华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金2021年第1季度报告

2021-04-20

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：二〇二一年四月二十日

重要提示

1.1 本基金管理人的董事会、董事及其高级管理人员保证本季度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和连带责任。

1.2 本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2021年4月19日复核了本季度报告的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

1.3 本季度报告财务会计报告未经审计。

1.4 本季度报告中财务指标、投资组合报告等内容，按照证券投资基金信息披露XBRL模板第1号《通用分类指引》披露。

1.5 本季度报告分别以中文和英文编制，两种语言版本在内容上有重大差异的，以中文版本为准。

基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞沪深300ETF
基金主代码	510300
交易代码	510300
基金运作方式	交易开放式
基金合同生效日	2012年05月04日
报告期末基金份额总额	77,777,777.00份
投资目标	本基金采用完全复制法，主要投资于标的指数成分股及备选成分股。为更好地实现投资目标，本基金在力争对标标的指数长期跟踪误差不超过0.35%的前提下，对成分股权重进行调整，以期获得超越标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制法，主要投资于标的指数成分股及备选成分股。为更好地实现投资目标，本基金在力争对标标的指数长期跟踪误差不超过0.35%的前提下，对成分股权重进行调整，以期获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行活期存款税后利息×5%
风险收益特征	本基金为指数型开放式基金，主要投资于标的指数成分股及备选成分股，面临标的指数所代表证券市场的系统性风险，以及因为成分股调整、标的指数调整、指数编制方法变更、成分股权重调整、指数计算错误、投资组合未能及时调整成分股权重、投资组合与标的指数在时间上、数量上、比例上不完全匹配等因素导致的风险。此外，还面临标的指数长期跟踪误差超过0.35%的风险、成分股因为流动性不足、交易不活跃或被暂停交易等因素导致的风险、标的指数成分股权重被调整、调入、调出成分股、成分股分红除息、标的指数成分股发生配股、增发、分拆、合并、停牌、摘牌、更名等事件导致的风险、标的指数编制方法变更导致的风险、指数计算错误导致的风险、投资组合未能及时调整成分股权重导致的风险、投资组合与标的指数在时间上、数量上、比例上不完全匹配导致的风险、证券市场因不可抗力因素导致的风险、以及本基金特有的风险：1、本基金采用完全复制法，投资于标的指数成分股及备选成分股，面临标的指数所代表证券市场的系统性风险。2、本基金采用完全复制法，投资于标的指数成分股及备选成分股，面临成分股因为流动性不足、交易不活跃或被暂停交易等因素导致的风险。3、本基金采用完全复制法，投资于标的指数成分股及备选成分股，面临成分股分红除息、标的指数成分股发生配股、增发、分拆、合并、停牌、摘牌、更名等事件导致的风险。4、本基金采用完全复制法，投资于标的指数成分股及备选成分股，面临标的指数编制方法变更导致的风险。5、本基金采用完全复制法，投资于标的指数成分股及备选成分股，面临指数计算错误导致的风险。6、本基金采用完全复制法，投资于标的指数成分股及备选成分股，面临投资组合未能及时调整成分股权重导致的风险。7、本基金采用完全复制法，投资于标的指数成分股及备选成分股，面临投资组合与标的指数在时间上、数量上、比例上不完全匹配导致的风险。8、证券市场因不可抗力因素导致的风险。9、本基金特有的风险：本基金投资于股指期货，面临股指期货市场风险、股指期货的杠杆风险、股指期货的流动性风险、股指期货的信用风险、股指期货的法律风险、股指期货的操作风险、股指期货的合规风险、股指期货的道德风险、股指期货的不可抗力风险、股指期货的特有风险、股指期货的其他风险。

主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标

单位：人民币元	报告期（2021年1月1日-2021年3月31日）
1.本期已实现收益	-1,147,192.00
2.本期利润	-10,136,192.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1303
4.期末可供分配利润	-11,283,192.00
5.期末可供分配份额	-0.1451
6.期末资产净值	66,494,808.00
7.期末基金份额净值	0.8548

净值表现

单位：人民币元	报告期末（2021年3月31日）					
1.本期利润	-10,136,192.00					
2.本期净值收入	0.00					
3.本期净值表现率	-13.03%	-0.17%	-13.31%	0.16%	0.28%	0.01%
4.期末可供分配利润	-11,283,192.00					
5.期末可供分配份额	-0.1451					
6.期末资产净值	66,494,808.00					
7.期末基金份额净值	0.8548					

管理人报告

基金管理人及其管理基金的经验及现状

单位：人民币亿元	截至2021年3月31日
1.1.1.