

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

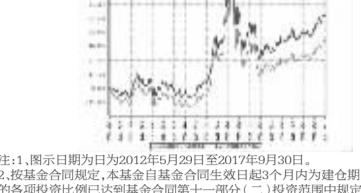
2017年第三季度报告

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末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 收益率差③ 收益率差标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 4.80% 0.01% 4.40% 0.06% 0.00% 0.00%

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.示期日期为2012年6月29日至2017年9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,截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的比例(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%。

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理时间 | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|--------|-----|
| | | 2012年6月29日 | - | 16年 |
| | | 2015年6月29日 | - | |
| | | 2017年6月29日 | - | |
| | | | | |

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守信守情况的说明

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,通过科学完善的规定及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间的利益输送。首先,投资部和研究部通过规定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的公平交易模块,确保公平交易。同时,风险管理部对报告期内的交易行为进行日常监控和分析评估。

4.3 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,通过科学完善的规定及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间的利益输送。首先,投资部和研究部通过规定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的公平交易模块,确保公平交易。同时,风险管理部对报告期内的交易行为进行日常监控和分析评估。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

进入三季度市场延续了二季度的上涨趋势,但风格分化稍有缓和,各指数表现差异不

大,宽基指数中以中盘股为代表的创业板指数表现相对较好,期间沪深300、中证500和创业板分别上涨4.63%、7.58%和6.69%,中小板指股票在季初经历快速下跌后反弹迅猛,之后市场风格开始出现一定逆转,中小市值股票的反弹幅度远高于大盘股涨幅,季度后半程大盘股相对弱势,宏观数据方面,在9月份数据走弱后,八九月的数据再度走高,经济总体保持较强景气,资金面对相对平均,人民币升值预期强,股市上涨受到基本面和资金面支撑,整体呈现结构性行情,部分行业表现相对较好,从市场风格来看,我们认为价值投资是一定的配置价值。三季度重点关注之后,国内市场资金流动方向及美联储加息进度。

本基金将始终严格执行跟踪偏离度最低的被动投资策略,从而为基金投资人谋取与业绩基准基本一致的投资回报。

4.5 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1.7013元,累计净值为1.7013元,本报告期期内基金份额净值上涨6.49%,本基金的业绩比较基准上涨4.40%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

无。

4.7 投资组合报告

4.7.1 期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 467,962,000.00 0.03

2 固定收益 467,962,000.00 0.03

3 货币市场工具 - -

4 其他资产 - -

5 合计 935,924,000.00 100.00

4.7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

4.7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 - -

B 采矿业 4,312,000.00 0.00

C 制造业 261,760,400.00 0.10

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 61,426,000.00 0.04

E 建筑业 - -

F 批发和零售业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 19,196,000.00 0.01

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 33,366,000.00 0.02

J 金融业 46,516,000.00 0.03

K 制造业 62,460,000.00 0.04

L 相关服务和辅助服务业 - -

M 科学研究、技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 国际贸易、代理和商务服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 邮政 - -

5 合计 407,962,000.00 0.03

4.7.2.2 报告期末按行业分类的港股通股票投资组合

4.7.2.3 报告期末按行业分类的境外股票投资组合

4.7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名股票明细

序号 股票代码 股票名称 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000033 中国平安 949,000 0.10

2 000036 中国银行 900,000 0.09

3 000028 中国建筑 850,000 0.08

4 000032 中国人寿 800,000 0.07

5 000031 中国太保 760,000 0.07

6 000023 中国铁建 720,000 0.06

7 000026 中国国航 680,000 0.06

8 000027 中国交建 650,000 0.06

9 000025 中国重工 630,000 0.06

10 000024 中国船舶 600,000 0.05

4.7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名债券明细

序号 债券代码 债券名称 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100001 中国平安 1,000,000 0.10

2 100002 中国银行 900,000 0.09

3 100003 中国建筑 850,000 0.08

4 100004 中国人寿 800,000 0.07

5 100005 中国太保 760,000 0.07

6 100006 中国铁建 720,000 0.06

7 100007 中国国航 680,000 0.06

8 100008 中国交建 650,000 0.06

9 100009 中国重工 630,000 0.06

10 100010 中国船舶 600,000 0.05

4.7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名贵金属

序号 贵金属代码 贵金属名称 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000001 金 1,000,000 0.01

2 000002 银 900,000 0.01

3 000003 铂 800,000 0.01

4 000004 钯 700,000 0.01

5 000005 铂 600,000 0.01

6 000006 钯 500,000 0.01

7 000007 铂 400,000 0.01

8 000008 铂 300,000 0.01

9 000009 铂 200,000 0.01

10 000010 铂 100,000 0.01

4.7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名存出保证金

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 存出保证金 27,900,422 0.03

2 应收证券清算款 99,637,681 0.01

3 应收股利 6,250,425 0.00

4 应收申购款 1,000 0.00

5 其他应收款 1,000 0.00

6 其他资产 1,000 0.00

7 待摊费用 1,000 0.00

8 其他 1,000 0.00

9 合计 106,837,026 0.03

4.7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名临时陛

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 买入返售金融资产 100,000,000 0.00

2 应收票据 99,637,681 0.01

3 应收股利 6,250,425 0.00

4 应收申购款 1,000 0.00

5 其他应收款 1,000 0.00

6 其他资产 1,000 0.00

7 待摊费用 1,000 0.00

8 其他 1,000 0.00

9 合计 106,837,026 0.03

4.7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例最大的前五名其他资产

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 其他资产 100,000,000 0.00

2 其他资产 100,000,000 0.00

3 其他资产 100,000,000 0.00

4 其他资产 100,000,000 0.00

5 其他资产 100,000,000 0.00

6 其他资产 100,000,000 0.00

7 其他资产 100,000,000 0.00

8 其他资产 100,000,000 0.00