华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月21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2016年1月20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10月1日起至2015年12月31日止。

本基金名称自2015年8月6日起,由“华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金”,基金简称为“华泰柏瑞亚洲领导混合”,基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司2015年8月6日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞亚洲领导企业混合(QDII)
交易代码	460010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月2日
报告期末基金份额总额	32,320,387.76份
投资目标	采取主动精选亚洲地区具有行业领导地位和国际竞争优势的企业,通过区域化分散投资,有效降低投资组合系统性风险,追求基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金投资研究团队将跟踪全球经济的发展趋势,重点研究亚洲地区内的宏观经济变量,采用自上而下的分析方法,以及定性和定量分析模型相结合的手段,确定基金资产在各国家/地区之间的配置。综合分析亚洲地区内的宏观经济指标、公司盈利发展趋势、资金流向、价格变动、社会政治风险、产业结构性风险等要素,采用专有定量模型作为参考工具,以确定各国股市的相对吸引力。通过将市场预期的净资产收益率、市净率及长期债券收益率等多种金融市场变量输入该模型,来确定各个市场的价值中枢,作为估值标准。
业绩比较基准	MSCI亚太综合指数(不含日本)
风险收益特征	本基金为区域性股票型证券投资基金,基金预期投资风险收益水平高于混合型基金和债券型基金。由于投资国家与地区市场的分散,长期而言风险应低于投资单一市场的股票型基金。
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

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (HongKong) Limited
	中文	中国银行(香港)有限公司
注册地址		香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港花园道1号中银大厦

§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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-989,685.28
2.本期利润	2,297,826.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.0670
4.期末基金资产净值	25,556,957.61
5.期末基金份额净值	0.791

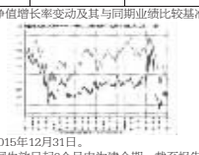
注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	9.10%	1.00%	4.65%	1.22%	4.45%	-0.22%

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2010年12月2日至2015年12月31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十四条(三)投资范围中基金投资组合比例限制中规定的各项比例,股票占基金资产的比例不低于60%;债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例不高于40%,其中,现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金不低于80%的权益类资产将投资于亚洲领导企业。

§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		
黄明仁	本基金的基金经理、海外投资部总监	2010年12月2日	-	15	黄明仁先生,美国西雅图华盛顿大学财务金融专业管理学硕士,具有14年以上境外证券投资管理经验。2004-2006年,任台湾建弘投资信托股份有限公司,建弘泛太平洋基金基金经理;2006-2008年中,加入英国保诚投资信托股份有限公司,任保诚印度基金基金经理。2008年加入本公司,2010年12月起任华泰柏瑞亚洲领导企业混合基金基金经理。2015年1月起任海外投资部总监。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注:本基金不聘请境外投资顾问,华泰柏瑞基金管理有限公司对全部资产进行自行管理。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。首先海外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。

4.4.2 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%。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度亚太股市反弹上涨,主因三季度亚洲股市跌幅过大投资人进场抄底,再加上A股反弹16%带动港股以及恒生国企股上涨,香港恒生指数在四季度上涨5.12%,恒生国企指数小涨2.72%,欧深的印度尼西亚股市与澳大利亚股市涨幅也都超过5%;不过美联储在12月确定加息之后,全球资金持续呈现流出新兴市场的现象,使得东南亚等新兴市场货币面临贬值压力。

4.5.2 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0.791元,本报告期份额净值增长率为9.10%,同期业绩比较基准增长率为4.65%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年一季度,在美联储加息以及人民币贬值压力渐增的宏观背景下,股市的波动将加大,而油价持续破底以及大宗商品价格持续下跌等因素,将影响股市投资人的信心,不过从估值或技术分析的角度来看,港股以及台股等亚洲股市指数都来到10年线的点位,再加上估值也在历史低位,因此一季度有机会呈现下跌后反弹的格局。

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内连续六十个工作日出现基金净值低于五千万元。我司已根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的要求,于2015年3月13日向证监会报告并提交了华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金的转型方案,目前正逐步推进转型的后续事宜

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	20,836,061.05	80.52
	其中:普通股	20,532,472.33	79.35
	优先股	-	-
	存托凭证	303,588.72	1.17
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	287,604.66	1.11
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,741,099.98	18.32
8	其他资产	10,611.30	0.04
9	合计	25,875,376.99	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
台湾亚交易所	3,202,573.34	12.53
韩国交易所	1,798,417.03	7.04
香港交易所	15,531,481.96	60.77
美国交易所	303,588.72	1.19
合计	20,836,061.05	81.53

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
10 能源	622,001.38	2.43
15 原材料	844,482.24	3.30
20 工业	521,032.14	2.04
25 非日常生活消费品	3,799,784.36	14.87
30 日常消费品	387,758.10	1.52
35 医疗保健	2,196,081.26	8.59
40 金融	4,035,825.03	15.79
45 信息技术	7,691,632.32	30.10
50 电信业务	490,855.30	1.92
55 公用事业	246,608.92	0.96
合计	20,836,061.05	81.53

注:本公司采用的行业分类标准为全球行业分类标准GICS。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港交易所	香港	17,800	2,274,153.81	8.90
2	LARGAN PRECISION CO LTD	大立光电股份有限公司	3008 TT	台湾亚交易所	台湾	4,000	1,796,097.03	7.03
3	SAMSUNG SDI CO LTD	三星SDI有限公司	006400 KS	韩国交易所	韩国	1,872	1,178,334.00	4.61
4	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业控股有限公司	867 HK	香港交易所	香港	105,000	1,004,582.00	3.93
5	NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY	新华人寿保险股份有限公司	1336 HK	香港交易所	香港	32,900	897,174.41	3.51
6	BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY	华熙生物科技有限公司	963 HK	香港交易所	香港	52,500	844,482.24	3.30
7	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD	中国民航信息网络股份有限公司	696 HK	香港交易所	香港	77,000	823,135.61	3.22
8	HAITONG SECURITIES CO LTD	海通证券股份有限公司	6837 HK	香港交易所	香港	71,600	821,795.16	3.22
9	CHAOWEI POWER HOLDINGS LTD	超威动力控股有限公司	951 HK	香港交易所	香港	172,000	789,657.92	3.09
10	STANDARD CHARTERED PLC	渣打集团有限公司	2888 HK	香港交易所	香港	13,850	758,852.75	2.97

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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	KRANE-SHARES CSI CHINA INTERN	-	-	-	287,604.66	1.13

5.10 投资组合报告附注

注:报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除海通证券(6837)外,没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

海通证券股份有限公司2015年11月29日发布关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告。因涉嫌在融资融券业务中涉嫌违反《证券公司监督管理条例》第八十四条“未按规定与客户签订业务合同”的规定,被中国证监会立案调查。海通证券将继续全面配合中国证监会的调查工作,并严格按照有关规定执行信息披露义务。

对该股票投资决策程序的说明:

根据我司的基金投资管理相关制度,以相应的研究报告为基础,结合其未来增长前景,由基金经理决定具体投资行为。

5.10.1 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	10,499.76
4	应收利息	111.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,611.30

5.10.2 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。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况。

5.10.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

截止2015年12月31日,本基金持有中国高精密(591HK)504,000股,占基金资产净值比例为2.02%。中国高精密(591HK)自2012年8月22日开始停牌。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	35,425,398.73
报告期期间基金总申购份额	573,804.89
减:报告期期间基金总赎回份额	3,678,815.86
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	32,320,387.76

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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 影响影响投资者决策的其他重要信息

-

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 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

9.3 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
2016年1月21日

华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月21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2016年1月20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10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞中证500ETF
交易代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年5月13日
报告期末基金份额总额	318,429,801.00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。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。
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	中证500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,采用完全复制的被动式投资策略:一方面,相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言,其风险和收益较高;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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-28,453,818.93
2.本期利润	99,521,434.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.3031
4.期末基金资产净值	483,789,562.68
5.期末基金份额净值	1.5193

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	24.32%	2.03%	24.40%	2.05%	-0.08%	-0.02%

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2015年5月13日至2015年12月31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十四部分(四)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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳军	指数投资部总监、本基金的基金经理	2015年5月13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%。

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

经历巨幅震荡的A股在四季度逐步回复,创业板首先迎来反弹。国庆假日后,在美联储推迟加息的影响下,沪深300指数大涨。四季度,沪深300指数涨幅16.48%,中证500指数涨幅24.40%,创业板指数上涨30.32%。经过十月和十一月围绕十三五规划的预期炒作之后,市场结构性行情得到了充分的发挥,由于临近年底加上12月美联储加息,人民币汇率走低,市场展开了震荡休整的行情。

我们严格按照基金合同的规定,紧密跟踪标的指数、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-0.077%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.001%,期间日跟踪误差为0.035%,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1.5193元,还原后基金份额累计净值为0.7553元,本报告期内基金份额净值增长24.32%,本基金的业绩比较基准增长24.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从各项宏观数据看,经济继续下滑,企稳迹象短期难现。展望2016-2017年,整体经济增速仍将持续下滑,在政府稳增长的思路下,需求端将保持平稳下行,GDP增速将进一步放缓到6.5%。

目前我国处于社会结构变化、存量资金面临再配置阶段。在钱多、经济弱、政府积极利用资本市场为转型服务的确定性前提下,行情的系统性风险不大。

一方面,从风险收益角度,2016配置高分红、低估值品种更佳。另一方面,从行业角度, 基于“立新+破旧”思路,优选投资标的,耐心布局。

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标的指数基本一致的投资回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注:无。

§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	477,173,431.87	98.33
	其中:股票	477,173,431.87	98.33
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	7,569,668.08	1.56
7	其他资产	555,585.50	0.11
8	合计	485,298,685.45	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	8,995,739.58	1.86
B	采矿业	15,234,188.81	3.15
C	制造业	285,063,295.32	58.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,317,857.90	2.96
E	建筑业	12,450,782.68	2.57
F	批发和零售业	29,212,313.08	6.04
G	交通运输、仓储和邮政业	13,923,835.70	2.88
H	住宿和餐饮业	1,116,107.36	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,376,331.86	6.07
J	金融业	4,882,959.49	1.01
K	房地产业	32,744,254.68	6.77
L	租赁和商务服务业	9,229,896.66	1.91
M	科学研究和技术服务业	2,534,597.00	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	3,533,165.82	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,203,042.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	6,612,912.84	1.37
S	综合	6,742,151.09	1.39
	合计	477,173,431.87	98.63

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

5.3.1 报告期末指数投资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	002018	华信国际	60,100	2,649,208.00	0.55
2	600978	宜华木业	117,466	2,623,015.78	0.54
3	002405	四维图新	63,800	2,475,440.00	0.51
4	002466	天齐锂业	17,300	2,434,975.00	0.50
5	600160	巨化股份	101,530	2,382,909.10	0.49
6	600201	生物股份	63,594	2,351,070.18	0.49
7	600816	安信信托	99,000	2,254,230.00	0.47
8	600079	人福医药	100,742	2,242,516.92	0.46
9	600635	大众公用	220,632	2,175,431.52	0.45
10	000748	长城信息	62,342	2,174,488.96	0.45

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投资。

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投资。

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。

5.9.1 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

注: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	306,080.35
2	应收证券清算款	247,231.55
3	应收股利	-
4	应收利息	2,273.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	555,585.50

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002018	华信国际	2,649,208.00	0.55	重大资产重组
2	600978	宜华木业	2,623,015.78	0.54	重大资产重组
3	000748	长城信息	2,174,488.96	0.45	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	332,429,801.00
报告期期间基金总申购份额	32,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	46,000,000.00
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	318,429,801.00

§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
2016年1月21日

华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月21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2016年1月20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10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	华泰柏瑞中证500ETF联接
交易代码	001214
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月13日
报告期末基金份额总额	386,097,345.38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	本基金为华泰柏瑞中证500ETF的联接基金。华泰柏瑞中证500ETF是采用完全复制法实现对中证500指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于华泰柏瑞中证500ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。
业绩比较基准	95%*中证500指数收益率+5%*银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为华泰柏瑞中证500ETF的联接基金,采用主要投资于目标ETF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中证500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	华泰柏瑞中证500ETF
基金主代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年5月13日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015年6月12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

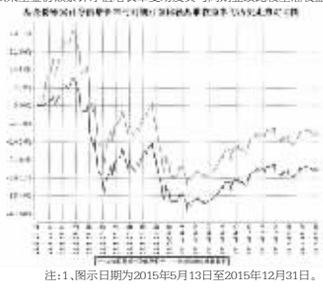
主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-13,832,924.91
2.本期利润	51,592,552.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.1316
4.期末基金资产净值	284,391,327.05
5.期末基金份额净值	0.7366

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	20.95%	1.84%	23.13%	1.94%	-2.18%	-0.10%

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2015年5月13日至2015年12月31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十四部分(四)投资范围中规定的比例,即本基金投资于目标ETF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 |