

信息披露 Disclosure

华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2015年10月27日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事及董事会成员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。
基金托管人的高级管理人员及基金资产保管部门负责人根据本合同规定，于2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

投资人欲了解详细情况，请仔细阅读基金的招募说明书。

本基金报告期自2015年1月1日起至2015年9月30日止。

本基金名称由“华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金”，基金简称不变，基金代码保持不变。本基金，基金管理人等在内的详细内容见我公司2015年8月16日发布的《基金更名及修改基金合同的公告》。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞盛世中国混合
交易代码	460001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月27日
报告期末基金份额总额	2,494,063,699.02份

投资目标 主要通过投资选择，辅以适度的大类资产配置调整，力求管理资产的长期稳健增值。

投资策略 本基金是以股票为主要投资工具，通过构造个股投资组合的长期投资，以价值投资为原则，综合考虑宏观经济环境、行业景气度、估值水平、公司治理、盈利能力、成长性、流动性等因素，精选具有投资价值的股票，通过有效的风险管理，力求在风险与收益之间取得平衡。

业绩比较基准 中证800指数×70%+中证全债指数×30%

风险收益特征 稳健回报，按期收益

基金管理人 华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -443,612,263.36

2.本期利润 -591,967,326.11

3.期初现金份额净值 1.02347

4.期末现金份额净值 1,018,088,106.30

5.期末可供分配基金份额 0.7689

注：1.上表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。
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）所对应的可供分配的金额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2 目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

基金净值增长率走势图

注：图示日期为2006年4月27日至2015年9月30日。
1.按基金合同规定，本基金合同生效之日起六个月内为建仓期，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条（二）投资范围和（八）风险控制指标的各项比例，投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%，现金及到期一年以内投资品种的比例为基金净资产的10%-40%。
2.基金经理

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

张慧 本基金的基金经理 2013年9月16日起 - 8 经济学硕士，八年证券从业经验。2005年7月至2013年9月任华泰柏瑞基金管理有限公司研究员，2013年9月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，担任基金经理，高级研究员，基金经理助理，华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金基金经理。2015年1月起任华泰柏瑞华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金基金经理。

季皓 本基金的基本基金经理 2015年6月30日起 - 5 北京大学西方经济学硕士，2010年7月至2015年6月任华泰柏瑞基金管理有限公司研究员，基金经理，高级研究员，基金经理助理，华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金基金经理。2015年1月起任华泰柏瑞华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平公正交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人根据《证券投资基金管理办法》公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度安排和流程，从决策层、监督层和执行层三个层面严格控制不同基金之间可能的利益输送，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 公正交易行为的专项说明

报告期内，本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边平均成交量超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内本基金的盈滚策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内本基金的盈滚策略和业绩表现说明

本基金在2015年6月20日完成盈滚操作，净值增长率为1.02347。

4.4.2 报告期内本基金的盈滚策略和业绩表现说明

本基金在2015年6月20日完成盈滚操作，净值增长率为1.02347。

4.5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 8,931,981.13

2.本期利润 51,941,577.49

3.期初现金份额净值 0.9496

4.期末现金份额净值 904,026,326.02

5.期末可供分配基金份额 1020

注：1.上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。
2.本期的利润指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.2 基金净值表现

3.2.1 本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(%) 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 3.87% ±0.28% -2.15% ±0.28% -2.06% ±0.03%

3.2.2 目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

基金净值增长率走势图

注：1.图示日期为2015年6月20日至2015年9月30日。
2.按基金合同规定，本基金合同生效之日起六个月内为建仓期，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条（二）投资范围和（八）风险控制指标的各项比例，投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%，现金及到期一年以内投资品种的比例为基金净资产的10%-40%。
3.4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

张慧 本基金的基金经理 2013年9月16日起 - 8

季皓 本基金的基本基金经理 2015年6月30日起 - 5

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平公正交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人根据《证券投资基金管理办法》公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度安排和流程，从决策层、监督层和执行层三个层面严格控制不同基金之间可能的利益输送，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 公正交易行为的专项说明

报告期内，本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边平均成交量超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内本基金的盈滚策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内本基金的盈滚策略和业绩表现说明

本基金在2015年6月20日完成盈滚操作，净值增长率为1.02347。

4.4.2 报告期内本基金的盈滚策略和业绩表现说明

本基金在2015年6月20日完成盈滚操作，净值增长率为1.02347。

4.5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 8,931,981.13

2.本期利润 51,941,577.49

3.期初现金份额净值 0.9496

4.期末现金份额净值 904,026,326.02

5.期末可供分配基金份额 1020

注：1.上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。
2.本期的利润指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.2 基金净值表现

3.2.1 本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(%) 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 3.87% ±0.28% -2.15% ±0.28% -2.06% ±0.03%

3.2.2 目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

基金净值增长率走势图

注：1.图示日期为2015年6月20日至2015年9月30日。
2.按基金合同规定，本基金合同生效之日起六个月内为建仓期，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条（二）投资范围和（八）风险控制指标的各项比例，投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%，现金及到期一年以内投资品种的比例为基金净资产的10%-40%。
3.4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

方伟 基金经理 2015年6月20日 - 12 经济学硕士，历任华泰柏瑞基金管理有限公司研究员，高

级研究员，基金经理助理，华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金基金经理，2007年2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，华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金基金经理，2007年6月至今任华泰柏瑞基金管理有限公司研究员，高

级研究员，基金经理助理，华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平公正交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人根据《证券投资基金管理办法》公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度安排和流程，从决策层、监督层和执行层三个层面严格控制不同基金之间可能的利益输送，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 公正交易行为的专项说明

报告期内，本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边平均成交量超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内本基金的盈滚策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内本基金的盈滚策略和业绩表现说明

本基金在2015年6月20日完成盈滚操作，净值增长率为1.02347。

4.4.2 报告期内本基金的盈滚策略和业绩表现说明

本基金在2015年6月20日完成盈滚操作，净值增长率为1.02347。

4.5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 8,931,981.13

2.本期利润 51,941,577.49

3.期初现金份额净值 0.9496

</