

华泰柏瑞创新升级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：中国工商银行股份有限公司
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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，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。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞创新升级			
交易代码	000066			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2014年04月16日			
报告期末基金份额总额	676,430,725.45份			
投资目标				
在有效控制风险的前提下，本基金追求基金资产的长期增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。				
投资策略				
本基金将采用积极的资产配置策略，精选行业，优化结构，力争通过资产配置与转型升级主题相结合，具备长期盈利能力提升的上市公司，力求实现基金资产的长期增值。				
业绩比较基准				
中证TMT产业主题指数收益率×20%+中证新产业指数收益率×40%				
基金管理人				
华泰柏瑞基金管理有限公司				
基金托管人				
中国工商银行股份有限公司				
§ 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	-170,262,748.38			
2.本期利润	-200,901,620.15			
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0518			
4.期末基金份额净值	661,228,102.70			
5.期末基金资产净值	1,766			
注：1.基金业绩指标包括持有人认购、申购（认沽）或赎回基金的各项费用，计上费用后实际收益水平要低于所列数字。 2.本公司已实现收益指基金利息收入、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 基金的表决权				
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①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率差额③=①-②	④=③/(①-②)
过去三个月	-20.25%	3.39%	-16.07%	-2.42%
过去一年	-32.05%	-16.07%	-15.98%	-0.07%
3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较				
注：1.图表示日期为2014年6月5日至2015年9月30日。 2.4 管理人报告				
4.1 基金经理／基金经理小组简介				
姓名	职务	任本基金的基金经理	证券从业年限	说明
张慧		本基金的基金经理	2014年5月6日	-
张慧：经济学硕士，8年证券从业经历，2007年7月至2010年6月任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员，2010年6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，2012年1月起任华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理，2014年6月起任华泰柏瑞创新升级混合型基金基金经理，2015年2月1日起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型基金基金经理。				
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的声明				
报告期内基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定，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				
报告期内，基金管理人根据《证券投资基金公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完备的制度及流程，从事前、事中和事后三个环节严格执行不同时区间利益输送，首先识别并判断可能对公平对待不同投资组合、不同账户的利益冲突，及时进行干预和调整，从而达到公平对待所有客户的目的。				
4.4 公平交易制度的执行情况				
报告期内，基金管理人根据《证券投资基金公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完备的制度及流程，从事前、事中和事后三个环节严格执行不同时区间利益输送，首先识别并判断可能对公平对待不同投资组合、不同账户的利益冲突，及时进行干预和调整，从而达到公平对待所有客户的目的。				
4.5 报告期内基金的异常交易行为综合分析				
4.5.1 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.5.2 报告期内本基金未发现存在内幕交易、利用未公开信息交易等情况。				
4.5.3 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.5.4 报告期内本基金未发现存在利用关联交易影响公平交易和正常秩序的情形。				
4.5.5 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.5.6 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.5.7 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.5.8 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.5.9 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.5.10 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.5.11 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.6 报告期内基金的定期报告				
4.6.1 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.6.2 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.6.3 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.6.4 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.6.5 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.6.6 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.6.7 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.6.8 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.6.9 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.6.10 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.6.11 报告期内本基金未发现存在不公平交易的情形。				
4.7 投资组合报告				
4.7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况				
4.7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况				
4.7.3 基金管理人运用固有资金投资资本交易明细				
4.7.4 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.5 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.6 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.7 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.8 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.9 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.10 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.11 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.12 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.13 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.14 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.15 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.16 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.17 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.18 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.19 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.20 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.21 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.22 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.23 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.24 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.25 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.26 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.27 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.28 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.29 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.30 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.31 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.32 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.33 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.34 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.35 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.36 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.37 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.38 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.39 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.40 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.41 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.42 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.43 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.44 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.45 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.46 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.47 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.48 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.49 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.50 基金管理人运用固有资金投资组合情况				
4.7.51 基金管理				