

上证红利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:招商银行股份有限公司

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。

投资人风险,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	华泰柏瑞上证红利ETF
场内简称	华红利ETP
交易代码	510100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006年11月1日
报告期末基金资产总额	227,773,700.00
投资目标	紧密跟踪标的指数,定期调整组合并跑赢标的指数最小化。
业绩比较基准	上证红利指数
基金业协会评价	风险收益特征:低风险、低收益
基金费率	申购费:0.5%;赎回费:0.5%;
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招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10月01日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	21,156,890.29
2.期初现金及现金等价物余额	88,246,292.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.3763
4.期末现金及现金等价物余额	644,360,896.79
5.期末基金份额净值	2.036

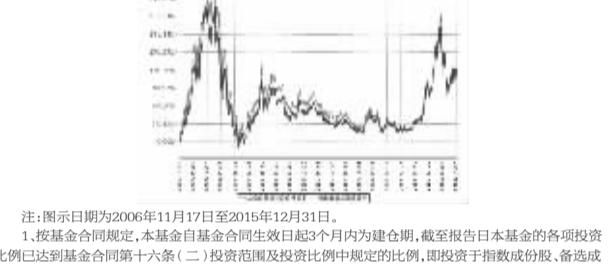
注:1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将有所下降。

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2007年10月1日成立并进行了基金份额折算, 折算比例为0.65527799, 期末还原后基金份额净值为1.00(期末份额净值+基金份额累计分红总额)÷折算比例, 该净值可反映投资者在申购时以份额净值1.00元购买红利ETF时的实际情况和变动情况。

3.2 基金的基本表现

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



注:图示日期为2006年11月17日至2015年12月31日。

1. 按基金合同规定, 本基金的基金合同生效日起3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十六条(一)投资范围及投资比例中规定的比例, 即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%。

3.4 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
柳军	本基金的基金经理	2009年04月14日	-	14
柳军	本基金的基金经理	2015年04月3日	-	4年

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, 通过科学完备的制度及流程, 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、有效性及合規性进行独立审核, 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执行日常监控和分析评估。

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。

4.4 报告期内本基金无下列情况: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 报告期内本基金的估值政策说明

4.5.1 估值方法

4.5.2 估值原则

4.5.3 估值程序

4.5.4 估值错误处理方法

4.5.5 估值差错处理

4.5.6 估值错误处理结果

4.5.7 估值错误处理复核机制

4.5.8 估值错误处理期间的其他安排

4.5.9 估值错误处理期间的其他安排

4.5.10 估值错误处理期间的其他安排

4.5.11 估值错误处理期间的其他安排

4.5.12 估值错误处理期间的其他安排

4.5.13 估值错误处理期间的其他安排

4.5.14 估值错误处理期间的其他安排

4.5.15 估值错误处理期间的其他安排

4.5.16 估值错误处理期间的其他安排

4.5.17 估值错误处理期间的其他安排

4.5.18 估值错误处理期间的其他安排

4.5.19 估值错误处理期间的其他安排

4.5.20 估值错误处理期间的其他安排

4.5.21 估值错误处理期间的其他安排

4.5.22 估值错误处理期间的其他安排

4.5.23 估值错误处理期间的其他安排

4.5.24 估值错误处理期间的其他安排

4.5.25 估值错误处理期间的其他安排

4.5.26 估值错误处理期间的其他安排

4.5.27 估值错误处理期间的其他安排

4.5.28 估值错误处理期间的其他安排

4.5.29 估值错误处理期间的其他安排

4.5.30 估值错误处理期间的其他安排

4.5.31 估值错误处理期间的其他安排

4.5.32 估值错误处理期间的其他安排

4.5.33 估值错误处理期间的其他安排

4.5.34 估值错误处理期间的其他安排

4.5.35 估值错误处理期间的其他安排

4.5.36 估值错误处理期间的其他安排

4.5.37 估值错误处理期间的其他安排

4.5.38 估值错误处理期间的其他安排

4.5.39 估值错误处理期间的其他安排

4.5.40 估值错误处理期间的其他安排

4.5.41 估值错误处理期间的其他安排

4.5.42 估值错误处理期间的其他安排

4.5.43 估值错误处理期间的其他安排

4.5.44 估值错误处理期间的其他安排

4.5.45 估值错误处理期间的其他安排

4.5.46 估值错误处理期间的其他安排

4.5.47 估值错误处理期间的其他安排

4.5.48 估值错误处理期间的其他安排

4.5.49 估值错误处理期间的其他安排

4.5.50 估值错误处理期间的其他安排

4.5.51 估值错误处理期间的其他安排

4.5.52 估值错误处理期间的其他安排

4.5.53 估值错误处理期间的其他安排

4.5.54 估值错误处理期间的其他安排

4.5.55 估值错误处理期间的其他安排

4.5.56 估值错误处理期间的其他安排

4.5.57 估值错误处理期间的其他安排

4.5.58 估值错误处理期间的其他安排

4.5.59 估值错误处理期间的其他安排

4.5.60 估值错误处理期间的其他安排

4.5.61 估值错误处理期间的其他安排

4.5.62 估值错误处理期间的其他安排

4.5.63 估值错误处理期间的其他安排

4.5.64 估值错误处理期间的其他安排

4.5.65 估值错误处理期间的其他安排

4.5.66 估值错误处理期间的其他安排

4.5.67 估值错误处理期间的其他安排

4.5.68 估值错误处理期间的其他安排

4.5.69 估值错误处理期间的其他安排

4.5.70 估值错误处理期间的其他安排

4.5.71 估值错误处理期间的其他安排

4.5.72 估值错误处理期间的其他安排

4.5.73 估值错误处理期间的其他安排

4.5.74 估值错误处理期间的其他安排

4.5.75 估值错误处理期间的其他安排

4.5.76 估值错误处理期间的其他安排

4.5.77 估值错误处理期间的其他安排

4.5.78 估值错误处理期间的其他安排

4.5.79 估值错误处理期间的其他安排

4.5.80 估值错误处理期间的其他安排

4.5.81 估值错误处理期间的其他安排

4.5.82 估值错误处理期间的其他安排

4.5.83 估值错误处理期间的其他安排

4.5.84 估值错误处理期间的其他安排

4.5.85 估值错误处理期间的其他安排

4.5.86 估值错误处理期间的其他安排

4.5.87 估值错误处理期间的其他安排

4.5.88 估值错误处理期间的其他安排

4.5.89 估值错误处理期间的其他安排

4.5.90 估值错误处理期间的其他安排

4.5.91 估值错误处理期间的其他安排

4.5.92 估值错误处理期间的其他安排