

华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（摘要）

2017 年第 1 号

华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金）根据 2016 年 11 月 28 日中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）《关于准予华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2878 号）的注册，进行募集。本基金的基金合同于 2017 年 1 月 13 日生效。

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，基金净值会因为证券、期货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 2017 年 7 月 12 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2017 年 6 月 30 日，财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人杭州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

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 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 17 层

邮政编码：200135

法定代表人：贾波

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

贾波先生：董事长，学士，曾任职于工商银行江苏省分行，2001年7月至2016年11月在华泰证券工作，历任经纪业务总部技术主办、零售客户服务总部地区经理、南宁双拥路营业部总经理、南京长江路营业部总经理、企划部副总经理(主持工作)、北京分公司总经理、融资融券部总经理等职务。2016年12月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

翟军先生：董事，学士，曾任职于江苏省国际信托投资公司、信泰证券，2009年9月进入华泰证券工作，曾任零售客户服务总部总经理助理、经纪业务总部副总经理、浙江分公司总经理等职务。现任华泰证券股份有限公司上海分公司总经理。

RajeevMittal先生：董事，学士，1992年加入美国国际集团，2009年至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。

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。

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。

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。

李亦宜女士：独立董事，硕士，曾任职于LazardCo.旧金山办事处以及LazardAsia香港办事处，2010年至2013年曾担任

JapanResidentialAssetsManagementLimited 董事。2002 年至今历任 ArgyleStreetManagementLimited 基金经理、执行董事，2006 年至今同时担任新加坡上市公司 TIHLimited 董事。

文光伟先生：独立董事，博士，1983 年至 2015 年先后任中国人民大学会计系助教、会计系讲师、中国人民大学商学院会计系副教授、硕士生导师，1989 年 12 月至 1991 年 6 月期间兼职于香港普华会计公司审计部。2015 年 3 月从中国人民大学退休。

沈志群先生：独立董事，学士，1978 年至 1987 年先后在中国建筑科学研究院、国家建委政策研究室、国家建设部经济研究所从事研究工作，任研究室副主任，1987 年至 1997 年先后任国家计委投资研究所研究室主任、所长助理、副所长（副司级），1997 年任国家计委宏观经济研究院科研部主任（正司级），2000 年任国家计委（国家发改委）宏观经济研究院院长助理，2001 年至 2014 年任北京国宏物业管理有限公司（宏观院下属）总经理。2014 年退休，现任中国投资协会副会长。

2、监事会成员

何雅茵女士：监事会主席，2001-2004 年任安永会计师事务所金融服务审计，2004-2013 任施罗德投资香港财务部会计，2013 年任卓誉金融服务有限公司财务部经理，2014 年至今任柏瑞投资财务部助理副总裁。

刘晓冰先生：监事，二十二年证券从业经历。1993 年 12 月进入公司，曾任无锡解放西路营业部总经理助理、副总经理、总经理，无锡永乐路营业部负责人，无锡城市中心营业部总经理，无锡分公司总经理等职务。现任华泰证券股份有限公司苏州分公司总经理。

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。

王瀚舸先生：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。

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，2016年5月起任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理，2017年3月起任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年5月起任华泰柏瑞量化创优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

杨景涵先生，中山大学经济学硕士。特许金融分析师（CFA），金融风险管理师（FRM）。2004年至2006年于平安资产管理有
限公司，任投资分析师；2006年至2009年9月于生命人寿保险公司，历任投连投资经理、投资经理、基金投资部负责人。
2009年10月加入本公司，曾任专户投资部投资经理，2014年6月起任研究部总监助理。2015年4月起任华泰柏瑞新利灵活配
置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月起任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年8月起
任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月起任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金和
华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年11月起任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基
金经理。2016年12月起任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏
瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年1月起任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利
灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月起任华泰柏瑞价值精选
30灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起任华泰柏
瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

罗远航先生，清华大学应用经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司交易员、研究员、基金经理。2017年1月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2017年3月起任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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WilshireAssociates量化研究员，2010年11月至2012年8月任GoldenbergHehmeyerTradingCompany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，2016年12月任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年3月起任华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年4月起任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年6月起任华泰柏瑞精选回报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、依法募集资金，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它职责。

（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）利用基金财产或者职务之便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）侵占、挪用基金财产；

（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律法规或中国证监会禁止的其它行为。

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权益；

（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营成本，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) 基金托管人基本情况

名称：杭州银行股份有限公司(简称：杭州银行)

住所：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

办公地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：陈震山

成立时间：1996 年 9 月 25 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 26.2 亿元

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：中国证监会证监许可[2014]337 号

（二）基金托管人开展资产托管业务的情况

杭州银行自 2014 年 3 月获得中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会的核准，取得证券投资基金托管资格（证监许可[2014]337 号）。目前，杭州银行已全面开展了包括证券投资基金、基金公司资管产品、证券公司资管产品、信托计划、商业银行理财产品、期货公司资管产品、私募投资基金等各类资产托管业务。

截至 2016 年 12 月，资产托管业务余额 9400 亿元，客户数量接近 300 家，托管资产种类丰富，包括：证券投资基金、信托计划、证券公司客户资产管理计划、基金公司特定客户管理计划、商业银行理财资金、股权投资基金等。杭州银行已托管了易方达裕如混合基金、天弘弘运宝货币 A 基金、天弘弘运宝货币 B 基金、博时裕利纯债基金、浙商惠丰债券型基金、浙商惠享债券型基金、海富通瑞丰债券型基金等 9 只公募基金。目前正在与多家基金管理公司洽谈公募基金托管合作。

（三）基金托管人资产托管部情况介绍

1、资产托管业务的机构设置及人员配备

杭州银行于 2012 年 12 月成立了证券投资基金托管项目组，并于 2013 年 3 月由董事会同意在总行正式设立资产托管部，专门负责全行包括证券投资基金在内的各类资产托管业务的业务运行和管理工作，并与其他业务部门保持独立。

杭州银行股份有限公司于 2013 年 3 月由董事会同意在总行正式设立资产托管部，专门负责全行包括证券投资基金在内的各类资产托管业务的业务运行和管理工作，并与其他业务部门保持独立。

目前资产托管部有从业人员 26 名。其中设总经理 1 人，负责全面组织和协调资产托管部的相关工作。资产托管部设其他人员 25 人，并根据岗位职责分成 3 个组：托管营运组、市场发展组和综合服务组。部门 25 人全部获得基金从业资格，从事资金清算、估值核算、投资监督、信息披露、内部稽核监控业务的执业人员 25 人。

2014 年 3 月 17 日，杭州银行获得中国证监会和中国银行业监督管理委员会联合批复的证券投资基金托管业务资格。目前可以开展公募基金托管、银行理财托管、基金公司专户产品托管、基金子公司专户/专项产品托管、证券公司定向/集合资产管理计划托管、信托计划保管、私募基金托管等多项业务。

2、托管业务技术系统

杭州银行采购了业内广泛使用的深圳赢时胜公司开发的托管业务系统，具有完善的估值核算、资金清算、投资监督和信息披露等功能，具备良好的安全性、稳定性、开放性和可扩展性。

3、资产托管业务内部控制与风险管理情况

杭州银行建立了较为完善的法人治理结构，形成了从董事会、经营层到操作层，覆盖信用风险、市场风险、操作风险在内的全面风险管理体系，资产托管部也牢固树立风险意识，采取各种必要措施防范和化解风险。

（1）建立科学、严格的岗位分离制度

明确划分各岗位职责，系统运维、估值核算、资金清算、投资监督和内部稽核监控等重要岗位、人员严格分开，估值核算、资金清算、投资监督等能接触到基金交易数据的岗位人员进行物理分离。

（2）建立健全授权管理体系

制定了《杭州银行证券投资基金托管业务授权管理办法》，将授权管理贯穿于资产托管业务的始终，各岗位业务人员均在规定的授权范围内行使相应职责。

（3）建立完备的备份机制

资产托管的业务数据及其他重要数据每日进行安全备份，定期将数据完整、真实、准确地转储到不可更改的介质上，并要求集中和异地保存，保存期限至少 20 年。资产托管部关键岗位人员也采用双人备份制度。

（4）建立完备有效的应急措施

制定了《杭州银行证券投资基金托管业务应急处理管理办法》，并针对托管业务备份、信息系统及资金清算等业务制定了专门的应急预案，对于各类突发事件、紧急事件或故障，定期开展应急演练，检验应急预案的有效性和可靠性。

（5）建立严格的保密机制

制定了《杭州银行证券投资基金托管保密管理办法》，资产托管部配备独立的门禁系统，严格禁止无关人员进入资产托管部办公区域，能接触到基金交易数据的岗位人员进行物理分离，并采用电话录音、监控录像、信息加密传递技术手段来实现风险控制。

（6）建立有效的内部稽核机制

资产托管部设立稽核监控岗，直接对资产托管部总经理负责，独立对各岗位、各项业务实施全面的监督反馈，以确保我行资产托管各项业务合法合规、安全有效，切实履行托管人职责。

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：贾波

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) 爱建证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

法定代表人：钱华

联系人：王威雅

电话：（021）32229888

传真：（021）68728703

客服电话：4001-962502

公司网站：www.ajzq.com

2) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

联系人：庞晓云

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962（深圳）

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

3) 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：尹旭航

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

4) 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：宋明

电话：（010）66568450

传真：（010）66568990

客服电话：400-888-8888

公司网址：www.chinastock.com.cn

5) 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：苗明

电话：021-20691923

传真：021-2069-1861

客服电话：400-820-2899

公司网站：www.erichfund.com

6) 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：陆敏

电话：021-20211847

传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

7) 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：朱钰

电话：021-54509988-1071

传真：021-64383798

客服电话：400-181-8188

公司网址：www.1234567.com.cn

8) 深圳众禄金融控股股份有限公司

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

9) 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：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

电话：010-59601366-7024

传真：010-62020355

客服电话：4008188000

公司网址：www.myfp.com

10) 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：刘晓倩

电话：0571889118188653

传真：0571-86800423

客服电话：4008-773-772

公司网站：www.5ifund.com

11) 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：刘洋

电话：010-85650628

客服电话：400-920-0022

公司网址：licaik.hexun.com

12) 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：张得仙

电话：(010)-52413390

公司网址：www.yixinfund.com

客服电话：400-6099-200

13) 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：马勇

联系人：文雯

电话：(010) 58325395

公司网址: <http://8.jrj.com.cn/>

客服电话: 400-166-1188

14) 北京钱景基金销售有限公司

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: 陈剑炜

电话: 010-57418813

传真: 010-57569671

公司网址: www.qianjing.com

客服电话: 400-893-6885

15) 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: 程晨

公司网址: www.lufunds.com

客服电话: 4008219031

16) 北京虹点基金销售有限公司

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: 陈铭洲

公司网址: www.pintec.com

客服电话: 400-068-1176

17) 北京格上富信投资顾问有限公司

注册地址: 北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人: 李悦章

联系人: 张林

联系电话: 010-65983311

公司网址: www.igesafe.com

客服电话: 010-82350618

18) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

办公地址: 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院望京 SOHO 塔 319 层

法定代表人: 钟斐斐

联系人: 戚晓强

公司网址: <https://danjuanapp.com/>

客服电话: 4000618518

19) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

注册地址: 北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人: 钱昊旻

联系人: 孟汉霄

联系电话: 010-59336498

公司网址: www.jnlc.com

客服电话: 4008-909-998

20) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址: 北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址: 北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层

法定代表人: 陈超

联系人: 赵德赛

公司网址: <http://fund.jd.com>

客服电话: 95518

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：贾波

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：赵景云

（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、范佳斐

（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、曹阳

电话：021-23238888

传真：021-23238800

四、基金的名称

华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极灵活的合理资产配置，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资

产的持续稳健增值。

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、企业债、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）。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

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%；每个交易日日终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%。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金为混合型基金，以获取长期稳定收益为目标，在投资过程中实现风险和收益的优化平衡。根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的分析与比较，对股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整。

2、股票投资策略

本基金股票投资以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手，结合宏观经济走势及市场分析，根据市场估值与流动性优选个股，重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中的股票。

（1）行业配置策略

本基金将综合考虑以下因素，对各行业的投资价值进行综合评估从而对行业配置比例进行动态调整。

1) 宏观经济环境

本基金对证券市场基本面产生普遍影响的宏观经济环境进行研究分析，主要考虑的宏观经济指标包括 GDP 增长率、居民消费价格指数（CPI）、生产者价格指数（PPI）、采购经理人指数（PMI）、货币供应量（M0，M1，M2）的增长率等指标，判断实体经济在经济周期中所处的阶段。

2) 国家经济政策

本基金将密切关注国家宏观经济与产业经济层面相关政策导向对市场和相关行业的影响，包括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，重点投资于受益于国家政策变化、预期收益率较高的行业。

3) 各行业的发展前景

本基金将持续跟踪行业数据并结合投资研究团队的深入研究及实地调研，根据相关行业盈利水平的横向与纵向比较，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，并相应调整基金资产的行业配置进行调整，重点投资于行业景气度较高且具

有可持续性的行业。

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) 行业竞争格局

各行业内部的行业进入者的数量、各公司的竞争策略、各公司产品和服务等方面存在较大差异。本基金将重点投资于行业竞争格局良好的行业。

(2) 个股选择策略

本基金将采用自上而下与自下而上相结合的分析方法，通过扎实的案头基本面分析以及密切的实地调研工作，根据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，选取具有持续盈利预期、财务状况运行良好、公司治理结构完善、有独特及可鉴别的企业核心竞争力的上市公司，并结合估值水平分析，组成股票投资组合。当行业、公司的基本面、股票的估值水平出现较大变化时，本基金将对股票组合适时进行动态调整。

3、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、企业债、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。

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、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。

6、股指期货投资策略

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。

7、融资融券业务的投资策略

本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。待监管机构允许本基金参与融券交易业务后，在法律法规允许的范围内，在不改变基金的风险收益特征及对基金份额持有人无不利影响的前提下，本基金可参与相关业务，以提高组合的投资效率，从而更好地实现投资目标。具体参与投资的比例将按照届时相关法律法规的规定执行。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 50%+中债综合指数收益率 50%。

沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数，该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，抗操纵性强，并且有较高的知名度和市场影响力。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场、不同发行主体和期限，能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。综合考虑基金资产配置与市场指数代表性等因素，本基金选用沪深 300 指数和中债综合指数加权作为本基金的投资业绩评价基准。

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变更名称，或者市场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，其预期风险与预期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 2017 年 6 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 113,307,250.31 24.53

其中：股票 113,307,250.31 24.53

2 基金投资 --

3 固定收益投资 333,429,000.00 72.18

其中：债券 333,429,000.00 72.18

资产支持证券 --

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

7 银行存款和结算备付金合计 11,423,176.98 2.47

8 其他资产 3,809,417.74 0.82

9 合计 461,968,845.03 100.00

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 462,740.00 0.10

B 采矿业 6,898,036.00 1.50

C 制造业 46,362,349.93 10.05

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 675,206.00 0.15

E 建筑业 1,523,276.24 0.33

F 批发和零售业 1,338,255.00 0.29

G 交通运输、仓储和邮政业 5,563,115.75 1.21

H 住宿和餐饮业 447,150.00 0.10

I 信息传输、软件和信息技术服务业 5,252,139.00 1.14

J 金融业 27,924,832.09 6.05

K 房地产业 10,336,554.60 2.24

L 租赁和商务服务业 3,279,019.70 0.71

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 2,728,272.00 0.59

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 516,304.00 0.11

S 综合 --

合计 113,307,250.31 24.56

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	122,000	6,052,420.00	1.31
---	--------	------	---------	--------------	------

2	000002	万科A	152,000	3,795,440.00	0.82
---	--------	-----	---------	--------------	------

3	600019	宝钢股份	469,300	3,149,003.00	0.68
---	--------	------	---------	--------------	------

4	600816	安信信托	227,300	3,089,007.00	0.67
---	--------	------	---------	--------------	------

5	002195	二三四五	416,800	2,980,120.00	0.65
---	--------	------	---------	--------------	------

6	600383	金地集团	245,800	2,819,326.00	0.61
---	--------	------	---------	--------------	------

7	600688	上海石化	415,000	2,743,150.00	0.59
---	--------	------	---------	--------------	------

8	000069	华侨城A	271,200	2,728,272.00	0.59
---	--------	------	---------	--------------	------

9	002385	大北农	416,700	2,621,043.00	0.57
---	--------	-----	---------	--------------	------

10	000415	渤海金控	370,700	2,494,811.00	0.54
----	--------	------	---------	--------------	------

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	29,586,000.00	6.41
---	------	---------------	------

2	央行票据	--	--
---	------	----	----

3	金融债券	--	--
---	------	----	----

其中：政策性金融债 --

4	企业债券	--	--
---	------	----	----

- 5 企业短期融资券 --
- 6 中期票据 --
- 7 可转债（可交换债） --
- 8 同业存单 303,843,000.00 65.86
- 9 其他 --
- 10 合计 333,429,000.00 72.27

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 111710284 17 兴业银行 CD284 800,000 79,120,000.00 17.15
- 2 111711062 17 平安银行 CD062 500,000 48,955,000.00 10.61
- 3 111791646 17 宁波银行 CD027 500,000 48,925,000.00 10.60
- 4 111714093 17 江苏银行 CD093 500,000 48,375,000.00 10.49
- 5 111793257 17 南京银行 CD036 400,000 39,124,000.00 8.4

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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

2) 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

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 89,880.97

2 应收证券清算款 121,748.55

3 应收股利 -

4 应收利息 3,597,788.22

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 3,809,417.74

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 2017 年 6 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

华泰柏瑞裕利混合 A

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	—	—
----	-------	----------	-----------	--------------	---	---

过去三个月	3.28%	0.15%	2.58%	0.32%	0.70%	-0.17%
-------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

自成立起

2017 年 1

月 13 日	3.74%	0.12%	4.09%	0.30%	-0.35%	-0.18%
--------	-------	-------	-------	-------	--------	--------

华泰柏瑞裕利混合 C

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	—	—
----	-------	----------	-----------	--------------	---	---

过去三个月	3.23%	0.15%	2.58%	0.32%	0.65%	-0.17%
-------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

自成立起

2017 年 1

月 13 日	3.64%	0.12%	4.09%	0.30%	-0.45%	-0.18%
--------	-------	-------	-------	-------	--------	--------

2、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1、图示日期为 2017 年 1 月 13 日至 2017 年 6 月 30 日。

2、按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%；每个交易日日

终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%。

本基金合同于 2017 年 1 月 13 日生效，目前还在建仓期。

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、本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、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；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的投资标的的交易费用；
- 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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 10、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 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \times \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 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致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \times \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复

核后于次月首日起 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致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，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，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，由基金管理人代付给销售机构。

若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

上述（一）基金费用的种类中第 4—10 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项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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》、《公开募集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、重要提示部分，增加了基金合同生效时间等。
- 2、三、基金管理人部分，对总经理及其他高级管理人员和本基金基金经理的相关信息作了更新。

- 3、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。
- 4、五、相关服务机构部分，更新了代销机构的相关信息。
- 5、六、基金的募集部分，增加了基金募集结果等相关信息。
- 6、九、基金的投资部分，对基金投资组合报告作了更新。
- 7、十、基金的业绩部分，对基金投资业绩作了更新。
- 8、二十二、其他应披露事项部分，根据本基金合同生效之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

二〇一七年八月二十五日