

重要提示

基金管理人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，也不保证最低收益。
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，也不保证最低收益。
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，也不保证最低收益。

基金基本情况
项目 数值
基金简称 华泰柏瑞中证500ETF联接
场内简称
基金代码 001214
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日 2015-05-13
报告期末基金份额总额 389,183,391.84
投资目标 紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

目标基金基本情况
基金名称 华泰柏瑞中证500ETF
基金代码 512510
基金运作方式 交易型开放式
基金合同生效日 2015-05-13
基金简称 华泰柏瑞中证500ETF联接A
基金简称 华泰柏瑞中证500ETF联接C

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。

主要财务指标
主要财务指标 本基金(元) 华泰柏瑞中证500ETF联接A(元) 华泰柏瑞中证500ETF联接C(元)
本期已实现收益 -3,748,847.79 -477,799.54
本期利润 51,468,650.65 3,180,111.40
加权平均基金份额本期利润 0.1403 0.1120
期末基金资产净值 186,278,986.47 42,230,654.73
期末基金份额净值 0.5862 0.5915

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。

基金净值表现
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

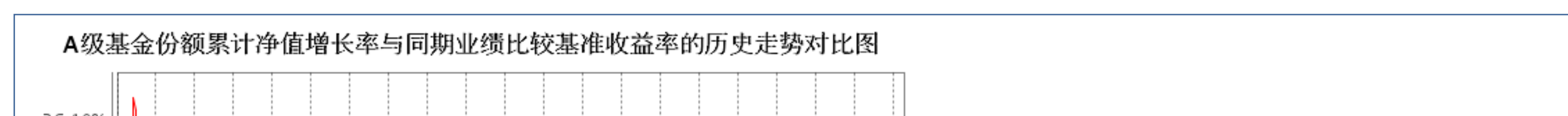
本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较A
阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 30.53% 1.86% 31.27% 1.63% -0.74% -0.07%

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 31.68% 1.87% 31.27% 1.63% 0.41% -0.06%

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
注：1、A类图示日期为2015年5月13日至2019年3月31日，C类图示日期为2018年6月13日至2019年3月31日。

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

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C



其他指标
其他指标 报告期(2019-01-01至2019-03-31)
其他指标 报告期(2019-03-31)

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
任日期 离任日期
梅军 指数投资部总监、本基金的基金经理 2015-05-13 18年 18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。

管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内本基金运作符合法律法规及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

公平交易专项说明
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和流程，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采取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，在交易过程中应用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实现。同时，风控管理部对报告期内的交易进行实时监控和事后分析。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

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%。

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0.5862元，本报告期内A类基金份额净值增长率为30.53%，业绩比较基准增长率为31.27%；本基金C类份额净值为0.5915元，本报告期内C类基金份额净值增长率为31.68%，业绩比较基准增长率为31.27%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
无。

投资组合报告
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 338,657.40 0.14
其中：普通股 - -
存托凭证 - -
2 基金投资 213,278,214.03 88.60
3 固定收益投资 - -
其中：债券 - -
资产支持证券 - -
4 金融衍生品投资 - -
其中：远期 - -
期货 - -
期权 - -
权证 - -
5 买入返售金融资产 - -
其中：买断式回购的买入返售金融资产 - -
6 货币市场工具 - -
7 银行存款和结算备付金合计 22,028,345.33 9.15
8 其他各项资产 5,081,165.10 2.11
9 合计 240,726,381.86 100.00

报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资分布
国家(地区) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资分布
行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

报告期末积极投资行业分类的股票及存托凭证投资分布
行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

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及存托凭证投资明细
报告期末按行业分类的境内股票投资组合
序号 公司名称(英文) 公司名称(中文) 证券代码 所在证券市场 所属国家(地区) 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

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
序号 债券代码 债券名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
注：本基金本报告期末未持有债券。

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。

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金融衍生品投资明细
注：本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

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(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 213,278,214.03 88.33

投资组合报告附注
受到调查及处罚情况
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。

基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
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。

其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 29,869.51
2 应收证券清算款 3,240,742.14
3 应收股利 - -
4 应收利息 - -
5 应收申购款 1,804,802.84
6 其他应收款 - -
7 待摊费用 - -
8 其他 - -
9 合计 5,081,165.10

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。

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。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动
项目 华泰柏瑞中证500ETF联接 华泰柏瑞中证500ETF联接A 华泰柏瑞中证500ETF联接C
报告期初基金份额总额 373,689,291.68 3,752,121.51
报告期间基金份额申购总额 74,053,380.38 155,975,695.00
减：报告期间基金份额赎回总额 129,965,775.09 88,331,321.22
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) - - -
报告期末基金份额总额 389,183,391.84 71,396,495.37

基金管理人运用固有资金投资本基金情况
基金管理人持有本基金份额变动情况
项目 华泰柏瑞中证500ETF联接 华泰柏瑞中证500ETF联接A 华泰柏瑞中证500ETF联接C
报告期初管理人持有的基金份额 - - -
报告期间买入/申购的基金份额 - - -
报告期间卖出/赎回的基金份额 - - -
报告期末管理人持有的基金份额 - - -
报告期末管理人持有的基金份额占基金份额总额比例(%) - - -

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
序号 交易方式 交易日期 交易数量(份) 交易金额(元) 适用费率
合计 - - - - -
注：无。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况
项目 持有份额总数 持有份额占基金总份额比例 发起份额总数 发起份额占基金总份额比例 发起份额锁定期限
基金管理人自有资金 0% 0% 0% 0%
基金管理人高级管理人员 0% 0% 0% 0%
基金管理人普通人员 0% 0% 0% 0%
基金管理人股东 0% 0% 0% 0%
其他 0% 0% 0% 0%

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
投资者类别 序号 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 期初份额 申购份额 赎回份额 持有份额 份额占比
机构 - - - - - - - -
个人 - - - - - - - -
产品特有风险 - - - - - - - -

注：本基金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。

影响投资者决策的其他重要信息
无。

备查文件目录
1. 本基金的基金合同及批准募集文件
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

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楼

查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅，也可工本费购买复印件。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