华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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: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。

华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金于2015年11月19日根据收费方式分不同,新增C类份额,C类相关指标从2015年11月19日开始计算。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞制造2025混合	
交易代码	001456	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年8月4日	
报告期末基金份额总额	55,885,163.91份	
投资目标	本基金通过在中国近向制造领域的选择中,把握科技基金和产业变革的投资机会,投资于具有较高投资价值的主题相关企业,在有效控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的长期稳定收益。	
投资策略	本基金为混合型基金,以股票投资为主,一般情况下本基金将保持配置的基本资产,最高可达95%。当股票市场的整体估值水平严重偏离企业实际的盈利状况和预期成长率,出现明显的价值高估,如果不及时调整将可能给基金持有人带来潜在的资本损失时,本基金将进行大类资产配置调整,降低股票资产的比例(最低20%),同时相应提高债券等其他资产的比例,以规避市场系统性风险。	
业绩比较基准	中银万国制造业指数收益率×80%+中债综合全价指数收益率×20%	
风险收益特征	基金为混合型基金,其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。	
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	华泰柏瑞制造2025混合A	华泰柏瑞制造2025混合C
下属分级基金的交易代码	001456	002394
报告期末下属分级基金的份额总额	48,530,413.18份	7,354,750.06份

§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)	
	华泰柏瑞制造2025混合A	华泰柏瑞制造2025混合C
1. 本期已实现收益	-3,024,119.26	-600,530.88
2. 本期利润	-3,158,366.24	-672,928.84
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0798	-0.0853
4. 期末基金资产净值	45,424,487.41	6,888,075.03
5. 期末基金份额净值	0.936	0.937

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

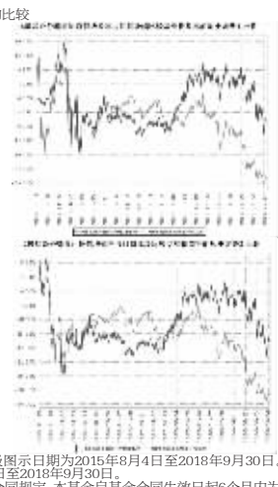
华泰柏瑞制造2025混合A

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	-9.04%	1.61%	-6.90%	1.15%	-2.14%	0.46%

华泰柏瑞制造2025混合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	-9.03%	1.62%	-6.90%	1.15%	-2.13%	0.47%

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



注:1. A级图示日期为2015年8月4日至2018年9月30日。C级图示日期为2015年11月19日至2018年9月30日。

2. 按基金合同规定,本基金日基金合同生效日起6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投资范围中规定的比例。

§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		
李灿	本基金的基金经理	2015年8月4日	-	8年	北京大学西方经济学硕士。2010年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员;2015年3月至4月任华泰柏瑞沪深300指数增强型证券投资基金的基金经理助理。2015年4月至2016年8月任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年8月起任华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年3月至2017年6月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对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。其次集中交易室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中的公平交易模块,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

2018年三季度,整个市场继二季度大跌之后继续走弱,但不同指数间分化较大。三季度上证综指下跌0.92%,中证500下跌7.99%,创业板指下跌12.16%,申万制造下跌8.81%。

本基金适当降低了部分仓位,2018年三季度侧重配置于云计算、军工、医药、机械、化工等行业。三季度中美贸易战对中国制造2025中的部分股票影响仍然较大,本基金虽然在行业配置和选股思路上也针对性的进行了一定的调整,但部分后周期标的在弱市下补跌,对净值伤害较大,最终相对于申万制造业指数略微跑输。

市场整体对于中国经济的短期增速下行基本形成共识,但与过往路径不同的是,美国经济保持强劲,美联储持续加息,美债利率持续上行,美强中弱的经济状态在过去相当长的时间内未曾遇到过。在这种背景下,中美利差对国内货币政策形成掣肘,汇率与利率、资产价格与经济增长之间彼此构成两难。未来经济演进路径不确定性较大,美国强劲的持续时间、中国经济下行斜率、贸易战的走向,都将对中国经济影响显著,进而在资产价格端放大波动。

在经济不确定性较大的背景判断下, 我们需要更好的平衡风险与收益的关系,投资策略重点关注两类资产。

第一是寻找在未来相当长一段时间内,能够通过确定性成长抵御经济周期下行的行业,尽管静态估值可能偏高。比如说军工、云计算。

第二,寻找目身行业可能受经济周期影响,但公司自身竞争力在周期波动中持续增强的优质公司,这类公司更多可能出现在制造业的细分领域和具备粘性的消费行业。

本基金仍将继续保持多头思维,因为只有在低谷时辛勤播种,才能在未来有所收获。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金A级份额净值为0.936元,下降9.04%,同期本基金的业绩比较基准下降6.90%,C级份额净值为0.937元,下降9.03%,同期本基金的业绩比较基准下降6.90%。

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	46,350,660.80	88.12
	其中:股票	46,350,660.80	88.12
2	基金投资	-	-
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	6,230,091.34	11.84
8	其他资产	19,118.98	0.04
9	合计	52,599,871.12	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	1,606,984.00	3.07
C	制造业	33,967,331.80	64.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,789,913.00	14.89
J	金融业	413,936.00	0.79
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,582,496.00	4.94
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	46,350,660.80	88.60

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	600588	用友网络	112,800	3,138,096.00	6.00
2	600845	宝信软件	119,700	2,903,847.00	5.61
3	000977	浪潮信息	118,800	2,860,704.00	5.47
4	002127	南极电商	352,800	2,582,496.00	4.94
5	000768	中航飞机	153,600	2,439,168.00	4.66
6	600760	中航沈飞	56,300	2,148,030.00	4.10
7	600104	上汽集团	60,000	1,996,800.00	3.82
8	601233	桐昆股份	118,300	1,944,852.00	3.72
9	000661	长春高新	7,500	1,777,500.00	3.40
10	002013	中航机电	200,000	1,680,000.00	3.21

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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情形,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

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情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,468.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,300.57
5	应收申购款	3,346.00
6	其他应收款	0.84
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,118.98

5.11.4 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。

5.11.5 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	华泰柏瑞制造2025混合A	华泰柏瑞制造2025混合C
报告期期初基金份额总额	33,833,846.94	9,508,142.00
报告期期间基金总申购份额	16,346,871.03	10,382.61
减:报告期期间基金总赎回份额	1,650,303.12	2,163,775.45
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	48,530,413.18	7,354,750.06

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	15,974,440.89
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	15,974,440.89
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	28.58

7.2 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	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	基金转换入	2018年8月22日	15,974,440.89	15,000,000.00	0.00%
合计			15,974,440.89	15,000,000.00	

注:基金管理人投资本基金的费用均参照本基金公布的费率收取。

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过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							

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回,可能导致巨额赎回,从而引发流动性风险,可能对基金产生如下影响:(1)延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时,投资者可能面临赎回申请延期办理,延缓支付或暂停赎回的风险。(2)基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短期内进行资产变现,这将对基金资产净值产生不利影响,同时可能发生大额赎回费用归入基金资产,基金份额净值保留位数四舍五入等问题,这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。(3)基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回可能导致基金规模缩小,基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形,从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。(4)基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算,转变等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向,审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响,同时将完善流动性风险管理机制,最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

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

华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金

2018年第三季度报告

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: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。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞中证500ETF
交易代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年6月13日
报告期末基金份额总额	310,429,801.00份
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,其风险和收益将比较密切地与标的指数保持基本一致。
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)
1.本期已实现收益	-2,918,653.03
2.本期利润	-22,542,874.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0762
4.期末基金资产净值	315,613,462.76
5.期末基金份额净值	1.0167

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、本基金于2015年6月3日建仓完毕并进行了基金份额折算, 折算比例为0.49716235。期末还原后基金份额累计净值=(期末基金份额净值+基金份额累计分红金额)×折算比例, 该净值可反映投资者在认购期以份额面值1.00元购买中证500ETF后的实际份额净值变动情况。

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	-7.35%	1.30%	-7.99%	1.30%	0.64%	0.00%

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

注:1、图示日期为2015年5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,即投资于指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。

§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、本基金的基金经理	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500ETF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和华泰柏瑞精选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。

4.2 管理人对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中的公平交易模块,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眼,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0.639%,日均绝对跟踪偏离度为0.015%,期间日跟踪误差为0.018%,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1.0167元,还原后基金份额累计净值为0.5174元,本报告期内基金份额净值增长率为-7.35%,本基金的业绩比较基准增长率为-7.99%。

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	312,919,383.62	98.96
	其中:股票	312,919,383.62	98.96
2	基金投资	-	-
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	3,303,099.39	1.04
8	其他资产	15,899.76	0.01
9	合计	316,238,382.77	100.00

注:上述股票投资包括可退替代款估值增值。

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	2,859,796.22	0.91
B	采矿业	10,221,987.84	3.24
C	制造业	186,409,263.35	59.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,901,075.42	3.14
E	建筑业	5,121,343.88	1.62
F	批发和零售业	16,202,847.95	5.13
G	交通运输、仓储和邮政业	11,688,001.66	3.70
H	住宿和餐饮业	1,356,285.00	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,724,507.11	8.47
J	金融业	8,477,788.08	2.69
K	房地产业	16,496,540.25	5.23
L	租赁和商务服务业	5,509,694.08	1.75
M	科学研究和技术服务业	572,194.50	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	1,946,338.52	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	214,291.00	0.07
Q	卫生和社会工作	489,185.64	0.15
R	文化、体育和娱乐业	6,169,544.77	1.95
S	综合	2,568,701.46	0.81
	合计	312,919,383.62	99.15

注:上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

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	000661	长春高新	13,365	3,167,505.00	1.00
2	603019	中科曙光	43,437	2,036,326.56	0.65
3	600256	广汇能源	388,338	1,984,407.18	0.63
4	600201	生物股份	111,436	1,896,640.72	0.60
5	600426	华鲁恒升	108,901	1,874,186.21	0.59
6	000703	恒逸石化	109,593	1,857,381.00	0.59
7	000977	浪潮信息	74,461	1,793,020.88	0.57
8	300146	汤臣倍健	84,200	1,726,100.00	0.55
9	002410	广联达	63,622	1,703,797.36	0.54
10	000860	顺鑫农业	36,800	1,678,080.00	0.53

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,123.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	776.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,899.76

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	274,429,801.00
报告期期间基金总申购份额	42,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	6,000,000.00
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	310,429,801.00

§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

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: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6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基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6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