华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

【2014】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:2014年10月24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2014年10月23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2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞创新升级
交易代码	000566
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月6日
报告期末基金份额总额	132,104,953.71份
投资目标	在有效控制风险的前提下,本基金追求基金资产的长期增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略,精选与经济结构调整与转型主题直接相关,具备长期盈利能力提升的上市公司,力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证TMT产业主题指数收益率×20%+中证新兴产业指数收益率×40%+中债总指数(全价)收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,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

§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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	12,601,675.98
2.本期利润	19,340,926.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.1578
4.期末基金资产净值	159,680,113.98
5.期末基金份额净值	1.209

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。

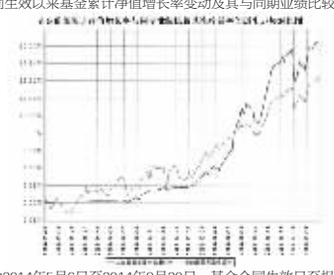
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	19.23%	0.78%	11.87%	0.61%	7.36%	0.17%

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2014年5月6日至2014年9月30日。基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例.本基金持有的股票占基金资产的比例为30%-95%,其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的80%;债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-70%。

§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		
张慧	本基金的基金经理	2014年5月6日	-	7	经济学硕士,7年证券从业经历。2007年7月至2010年6月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010年6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、基金经理助理,2013年9月起任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金的基金经理,2014年5月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。
沈雪峰	本基金的基金经理、投资部副总监	2014年5月6日	-	20	经济学硕士。历任:安徽省国际信托投资公司投资银行部、股票自营部投资经理;华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员;亚洲证券资产管理总部副总经理兼固定收益证券管理总部副总经理,研究所副所长;华富基金管理公司资深研究员、基金经理、投研部副总监。后重新加入华安基金管理公司,任基金经理。2012年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,2013年2月起任华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金的基金经理,2014年5月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2014年7月起任投资部总监,2014年8月任华泰柏瑞盛世中国股票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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年三季度,市场呈现上涨走势,沪深300指数上涨13.20%,创业板指数上涨9.69%,中证500指数上涨25.25%。除却7月初开始创业板指数出现快速调整之外,7月下旬之后市场呈现普涨态势。7月下旬至8月中旬,低估值蓝筹股表现突出,主要市场驱动力为稳增长措施带来的经济数据改善预期并叠加投资者对“沪港通”开放的憧憬。从8月下旬开始,经济数据低于预期,外资流入放缓乃至流出,周期股滞涨。而与转型和改革等相关的主题投资盛行,军工、信息安全、电力改革、体育产业、国企改革、土地改革等主题此起彼伏,并购和注入事件频发,投资者对改革的期待和较为宽松的流动性提升了市场的风险偏好。

本基金自5月6日成立,采取了稳健的建仓方式,净值始终保持在1.00元以上。三季度,本基金重点配置了信息安全、移动互联网、金融信息化、电力改革、体育产业、迪斯尼、军工、国企改革等板块和主题,并适度参与了沪港通相关的低估值板块的估值修复行情,取得良好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.209元,本报告期份额净值增长率为19.23%,同期业绩比较基准增长率为11.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,本基金认为十月份可能酝酿调整的风险,市场的风险偏好存在阶段性下降的可能。近期的宏观经济数据大多低于预期,而上市公司也即将进入季报期,三季度业绩的环比趋势和对全年的展望需要研判,估值和业绩的缺口有可能收窄。流动性方面,AH溢价基本消失导致“沪港通”的影响减弱,融资融券的获利盘存在放大市场波动的可能,美元指数走强使得外资也有流出的压力。但由于央行的定向宽松,以及实体经济偏弱,使得国内流动性总体不会太紧。

本基金认为市场的驱动力来自结构性创新和改革预期,而非经济数据。尽管短期存在调整的风险,但市场上行的逻辑并未被破坏。因此,市场调整之后仍存在上行的机会。在经济减速不可避免的宏观背景下,创新、并购、注入、效率提升是企业抵御盈利放缓的措施,也是本基金筛选标的的思路。

从渗透率的角度,本基金重点关注的创新领域主要有:(移动)互联网应用(包括支付、医疗等),金融信息化(包括银行信息化、供应链金融,互联网金融等),国产化(包括IT国产化和半导体国产化),细胞免疫治疗,新能源汽车,机器人,车联网等。在改革与转型方面,国企改革、体制改革、传统行业向新兴产业转型值得目下而上的挖掘。对于年初以来股价表现较差,但成长逻辑仍在,估值压力已经消化的成长蓝筹,本基金将在四季度关注其估值修复的机会。

针对市场的波动,本基金可能采取一定的择时操作,但认为行业和个股的选择更为重要。本基金将围绕创新与改革转型布局,择机增持相关标的,争取获得超额收益。

§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	113,127,492.85	68.63
	其中:股票	113,127,492.85	68.63
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	37,399,589.19	22.69
7	其他资产	14,308,143.76	8.68
8	合计	164,835,225.80	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	73,162,631.48	45.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,888.56	1.70
E	建筑业	10,120,370.48	6.34
F	批发和零售业	2,303,760.00	1.44
G	交通运输、仓储和邮政业	2,699,652.22	1.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,531,392.33	13.48
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	58,599.68	0.04
M	科学研究和技术服务业	32,260.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	2,670.00	0.00
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	502,268.10	0.31
S	综合	-	-
	合计	113,127,492.85	70.85

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	600536	中国软件	284,000	8,088,320.00	5.07
2	000066	长城电脑	1,268,007	7,544,641.65	4.72
3	600580	卧龙电气	635,999	6,277,310.13	3.93
4	002268	卫士通	121,950	6,221,889.00	3.90
5	002415	海康威视	277,901	5,355,152.27	3.35
6	002364	中恒电气	252,416	5,280,542.72	3.31
7	600987	航民股份	660,100	5,214,790.00	3.27
8	002445	中南重工	264,489	5,176,049.73	3.24
9	300339	润和软件	197,000	5,035,320.00	3.15
10	601877	正泰电器	188,244	4,764,455.64	2.98

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:无

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:无

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:无

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:无

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:无

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:无

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	57,110.19
2	应收证券清算款	8,814,985.32
3	应收股利	-
4	应收利息	6,132.23
5	应收申购款	5,429,916.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,308,143.76

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: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

报告期期初基金份额总额	185,713,299.42
报告期期间基金总申购份额	126,073,389.20
减:报告期期间基金总赎回份额	179,681,734.91
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	132,104,953.71

§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 备查文件目录

8.1 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

8.2 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

8.3 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
2014年10月24日

华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金

【2014】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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23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2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	华泰柏瑞沪深300ETF联接
交易代码	460300
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月29日
报告期末基金份额总额	59,666,644.08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	本基金为沪深300ETF的联接基金。沪深300ETF是主要采用完全复制法实现对沪深300指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于沪深300ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。 在投资运作过程中,本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金。
业绩比较基准	沪深300指数 × 95% +银行活期存款税后收益率 × 5%
风险收益特征	本基金为沪深300ETF的联接基金,采用主要投资于华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金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沪深300指数的表现密切相关。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	中国工商银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞沪深300ETF
基金主代码	510300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年5月4日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012年5月28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	中国工商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

基金名称	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。
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	沪深300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,股票最低仓位为95%,并采用完全复制的被动式投资策略;一方面,相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言,其风险和收益较高,属于股票型基金中高风险、高收益的产品;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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	248,959.38
2.本期利润	9,781,892.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.1271
4.期末基金资产净值	63,456,853.35
5.期末基金份额净值	1.0635

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。

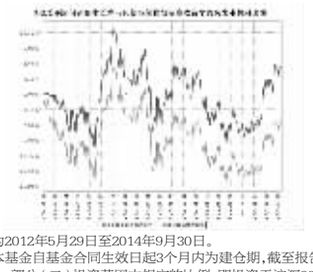
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	13.54%	0.84%	12.52%	0.85%	1.02%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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、图示日期为日为2012年5月29日至2014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十一部分(二)投资范围中规定的比例,即投资于沪深300ETF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		
张娓	本基金的基金经理、指数投资部总监	2012年5月29日	-	10年	张娓女士,美国俄亥俄州肯特州立大学金融工程硕士、MBA,具有多年海内外金融从业经验,曾在芝加哥期货交易所、Danzas-AEI公司、SunGard Energy和联合证券工作,2004年初加入本公司,从事投资研究和金融工程工作,2006年11月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010年10月1日起任华泰柏瑞指数投资部总监。2011年1月起担任华泰柏瑞上证中小盘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。
柳军	本基金的基金经理、指数投资部副总监	2012年5月29日	-	13年	柳军,13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1日起任华泰柏瑞指数投资部副总监。2011年1月起担任华泰柏瑞上证中小盘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。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度 A股的表现显示市场已逐渐开始与短期基本面脱钩,基本面虽然没有起色,但投资者的情绪受到“沪港通”、无风险利率下行、房地产政策调整的影响,参与热情逐渐升温,但行情普涨的同时,市场也出现了结构性分化,军工、国企改革等主题涨幅居前,银行、传媒、家电等走势相对落后。

3季度,沪深300指数上涨13.20%,上证红利指数上涨13.10%,上证中小盘指数上涨22.20%。

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+1.01%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.023%,期间日跟踪误差为0.048%,较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 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1.0635元,累计净值为1.0635元,本报告期内基金份额净值上涨13.54%,本基金的业绩比较基准上涨12.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望4季度,我们认为市场情绪仍然是主导下一阶段行情的主要因素,近期政策层面的调整,包括央行近期所采取的宽松政策、月末存款时点扰动降低、首套房认定政策调整等,都降低了投资者对经济失速的担心,短期内经济基本面不会成为扰动A股市场的因素。

短期而言,由于“沪港通”准备期间已有资金提前参与,不排除“落袋为安”对市场的短期干扰,但长期而言,地产行业政策的回归常态,经济企稳的概率在增大,同时改革红利的释放将成为A股上行的基石。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略,从而为基金投资人谋求与业绩基准基本一致的投资回报。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	60,673,577.46	94.78
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	3,327,595.47	5.20
8	其他资产	11,647.21	0.02
9	合计	64,012,820.14	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

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

注:基金本报告期末未持有股票。

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:无。

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	沪深300ETF	指数型	交易型开放式	华泰柏瑞基金管理有限公司	60,673,577.46	95.61

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:无。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:无。

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:无。

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:无。

5.11.3 本期国债期货投资评价

注:无。

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	4,459.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	911.92
5	应收申购款	6,275.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,647.21

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:本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	79,079,699.88
报告期期间基金总申购份额	4,338,256.53
减:报告期期间基金总赎回份额	23,751,312.33
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	59,666,644.08

§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 备查文件目录

8.1 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

8.2 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

8.3 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
2014年10月24日

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23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2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	华泰柏瑞沪深300ETF联接
交易代码	460300
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月29日
报告期末基金份额总额	59,666,644.08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	本基金为沪深300ETF的联接基金。沪深300ETF是主要采用完全复制法实现对沪深300指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于沪深300ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。 在投资运作过程中,本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金。
业绩比较基准	沪深300指数 × 95% +银行活期存款税后收益率 × 5%
风险收益特征	本基金为沪深300ETF的联接基金,采用主要投资于华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金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沪深300指数的表现密切相关。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	中国工商银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞沪深300ETF
基金主代码	510300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年5月4日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012年5月28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	中国工商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

基金名称	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。
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	沪深300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,股票最低仓位为95%,并采用完全复制的被动式投资策略;一方面,相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言,其风险和收益较高,属于股票型基金中高风险、高收益的产品;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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	248,959.38
2.本期利润	9,781,892.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.1271
4.期末基金资产净值	63,456,853.35
5.期末基金份额净值	1.0635

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

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	13.54%	0.84%	12.52%	0.85%	1.02%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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、图示日期为日为2012年5月29日至2014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十一部分(二)投资范围中规定的比例,即投资于沪深300ETF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

张娓 本基金的基金经理、指数投资部总监 2012年5月29日 - 10年 张娓女士,美国俄亥俄州肯特州立大学金融工程硕士、MBA,具有多年海内外金融从业经验,曾在芝加哥期货交易所、Danzas-AEI公司、SunGard Energy和联合证券工作,2004年初加入本公司,从事投资研究和金融工程工作,2006年11月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010年10月1日起任华泰柏瑞指数投资部总监。2011年1月起担任华泰柏瑞上证中小盘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。

柳军 本基金的基金经理、指数投资部副总监