（上接B059版）

37）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
38）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
39）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
40）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
41）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
42）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
43）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
44）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
45）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

四、基金的名称

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

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。

九、基金的业绩比较基准

95%*中证500指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）

中证500指数由中证指数有限公司编制并发布。它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的中小市值股票，综合反映了沪深证券市场内中小市值公司的整体状况。

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

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。 基金托管人中国银行根据本合同规定，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。 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	380,867,609.47	67.33
	其中：股票	380,867,609.47	67.33
2	固定收益投资	20,074,000.00	3.55
	其中：债券	20,074,000.00	3.55
	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	100,000,000.00	17.68
	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	54,158,488.71	9.57
7	其他资产	10,570,607.00	1.87
8	合计	565,670,705.18	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	4,806,298.00	0.85
B	采矿业	10,995,932.30	1.95
C	制造业	275,251,734.46	48.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,003,127.70	2.31
E	建筑业	15,279,000.51	2.71
F	批发和零售业	14,540,593.12	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	11,812,775.07	2.10
H	住宿和餐饮业	2,260,491.00	0.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,966,765.50	0.88
J	金融业	739,390.80	0.13
K	房地产业	20,589,170.61	3.66
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	3,705,082.40	0.66
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	2,917,248.00	0.52
S	综合	-	-
	合计	380,867,609.47	67.64

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	002202	金风科技	617,132	8,337,453.32	1.48
2	002179	中航光电	216,140	7,655,678.80	1.36
3	601668	中国建筑	1,266,400	7,319,792.00	1.30
4	600973	宝胜股份	639,680	7,177,209.60	1.27
5	002080	中材科技	434,800	6,948,104.00	1.23
6	002538	司尔特	684,316	6,843,160.00	1.22
7	600176	中国巨石	318,743	6,674,478.42	1.19
8	603001	奥康国际	259,679	6,595,846.60	1.17
9	002588	史丹利	297,321	6,478,624.59	1.15
10	000418	小天鹅A	340,500	6,363,945.00	1.13

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	20,074,000.00	3.56
	其中：政策性金融债	20,074,000.00	3.56
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	20,074,000.00	3.56

5、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	150307	15进出07	100,000	10,052,000.00	1.79
2	140230	14国开30	100,000	10,022,000.00	1.78

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、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
IC1512	IC1512	40	44,566,400.00	-9,002,800.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-9,002,800.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-9,002,800.00

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资“的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

9、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，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

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况。

3） 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,067,334.08
2	应收证券清算款	962,043.99
3	应收股利	-
4	应收利息	539,147.35
5	应收申购款	2,081.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,570,607.00

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：本基金期末投资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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。 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。基金的业绩报告截止日为2015年9月30日。

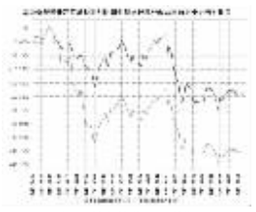
1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-15.29%	3.24%	-29.76%	3.82%	14.47%	-0.58%
基金成立至2015年9月30日	-19.21%	2.89%	-41.92%	3.72%	22.71%	-0.83%

2、基金的收益分配情况

本基金未实施过收益分配。

3、图示自基金合同生效以来基金份额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



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，经基金托管人复核后于次月首日起2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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

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0.25%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2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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

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，无需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、“重要提示”部分，增加了基金合同生效时间等相关信息。
2、“三、基金管理人”部分，对董事会成员、监事会成员、总经理及其他高级管理人员、投资决策委员会成员作了更新。
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，增加了募集结果的相关内容。
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
二〇一六年一月十四日

华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金获配16深燃气CP001的公 告

华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“本公司”)所管理的华泰柏瑞货币市场证券投资基金参加了深圳市燃气集团股份有限公司2016年度第一期短期融资券（16深燃气CP001）认购。该债券发行的承销团成员华泰证券股份有限公司为本公司关联方。

根据中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》等有关规定，本公司现将华泰柏瑞货币市场证券投资基金参加深圳市燃气集团股份有限公司2016年度第一期短期融资券认购的情况披露如下：

产品	分销买入	面值（万元）
华泰柏瑞货币市场证券投资基金	16深燃气CP001	9000

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2016年 1月14日

华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金收益分配公告

公告送出日期：2016年1月14日

1 公告基本信息

基金名称		华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金
基金简称		华泰柏瑞季季红债券
基金主代码		000186
基金合同生效日		2013年11月13日
基金管理人名称		华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人名称		中国建设银行股份有限公司
公告依据		《证券投资基金信息披露管理办法》、《华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金合同》、《华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金招募说明书》
收益分配基准日		2015年12月31日
截止收益分配基准日的相关指标	基准日基金份额净值（单位：人民币元）	1.047
	基准日基金可供分配利润（单位：人民币元）	19,712,831.45
	截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额（单位：人民币元）	17,741,548.31
本次分红方案（单位：元/10份基金份额）		0.2800
有关年度分红次数的说明		本次分红为2015年度第四次分红

注：根据《华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，每季度末基金份额可供分配利润超过0.01元时，本基金至少进行收益分配1次，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的50%，每年度末收益分配比例不得低于基金该年度末可供分配利润的90%。

2 与分红相关的其他信息

权益登记日	2016年1月19日
除息日	2016年1月19日
现金红利发放日	2016年1月20日
分红对象	权益登记日在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人
红利再投资相关事项的说明	选择现金红利再投资的投资者将其现金红利转基金份额的基金份额净值确定日为：2016年1月19日，选择现金红利再投资方式的投资者其红利再投资的基金份额将于2016年1月20日直接计入其基金账户，2016年1月21日起可以查询、赎回。
税收相关事项的说明	根据财政部、国家税务总局得相关规定，基金向投资者分配的基金收益暂免征收所得税。
费用相关事项的说明	本次分红免收分红手续费；选择现金红利再投资方式的投资者其现金红利再投资的基金份额免收申购费用。

3 其他需要提示的事项

1、权益登记日申请申购的基金份额不享有本次分红，权益登记日申请赎回的基金份额享有本次分红。

2、投资者可以在基金开放日的交易时间内到销售网点修改分红方式。本次分红确认的方式将按照投资者在权益登记日2016年1月19日之前（不含2016年1月19日）最后一次选择的分红方式为准。投资者可通过销售网点或通过华泰柏瑞基金管理有限公司的网站及客服热线查询所持有基金份额的分红方式，如需修改分红方式，请务必在规定时间前通过销售网点办理变更手续。

3、本次分红不会改变本基金的风险收益特征，也不会降低本基金的投资风险或提高本基金的投资收益。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2016年1月14日

华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金收益分配公告

公告送出日期：2016年1月14日

1 公告基本信息

基金名称		华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金
基金简称		华泰柏瑞积极成长混合
基金主代码		460002
基金合同生效日		2007年5月29日
基金管理人名称		华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人名称		中国银行股份有限公司
公告依据		《证券投资基金运作管理办法》、《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金招募说明书》
收益分配基准日		2015年12月31日
截止收益分配基准日的相关指标	基准日基金份额净值（单位：人民币元）	1.6896
	基准日基金可供分配利润（单位：人民币元）	994,852,166.58
	截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额（单位：人民币元）	248,713,041.65
本次分红方案（单位：元/10份基金份额）		1.7000
有关年度分红次数的说明		本次分红为2015年度第一次分红

注：根据《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金合同》约定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多6次；全年收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的25%，年度基金已实现净收益为994,852,166.58元。

2 与分红相关的其他信息

权益登记日	2016年1月19日
除息日	2016年1月19日
现金红利发放日	2016年1月20日
分红对象	权益登记日在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人
红利再投资相关事项的说明	选择现金红利再投资的投资者将其现金红利转基金份额的基金份额净值确定日为：2016年1月19日，选择现金红利再投资方式的投资者其红利再投资的基金份额将于2016年1月20日直接计入其基金账户，2016年1月21日起可以查询、赎回。
税收相关事项的说明	根据财政部、国家税务总局得相关规定，基金向投资者分配的基金收益暂免征收所得税。
费用相关事项的说明	本次分红免收分红手续费；选择现金红利再投资方式的投资者其现金红利再投资的基金份额免收申购费用。

3 其他需要提示的事项

1、权益登记日申请申购的基金份额不享有本次分红，权益登记日申请赎回的基金份额享有本次分红。

2、投资者可以在基金开放日的交易时间内到销售网点修改分红方式。本次分红确认的方式将按照投资者在权益登记日2016年1月19日之前（不含2016年1月19日）最后一次选择的分红方式为准。投资者可通过销售网点或通过华泰柏瑞基金管理有限公司的网站及客服热线查询所持有基金份额的分红方式，如需修改分红方式，请务必在规定时间前通过销售网点办理变更手续。

3、本次分红不会改变本基金的风险收益特征，也不会降低本基金的投资风险或提高本基金的投资收益。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2016年1月14日

华泰柏瑞基金管理有限公司关于上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金收益分配公告

公告送出日期：2016年1月14日

1 公告基本信息

基金名称		上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金
基金简称		华泰柏瑞上证中小盘ETF
基金主代码		510220
基金合同生效日		2011年1月26日
基金管理人名称		华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人名称		中国银行股份有限公司
公告依据		《证券投资基金信息披露管理办法》、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
收益分配基准日		2015年12月31日
截止收益分配基准日的相关指标	基准日基金份额净值（单位：人民币元）	4.719
	基准日基金可供分配利润（单位：人民币元）	7,661,261.37
	截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额（单位：人民币元）	-
本次分红方案（单位：元/10份基金份额）		0.39
有关年度分红次数的说明		本次分红为2015年度第一次分红

注：①根据《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的约定，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到1%以上时，可进行收益分配。

②本基金收益分配采取现金方式。

2 与分红相关的其他信息

权益登记日	2016年1月19日
除息日	2016年1月19日
现金红利发放日	2016年1月20日
分红对象	权益登记日在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人
红利再投资相关事项的说明	选择现金红利再投资的投资者将其现金红利转基金份额的基金份额净值确定日为：2016年1月19日，选择现金红利再投资方式的投资者其红利再投资的基金份额将于2016年1月20日直接计入其基金账户，2016年1月21日起可以查询、赎回。
税收相关事项的说明	根据财政部、国家税务总局得相关规定，基金向投资者分配的基金收益暂免征收所得税。
费用相关事项的说明	本次分红免收分红手续费；选择现金红利再投资方式的投资者其现金红利再投资的基金份额免收申购费用。

3 其他需要提示的事项

1、权益登记日申请申购的基金份额不享有本次分红，权益登记日申请赎回的基金份额享有本次分红。

2、投资者可以在基金开放日的交易时间内到销售网点修改分红方式。本次分红确认的方式将按照投资者在权益登记日2016年1月19日之前（不含2016年1月19日）最后一次选择的分红方式为准。投资者可通过销售网点或通过华泰柏瑞基金管理有限公司的网站及客服热线查询所持有基金份额的分红方式，如需修改分红方式，请务必在规定时间前通过销售网点办理变更手续。

3、本次分红不会改变本基金的风险收益特征，也不会降低本基金的投资风险或提高本基金的投资收益。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2016年1月14日

华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金获配非公开发行股票的公 告

华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“本公司”)所管理的华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金参加了合康变频（300048）非公开发行股票的认购。

根据中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》、《关于基金投资非公

开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关规定，本公司现将华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金获配非公开发行股票情况披露如下：

基金名称	华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金
获配股票	合康变频（300048）
获配数量（股）	5,586,381
总成本（元）	88,600,002.66
总成本占基金净资产（%）	2.28%
账面价值（元）	88,376,547.42
账面价值占基金净资产（%）	2.27%
限售期	12个月

注：基金资产净值、账面价值为2016年1月12日数据。

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2016年1月14日

华泰柏瑞基金管理有限公司关于上证红利交易型开放式指数证券投资基金收益分配公告

公告送出日期：2016年1月14日

1 公告基本信息

基金名称		上证红利交易型开放式指数证券投资基金
基金简称		华泰柏瑞上证红利ETF
基金主代码		510880
基金合同生效日		2006年11月17日
基金管理人名称		华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人名称		招商银行股份有限公司
公告依据		《证券投资基金信息披露管理办法》、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
收益分配基准日		2015年12月31日
截止收益分配基准日的相关指标	基准日基金份额净值（单位：人民币元）	2.836
	基准日基金可供分配利润（单位：人民币元）	297,675,443.77
	截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额（单位：人民币元）	-
本次分红方案（单位：元/10份基金份额）		0.50
有关年度分红次数的说明		本次分红为2015年度的第一次分红

注：①根据《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的约定，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到1%以上时，可进行收益分配。

②本基金收益分配采取现金方式。

2 与分红相关的其他信息

权益登记日	2016年1月19日
除息日	2016年1月20日
现金红利发放日	2016年1月25日
分红对象	权益登记日下午上海证券交易所交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的本基金全体基金份额持有人。
红利再投资相关事项的说明	-
税收相关事项的说明	根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。
费用相关事项的说明	-

注：一、收益发放办法

本公司于2016年1月21日将本基金收益分配的款项及代理发放收益的手续费足额划入中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的指定银行账户。中国证券登记结算有限责任公司上海分公司在2016年1月22日将已办理指定交易的投资者的现金红利金额通过资金结算系统划付给被指定交易的证券公司，投资者可在2016年1月25日领取现金红利。对未办理指定交易的投资者的现金红利暂由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司保管，待其办理指定交易并经确认后即将其尚未领取的现金红利划付给被指定交易的证券公司，投资者在办理指定交易后的第二个交易日可领取现金红利。

二、咨询方式

投资者可拨打本公司客户服务电话（400-888-0001）或登陆本公司网站（www. huatai-pb.com）获取相关信息。

3 其他需要提示的事项

-

华泰柏瑞基金管理有限公司
2016年1月14日

华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金收益分配公告

公告送出日期：2016年1月14日

1 公告基本信息

基金名称		华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金简称		华泰柏瑞沪深300ETF
基金主代码		510300
基金合同生效日		2012年5月4日
基金管理人名称		华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人名称		中国工商银行股份有限公司
公告依据		《证券投资基金运作管理办法》、《华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金合同》、《华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
收益分配基准日		2015年12月31日
截止收益分配基准日的相关指标	基准日基金份额净值（单位：人民币元）	3.7831
	基准日基金可供分配利润（单位：人民币元）	6,282,078,435.08
	截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额（单位：人民币元）	-
本次分红方案（单位：元/10份基金份额）		0.51
有关年度分红次数的说明		本次分红为2015年度的第一次分红

注：①根据《华泰柏瑞沪深300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的约定，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到1%以上时，可进行收益分配。

②本基金收益分配采取现金方式。

2 与分红相关的其他信息

权益登记日	2016年1月19日
除息日	2016年1月20日
现金红利发放日	2016年1月25日
分红对象	权益登记日下午上海证券交易所交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的本基金全体基金份额持有人，以及在权益登记日申购且当日未卖出本基金并于下一交易日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的基金份额持有人。