

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2015 年第 3 季度报告

2015 年 9 月 30 日

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。

本报告中的财务资料未经审计。

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

2.1 基金产品情况

基金简称	华泰柏瑞中证 500ETF 联接
交易代码	001214
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 日
报告期末基金份额总额	413,884,053.23 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为华泰柏瑞中证 500ETF 的联接基金。华泰柏瑞中证 500ETF 是采用完全复制法实现对中证 500 指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于华泰柏瑞中证 500ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。
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)
风险收益特征	本基金为华泰柏瑞中证 500ETF 的联接基金，采用主要投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 500 的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证500ETF
基金主代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年5月13日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015年6月12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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 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	-68,244,063.65
2. 本期利润	-123,477,859.72
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2871
4. 期末基金资产净值	252,067,011.61
5. 期末基金份额净值	0.6090

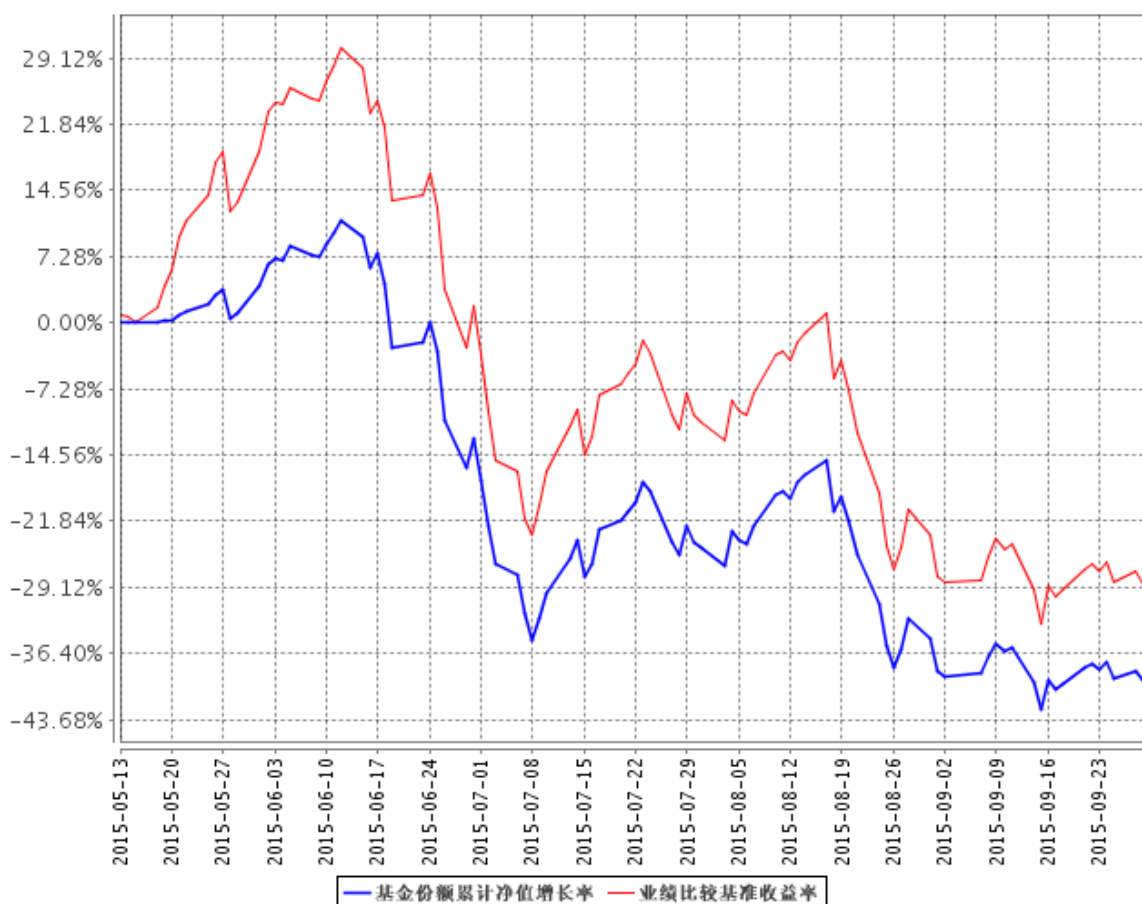
3.2 基金净值表现

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	-30.20%	3.62%	-29.76%	3.82%	-0.44%	-0.20%

3.2.2 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2015 年 5 月 13 日至 2015 年 9 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分（四）投资范围中规定的比例，即本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。

§ 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
		任职日期	离任日期		
柳军	本基金的基金经理、指数投资部总监	2015 年 5 月 13 日	-	14 年	柳军，14 年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士，2000 年至 2001 年在上海汽车集团

				<p>财务有限公司从事财务工作，2001 年至 2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月起加入本公司，历任基金事务部总监、基金经理助理。2009 年 6 月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010 年 10 月 1 日起任华泰柏瑞指数投资部副总监。2011 年 1 月起担任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 及华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起担任华泰柏瑞沪深 300ETF 及华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金基金经理。2015 年 2 月起任华泰柏瑞指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 ETF 及华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，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情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现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交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在监管层一系列及时、有效的救市措施下,6月中旬到7月初由配资强平引起的流动性危机得以解决。但受到8月份汇率波动,A股再次重挫。随着9月份去杠杆去泡沫进入尾声,以及政策利空出尽,市场正进入安全区间。而三季末市场反弹也一定程度上反映了市场微观结构正在恢复。

我们严格按照基金合同的规定,紧密跟踪业绩基准、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内,本基金的累计跟踪偏离为-0.44%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.243%,期间日跟踪误差为0.377%,本基金尚处于建仓期内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.6090元,本报告期内基金份额净值下降30.20%,本基金的业绩比较基准下降29.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来A股表现仍取决于中国经济转型和改革的进一步深化,以及市场风险偏好的恢复,四季度保持乐观。市场普遍担心美国加息和人民币贬值对于A股市场的影响。一方面,从美联储连续推迟加息步伐以及美国经济数据疲软,市场对于美联储短期加息预期减弱;另一方面,人民币汇率从“非稳态”逐步回到阶段性“稳态”。基本面方面,目前国内的传统行业下行趋势并没有结束,重资产行业的投资冲动小、资金需求少,这有利于利率的进一步下行。不过随着国内“保增长”政策的不断加码,实体经济可能在明年上半年实现企稳,届时利率下行的空间就会面临限制了。

大机会仍在新兴产品,转型经济领域,但投资者将更为理性和稳健。在市场信心未明确恢复前,低估值、高红利的蓝筹板块相对投资价值更佳。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略,从而为基金投资人谋求与业绩基准基本一致的投资回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	41,400,515.43	16.40
	其中：股票	41,400,515.43	16.40
2	基金投资	181,800,710.56	72.01
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	28,863,553.39	11.43
8	其他资产	414,100.91	0.16
9	合计	252,478,880.29	100.00

5.2 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	-	-
B	采矿业	961,615.96	0.38
C	制造业	26,433,619.91	10.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	828,827.00	0.33
E	建筑业	1,025,207.30	0.41
F	批发和零售业	2,553,747.10	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,280,111.00	0.90
H	住宿和餐饮业	375,012.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,545,398.76	0.61
J	金融业	838,381.20	0.33
K	房地产业	1,328,426.20	0.53
L	租赁和商务服务业	2,115,481.00	0.84
M	科学研究和技术服务业	24,794.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	62,320.00	0.02
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	359,119.00	0.14
S	综合	668,455.00	0.27
	合计	41,400,515.43	16.42

5.3 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	002183	怡亚通	42,100	1,826,719.00	0.72
2	000566	海南海药	45,500	1,365,910.00	0.54
3	000887	中鼎股份	51,570	1,276,357.50	0.51
4	600978	宜华木业	57,800	1,256,572.00	0.50
5	000748	长城信息	65,200	1,170,340.00	0.46
6	002191	劲嘉股份	91,700	1,147,167.00	0.46
7	002018	华信国际	47,300	1,023,572.00	0.41
8	600499	科达洁能	32,000	948,480.00	0.38
9	600110	中科英华	65,500	899,315.00	0.36
10	600312	平高电气	36,700	810,336.00	0.32

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	ETF500	指数型	交易型开放式	华泰柏瑞基金管理有限公司	181,800,710.56	72.12

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

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、处罚的情形。

5.12.2

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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	379,279.55
2	应收证券清算款	22,733.10

3	应收股利	-
4	应收利息	5,913.26
5	应收申购款	6,175.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	414,100.91

5.12.4 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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002183	怡亚通	1,826,719.00	0.72	临时停牌
2	000566	海南海药	1,365,910.00	0.54	临时停牌
3	000887	中鼎股份	1,276,357.50	0.51	临时停牌
4	600978	宜华木业	1,256,572.00	0.50	临时停牌
5	000748	长城信息	1,170,340.00	0.46	临时停牌
6	002191	劲嘉股份	1,147,167.00	0.46	临时停牌
7	002018	华信国际	1,023,572.00	0.41	临时停牌
8	600499	科达洁能	948,480.00	0.38	临时停牌
9	600110	中科英华	899,315.00	0.36	临时停牌
10	600312	平高电气	810,336.00	0.32	临时停牌

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	498,632,147.77
报告期期间基金总申购份额	63,350,939.70
减：报告期期间基金总赎回份额	148,099,034.24
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	413,884,053.23

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

8.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费）021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2015 年 10 月 27 日