

华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金

【2015】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：2015年10月27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。

基金管理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10月26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预示其未来表现。

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。

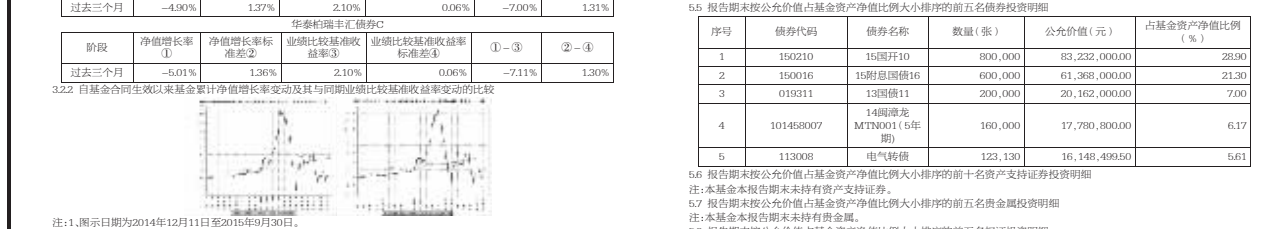
本报告中的财务资料未经审计。

本报告日期为2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	华泰柏瑞丰汇债券
交易代码	000421
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月11日
报告期末基金份额总额	288,736,672.62份
投资目标	在控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用以下投资策略：1、类属资产配置策略：综合考虑债券市场供求状况、流动性水平以及走势的相关性，在基金合同约定的比例范围内，动态调整各类资产的配置比例，保持投资组合的流动性，并根据市场利率走势、利率变化趋势、收益率曲线形态变化及债信主体基本分析的基础上，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，对符合配置要求的品种和期限进行组合。2、个股投资策略：本基金投资于具有良好流动性的基本盘股、成长股、中盘股及股票市场中估值水平合理、盈利能力较强的股票，综合考虑基金资产的流动性、成本等因素。
业绩比较基准	中证综合指数
风险收益特征	本基金属于债券型基金，具有长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。
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
华泰柏瑞丰汇债券A	华泰柏瑞丰汇债券C
报告期末基金份额总额	600,641
报告期末下基金份额总额	228,114,979.50份
报告期末下基金份额总额	57,680,594.12份

3.1 主要财务指标		单位：人民币元		6.4 报告期末按基金品种分类的证券投资组合			
主要财务指标		报告期末（2015年7月1日至2015年9月30日）		报告期末按基金品种分类的证券投资组合			
华泰柏瑞丰汇债券A		华泰柏瑞丰汇债券C		序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1.	本期已实现收益	3,106,868.72	1,203,676.77	1	国家债券	85,465,200.00	29.67
2.	本期利润	-8,006,078.00	-3,284,220.05	2	央行票据	93,827,560.00	32.57
3.	加权平均基金份额本期利润	-0.0060	-0.0051	3	金融债券	67,627,560.00	32.57
4.	期末基金资产净值	230,092,287.67	87,966,116.94	其中：政策性金融债	67,627,560.00	32.57	
5.	期末基金份额净值	1.009	1.005	4	企业债	60,000,985.60	22.57
				5	企业短期融资券	32,222,000.00	10.49
				6	央行票据	10,780,800.00	6.17
				7	回购	16,795,648.40	5.83
				8	其他	-	-
				9	合计	309,094,187.90	107.31

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		3.2.2 基金净值表现				
华泰柏瑞丰汇债券A		华泰柏瑞丰汇债券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	-4.90%	1.37%	2.10%	0.06%	-7.00%	1.31%
过去六个月	-5.01%	1.36%	2.10%	0.06%	-7.11%	1.30%
过去一年	-5.01%	1.36%	2.10%	0.06%	-7.11%	1.30%
过去二年	-5.01%	1.36%	2.10%	0.06%	-7.11%	1.30%
过去三年	-5.01%	1.36%	2.10%	0.06%	-7.11%	1.30%
自基金合同生效以来	-5.01%	1.36%	2.10%	0.06%	-7.11%	1.30%



2、投资管理职责：本基金管理人将主要投资于国内证券市场，基金资产主要投资于中国证监会规定范围内的股票并遵循下列原则： （1）投资组合中股票投资比例：本基金投资于股票资产比例不低于基金资产的70%；股票资产投资于中国证监会规定的中小市值上市公司股票的比例不低于股票资产总额的50%； （2）股票集中度控制：自上一会计年度结束后1个月以内的时间对持仓中基金资产的市值前50名股票，股票市值占基金资产净值比例不得超过10%； （3）本基金管理人没有持有权证； （4）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （5）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （6）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （7）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （8）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （9）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （10）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （11）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （12）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （13）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （14）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （15）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （16）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （17）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （18）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （19）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （20）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （21）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （22）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （23）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （24）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （25）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （26）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （27）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （28）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （29）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （30）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （31）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （32）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （33）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （34）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （35）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （36）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （37）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （38）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （39）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （40）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （41）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （42）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （43）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （44）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （45）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （46）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （47）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （48）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （49）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （50）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （51）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （52）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （53）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （54）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （55）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （56）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （57）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （58）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （59）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （60）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （61）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （62）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （63）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （64）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （65）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （66）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （67）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （68）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （69）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （70）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （71）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （72）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （73）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （74）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （75）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （76）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （77）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （78）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （79）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （80）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （81）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （82）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （83）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （84）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （85）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （86）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （87）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （88）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （89）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （90）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （91）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （92）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （93）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （94）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （95）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （96）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （97）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （98）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （99）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （100）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （101）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （102）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （103）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （104）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （105）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （106）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （107）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （108）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （109）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （110）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （111）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （112）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （113）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （114）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （115）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （116）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （117）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （118）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （119）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （120）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （121）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （122）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （123）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （124）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （125）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （126）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （127）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （128）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （129）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （130）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （131）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （132）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （133）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （134）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （135）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （136）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （137）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （138）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （139）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （140）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （141）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （142）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （143）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （144）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （145）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （146）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （147）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （148）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （149）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （150）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （151）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （152）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （153）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （154）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （155）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （156）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （157）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （158）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （159）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （160）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （161）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （162）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （163）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （164）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （165）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （166）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （167）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （168）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （169）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （170）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （171）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （172）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （173）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （174）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （175）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （176）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （177）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （178）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （179）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （180）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （181）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （182）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （183）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （184）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （185）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （186）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （187）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （188）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （189）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （190）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （191）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （192）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （193）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （194）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （195）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （196）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （197）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （198）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （199）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （200）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （201）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （202）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （203）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （204）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （205）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （206）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （207）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （208）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （209）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （210）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （211）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （212）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （213）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （214）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （215）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （216）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （217）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （218）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （219）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （220）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （221）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （222）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （223）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （224）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （225）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （226）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （227）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （228）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （229）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （230）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （231）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （232）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （233）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （234）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （235）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （236）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （237）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （238）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （239）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （240）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （241）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （242）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （243）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （244）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （245）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （246）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （247）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （248）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （249）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （250）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （251）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （252）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （253）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （254）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （255）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （256）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （257）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （258）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （259）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （260）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （261）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （262）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （263）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （264）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （265）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （266）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （267）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （268）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （269）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （270）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （271）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （272）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （273）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （274）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （275）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （276）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （277）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （278）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （279）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （280）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （281）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （282）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （283）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （284）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （285）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （286）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （287）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （288）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （289）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （290）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （291）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （292）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （293）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （294）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （295）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （296）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （297）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （298）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （299）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （300）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （301）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （302）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （303）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （304）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （305）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （306）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （307）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （308）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （309）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （310）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （311）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （312）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （313）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （314）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （315）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （316）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （317）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （318）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （319）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （320）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （321）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （322）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （323）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （324）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （325）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （326）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （327）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （328）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （329）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （330）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （331）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （332）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （333）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （334）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （335）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （336）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （337）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （338）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （339）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （340）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （341）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （342）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （343）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （344）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （345）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （346）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （347）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （348）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （349）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （350）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （351）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （352）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （353）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （354）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （355）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （356）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （357）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （358）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （359）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （360）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （361）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （362）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （363）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （364）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （365）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （366）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （367）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （368）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （369）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （370）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （371）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （372）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （373）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （374）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （375）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （376）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （377）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （378）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （379）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （380）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （381）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （382）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （383）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （384）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （385）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （386）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （387）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （388）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （389）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （390）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （391）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （392）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （393）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （394）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （395）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （396）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （397）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （398）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （399）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （400）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （401）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （402）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （403）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （404）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （405）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （406）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （407）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （408）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （409）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （410）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （411）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （412）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （413）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （414）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （415）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （416）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （417）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （418）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （419）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （420）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （421）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （422）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （423）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （424）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （425）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （426）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （427）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （428）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （429）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （430）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （431）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （432）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （433）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （434）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （435）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （436）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （437）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （438）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （439）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （440）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （441）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （442）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （443）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （444）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （445）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （446）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （447）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （448）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （449）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （450）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （451）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （452）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （453）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （454）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （455）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （456）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （457）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （458）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （459）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （460）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （461）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （462）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （463）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （464）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （465）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （466）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （467）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （468）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （469）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （470）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （471）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （472）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （473）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （474）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （475）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （476）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （477）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （478）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （479）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （480）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （481）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （482）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （483）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （484）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （485）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （486）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （487）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （488）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （489）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （490）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （491）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （492）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （493）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （494）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （495）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （496）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （497）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （498）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （499）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （500）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （501）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （502）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （503）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （504）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （505）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （506）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （507）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （508）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （509）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （510）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （511）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （512）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （513）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （514）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （515）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （516）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （517）前10名股票投资市值不得超过基金资产净值的10%； （518）前10名股票投资市值不得超过基金资产净				
---	--	--	--	--

4.2 管理人对于报告期内本基金投资遵规守信情况的说明

报告期内本基金的投资运作符合相关法律法规、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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和流程，从事前、事中和事后各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，在交易过程中采用投资交易系统集中公平交易模块，确保公平交易政策的实施。同时，风险管理部对报告期的交易进行日常监控和事后评估。

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业绩表现说明

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、事中和事后各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，在交易过程中采用投资交易系统集中公平交易模块，确保公平交易政策的实施。同时，风险管理部对报告期的交易进行日常监控和事后评估。

§ 5 投资组合报告				基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
5.1 报告期末基金资产组合情况				§ 5 备查文件目录	
序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）	0.1 备查文件目录	
1	权益投资	30,767,433.08	8.76	1.本基金的《中国证监会备案募集文件	
	其中：股票	30,767,433.08	8.76	2.本基金的《基金合同》	
2	固定收益投资	309,094,187.90	87.50	3.本基金的《招募说明书》	
	其中：债券	309,094,187.90	87.50	4.本基金的《托管协议》	
	资产支持证券	-	-	5.基金管理人业务资格批件、营业执照	
	贵金属投资	-	-	6.本基金的公告	
4	金融衍生品投资	-	-	8.2 存放地点	
5	买入返售金融资产	-	-	上海市浦东新区民生路1100号正大大道口1号楼17楼	
	其中：买入返售金融资产	-	-	8.3 聘请方式	
	其中：买入返售金融资产	-	-	投资者可在营业时间免费查询，也可使用本费购买复印件。	
	其中：买入返售金融资产	-	-	投资者可本行告知和提示，可咨询基金管理人上海申银万国基金管理有限公司。	
	其中：买入返售金融资产	-	-	客户服务热线：400-888-0001（免长话费） 021-38787 4020	
	其中：买入返售金融资产	-	-	公司网址：www.shsbw-ph.com	
6	银行存款和结算备付金合计	6,062,383.43	1.73		
7	其他资产	5,534,287.08	1.67		
		</			

§6 开放式基金资产净值	
报告期末基金份额总额	288,736,672.62份
报告期末基金份额净值	1.009
报告期末基金份额总额	600,641
报告期末基金份额净值	1.009
报告期末基金份额总额	228,114,979.50份
报告期末基金份额净值	1.009
报告期末基金份额总额	57,680,594.12份
报告期末基金份额净值	1.009

§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	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.3 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.4 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.5 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.6 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.7 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.8 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.9 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.10 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.11 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.12 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.13 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.14 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.15 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.16 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.17 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.18 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.19 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.20 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.21 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.22 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.23 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.24 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.25 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.26 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.27 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.28 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.29 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.30 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.31 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.32 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.33 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.34 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.35 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.36 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.37 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.38 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.39 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.40 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.41 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.42 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.43 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.44 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.45 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.46 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.47 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.48 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.49 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.50 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.51 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.52 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.53 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.54 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.55 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.56 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.57 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.58 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.59 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.60 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.61 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.62 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.63 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.64 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.65 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.66 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.67 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.68 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.69 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.70 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.71 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.72 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.73 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.74 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.75 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.76 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.77 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.78 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.79 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.80 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.81 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.82 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.83 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.84 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.85 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.86 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.87 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.88 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.89 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.90 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.91 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.92 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.93 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.94 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.95 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.96 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.97 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.98 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
7.99 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.100 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。在宏观层面从经济周期、政策预期、利率变化、估值水平等方面把握市场，在微观层面从个股基本面、估值水平、市场情绪等方面把握个股，实现个股精选和组合优化，力争实现基金资产的长期增值。本基金将持有大量现金以应对赎回，确保投资组合的流动性，同时运用股指期货等其他金融工具。				
业绩比较基准	一年定期银行定期存款利率（税后）+1%。				
风险控制特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于货币型基金与债券型基金，低于股票型基金。				
基金管理人	华泰证券股份有限公司				
基金投资人	中国工商银行股份有限公司				
下属分设的基金简称	华泰沪深300ETF				
下属分设的基金代码	001350				
报告期末下属分设基金的资产总额	3,203,034,243.06元				
	001341				
	001,043,648元				

§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

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律法规、法规以及基金合同的约定,不存在损害基金