需求结构等手段，逐步转向技术先进、节能环保、集约型的生产方式，具体相关产业包括但不限于先进制造业、服务业、能源环保、新型农业等；另一个方面是指对传统产业融入信息技术、衍生新的商业模式，从而实现产业的改造升级，产生新的业态，例如金融行业的互联网金融，商业零售行业的线上线下模式，从而改变传统产业的运行机制和盈利模式，实现脱胎换骨式的产业升级转型。

本基金管理人将持续跟踪国家政策、产业发展趋势、技术、工艺、商业模式的最新变化，对创新和转型升级主题相关行业的范围进行动态调整。

总体来说，本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的方法，深入挖掘在中国经济结构调整和产业升级过程中出现的主题投资机会。

（1）投资主题的行业选择

首先，本基金将在挖掘前述创新和经济结构转型升级主题的基础上，研究分析相关行业与投资主题的关联程度，以及相关行业的成长性，发掘出具有重要革新意义、强劲竞争力和高速增长前景的主题相关行业。

（2）行业配置

在确定投资主题行业的基础上，本基金将综合考虑以下因素，进行股票资产在各行业间的配置。

1）国家经济政策

本基金将积极关注政府未来的产业发展规划方向，以及配套的国家财政与税收政策、货币政策、产业政策、贸易政策、汇率政策等政策的变化，分析国家政策对主题行业的影响，重点投资于受益于国家政策变化、预期收益率较高的行业。

2）经济周期

经济周期对各个行业的影响不尽相同，本基金主要从两个角度把握经济周期带来的投资机会：一是充分分析过往历史数据，找出经济周期对行业景气度影响的共性规律；二是将对当前所处经济周期阶段进行前瞻性分析，根据各行业在经济周期各阶段的预期表现，进行行业配置与调整，为投资者追求超额收益。

3）各行业的发展前景

本基金将重点关注各行业的创新能力和转型升级的发展进程，捕捉行业科技技术、制造工艺、商业模式、人才结构等因素的最新变化，从而预测各行业的发展前景，发掘具有广阔发展潜力的行业，并相应对基金资产的行业配置进行调整。

4）各行业基本面的变化

本基金将对影响各行业基本面的因素进行跟踪分析，预期各行业基本面变化的拐点，超配基本面即将发生有利变化的行业，低配基本面即将发生不利变化的行业。

5）各行业的相对估值水平

本基金将对各行业的相对估值水平进行动态分析，增加被市场低估的行业配置比例，降低盈利低于预期的行业配置比例。

6）市场需求趋势

各行业市场需求的变化趋势不同，有的表现为刚性需求，有的呈现较大弹性，导致不同行业成长性出现差异。本基金将重点投资市场需求稳定或保持较高增长的行业。

7）行业竞争格局

各行业内部的竞争格局不同，行业利润率存在较大差异。本基金将重点投资行业进入壁垒较高、利润率稳定或保持增长的行业。

（3）个股选择策略

本基金管理人首先从上市公司的经营状况、行业特征、驱动因素及同业比较等定性方面对个股进行基本面研究，选取具有持续经营能力的上市公司，组成股票初选库。

在股票初选库中，按照企业生命周期理论将股票划分为突出成长类——A类、高速稳定成长类——B 类、高速周期性成长类——C 类、成熟类——D 类（D类又分为成熟/良性转折——D1 类、成熟/周期性——D2 类、成熟/防御性——D3类）。本基金管理人对股票初选库中的上市公司深入研究，构建财务模型，进行盈利预测，给出股票评级和目标价，提交详尽的标准研究报告，其中获得 1、2、3 评级的股票构成本基金的股票精选库。

3、债券投资策略

本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，自上而下，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，采取以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略、收益率利差策略等，投资于国债、金融债、企业债、可转债、央票、短期融资券以及资产证券化产品，确定和构造能够提供稳定收益、流动性较高的债券和货币市场工具组合，在获取较高的利息收入的同时兼顾资本利得，谋取超额收益。

（1）久期管理策略

本基金通过对宏观经济变量以及宏观经济等因素进行分析判断，形成对未来利率走势的合理预测，根据利率水平的预期变化主动调整债券组合的久期，有效控制基金组合整体风险，以达到优化资产收益率的目的。

如果判断未来利率水平将下降，本基金可通过增加组合的久期，获得债券收益率下降带来的收益；反之，如果预测未来利率水平将上升，本基金可缩短组合的久期，以减小债券收益率上升带来的损失。

（2）期限结构配置策略

在确定组合久期的基础上，运用统计和数量分析技术、对市场利率期限结构历史数据进行分析检验和情景测试，并综合考虑债券市场微观因素如历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等，形成对债券收益率曲线形态及其发展趋势的判断，从而在子弹型、杠铃型或阶梯型配置策略中进行选择并动态调整。其中，子弹型策略是将偿还期限高度集中于收益率曲线上的某一点；杠铃型策略是将偿还期限集中于收益率曲线的两端；而阶梯型策略是每类期限债券所占的比重基本一致。在收益率曲线变陡时，本基金将采用子弹型配置；当预期收益率曲线变平时，将采用哑铃型配置；在预期收益率曲线平移时，则采用阶梯型配置。

（3）骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，当债券收益率曲线比较陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着债券剩余期限的缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，这样可同时获得该债券持有期的稳定的票息收入以及收益率下降带来的价差收入；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。

（4）息差策略

根据市场利率水平，收益率曲线的形态以及对利率期限结构的预期，通过采用长期债券和短期回购相结合，获取债券票息收益和回购利率成本之间的利差。当回购利率低于债券收益率时，可以将正回购所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债基投资的收益。

（5）信用策略

发债主体的资信状况以及信用利差曲线的变动将直接决定信用债的收益率水平。本基金将利用内部信用评级体系对债券发行人及其发行的债券进行信用评估，分析违约风险以及合理信用利差水平，识别投资价值。

（6）个券精选策略

在内部信用评级结果的基础上，综合分析个券的到期收益率、剩余期限、交易量、票息率、信用等级、信用利差水平、税赋特点、内嵌期权属性等因素，对个券进行内在价值的评估，精选估值合理或者相对估值较低、到期收益率较高、票息率较高的债券。

4、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价，主要运用的投资策略为：杠杆交易策略、对冲保底组合投资策略、保底套利组合投资策略、买入跨式投资策略、Delta对冲策略等。

5、其他金融衍生工具投资策略

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，从而更好地实现本基金的投资目标。

（二）投资决策依据

1、国家有关法律、法规、基金合同等的有关规定；

2、根据投研团队对于市场中可获得相应数据的研究分析所构建的投资模型以及投资经理和投研团队对市场状态的判断 ；

3、基于风险估测模型的投资风险分析。

（三）投资决策机制

1、投资决策委员会负责审定基金经理的投资策略和原则；审定基金经理定期调整计划；审定基金定期投资检讨报告；决定基金禁止的投资事项等。

2、基金经理：在投资决策委员会的授权范围内，根据基金的投资政策实施投资管理，确定具体的投资品种、数量、策略，构建优化和调整投资组合，进行投资组合的日常分析和管理。

3、基金经理助理/投资分析员：通过内部调研和参考外部研究报告，编写有关公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析的各类报告，提交基金经理，作为投资决策的依据。

（四）投资程序

1、投研团队对市场中可获得的相应数据进行研究分析，并构建投资模型，为本基金的投资管理提供决策依据。

2、投资决策委员会依据投研团队的研究结果对基金的资产配置比例等提出指导性意见。

3、基金经理根据投资决策委员会的决议，利用投资模型，并结合对宏观政策、证券市场和上市公司等的分析判断，形成基金投资计划。

4、集中交易室依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

5、法律监察部对投资组合计划的执行过程进行监控。

6、基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

九、基金的业绩比较基准

中证TMT产业主题指数收益率×20%+中证新兴产业指数收益率×40%+中债总指数（全价）收益率×40%

中证TMT产业主题指数从电讯业务、信息技术、媒体、消费电子产品等行业与TMT产业相关的股票中挑选规模和流动性较好的100只公司股票组成样本股，反映A股上市公司中数字新媒体相关产业公司股票的走势。中证新兴产业指数由沪深两市中规模大、流动性好的100家新兴产业公司组成，综合反映了沪深两市中新兴产业公司的整体表现。中债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的反映债券全市场整体价格和投资回报情况的指数，具有很高的代表性。综合考虑基金资产配置与市场指数代表性等因素，本基金选用中证TMT产业主题指数、中证新兴产业指数和中债总指数加权作为本基金的投资业绩评价基准。

在本基金的运作过程中，如果法律法规变化或者出现更有代表性、更权威、更为市场普遍接受的业绩比较基准，则基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后公告，对业绩比较基准进行变更，而无需召开基金份额持有人大会。

**十、基金的风险收益特征**

本基金是一只混合型证券投资基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

**十一、基金的投资组合报告**

投资组合报告截止日为2015年3月31日。

1、 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 621,158,620.80 | 91.42 |
|  | 其中：股票 | 621,158,620.80 | 91.42 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
|  | 其中：债券 | - | - |
|  | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
|  | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 49,922,880.08 | 7.35 |
| 7 | 其他资产 | 8,361,201.63 | 1.23 |
| 8 | 合计 | 679,442,702.51 | 100.00 |

2、 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 236,437,060.94 | 35.47 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 23,431,891.78 | 3.52 |
| F | 批发和零售业 | 46,488,624.62 | 6.97 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 59,068,800.00 | 8.86 |
| H | 住宿和餐饮业 | 15,584,600.00 | 2.34 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 185,327,774.73 | 27.81 |
| J | 金融业 | 275,850.00 | 0.04 |
| K | 房地产业 | 8,241,279.69 | 1.24 |
| L | 租赁和商务服务业 | 12,608,000.00 | 1.89 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,118,000.00 | 0.62 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 11,272,800.00 | 1.69 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 18,303,939.04 | 2.75 |
| S | 综合 | - | - |
|  | 合计 | 621,158,620.80 | 93.19 |

3、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300253 | 卫宁软件 | 308,786 | 50,362,996.60 | 7.56 |
| 2 | 600029 | 南方航空 | 5,700,000 | 45,144,000.00 | 6.77 |
| 3 | 600536 | 中国软件 | 609,373 | 31,474,115.45 | 4.72 |
| 4 | 000566 | 海南海药 | 1,029,955 | 30,270,377.45 | 4.54 |
| 5 | 002467 | 二六三 | 1,020,000 | 25,959,000.00 | 3.89 |
| 6 | 300081 | 恒信移动 | 430,141 | 24,410,501.75 | 3.66 |
| 7 | 600570 | 恒生电子 | 208,068 | 22,654,443.84 | 3.40 |
| 8 | 600559 | 老白干酒 | 431,400 | 22,381,032.00 | 3.36 |
| 9 | 002121 | 科陆电子 | 814,080 | 22,313,932.80 | 3.35 |
| 10 | 002405 | 四维图新 | 519,490 | 21,195,192.00 | 3.18 |

4、 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

6、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8、 投资组合报告附注

1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2）基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

1） 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 468,592.47 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 18,290.10 |
| 5 | 应收申购款 | 7,874,319.06 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 8,361,201.63 |

1） 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

2） 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300081 | 恒信移动 | 24,410,501.75 | 3.66 | 临时停牌 |

**十二、基金的业绩**

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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为2015年3月31日。

1、 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

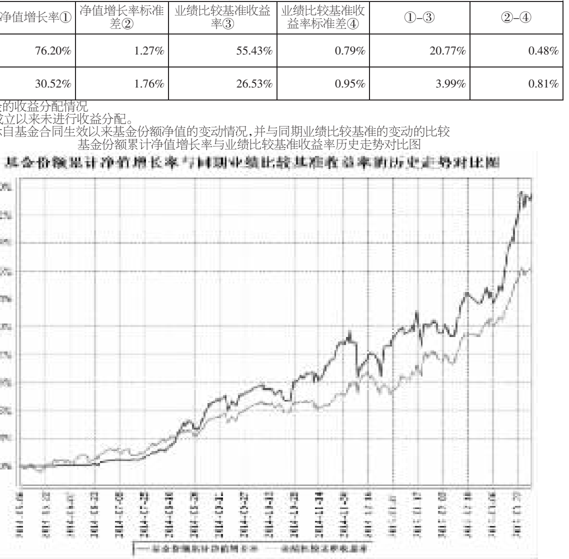
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自成立日至今 | 76.20% | 1.27% | 55.43% | 0.79% | 20.77% | 0.48% |
| 过去三个月 | 30.52% | 1.76% | 26.53% | 0.95% | 3.99% | 0.81% |

1、 基金的收益分配情况

本基金成立以来未进行收益分配。

2、 图示自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、图示日期为2014年5月6日至2015年3月31日。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。

2、2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三条（二）投资范围、（八）投资组合中规定的各项比例.本基金持有的股票占基金资产的比例为30%-95%，其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的80%；债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-70%。

**十三、基金的费用与税收**

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、基金合同生效以后的信息披露费用；
4、基金合同生效以后的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、基金的开户费用、账户维护费用；
9、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.50%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 1.50\%\div$当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 0.25\%\div$当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

3、本条第（一）款第3 至第9项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、基金合同生效前的相关费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。

（五）基金税收

根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

**十四、对招募说明书更新部分的说明**

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，本基金的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、 “三、基金管理人”部分，对董事会成员、总经理及其他高级管理人员和本基金基金经理作了更新。
2、 “四、基金托管人”部分，根据基金托管人提供的更新内容作了相应的更新。
3、 “五、相关服务机构”部分，更新了代销机构的相关信息；
4、 “九、基金的投资”部分，对基金投资组合报告作了更新。
5、 “十、基金的业绩”部分，对基金投资业绩作了更新。
7、“二十二、其他应披露事项”部分，根据前次招募说明书（更新）公布日至本次更新内容截止日的历次信息披露作了更新。

华泰柏瑞基金管理有限公司
二〇一五年六月十七日