

# 华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书(摘要)

2016年第1号

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2015年3月25日中国证监会《关于核准华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金注册的批文》(证监许可[2015]439号)的注册,进行募集。本基金的基金合同于2015年6月3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。本基金招募说明书由中基会监会注册,由中基会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做出实质性判断或保证,也不表示投资于本基金没有风险。

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

华泰柏瑞证券、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种风险,包括但不限于系统性风险、非系统性风险、流动性风险、基金管理人在基金投资实施过程中产生的基金管理风险等。

投资者购买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品种,并且中长期持有。

本更新招募说明书中截止日为2015年12月2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。

本基金托管人中国工商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:齐平

成立日期:2004年11月18日

批准设立机关:中国证监会监督管理委员会

批准设立文号:中国证监会证监基字[2004]178号

经营范围:基金销售业务;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:人民币1亿元人民币

存续期间:持续经营

联系人:汪莹莹

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%,苏州高新区高新技术产业投资有限公司2%。

(二)主要人员情况

1.董事会成员

齐平先生:董事长,硕士,1994-1998年任国务院发展研究中心情报处长、副局长,1998-2001年任中央财经领导小组办公室副主任,2001年至2004年任华泰证券股份有限公司董事局主席。

杨智雅女士:董事,硕士,曾就职于原工商银行股份有限公司,华之杰国际商业有限公司,1992年4月至1996年12月任AIG友邦投资顾问有限公司,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经理、资深经理,协理,2001年7月至2010年任柏瑞证券投资基金有限公司董事长兼总经理、总经理。

吴祖芳先生:董事,硕士,1992年起至今任华泰证券股份有限公司部门负责人、子公司负责人、总助裁、总经理助理、总经济师、总裁助理。

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)执行董事,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总监(总裁),亚洲(日本除外),新兴市场投资总监,全权负责固定收益研究团队主管。

韩勇先生:董事,硕士,1997-1999年任长江证券有限公司投资银行部副总经理,2000-2001年任华泰基金管理有限公司总经理,2001年至2005年任华泰证券集团有限公司董事局董事长,总经理。

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月任罗威永(前容道永道会计师)高级核稿员,1988年12月至1990年4月任港资电讯(前大东日报)管理会计,1990年5月至1996年11月任宝达证券(施罗德集团)财务总监,1996年12月至2007年12月任施罗德投资管理(香港)有限公司财务总监,2008年1月至2012年9月任施罗德投资有限公司首席财务官。

陈念良先生:独立董事,硕士,1997-2003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年任华泰汽车租赁有限公司财务总监,2001年至2004年任华泰基金管理有限公司高级基金经理,2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任基金客户服务部总监、上证红利ETF基金经理,上证红利ETF基金经理,2010年1月起任华泰柏瑞量化增强型基金基金经理,2012年5月起任华泰柏瑞深证300ETF及华泰柏瑞深证300ETF联接基金基金经理。2015年6月起任华泰柏瑞量化基金基金经理。

童辉先生:监事,硕士,1997-1998年任上海恒信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.高级管理人员及其他高级管理人员

韩勇先生:总经理,博士,曾就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4月任华泰基金管理有限公司总经理,2011年4月任华泰柏瑞基金管理有限公司。

王澜女士:副总监,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:副总监,硕士,2000-2001年任华泰汽车租赁有限公司财务总监,2001年至2004年任华泰基金管理有限公司高级基金经理,2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任基金客户服务部总监、上证红利ETF基金经理,上证红利ETF基金经理,2010年1月起任华泰柏瑞量化增强型基金基金经理,2012年5月起任华泰柏瑞深证300ETF及华泰柏瑞深证300ETF联接基金基金经理。

童辉先生:副总监,硕士,1997-1998年任上海恒信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。

4.基金经理

田汉卿女士,硕士,2012年8月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,2013年10月起任华泰柏瑞量化增强型基金基金经理,2015年3月起任华泰柏瑞量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年6月起任华泰柏瑞量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

5.投资决策委员会成员

主席:总经理助理齐平先生;

委员:副总监柳军先生;副总经理高鹏先生;副总经理田汉卿女士;总经理助理兼固定收益部总监董元星先生;投资部总监方伦生先生;投资部总监吕慧建先生;

列席人员:督察长陈晓女士;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,建立健全内部控制制度,监督与稽核、财务管理及人事管理等制度,确保所管理的基金财产和基金管理人的财产相对独立,对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券估值;

4.按照基金合同的约定定期编制基金会计报告;

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,确定基金份额的申购、赎回价格;按有关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申购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律法规的规定;

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.保存基金份额持有人名册,代表基金份额持有人行使权利或者实施其他法律行为;

11.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;

12.中国证监会规定的其他职权。

(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,防止出现违反有效的有关法律、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,防止下述行为发生:

(1)将自有资金或者他人资金混同于基金财产从事证券投资;

(2)不公平对待不同类别基金财产;

(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)泄密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)法律允许或中国证监会禁止的其他行为。

3.本基金管理人承诺加强职业道德,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,不从事以下行为:

(1)越权从事投资经营;

(2)违反基金合同和托管协议;

(3)损害基金份额持有人利益或者其他基金相关机构的利益;

(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;

(5)拒绝、干扰、阻挠或者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)贬低同行,抬高自己;

(10)以不正当手段谋取个人利益;

(11)有悖社会公德,损害社会公共利益基金投资人形象;

(12)在公开披露信息中故意含有虚假、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其他行为。

4.基金管理人承诺

(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、雇员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)不从事损害基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

5.内部控制的原则

(1)完整性原则。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适应经营需要的机构,各部门和岗位能够在保持相对独立、内部制衡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)相互制约的原则。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。

(7)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议;董事会下设薪酬、考核与提名委员会,对基金管理人、董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的聘任进行审核;考核与提名委员会对基金管理人的任职资格,制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监等高级管理人员的薪酬和福利政策;

(2)控制活动。控制委员会对内部控制制度的执行情况进行审查,发现重大风险事件时向公司董事会报告;

(3)控制活动。控制委员会对内部控制制度的执行情况进行审查,发现重大风险事件时向公司董事会报告;

(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递渠道和自下而上的信息汇报制度,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,以及对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、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议;董事会下设薪酬、考核与提名委员会,对基金管理人、董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的聘任进行审核;考核与提名委员会对基金管理人的任职资格,制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监等高级管理人员的薪酬和福利政策;

(6)内部监控。内部监控由公司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议;董事会下设薪酬、考核与提名委员会,对基金管理人、董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的聘任进行审核;考核与提名委员会对基金管理人的任职资格,制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监等高级管理人员的薪酬和福利政策;

(7)内部监控。内部监控由公司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议;董事会下设薪酬、考核与提名委员会,对基金管理人、董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的聘任进行审核;考核与提名委员会对基金管理人的任职资格,制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监等高级管理人员的薪酬和福利政策;

(8)内部监控。内部监控由公司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议;董事会下设薪酬、考核与提名委员会,对基金管理人、董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的聘任进行审核;考核与提名委员会对基金管理人的任职资格,制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监等高级管理人员的薪酬和福利政策;

(9)内部监控。内部监控由公司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议;董事会下设薪酬、考核与提名委员会,对基金管理人、董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的聘任进行审核;考核与提名委员会对基金管理人的任职资格,制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监等高级管理人员的薪酬和福利政策;

(10)内部监控。内部监控由公司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议;董事会下设薪酬、考核与提名委员会,对基金管理人、董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的聘任进行审核;考核与提名委员会对基金管理人的任职资格,制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监等高级管理人员的薪酬和福利政策;

(11)内部监控。内部监控由公司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议;董事会下设薪酬、考核与提名委员会,对基金管理人、董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的聘任进行审核;考核与提名委员会对基金管理人的任职资格,制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监等高级管理人员的薪酬和福利政策;

(12)内部监控。内部监控由公司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议;董事会下设薪酬、考核