

# 信息披露 Disclosure

## 华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

### 【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。  
投资者有风险，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       | 华泰柏瑞沪深300ETF联接  |
|------------|---|
| 交易代码       | 000906  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2014年5月26日  |
| 报告期末基金份额总额 | 376,538,724.61份   |
| 投资目标       | 在有效控制风险的前提下，本基金追求跟踪标的指数增长，力争在中长期为投资者提供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，精选与结构相调整与长期主题相契合、具备长期盈利能力强的上市公司，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%+中国总指数（全价）收益率×40%               |
| 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  |

| 主要财务指标         | 单位：人民币元                     |
|----------------|-----------------------------|
| 主要财务指标         | 报告期（2015年7月1日 - 2015年9月30日） |
| 1.本期已实现收益      | -170,262,748.38             |
| 2.本期利润         | -200,501,520.15             |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0168                     |
| 4.期末基金资产净值     | 661,228,102.70              |
| 5.期末基金份额净值     | 1.765                       |

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 主要财务指标和基金净值表现

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。

§4 基金经理人报告

§5 投资组合报告

§6 开放式基金份额变动

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

§8 备查文件目录

§9 备查文件目录

§10 备查文件目录

§11 备查文件目录

§12 备查文件目录

§13 备查文件目录

§14 备查文件目录

§15 备查文件目录

§16 备查文件目录

§17 备查文件目录

§18 备查文件目录

§19 备查文件目录

§20 备查文件目录

§21 备查文件目录

§22 备查文件目录

§23 备查文件目录

§24 备查文件目录

§25 备查文件目录

§26 备查文件目录

§27 备查文件目录

§28 备查文件目录

§29 备查文件目录

§30 备查文件目录

§31 备查文件目录

§32 备查文件目录

§33 备查文件目录

§34 备查文件目录

§35 备查文件目录

§36 备查文件目录

§37 备查文件目录

§38 备查文件目录

§39 备查文件目录

§40 备查文件目录

§41 备查文件目录

§42 备查文件目录

§43 备查文件目录

§44 备查文件目录

§45 备查文件目录

§46 备查文件目录

§47 备查文件目录

§48 备查文件目录

§49 备查文件目录

§50 备查文件目录

§51 备查文件目录

§52 备查文件目录

§53 备查文件目录

§54 备查文件目录

§55 备查文件目录

§56 备查文件目录

§57 备查文件目录

§58 备查文件目录

§59 备查文件目录

§60 备查文件目录

§61 备查文件目录

§62 备查文件目录

§63 备查文件目录

§64 备查文件目录

§65 备查文件目录

§66 备查文件目录

§67 备查文件目录

§68 备查文件目录

§69 备查文件目录

§70 备查文件目录

§71 备查文件目录

§72 备查文件目录

§73 备查文件目录

## 华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金

### 【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。  
投资者有风险，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       | 华泰柏瑞沪深300ETF   |
|------------|--|
| 场内简称       | 华泰沪深300ETF   |
| 交易代码       | 510300   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2012年8月1日  |
| 报告期末基金份额总额 | 6,422,787,680.00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，并跟踪标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在特殊情况下（如流动性不足）导致无法完全复制标的指数的成份股时，基金管理人将运用其他合理的方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能接近目标指数的表现。  |
| 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，股票资产仓位为95%，并采用完全复制的被动式投资策略，相对于沪深300指数、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、高收益的产品之一方面，相对于采用其他复制策略的指数基金而言，其风险和收益特征将更接近于标的指数的表现。 |
| 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   |

| 主要财务指标         | 单位：人民币元                     |
|----------------|-----------------------------|
| 主要财务指标         | 报告期（2015年7月1日 - 2015年9月30日） |
| 1.本期已实现收益      | -4,320,645,866.25           |
| 2.本期利润         | -7,304,789,003.19           |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0089                     |
| 4.期末基金资产净值     | 20,876,766,242.25           |
| 5.期末基金份额净值     | 3.2409                      |

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 主要财务指标和基金净值表现

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。

§4 基金经理人报告

§5 投资组合报告

§6 开放式基金份额变动

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

§8 备查文件目录

§9 备查文件目录

§10 备查文件目录

§11 备查文件目录

§12 备查文件目录

§13 备查文件目录

§14 备查文件目录

§15 备查文件目录

§16 备查文件目录

§17 备查文件目录

§18 备查文件目录

§19 备查文件目录

§20 备查文件目录

§21 备查文件目录

§22 备查文件目录

§23 备查文件目录

§24 备查文件目录

§25 备查文件目录

§26 备查文件目录

§27 备查文件目录

§28 备查文件目录

§29 备查文件目录

§30 备查文件目录

§31 备查文件目录

§32 备查文件目录

§33 备查文件目录

§34 备查文件目录

§35 备查文件目录

§36 备查文件目录

§37 备查文件目录

§38 备查文件目录

§39 备查文件目录

§40 备查文件目录

§41 备查文件目录

§42 备查文件目录

§43 备查文件目录

§44 备查文件目录

§45 备查文件目录

§46 备查文件目录

§47 备查文件目录

§48 备查文件目录

§49 备查文件目录

§50 备查文件目录

§51 备查文件目录

§52 备查文件目录

§53 备查文件目录

§54 备查文件目录

§55 备查文件目录

§56 备查文件目录

§57 备查文件目录

§58 备查文件目录

§59 备查文件目录

§60 备查文件目录

§61 备查文件目录

§62 备查文件目录

§63 备查文件目录

§64 备查文件目录

§65 备查文件目录

§66 备查文件目录

§67 备查文件目录

§68 备查文件目录

§69 备查文件目录

§70 备查文件目录

§71 备查文件目录

§72 备查文件目录

§73 备查文件目录

## 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。  
投资者有风险，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       | 华泰柏瑞沪深300ETF联接   |
|------------|--|
| 交易代码       | 480906   |
| 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 | 607,460,200.30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指数成份股的全被动复制策略。本基金主要投资于沪深300ETF基金份额以实现对标的指数的紧密跟踪。在投资组合过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一种或多种合理的方式，追求与标的指数的投资收益水平相接近。 |
| 业绩比较基准     | 沪深300指数×90%+银行活期存款利率×10%   |
| 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标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的风险收益特征与沪深300ETF的风险收益特征相一致。本基金的风险与收益水平高于普通型股票基金、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8月1日    |
| 上市日期    | 2012年8月29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

| 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，并跟踪标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在特殊情况下（如流动性不足）导致无法完全复制标的指数的成份股时，基金管理人将运用其他合理的方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能接近目标指数的表现。  |
| 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，股票资产仓位为95%，并采用完全复制的被动式投资策略，相对于沪深300指数、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、高收益的产品之一方面，相对于采用其他复制策略的指数基金而言，其风险和收益特征将更接近于标的指数的表现。 |

§3 主要财务指标

| 主要财务指标         | 单位：人民币元                     |
|----------------|-----------------------------|
| 主要财务指标         | 报告期（2015年7月1日 - 2015年9月30日） |
| 1.本期已实现收益      | 11,222,227.04               |
| 2.本期利润         | -309,007,350.68             |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0163                     |
| 4.期末基金资产净值     | 912,069,020.21              |
| 5.期末基金份额净值     | 1.3271                      |

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。

## 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。  
投资者有风险，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       | 华泰柏瑞沪深300ETF联接   |
|------------|--|
| 交易代码       | 480906   |
| 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 | 607,460,200.30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指数成份股的全被动复制策略。本基金主要投资于沪深300ETF基金份额以实现对标的指数的紧密跟踪。在投资组合过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一种或多种合理的方式，追求与标的指数的投资收益水平相接近。 |
| 业绩比较基准     | 沪深300指数×90%+银行活期存款利率×10%   |
| 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标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的风险收益特征与沪深300ETF的风险收益特征相一致。本基金的风险与收益水平高于普通型股票基金、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8月1日    |
| 上市日期    | 2012年8月29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

| 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，并跟踪标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在特殊情况下（如流动性不足）导致无法完全复制标的指数的成份股时，基金管理人将运用其他合理的方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能接近目标指数的表现。  |
| 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，股票资产仓位为95%，并采用完全复制的被动式投资策略，相对于沪深300指数、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、高收益的产品之一方面，相对于采用其他复制策略的指数基金而言，其风险和收益特征将更接近于标的指数的表现。 |

§3