

华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019年第一季度报告

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：2019年4月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性承担责任。自2019年4月19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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月19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。

本报告告期自2019年1月1日起至2019年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金名称：华泰柏瑞上证中小盘ETF联接

交易代码：400220

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2011年1月20日

报告期末基金份额总额：87,063,260,529份

投资目标：紧密跟踪上证中小盘指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

本基金为华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“中小盘ETF”）的联接基金，是采用完全复制法跟踪上证中小盘指数的开放式基金，通过将大部分基金资产投资于中小盘ETF，实现对标的指数的紧密跟踪。在投资过程中，本基金将严格遵守法律法规、基金合同的约定，通过谨慎的投资方法，在法律规定范围内，选择风险与收益相匹配的金融工具进行投资，从而在一定程度上分散投资于中小盘ETF的风险。

投资策略：本基金主要通过投资于中小盘ETF，从而间接地投资于上证中小盘指数成份股，以实现对标的指数的紧密跟踪。

风险收益特征：本基金为股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金品种。

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：华泰柏瑞上证中小盘ETF

基金代码：610220

基金运作方式：交易型开放式

基金合同生效日：2011年1月20日

报告期末基金份额总额：132,723,962,02份

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

2.1.2 基金产品说明

投资目标：紧密跟踪上证中小盘指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

本基金实行完全复制法，即通常所称的被动管理方法，即尽可能地使基金的收益率与业绩基准的收益率相一致。

投资策略：本基金通过完全复制法跟踪上证中小盘指数，即完全按照上证中小盘指数的构成比例构建股票组合，并根据上证中小盘指数成份股的调整而进行相应调整。

风险收益特征：本基金为股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金品种。

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

2.1.3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)

1.本期已实现收益 16,946.44

2.本期利润 13,782,962.02

3.期末基金资产净值 63,352,762.44

4.期末基金份额净值 1.0002

5.期末基金净值增长率 -0.002%

注：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，计价费用后实际收益水平将低于所列示数据。

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)

1.本期已实现收益 6,196,677.00

2.本期利润 69,722,406.14

3.加权平均基金份额本期利润 0.2627%

4.期末基金资产净值 63,352,762.44

5.期末基金份额净值 1.0002

注：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，计价费用后实际收益水平将低于所列示数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%)

过去三个月 21.65% 1.43% 22.66% 1.47% -1.10% -0.04%

3.2.2 本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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%)

过去三个月 27.76% 1.55% 26.07% 1.66% -0.31% -0.03%

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，计价费用后实际收益水平将低于所列示数据。
2. 本期利润实现收益扣除非经常性损益后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.3 基金净值表现

3.2.4 本期报告期基金业绩指标与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期期内本基金无异常交易行为。本报报告期内无下列情况：所有投资组合与交易所的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

本基金2019年一季度，采取积极的策略，保持股票资产的高仓位，以股票投资为获利手段，业绩表现较好。展望2019年二季度，随着各种利好因素的不断兑现和情绪的修复，以及经济数据的好转，市场还将保持弱势。我们判断目前的权益市场仍然是机遇大于风险，专业投资者选股优势逐步显现，精选个股将有积极作用，密切关注短期波动是正确的盈利手段。本基金将专注于权益市场的投资机会，审慎投资，精选个股，降低风险，努力为2019年第二季度为投资者带来相对更好的净值表现。

4.5 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1.0508元，基金份额净值上涨21.56%，本基金的业绩比较基准上涨22.66%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.1 报告期末基金资产组合情况

注：1.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

2.按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起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。

3.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

4.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

5.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

6.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

7.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

8.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

9.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

10.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

11.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

12.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

13.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

14.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

15.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

16.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

17.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

18.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

19.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

20.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

21.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

22.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

23.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

24.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

25.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

26.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

27.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

28.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

29.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

30.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

31.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

32.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

33.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

34.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

35.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

36.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

37.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

38.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

39.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

40.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

41.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

42.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

43.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

44.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

45.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

46.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

47.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

48.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

49.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

50.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

51.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

52.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

53.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。

54.图示为本基金的资产配置情况，其明细请见“附注四、报告期末按行业分类的境内股票投资组合”。