华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:2015年7月18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2015年7月17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2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞沪深300ETF
交易代码	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
报告期末基金份额总额	5,845,987,690.00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。
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。
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

§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(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	9,253,572,214.20
2.本期利润	6,042,485,793.80
3.加权平均基金份额本期利润	1.2181
4.期末基金资产净值	26,180,580,349.75
5.期末基金份额净值	4.4784

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2012年5月11日建仓完毕并进行了基金份额折算,折算比例为0.37094933。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元购买沪深300ETF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	11.19%	2.57%	10.41%	2.61%	0.78%	-0.04%

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2012年5月4日至2015年6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十三部分(二)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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张娅	本基金的基金经理、指数投资部执行总监	2012年5月4日	2015年6月12日	11年	张娅女士,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。2015年2月起任华泰柏瑞指数投资部执行总监。
柳军	本基金的基金经理、指数投资部总监	2012年5月4日	-	14年	柳军,14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,2015年2月起任华泰柏瑞指数投资部总监,2015年5月起任华泰柏瑞中证500 ETF及华泰柏瑞中证500ETF联接基金的基金经理。

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%。

§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	25,261,861,295.91	93.16
	其中:股票	25,261,861,295.91	93.16
2	固定收益投资	2,551,643.60	0.01
	其中:债券	2,551,643.60	0.01
	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	1,234,047,489.55	4.55
7	其他资产	619,616,525.31	2.28
8	合计	27,118,076,954.37	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	60,325,678.96	0.23
B	采矿业	1,099,239,032.66	4.20
C	制造业	8,514,996,548.44	32.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	922,445,784.18	3.52
E	建筑业	1,121,668,796.18	4.28
F	批发和零售业	483,991,787.91	1.85
G	交通运输、仓储和邮政业	997,087,408.46	3.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,437,974,389.97	5.49
J	金融业	8,721,331,144.77	33.31
K	房地产业	978,084,144.01	3.74
L	租赁和商务服务业	241,603,801.91	0.92
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	216,312,269.31	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	25,043,986.42	0.10
R	文化、体育和娱乐业	301,543,359.41	1.15
S	综合	137,591,213.54	0.53
	合计	25,259,239,346.13	96.48

注:上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

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	601318	中国平安	12,259,034	1,004,505,245.96	3.84
2	600036	招商银行	37,187,754	696,154,754.88	2.66
3	600016	民生银行	56,618,793	562,790,802.42	2.15
4	600030	中信证券	17,661,738	475,277,369.58	1.82
5	601166	兴业银行	25,875,983	446,360,706.75	1.70
6	600000	浦发银行	25,232,609	427,945,048.64	1.63
7	600837	海通证券	18,230,354	397,421,717.20	1.52
8	601766	中国南车	20,674,478	379,583,416.08	1.45
9	601328	交通银行	42,460,606	349,875,393.44	1.34
10	000651	格力电器	5,326,807	340,382,967.30	1.30

注:上述股票价值不包括可退替代估增。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,551,643.60	0.01
8	其他	-	-
9	合计	2,551,643.60	0.01

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	17,560	2,551,643.60	0.01

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
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
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	13,083,580.67
2	应收证券清算款	606,112,690.31
3	应收股利	-
4	应收利息	269,021.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	151,232.48
8	其他	-
9	合计	619,616,525.31

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:本基金期末投资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	7,212,187,690.00
报告期期间基金总申购份额	27,431,100,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	28,797,300,000.00
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	5,845,987,690.00

§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 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
2015年7月18日

华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:2015年7月18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2015年7月17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2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞丰盛纯债债券	
交易代码	000187	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年9月2日	
报告期末基金份额总额	710,420,582.44份	
投资目标	在合理控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳健增值,力争实现超越业绩比较基准的投资收益	
投资策略	本基金将在对宏观经济走势、利率变化趋势、收益率曲线形态变化和发债主体基本面分析的基础上,综合运用久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略等主动投资策略,选择合适的时机和品种构建债券组合。	
业绩比较基准	一年期银行定期存款收益率(税后)*130%	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞丰盛纯债债券A	华泰柏瑞丰盛纯债债券C
下属分级基金的交易代码	000187	000188
报告期末下属分级基金的份额总额	707,819,947.27份	2,600,635.17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(2015年4月1日 - 2015年6月30日)	
	华泰柏瑞丰盛纯债债券A	华泰柏瑞丰盛纯债债券C
1.本期已实现收益	13,098,825.80	297,065.03
2.本期利润	20,635,576.22	772,436.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0289	0.0465
4.期末基金资产净值	763,022,950.60	2,794,301.29
5.期末基金份额净值	1.078	1.074

注:1、所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

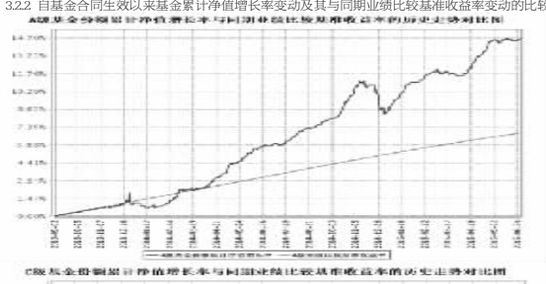
华泰柏瑞丰盛纯债债券A

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	2.76%	0.07%	0.77%	0.01%	1.99%	0.06%

华泰柏瑞丰盛纯债债券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	3.07%	0.09%	0.77%	0.01%	2.30%	0.08%

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2013年9月2日至2015年6月30日。

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十二部分(二)投资范围中规定的各项比例,投资于债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%,现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈东	固定收益部副总监、本基金的基金经理	2013年9月2日	-	8年	陈东先生,硕士,曾任深圳发展银行(现已更名为平安银行)总行金融市场部固定收益与衍生品交易员,负责本外币理财产品的资产管理工作;中国工商银行总行金融市场部人民币债券交易员,负责银行账户的自营债券投资工作。2007年4月至2010年1月任深圳发展银行(现已更名为平安银行)总行金融市场部固定收益与衍生品交易员;2010年1月至2012年9月任中国工商银行总行金融市场部人民币债券交易员;2012年9月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2012年11月起任华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金经理,2013年9月起任华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金的基金经理,2013年11月起任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金的基金经理,2014年12月起任华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金的基金经理,2015年1月起任固定收益部副总监。

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

上半年,央行通过定向工具和传统货币政策工具对市场投放流动性并引导社会融资成本下行。随着经济指标的下滑,央行货币政策放松力度开始逐渐加码。前4个月,央行主动投放的流动性超过2万亿。货币市场利率的下行对中长期债券收益率和贷款利率的传导并不顺畅,中长端利率并没有伴随短融利率下行,5-6月收益率曲线整体变得比较陡峭,长端收益率上升。

投资策略上,基金以配置中短久期品种为主,并保持了较高的杠杆水平,获取了较高的持有期回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金A类和C类份额净值分别为1.078元和1.074元,分别上涨2.76%和3.07%,同期本基金的业绩比较基准上涨0.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年,债券市场预计将呈现整体震荡与短期受政策刺激上涨并存的局面。操作上,基金将继续保持短久期高杠杆的配置策略,获取较高的票息收入。并在长久期品种上进行一定仓位的交易操作,获取阶段性的交易机会。

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

姓名	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,287,932,067.40	95.58
	其中:债券	1,287,932,067.40	95.58
	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	32,816,354.83	2.44
7	其他资产	26,720,874.52	1.98
8	合计	1,347,469,296.75	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:本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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	67,680,550.00	8.84
	其中:政策性金融债	67,680,550.00	8.84
4	企业债券	395,168,767.40	51.60
5	企业短期融资券	403,161,850.00	52.64
6	中期票据	421,920,900.00	55.09
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,287,932,067.40	168.18

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101461032	14太湖新发MTN001	560,000	57,820,000.00	7.55
2	112041	11寓东01	540,030	56,897,560.80	7.43
3	1082217	10云冶MTN1	530,000	53,466,400.00	6.98
4	124505	14嘉市镇	500,000	53,005,000.00	6.92
5	1282168	12九龙MTN1	500,000	50,960,000.00	6.65

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国债期货交易情况说明
5.9.1 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。
5.9.2 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。
5.9.3 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。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1
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。
5.10.2
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。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,193.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,432,990.37
5	应收申购款	284,691.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,720,874.52

5.10.4 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。
5.10.5 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	华泰柏瑞丰盛纯债债券A	华泰柏瑞丰盛纯债债券C
报告期期初基金份额总额	690,118,051.27	2,683,589.58
报告期期间基金总申购份额	59,017,221.13	30,647,588.03
减:报告期期间基金总赎回份额	41,315,325.13	30,730,542.44
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	707,819,947.27	2,600,635.17

§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
2015年7月18日

华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2015】第二季度报告

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:2015年7月18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2015年7月17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2015年4月1日起至2015年6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	37,787,573.61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(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	5,819,748.81
2.本期利润	8,852,939.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.2138
4.期末基金资产净值	69,477,144.45
5.期末基金份额净值	1.8386

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。

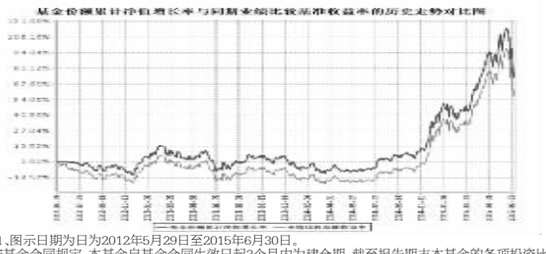
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	10.80%	2.42%	9.98%	2.48%	0.82%	-0.06%

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2015年6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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张娅	本基金的基金经理、指数投资部执行总监	2012年5月29日	2015年6月12日	11年	张娅女士,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。2015年2月起任华泰柏瑞指数投资部执行总监。
柳军	本基金的基金经理、指数投资部总监	2012年5月29日	-	14年	柳军,14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