

华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金

更新的招募说明书

（摘要）

2013 年第 1 号

华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2007 年 5 月 8 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准友邦华泰积极成长混合型证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2007】131 号）和 2007 年 5 月 14 日《关于友邦华泰积极成长混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2007】120 号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于 2007 年 5 月 29 日正式生效。

本基金名称自 2010 年 4 月 30 日起，由“友邦华泰积极成长混合型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞积极成长混合”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司 2010 年 4 月 30 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

重要提示

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2012 年 11 月 28 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2012 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 号楼 17 层

成立日期：2004 年 11 月 18 日

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

联系人：沈炜

注册资本：贰亿元人民币

股权结构：PineBridge Investments LLC 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 年任华泰证券有限责任公司副总裁。

姜治平先生：董事，硕士，曾就职于 CR&R 环保公司、Unisys 优利系统日本有限公司，1994 年-2002 年任纽约银行梅隆资产管理公司高级投资组合经理，2003 年-2010 年任纽约梅隆资产管理公司亚太区行政总裁，2010 年-2011 年任纽约梅隆银行被动投资及交易型开放式指数证券投资基金全球主管，2012 年 3 月至今任柏瑞投资公司行政总裁。

吴祖芳先生：董事，硕士，1992 年起至今历任华泰证券有限责任公司部门负责人、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。

朱小平先生，独立董事，硕士，1983 年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。

2、监事会成员

常小抒先生：监事长，学士，2004-2007年任美国国际集团全球投资公司（现称柏瑞投资有限责任公司）资深财务分析师，2007年至今柏瑞投资亚洲有限公司亚洲区首席财务官。

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。

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年任华泰证券有限责任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年任华泰证券有限责任公司北京总部总经理。

房伟力先生：副总经理，硕士，1997-2001年任上海证券交易所登记结算公司交收系统开发经理，2001-2004年任华安基金管理有限公司基金登记及结算部门总监。2004-2008年5月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

4、本基金基金经理

方伦煜先生：管理学硕士，12年证券从业经历，历任广发证券股份有限公司行业研究员、招商证券有限公司投资经理、巨田基金管理有限公司研究员，广发证券股份有限公司投资经理。2008年6月至2010年2月任中国人寿资产管理有限公司投资经理，2010年2月至2012年2月任职于华安基金管理有限公司基金投资部，2012年3月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2012年4月起担任华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金经理。

历任本基金基金经理：

秦岭松先生，2007年5月至2012年2月担任本基金基金经理。

卞亚军先生，2011年1月至2012年4月担任本基金基金经理。

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；研究部副总监蔡静女士；投资部总监汪晖先生；田汉卿女士；固定收益部总监董元星先生；基金经理沈涛先生。

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、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；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 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、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: 肖钢

基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理: 李爱华

托管部门信息披露联系人: 唐州徽

电话: (010) 66594855

传真: (010) 66594942

(二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部,为进一步树立以投资者为中心的服务理念,中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,现有员工120余人。另外,中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前,中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII资产、QDII资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内,中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,为各类客户提供个性化的托管服务。2011年末,中国银行各类托管资产规模突破两万亿元,居同业前列。

(三) 证券投资基金托管情况

截至2012年6月末,中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优

势混合(LOF)、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数(LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数(LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证380指数增强型、泰达宏利中证500指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证300指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证500指数分级、招商优势企业灵活配置混

合型、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深 300 交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融 50 指数债券型、180 等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、嘉实海外中国股票 (QDII)、银华全球优选 (QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型 (QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型 (QDII)、信诚金砖四国积极配置 (QDII)、海富通大中华精选股票型 (QDII)、招商标普金砖四国指数 (LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选 (QDII)、大成标普 500 等权重指数 (QDII)、长信标普 100 等权重指数 (QDII)、博时抗通胀增强回报 (QDII)、华安大中华升级股票型 (QDII)、信诚全球商品主题 (QDII)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型 (QDII)、易方达标普全球高端消费品指数增强型、建信全球资源股票型等 164 只证券投资基金，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

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

最近一年内，中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

（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，立即通知基金管理人，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，应当立即通知基金管理人，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：上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：齐亮

电话：（021）38784638

传真：（021）50103016

联系人：沈炜

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：肖钢

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、中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

联系人：陈春林

传真：（010）68858117

客服电话：95580

公司网址：www.psbc.com

4、交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

联系人：吴中文

电话：（021）58781234

传真：（021）58408842

客服电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

5、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：傅育宁

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

6、平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

联系人：张青

电话：（0755）82088888

传真：（0755）25841098

客服电话：95501

公司网址：www.sdb.com.cn

7、中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：田国立

联系人：赵树林

电话：（010）65557046

传真：（010）65550828

客服电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

8、中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍

客服电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

9、北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

联系人：王曦

电话：010-66223584

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

10、华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：蒋驰

电话：（010）85237356

传真：（010）85238680

客服电话：95577

公司网址：www.hxb.com.cn

11、浙商银行股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市庆春路 288 号

办公地址：浙江省杭州市庆春路 288 号

法定代表人：张达洋

联系人：毛真海/刘坚

电话：0571-87659546/87659234

传真：0571-87659188

客服电话：95527

公司网址：www.czbank.com

12、嘉兴银行股份有限公司

注册地址：嘉兴市建国南路 409 号

办公地址：嘉兴市建国南路 409 号

法定代表人：许洪明

联系人：陈兢

电话：0573-82082676

传真：0573-82062161

客服电话：0573-96528

公司网址：www.bojx.com

13、爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市南京西路 758 号 24 楼

办公地址：上海浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：郭林

联系人：戴莉丽

电话：（021）32229888

传真：（021）68728703

客服电话：（021）63340678

公司网站：www.ajzq.com

14、安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：（0755）82825551

传真：（0755）82558355

客服电话：400-800-1001

公司网址：www.essence.com.cn

15、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：杜庆平

联系人：王兆权

电话：（022）28451861

传真：（022）28451892

客服电话：400-651-5988

公司网址：www.bhzq.com

16、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 楼

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 楼

法定代表人：周晖

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

17、财通证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：徐轶青

电话：（0571）87822359

传真：（0571）87818329

客服电话：96336（浙江），40086-96336（全国）

公司网址：www.ctsec.com

18、长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：（027）65799999

传真：（027）85481900

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司客服网址：www.95579.com

19、德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：姚文平

联系人：叶蕾

电话：（021）68761616

传真：（021）68767981

客服电话：400-888-8128

公司网址：www.tebon.com.cn

20、第一创业证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

法定代表人：刘学民

联系人：徐子婷

电话：（0755）82481522

传真：（0755）82485081

客服电话：400-888-1888

公司网址：www.firstcapital.com.cn

21、东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

电话：（0431）85096517

传真：（0431）85096795

客服电话：4006000686，（0431）85096733

公司网址：www.nesc.cn

22、东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴宇

电话：（021）63325888

传真：（021）63327888

客服电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

23、东海证券有限责任公司

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：朱科敏

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

24、东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：（010）66555316

传真：（010）66555246

客服电话：400-888-8993

公司网址：www.dxzq.net.cn

25、方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

联系人：郭军瑞

电话：（0731）85832503

传真：（0731）85832214

客服电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

26、光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨

电话：（021）22169999

传真：（021）22169134

客服电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

27、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

28、广州证券有限责任公司

注册地址：广东省广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

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 楼

法定代表人：刘东

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

29、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

30、国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：万建华

联系人：芮敏棋

电话：（021）38676666

传真：（021）38670666

客服电话：95521

公司网址：www.gtja.com

31、国信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：广东省深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：（0755）82130833

传真：（0755）82133302

客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

32、国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：李蔡

电话：（0551）2207939

传真：（0551）2645709

客服电话：95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

33、海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：（021）23219000

传真：（021）23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客服电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：www.htsec.com

34、恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：庞介民

联系人：扬子莹

电话：（0471）4974437

客服电话：（0471）4961259

公司网址：www.cnht.com.cn

35、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

36、华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

联系人：赵洁

电话：（021）68777222

传真：（021）68777822

客服电话：400-820-9898

公司网址：www.cnhbstock.com

37、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：张腾

电话：（0591）87383623

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

38、华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

电话：（0931）4890208

传真：（0931）4890118

客服电话：（0931）4890100、4890619、4890618

公司网址：www.hlzqgs.com

39、华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座三、五层

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号华融大厦 A 座五层

法定代表人：宋德清

联系人：梁宇

电话：（010）58568007

传真：（010）58568062

客服电话：（010）58568118；或前往各营业网点咨询

公司网址：www.hrsec.com.cn

40、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：万鸣

电话：（025）84457777

传真：（025）84579763

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

41、南京证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

联系人：李铮

电话：（025）52310585

传真：（025）52310586

客服电话：400-828-5888

公司网址：www.njzq.com.cn

42、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

43、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

44、山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：（0351）8686659

传真：（0351）8686619

客服电话：400-666-1618、（0351）95573

公司网址：www.i618.com.cn

45、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

46、申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：褚晓明

联系人：李清怡

电话：（021）54041654

传真：（021）54038844

客服电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.sywg.com

47、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：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：潘鸿

电话：（010）66045446

传真：（010）66045500

客服电话：（010）66045678

公司网址：www.txsec.com 或 www.txjijin.com

48、万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人：张建军

联系人：罗创斌

电话：（020）37865070

传真：（020）37865008

客服电话：400-888-8133

公司网址：www.wlzq.com.cn

49、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

50、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：高冠江

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

51、兴业证券股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 楼

法定代表人：兰荣

联系人：雷宇钦

电话：（0591）38507679

传真：

客服电话：400-888-8123

公司网址：www.xyzq.com.cn

52、招商证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：（0755）82960223

传真：（0755）82960141

客服电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

53、浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

办公地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

法定代表人：吴承根

联系人：李凌芳

电话：（021）64718888

传真：（0571）87901913

客服电话：（0571）967777

公司网址：www.stocke.com.cn

54、中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层

办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层

法定代表人：赵大建

联系人：李微

电话：（010）59355941

传真：（010）66553791

客服电话：400-889-5618

公司网址：www.e5618.com

55、中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

电话：（010）66568430

传真：（010）66568990

客服电话：400-888-8888

公司网址：www.chinastock.com.cn

56、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：杜航

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

57、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

58、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：周妍

电话：（0571）86811958

传真：（0571）85783771

客服电话：（0571）96598

公司网址：www.bigsun.com.cn

59、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：北京市朝阳区门内大街 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

60、中信万通证券有限责任公司

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(266061)

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：（0532）96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

61、中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

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：张于爱

电话：（010）60838888

传真：（010）60833739

客服电话：95558

公司网址：www.cs.ecitic.com

62、中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：许刚

联系人：李丹

电话：（021）68604866

传真：（021）50372474

客服电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

63、中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

联系人：程月艳、耿铭

电话：（0371）65585670

传真：（0371）65585665

客服电话：（0371）967218

公司网址：www.ccnew.com

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 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

电话：（021）38601777

传真：（021）38601799

联系人：陈培

（三）律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

经办律师：秦悦民、王利民

（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有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：单峰

经办注册会计师：薛竞、单峰

四、基金的名称

华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金以长期投资为基本原则。通过严格的投资纪律约束和风险管理手段，投资于具备持续突出增长能力的优秀企业，辅以特定市场状况下的大类资产配置调整，追求基金资产的长期稳定增值。

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、债券、现金、短期金融工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%—95%；现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-70%，其中，基金持有全部股改权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金投资组合中突出成长 A 类、高速稳定成长 B 类和高速周期成长 C 类股票的合计投资比例不低于股票资产的 80%。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

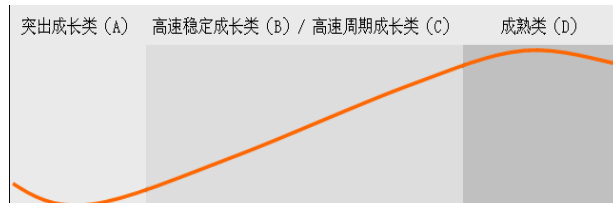
本基金以股票类资产为主要投资工具，通过精选个股获取资产的长期增值；通过适度的大类资产配置来降低组合的系统性风险。

本基金将“自上而下”的趋势投资和“自下而上”的个股选择相结合。投资决策的重点

在于寻找具有巨大发展潜力的趋势，发现并投资于有能力把握趋势并在竞争中处于优势的公司。

1、股票投资策略

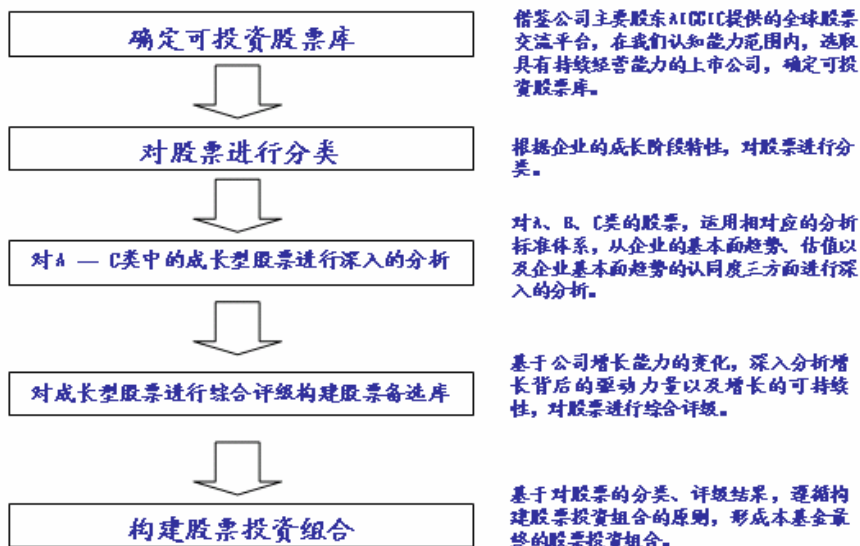
本基金借鉴外方股东的源于企业生命周期理论的全局股票分类标准，根据企业成长的阶段特性，将股票进行分类，主要投资于其中的突出成长（A类）、高速稳定成长（B类）和高速周期成长（C类）的公司。



A、B、C三类股票的主要特征如下：

	成长类别	主要特征
A	突出成长	新商业模式；创新科技、创新材料。
B	高速稳定成长	极强的定价能力，销售盈利稳定快速增长；极强的成本控制能力，能稳定快速占有市场。
C	高速周期成长	行业具有周期波动的特征，具有长期良好增长趋势，能通过产能扩张，不断扩大市场份额，在周期性波动中实现业绩增长。

(1) 具体股票投资流程图如下。



本基金将重点关注 A、B、C 三类企业经营状况中出现的新变化因素，判断这些因素是否会驱动行业或企业发展趋势出现良性的变化；依据企业近期销售收入、利润、现金流和经营利润率的变化去识别增长加速的企业；同时根据各个行业的经营特征和具体指标再加以横

向比较，以进一步确认行业或企业基本面的变化趋势。

（2）增长归因分析和三元复合评级

针对出现增长加速的行业或企业，在分析增长背后的驱动力量（这些力量包括技术的变革、消费者消费方式的变化、企业管理及经营模式的转型、或者政府政策的变化）的基础上，本基金将深入分析行业的竞争状况、企业的行业地位、产品的特性和市场需求的变化等因素来判断这些驱动力量所带来的增长是否具备持续性。

本基金借鉴外方股东的三元复合投资评级体系，从企业的基本面趋势、估值以及企业基本面趋势的认同度三方面对备选公司进行量化综合评级，按照一定的权重加总得出对该股票的综合评级。具体公式为：综合评级级别 = $X \times$ 企业基本面趋势的评级级别 + $Y \times$ 估值的评级级别 + $Z \times$ 企业基本面趋势的认同度的评级级别（ X 、 Y 、 Z 为设定权重）。

三元复合股票综合评级是构建股票备选库的重要环节，是基金经理投资决策的依据之一。如需调整，将由公司投资决策委员会根据基金经理和投资研究团队对市场形势等因素综合判断后的建议加以调整。

（3）股票投资组合的构建原则

本基金遵循自下而上的选股原则，基于对股票的分类、评级的结果进行股票组合的构建。本基金将重点投资于 A、B、C 三类满足成长性标准的股票，分享高速稳定成长类和高速周期成长类企业的发展带来的资本增值。对于处在成熟阶段的企业，本基金将本着审慎的原则，通过准确判断其基本面改善的概率，进行适度投资。

为了避免自下而上的选股方法造成的行业集中度过高而引起的组合流动性下降的风险，以及较高的组合非系统性风险，本基金将在对行业的基本面趋势、行业整体估值水平等因素进行深入研究的基础上，对股票组合进行适当的行业分布调整。

2、大类资产配置策略

大类资产配置策略是指“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%。大类资产配置策略不作为本基金的核心策略。但考虑到中国 A 股市场现阶段仍存在较大的系统性风险，本基金在某些特定的市场状况下会进行大类资产配置调整（股票投资的比例最低不低于 30%）。

本基金需要进行大类资产配置调整的特定市场状况主要指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的情况。

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。

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。

（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、投资分析团队对于宏观经济走势、宏观经济政策取向、行业增长速度等经济数据的量化分析的报告和建议；
- 3、投资分析团队对于企业和债券基础分析的报告和建议；
- 4、投资风险管理团队对于投资组合风险评估的报告和建议。

（三）投资决策机制

- 1、投资决策委员会负责审定基金经理的整体投资策略和原则；审定基金经理季度资产配置和调整计划；审定基金季度投资检讨报告；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日常管理。
- 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、研究部、数量化投资部和交易部通过自身研究及借助外部研究机构形成有关上市公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析以及数据模拟的各类报告，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上述报告对基金的投资方向、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，参考上述报告，并结合自身对证券市场和上市公司的分析判断，形成基金投资计划。
- 4、交易部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、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

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×60%+中信标普国债指数×40%

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人有权对此基准进行调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告，并在更新的招募说明书中列示。

本基金为混合型基金，在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后，选定被市场广泛认同的沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用了市场上通用的中信标普国债指数。

十、基金的风险收益特征

本基金属主动管理的混合型证券投资基金，为证券投资基金中的较高风险较高收益品种，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。本基金力争通过主动投资追求适度风险水平下的较高收益。

十一、基金的投资组合报告

投资组合报告截止日为 2012 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	1,839,583,800.50	89.97
	其中：股票	1,839,583,800.50	89.97
2	固定收益投资	79,744,000.00	3.90

	其中：债券	79,744,000.00	3.90
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	95,833,547.66	4.69
6	其他资产	29,453,972.09	1.44
7	合计	2,044,615,320.25	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	采掘业	168,309,528.83	8.26
C	制造业	586,904,889.87	28.82
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	118,209,001.19	5.80
C5	电子	145,348,989.10	7.14
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	165,887,624.83	8.14
C8	医药、生物制品	157,459,274.75	7.73
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	27,743,615.36	1.36
E	建筑业	36,849,934.05	1.81
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	35,790,974.26	1.76
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	574,989,539.32	28.23
J	房地产业	207,167,422.21	10.17
K	社会服务业	201,827,896.60	9.91
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,839,583,800.50	90.32

3、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	600547	山东黄金	2,194,666	91,561,465.52	4.50
2	600036	招商银行	8,920,352	90,630,776.32	4.45
3	002037	久联发展	3,573,877	89,918,745.32	4.41
4	601398	工商银行	23,649,956	88,687,335.00	4.35
5	601166	兴业银行	6,916,972	83,072,833.72	4.08
6	002025	航天电器	5,765,509	74,144,445.74	3.64
7	600000	浦发银行	9,799,930	72,323,483.40	3.55
8	000002	万科A	8,468,255	71,387,389.65	3.51
9	000776	广发证券	5,009,804	68,133,334.40	3.35
10	600048	保利地产	5,858,430	63,036,706.80	3.10

4、报告期末按券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	79,744,000.00	3.92
	其中：政策性金融债	79,744,000.00	3.92
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	79,744,000.00	3.92

5、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

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	120228	12 国开 28	800,000	79,744,000.00	3.92

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，也没有在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2) 基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3) 基金的其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,289,796.94
2	应收证券清算款	26,603,861.91
3	应收股利	-
4	应收利息	556,265.65
5	应收申购款	4,047.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,453,972.09

4) 报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截至本报告期末，本基金未持有处于转股期可转换债券。

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

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 2012 年 9 月 30 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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

基金合同生效至2007年12月31日	29.46%	1.45%	18.86%	1.39%	10.60%	0.06%
2008年	-43.14%	1.81%	-44.16%	1.83%	1.02%	-0.02%
2009年	43.16%	1.73%	52.60%	1.23%	-9.44%	0.50%
2010年	7.03%	1.40%	-5.99%	0.95%	13.02%	0.45%
2011年	-31.01%	1.26%	-13.97%	0.78%	-17.04%	0.48%
2012年前9个月	0.50%	1.14%	0.04%	0.77%	0.46%	0.37%
成立至2012-9-30	-21.80%	1.51%	-18.06%	1.23%	-3.74%	0.28%

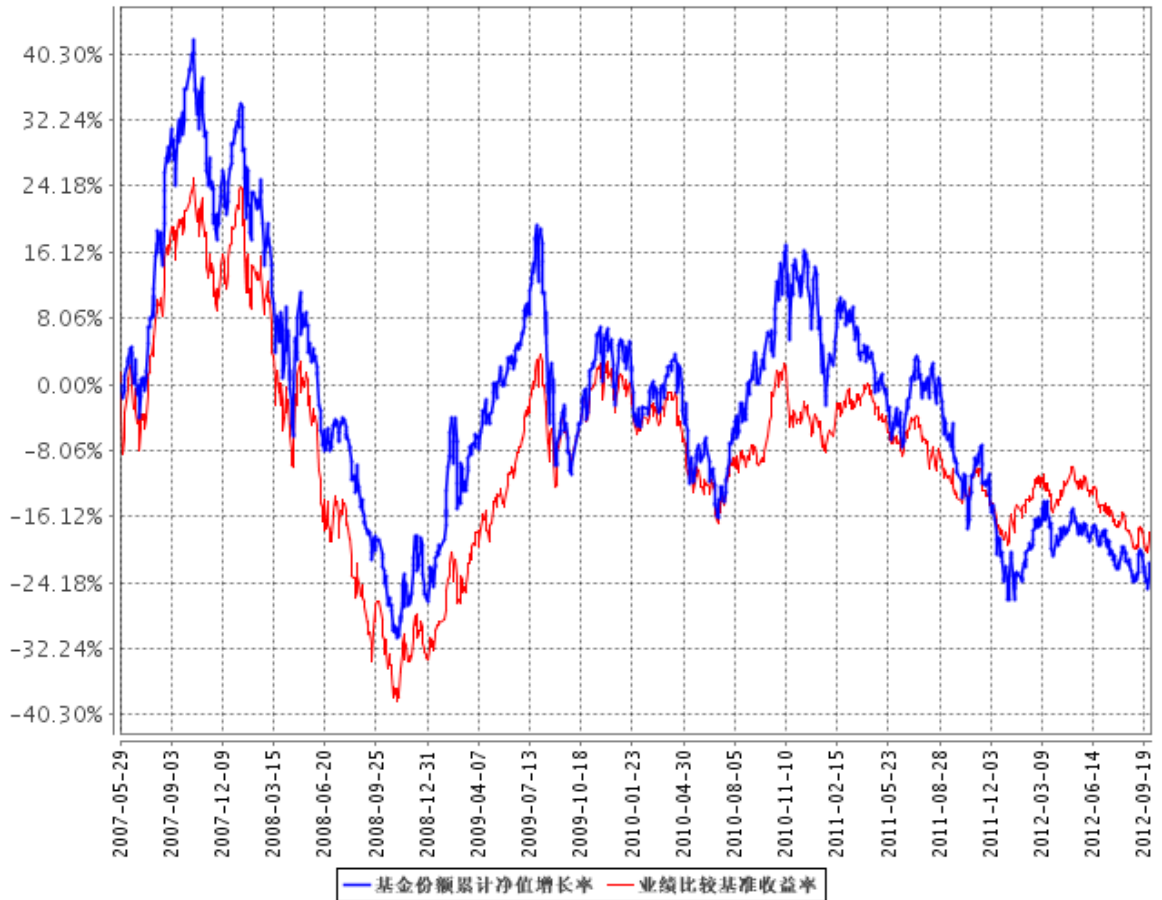
2、基金收益分配情况

期间	每 10 份基金份额分红数(元)	备注
基金合同生效日至 2007 年年底	—	—
2008 年	—	—
2009 年	—	—
2010 年	0.30	2010 年 1 月 18 日实施
2011 年	0.20	2011 年 1 月 14 日实施
合计	0.50	

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与业绩比较基准收益率历史走势对比图

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2007 年 5 月 29 日至 2012 年 9 月 30 日。

十三、基金的费用概览

（一）基金运作有关费用

1、基金运作费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- （4）基金合同生效以后的信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- （7）基金的资金汇划费用；
- （8）按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

2、基金运作费用的计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的基金管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5%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 1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 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、休息日等，支付日期顺延。

基金管理人可以降低基金管理费率，如降低基金管理费率，基金管理人最迟须于新的费率开始实施 3 个工作日前在中国证监会指定媒体公告。

（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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 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、休息日等，支付日期顺延。

3、本条第 1 款第（3）至第（8）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法律、法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。基金募集过程中所发生的会计师费和律师费从基金认购费用中列支，招募说明书、发售公告等信息披露费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

4、基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金管理费率、托管费率，无须召开基金份额持有人大会。如降低基金管理费率、托管费率，基金管理人最迟须于新的费率开始实施 3 个工作日前在中国证监会指定媒体公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、认购费

本基金认购费率按认购金额的大小分为不同档次，最高不超过 1.0%，如下表所示：

认购金额（元）	认购费率
认购金额 < 50 万	1.0%
50 万 ≤ 认购金额 < 100 万	0.8%
100 万 ≤ 认购金额 < 200 万	0.6%

200 万 ≤ 认购金额 < 500 万	0.4%
认购金额 ≥ 500 万	1000 元/笔

认购费将用于支付募集期间会计师费、律师费、注册登记费、销售费及市场推广等支出，不计入基金资产。

2、申购费

本基金的申购费用由投资人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。本基金采用前端收费的形式收取申购费用，申购费率按申购金额的大小分为不同档次，最高不超过 1.5%，具体如下表所示：

申购金额（元）	申购费率
申购金额 < 50 万	1.5%
50 万 ≤ 申购金额 < 100 万	1.2%
100 万 ≤ 申购金额 < 200 万	1.0%
200 万 ≤ 申购金额 < 500 万	0.6%
申购金额 ≥ 500 万	1000 元/笔

基金管理人可在法律法规允许的情况下，根据市场情况制定促销计划，在基金促销活动期间，基金管理人与基金托管人协商一致后，基金管理人可以对促销活动范围内的投资人调低基金申购费率。

3、赎回费

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。赎回费率随投资人持有本基金的时间的增加而递减，投资人持有本基金一年以内的，赎回费率为 0.5%，投资人持有本基金一年到两年之间的赎回费率为 0.25%，投资人持有本基金两年以上的赎回费为零。

如下表所示：

持有期限	赎回费率
持有期 < 一年	0.5%
一年 ≤ 持有期 < 两年	0.25%
持有期 ≥ 两年	0

4、转换费率

基金转换费由基金份额持有人承担，基金转换费率由基金管理人另行公告。

5、投资人通过网上交易方式办理基金申购或转换，适用网上交易费率，详见基金管理人网站的具体规定。

6、基金管理人与基金托管人协商一致后，可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更，基金管理人应最迟于新的费率实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。调整后的上述费率还将在最新的更新的招募说明书中列示。

7、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资人以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交一的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。

（三）不列入基金费用的项目

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资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金资产中列支。

（四）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律、法规的规定履行纳税义务。

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》及其他有关法律法规的要求，对本招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- 1、“三、基金管理人”部分，对董事会成员、监事会成员和投资决策委员会成员的相关信息作了更新。
- 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，对直销机构、代销机构等相关内容进行了更新。
- 4、“十、基金的投资”部分，对基金投资组合报告作了更新。
- 5、“十一、基金的业绩”部分，对基金投资业绩作了更新。
- 6、“二十三、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

二〇一三年一月十一日