

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 2018 年第 3 季度报告

2018 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：2018 年 10 月 26 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 2018 年 10 月 25 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 2018 年 7 月 1 日起至 2018 年 9 月 30 日止。

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于 2018 年 6 月 13 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2018 年 6 月 13 日开始计算。

§2 基金产品概况

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	308,661,186.27 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	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	001214	006087
报告期末下属分级基金的份额总额	307,350,468.49 份	1,310,717.78 份

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

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	中证500指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险

	和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。
--	----------------------

§ 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（2018年7月1日—2018年9月30日）	
	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C
1. 本期已实现收益	-404,499.26	-1,155.68
2. 本期利润	-11,623,937.85	-24,604.24
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0381	-0.0300
4. 期末基金资产净值	157,167,441.74	670,151.64
5. 期末基金份额净值	0.5114	0.5113

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字。

2、本期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 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

华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A

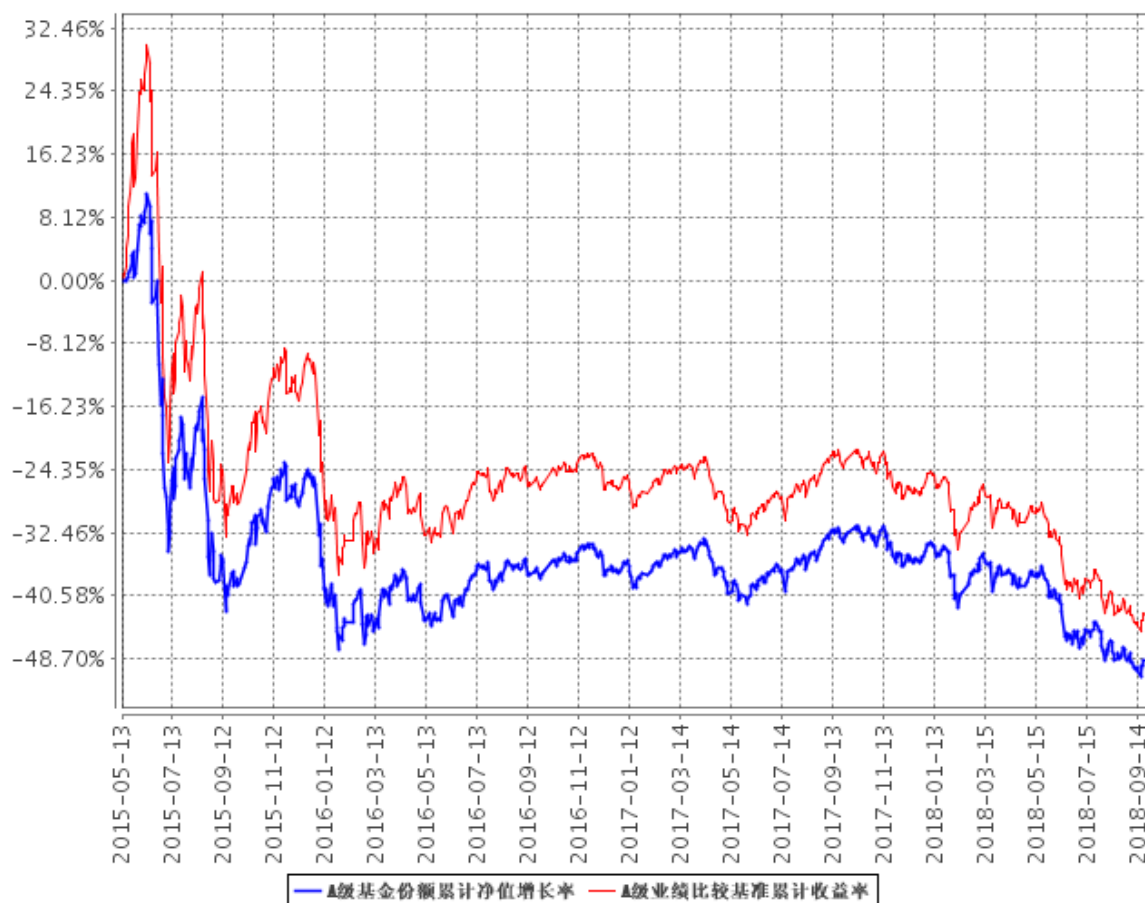
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.93%	1.24%	-7.58%	1.24%	0.65%	0.00%

华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C

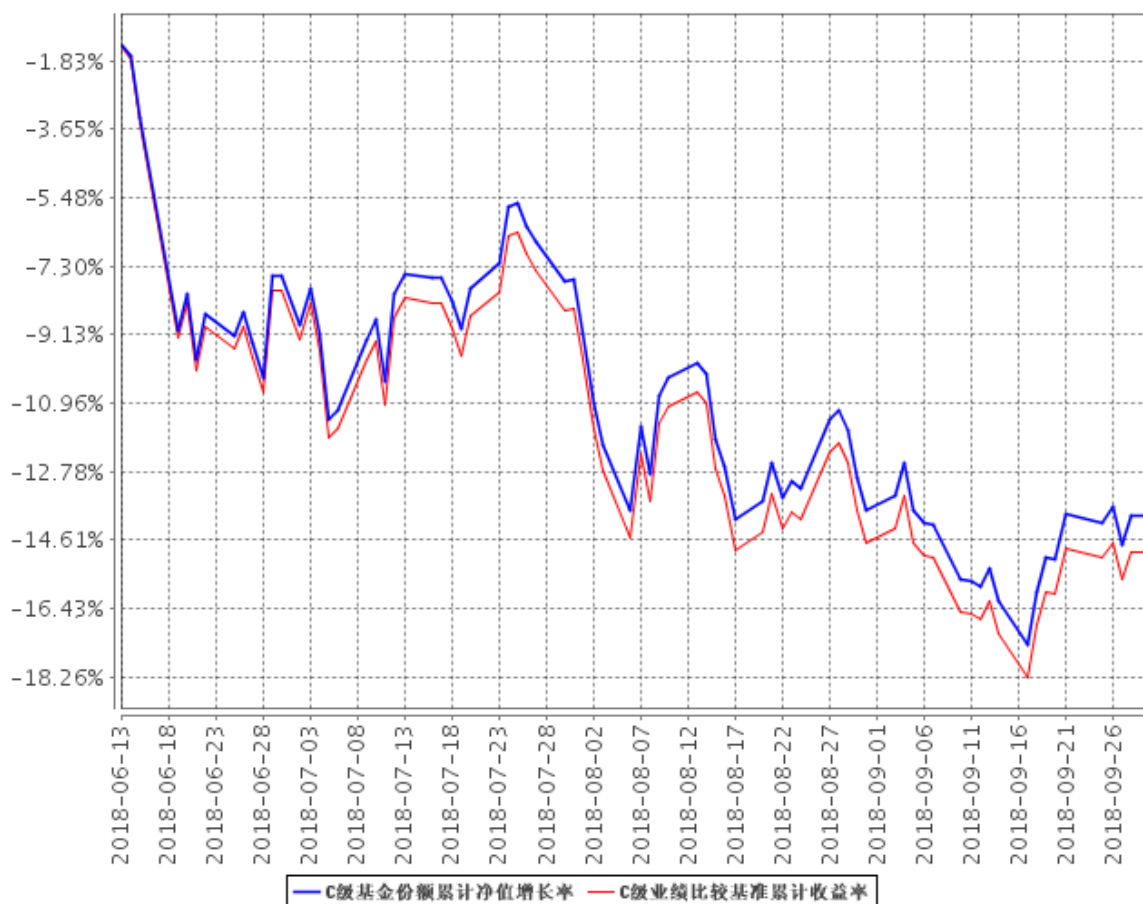
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.93%	1.23%	-7.58%	1.24%	0.65%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

A级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



C级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、A类图示日期为2015年5月13日至2018年9月30日。C类图示日期为2018年6月13日至2018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	指数投资部总监、本基金的基金经	2015年5月13日	-	17年	17年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士，2000年至2001年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作，2001年至

	理			<p>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 月起任指数投资 部副总监。2011 年 1 月起 担任上证中小盘 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。2018 年 3 月起任华泰柏瑞泰利灵活 配置混合型证券投资基金、 华泰柏瑞锦利灵活配置混 合型证券投资基金和华泰 柏瑞裕利灵活配置混合型 证券投资基金的基金经理。 2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易 型开放式指数证券投资基 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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度受中美贸易战影响，市场整体仍表现不佳，人气低迷，上证指数出现多日成交额在 1000 亿以下。期间以沪深 300 为代表的大盘蓝筹表现相对抗跌，三季度仅下跌 2.05%；而以中证 500、中证 1000 和创业板指为代表的中小盘股票仍处于估值寻底的过程中，分别下跌了 7.99%、11.08%和 12.16%。特别值得一提的是，以上证红利指数为代表的高分红股票三季度表现靓丽，期间录得 2.04%的正收益。从投资风格来看，市场整体偏向价值股，沪深 300 价值指数和中证 500 价值指数较各自基准超额收益显著。行业方面，银行和非银金融表现突出，而前期表现较好的医药生物和家用电器则出现了较为明显的回调。

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 0.659%，日均绝对跟踪偏离度为 0.017%，期间日跟踪误差为 0.021%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 0.5114 元，本报告期内 A 类基金份额净值增长率为-6.93%，业绩比较基准增长率为-7.58%；本基金 C 类份额净值为 0.5113 元，本报告期内 C 类基金份额净值增长率为-6.93%，业绩比较基准增长率为-7.58%。

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	404,245.15	0.26
	其中：股票	404,245.15	0.26

2	基金投资	149,149,105.11	94.36
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	8,412,767.69	5.32
8	其他资产	93,755.96	0.06
9	合计	158,059,873.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	20,906.00	0.01
C	制造业	301,217.15	0.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,920.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	393.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	7,662.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,219.00	0.02
J	金融业	11,616.00	0.01
K	房地产业	8,772.00	0.01
L	租赁和商务服务业	11,028.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	4,512.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	404,245.15	0.26

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	603590	康辰药业	1,000	42,960.00	0.03
2	002932	明德生物	500	28,050.00	0.02
3	600201	生物股份	910	15,488.20	0.01
4	603019	中科曙光	300	14,064.00	0.01
5	600256	广汇能源	2,600	13,286.00	0.01
6	002340	格林美	2,300	12,075.00	0.01
7	600426	华鲁恒升	700	12,047.00	0.01
8	000977	浪潮信息	500	12,040.00	0.01
9	600643	爱建集团	1,200	11,616.00	0.01
10	603589	口子窖	200	10,300.00	0.01

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。

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。

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	149,149,105.11	94.50

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

注：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	7,794.42
2	应收证券清算款	288.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,654.74
5	应收申购款	84,018.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	93,755.96

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

注：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C
报告期期初基金份额总额	302,498,156.54	232,759.33
报告期期间基金总申购份额	12,304,539.29	1,697,623.13
减：报告期期间基金总赎回份额	7,452,227.34	619,664.68
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	307,350,468.49	1,310,717.78

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 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

9.3 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

2018 年 10 月 26 日