

# 信息披露 Disclosure

中国证券报

## 华泰柏瑞创新动力灵活配置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、监事、高级管理人员和基金经理等人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和中国银行股份有限公司根据基金合同约定,于2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

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

## 基金名称 华泰柏瑞创新动力混合

交易代码 000697

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2015年2月16日

报告期末基金份额总额 226,422,485.10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,力争在行业中成为收益较高的行业比较基准的投资回报。

投资策略 本基金采取积极的投资策略,通过资产配置、长期盈利能力提升的上市公司的力量,来实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准 中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数(价格)×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 -101,716,897.46

2.本期利润 -86,323,310.74

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0330

4.期末基金资产净值 262,612,679.00

5.期末基金份额净值 1.068

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据。  
2. 本基金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)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。

3.2.1 本基金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(%) 差额(%) 业绩比较基准 收益率(%) 业绩基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -18.74% 3.29% -16.68% 2.48% -2.06% 0.81%

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

阶段 净值增长(%) 差额(%) 业绩比较基准 收益率(%) 业绩基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -18.74% 3.29% -16.68% 2.48% -2.06% 0.81%

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵循守信情况的说明

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 公平交易机制的执行情况

本基金的公平交易制度《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,通过系统完善

的制度安排,从事前、事中和事后三个环节严格限制基金经理之间的利益输送。首先投资决策和研究部

通过掷硬币的决策和投票表决对基金经理的合规性、合理性及合

规性进行审核,在交易过程中使用投资交易系统的公平交易模块,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得良好。

4.3.2 平衡交易行为的专门说明

报告期内未发现本基金存在不公平交易行为。

4.4 报告期内基金的定期报告和临时报告说明

2015年7月份,华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年9月起任华泰柏

瑞创新动力基金经理,2015年9月起任华泰柏瑞

创新动力基金经理,2015年9月起任华泰柏瑞

创新动力基金经理,2015年9月起任华泰柏瑞