华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）(摘要)

2016年第1号

华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2014年10月29日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2014】1132号）的注册，进行募集。本基金的基金合同于2014年12月17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注册，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、期货市场，基金净值会因为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12月16日，有关财务和业绩表现数据截止日为2015年9月30日，财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人中国建设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。

杨智雅女士：董事，硕士，曾就职于升强工业股份有限公司，华之杰国际商业顾问有限公司，1992年4月至1996年12月任AIG友邦证券投资顾问股份有限公司管理部经理，1997年1月至2001年7月任AIG友邦证券投资信托股份有限公司管理部经理、资深经理、协理，2001年7月至2010年2月任AIG友邦证券投资顾问股份有限公司副总经理、总经理、董事长暨总经理，2010年2月至今任柏瑞证券投资顾问股份有限公司董事长暨总经理、总经理。

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。2015年2月起任华泰柏瑞指数投资部总监。2015年5月起任华泰柏瑞中证500ETF及华泰柏瑞中证500ETF联接基金的基金经理。

童辉先生：监事，硕士。1997-1998年任上海众恒信息产业有限公司程序员，1998-2004年任国泰基金管理有限公司信息技术部经理，2004年4月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任信息技术与电子商务部总监。

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年任华安基金管理有限公司部门总监，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增强混合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混合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，2015年6月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式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年5月至2013年7月任职于全国社会保障基金理事会投资部，任处长；2013年7月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。

董元星先生：副总经理，博士。2006.9-2008.12任巴克莱资本（纽约）债券交易员，2009.3-2012.8任华夏基金管理有限公司基金经理。2012年8月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任固定收益部总监。2013年10月起任华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金的基金经理。2014年2月起任总经理助理。2015年12月起任公司副总经理。北京大学经济学学士，纽约大学STERN商学院金融学博士。

程安至先生：副总经理，硕士。1997.9-2001.1任中国工商银行上海市分行信贷经理，2001.2-2012.4任华安基金管理有限公司市场部销售总监。2012年5月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任总经理助理。2015年12月起任公司副总经理。本科毕业于华东师范大学国际金融专业，硕士毕业于上海财经大学国民经济学专业，EMBA毕业于上海交通大学中欧国际工商学院。

4、本基金基金经理

田汉卿女士，同上。

盛豪先生，英国剑桥大学数学系硕士。2007年10月至2010年3月任Wilshire Associates量化研究员，2010年11月至2012年8月任Goldenberg Hehmeyer Trading Company交易员。2012年9月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。2015年1月起任量化投资部副总监，2015年10月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金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。

5、投资决策委员会成员

主席：总经理韩勇先生；

成员：副总经理王溯舸先生；副总经理高山先生；副总经理田汉卿女士；副总经理兼固定收益部总监董元星先生；投资部总监方伦煜先生；投资部总监吕慧建先生

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、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
联系人：田 青
联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2015年6月末，本集团资产总额182,192亿元，较上年末增长8.81%；客户贷款和垫款总额101,571亿元，增长7.20%；客户存款总额136,970亿元，增长6.19%。净利润1,322亿元，同比增长0.97%；营业收入3,110亿元，同比增长8.34%，其中，利息净收入同比增长6.31%，手续费及佣金净收入同比增长5.76%。成本收入比23.23%，同比下降0.94个百分点。资本充足率14.70%，处于同业领先地位。

物理与电子渠道协同发展。总行成立了渠道与运营管理部，全面推进渠道整合；营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点达到1.44万个，综合营销团队达到19,934个，综合柜员占比达到84%，客户可在转型网点享受便捷舒适的“一站式”服务。加快打造电子银行的主渠道建设，有力支持物理渠道的综合化转型，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达94.32%，较上年末提高6.29个百分点；个人网上银行客户、企业网上银行客户、手机银行客户分别增长8.19%、10.78%和11.47%；善融商务推出精品移动平台，个人商城手机客户端“建行善融商城”正式上线。

转型重点业务快速发展。2015年6月末，累计承销非金融企业债务融资工具2,374.76亿元，承销金额继续保持同业第一；证券投资基金托管只数和新发基金托管只数均列市场第一，成为首批香港基金内地销售代理人中唯一一家银行代理人；多模式现金池、票据池、银联单位结算卡等战略性产品市场份额不断扩大，现金管理品牌“禹道”的市场影响力持续提升；代理中央财政授权支付业务、代理中央非税收入收缴业务客户数保持同业第一，在同业中首家按照财政部要求实现中央非税收入收缴电子化上线试点。“鑫存管”证券客户保证金第三方存管客户数3,076万户，管理资金总额7,417.41亿元，均为行业第一。

2015年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的40多项重要奖项。在英国《银行家》杂志2015年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《福布斯》杂志2015年全球上市公司2000强排名中继续位列第2；在美国《财富》杂志2015年世界500强排名第29位，较上年上升9位；荣获美国《环球金融》杂志颁发的“2015年中国最佳银行”奖项；荣获中国银行业协会授予的“年度最具社会责任金融机构奖”和“年度社会责任最佳民生金融奖”两个综合大奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工210余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2015年9月末，中国建设银行已托管537只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

（二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

（三）内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

（一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

（二）监督流程

1.每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3.根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

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

3）招商银行股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：李建红
联系人：邓炯鹏
电话：（0755）83198888
传真：（0755）83195109
客服电话：95555
公司网址：www.cmbchina.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或400-609-5537
公司网址：www.hrbb.com.cn

5）爱建证券有限责任公司
注册地址：上海浦东新区世纪大道1600号32层
办公地址：上海浦东新区世纪大道1600号32层
法定代表人：宫龙云
联系人：戴莉丽
电话：（021）32229888
传真：（021）68728703
客服电话：4001-962502
公司网站：www.ajzq.com

6）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：王星
电话：（022）28451922
传真：（022）28451892
客服电话：400-651-5988
公司网址：www.bhzq.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：吴军
电话：（0755）23838751
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：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：朱科敏
联系人：王一彦
电话：021-20333333
传真：021-50498825
客服电话：95531或400-8888-588
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：400-860-1555或96288
公司网址：www.dwzq.com.cn

11）国都证券股份有限公司
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

12）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：刘婧漪
电话：（028）86690057
传真：（028）86690126
客服电话：4006-600109
公司网址：www.gjzq.com.cn

13）申万宏源西部证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址：新疆乌鲁木齐市天山区文艺路233号宏源大厦8楼
法定代表人：李季
联系人：王君
电话：0991-7885083
传真：0991-2301802
客服电话：400-800-0562
公司网址：www.swhysc.com

14）华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福建省福州市五四路157号新天地大厦7-10层
法定代表人：黄金琳
联系人：徐松梅
电话：（0591）83893286
传真：（0591）87383610
客服电话：96326（福建省外请加拨0591）
公司网址：www.hfzq.com.cn

15）华泰证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市中山东路90号
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
联系人：庞晓云
电话：（0755）82569143
传真：（0755）82492962
客服电话：95597
公司网址：www.htsc.com.cn

16）华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b)单元
办公地址：上海市肇家浜路750号
法定代表人：俞洋
联系人：陈敏
电话：（021）64316642
传真：（021）64333051
客服电话：400-109-9918、021—32109999、029-68918888
公司网址：www.cfsc.com.cn

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：吴琼
电话：（0755）22621866
传真：（0755）82400862
客服电话：95511*8
公司网址：stock.pingan.com

18）中泰证券股份有限公司
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.zts.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
办公地址：上海市四川中路213号久事商务大厦7楼
法定代表人：龚德雄
联系人：许曼华
电话：021-53686888
传真：021-53686100，021-53686200
客服电话：021-962518
公司网址：www.962518.com

20）申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅
联系人：黄莹
电话：（021）33389888
传真：（021）33388224
客服电话：95523或4008895523
公司网址：www.swhysc.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：尹伶
电话：（010）66045152
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）新时代证券股份有限公司
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：鹿馨方
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）中国国际金融股份有限公司
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：高涛
联系人：刘毅
电话：（0755）82023442
传真：（0755）82026539
客服电话：95532
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）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人：林卓
联系人：薛长平
电话：0411-88891212
传真：0411-88891212
客服电话：400-641-1999
公司网址：www.taichengcaifu.com

30）一路财富（北京）信息科技有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街9号院5号楼702室
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界A座2208
法定代表人：吴雪秀
联系人：段京璐
电话：010-88312877
传真：010-88312099
客服电话：400-001-1566
公司网址：www.yilucaifu.com

31）大同证券有限责任公司
注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座12、13层
法定代表人：董祥
联系人：薛津
电话：0351-4130322
传真：0351-7219891
客服电话：400-712-1212
公司网址：http://www.dtsbc.com.cn

32）嘉实财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元
办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人：赵学军
联系人：余永键
电话：010-85097570
传真：010-85097308
客服电话：400-021-8850
公司网址：www.harvestwm.cn

33）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：刘潇
电话：021-20691942
传真：021-2069-1861
客服电话：400-820-2899
公司网站：www.erichfund.com

34）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：胡锴隽
电话：021-20613635
传真：021-68596916
客服电话：400-700-9665
公司网址：www.ehowbuy.com

35）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：朱玉
电话：021-54509988-1071
传真：021-64383798
客服电话：400-181-8188
公司网址：www.1234567.com.cn

36）深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-33227951
客服电话：4006-788-887
公司网址：www.jjmmw.com；www.zlfund.cn

37）北京展恒基金销售股份有限公司
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：翟飞飞
电话：010-62020088-6006
传真：010-62020355
客服电话：400-888-6661
公司网址：www.myfp.com

38）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：吴强
电话：0571-88911818
传真：0571-86800423
客服电话：4008-773-772
公司网站：www.5ifund.com

39）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：朱晓超
客服电话：4000-766-123
公司网站：http://www.fund123.cn

40）中期资产管理有限公司
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：北京市朝阳区光华路16号中期大厦A座8层
法定代表人：姜新
联系人：侯英建
电话：010-65807865
传真：010-65807864
客服电话：010-65807865
公司网站：www.cifcofund.com

41）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：吴卫东
电话：021-20835787
客服电话：400-920-0022
公司网址：licaike.hexun.com

42）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

43）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

44）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

45）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

46）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
电话：010-66154828-835
公司网址：www.5irich.com
客服电话：400-6262-818

47）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
电话：010-65617753
公司网址：www.haofunds.com
客服电话：4006-525-676

48）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
电话：021-33323999-8147

49）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：徐鹏
公司网址：http://m.leadfund.com.cn
客服电话：400-005-6355

50）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：高静
电话：010-57418829
传真：010-57569671
公司网址：www.qianjing.com
客服电话：400-893-6885

51）北京增财基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人：罗细安
联系人：李皓
电话：010- 67000988-6003
公司网址：www.zcvc.com.cn
客服电话：400-001-8811

52）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：中国上海市杨浦区昆明路508号B座12F
法定代表人：汪静波
联系人：谢远敏
电话：021-3850 9626
公司网址：www.noah-fund.com
客服电话：400-821-5399

53）上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：郭坚
联系人：陈思乐
公司网址：www.lufunds.com
客服电话：4008219031

54）北京乐融多源投资咨询有限公司
注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603
办公地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603
法定代表人：董浩
联系人：于婷婷
公司网址：www.jimufund.com
客服电话：400-068-1176

55）珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：珠海横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人：肖雯
联系人：钟琛
公司网址：www.yingmi.cn
客服电话：020-89629066

56）大泰金石投资管理有限公司
注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址：江苏省南京市秦淮区中山南路1号南京中心66楼
法定代表人：袁顾明
联系人：何庭宇
联系电话：021-22267987
公司网址：www.dtfunds.com
客服电话：400-928-2266

57）上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
法定代表人：燕斌
联系人：凌秋艳
公司网址：www.66zichan.com
客服电话：4000-466-788

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：廖海、刘佳

（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：单峰、张勇
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800

四、基金的名称

华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

灵活配置混合型

六、基金的投资目标

利用定量投资模型，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。

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（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证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（但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后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理，届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事宜按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会审议。

八、基金的投资策略

1、股票投资策略

本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。但在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可降至0%。

本基金运用的量化投资模型主要包括：

（1）多因子alpha模型——股票超额回报预测

多因子alpha模型以中国股票市场较长期的回测研究为基础，结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金alpha模型的因子可归为如下几类：价值（value）、质量（quality）、动量（momentum）、成长（growth）、市场预期等等。公司的量化投研团队会持续研究市场的状态以及市场变化，并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。

多因子alpha模型利用长期积累并最新扩展的数据库，科学地考虑了大量的各类信息，包括来自市场各类投资者、公司各类报表、分析师预测等等多方的信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适合调整各因子类别的具体组成及权重。

（2）风险估测模型——有效控制预期风险

本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施，有效控制投资组合的预期投资风险，并力求将投资组合的实现风险控制在目标范围内。

（3）交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩

本基金的交易成本模型既考虑固定成本，也考虑交易的市场冲击效应，以减少交易对业绩造成的负面影响。在控制交易成本的基础上，进行投资收益的优化。

（4）投资组合的优化和调整

本基金将综合考虑预期回报，风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将包括流动性和基本面信息较好的股票。投资组合构建完成后，本基金将充分考虑各种市场信息的变化情况，对投资组合进行相应调整，并根据市场的实际情况适当控制和调整组合的换手率。

2、固定收益资产投资策略

本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

固定收益资产包括债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等。

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对固定收益资产的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在固定收益资产投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

3、资产支持证券投资策略

在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。

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。

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，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、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。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。

（四）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。

（五）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。

（六）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

95%*沪深300指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）

沪深300指数是由中证指数有限公司编制的反映A股市场整体走势的指数，该指数从上海和深圳证券交易所中选取300只交易活跃、代表性强的A股作为成份股，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强且公信力较好的股票指数。本基金为灵活配置混合型基金，股票资产的投资比例最高可达基金资产的95%，在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，现金及到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金净资产的5%。因此，本基金适宜采用该业绩比较基准。

随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金，或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者推出更权威的能够代表本基金风险收益特征的指数，基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，与基金托管人协商一致后，对业绩比较基准进行相应调整，并报中国证监会备案并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，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9月30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	375,466,890.03	81.14
	其中：股票	375,466,890.03	81.14
2	固定收益投资	10,042,000.00	2.17
	其中：债券	10,042,000.00	2.17
	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	30,000,000.00	6.48
	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	37,617,987.00	8.13
7	其他资产	9,605,746.38	2.08
8	合计	462,732,623.41	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	1,206,839.52	0.26
B	采矿业	9,835,702.96	2.14
C	制造业	149,080,331.35	32.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,068,771.42	4.59
E	建筑业	24,045,590.68	5.23
F	批发和零售业	3,805,320.80	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	15,901,679.45	3.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	212,834.00	0.05
J	金融业	126,966,551.49	27.64
K	房地产业	21,807,604.36	4.75
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	1,535,664.00	0.33
S	综合	-	-
	合计	375,466,890.03	81.73

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	601318	中国平安	508,154	15,173,478.44	3.30
2	600000	浦发银行	764,049	12,706,134.87	2.77
3	000002	万 科A	992,000	12,628,160.00	2.75
4	601668	中国建筑	2,071,027	11,970,536.06	2.61
5	601166	兴业银行	764,400	11,129,664.00	2.42
6	601009	南京银行	749,843	10,880,221.93	2.37
7	000333	美的集团	384,936	9,711,935.28	2.11
8	002142	宁波银行	801,760	9,011,782.40	1.96
9	002202	金风科技	659,689	8,912,398.39	1.94
10	600999	招商证券	547,229	8,772,080.87	1.91

4、 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,042,000.00	2.19
	其中：政策性金融债	10,042,000.00	2.19
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	10,042,000.00	2.19

5、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150403	15农发03	100,000	10,042,000.00	2.19

6、 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序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

9、 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1512	沪深300股指期货1512	50	44,856,000.00	-11,461,680.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-11,461,680.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-11,461,680.00

（2）本基金投资股指期货的投资政策

根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期初，股指期货大幅贴水，我们选择买入相对便宜的股指期货替代一部分股票仓位，同时也提升了组合的流动性。

10、 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

（3）本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

11、 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情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（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情形。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,366,095.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	236,972.78
5	应收申购款	2,677.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,605,746.38

（4）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。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

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，投资者在作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9月30日。

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

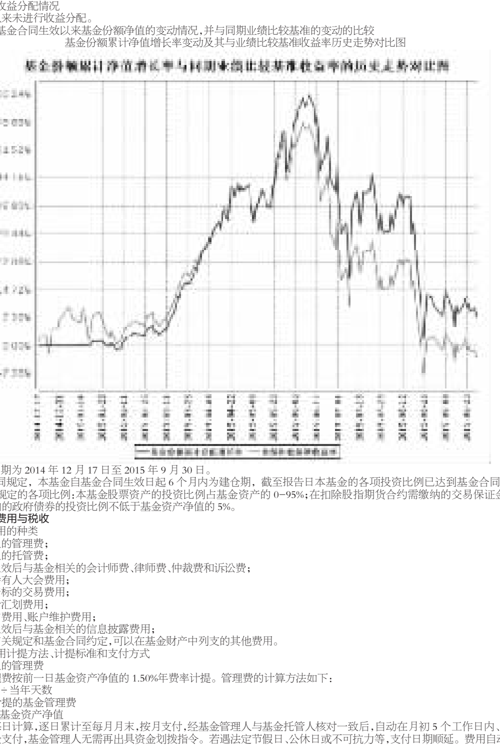
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-25.88%	3.58%	-27.06%	3.18%	1.18%	0.40%

2、 基金的收益分配情况

本基金成立以来未进行收益分配。

3、 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变动及其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12月17日至2015年9月30日。

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十二部分（二）投资范围中规定的各项比例：本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

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、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
4、基金份额持有人大会费用；
5、基金的投资标的交易费用；
6、基金的银行汇划费用；
7、基金的开户费用、账户维护费用；
8、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷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

基金托管费每日计算，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，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“（一）基金费用的种类中第3—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

下列费用不列入基金费用：

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）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

（五）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和基金托管费率，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，但法律法规要求提高该等报酬标准或费率的除外。

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，对监事会成员、总经理及其他高级管理人员和本基金基金经理、投资决策委员会成员作了更新。
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。
9、“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
二〇一六年一月二十九日