

上证红利交易型开放式指数证券投资基金

2017年年度报告摘要

2017年12月31日
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
送出报告日期:2018年3月28日

1 重要提示及目录
1.1 重要提示

基金管理人的董事、董事会、监事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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金管理人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。投资人对基金的风险、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及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证红利交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞上证红利 ETF
基金主代码	510880
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006年1月17日
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
报告期基金资产总值	458,673,703.00份
基金合同终止日期	不适用
基金资产的类别	上证红利指数
报告期天数	2017年1月1日至2017年12月31日

2.2 基金产品说明

投资目标 将资产投资于上证红利指数，力争在扣除相关费用后，使基金的收益与上证红利指数的表现相一致。

投资策略 本基金将主要投资于上证红利指数所包含的股票，通过严格控制股票仓位，以期在扣除相关费用后，使基金的收益与上证红利指数的表现相一致。

业绩比较基准 上证红利指数

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险收益特征与上证红利指数的风险收益特征一致，即本基金的风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
住所	上海市	上海市
法定代表人	021-38601772	0755-83199084
电子邮箱	ct08888000@163.com	yan_zhang@招银.com
客户服务电话	400-888-0001	95555
传真	021-38601799	0755-83195208

2.4 信息披露方式

在规定报刊上披露的基金净值公告的披露日期 网址 http://www.huar-ph.com

基金净值公告的披露日期及披露网站

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

主要数据和指标	2017年	2016年	2015年
本期实现的盈余	126,211,407.07	22,358,603.18	425,369,434.80
本期利润	223,830,696.94	-23,370,784.38	193,762,201.10
0.5158	-0.0935	0.6185	
本期期末基金资产净值	20.42%	-4.05%	11.54%
3.12 每份基金资产净值	2017年1月 1.5778	2016年1月 1.4010	2015年1月 1.3030
3.13 基金期末的净值	1,243,667,125.14	825,062,879.74	644,360,457.97
3.14 基金份额净值	1.5094	1.2435	1.2435
3.15 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	2.43%	0.63%	2.35%
3.16 本期基金份额净值增长率	-0.12%	0.00%	
3.17 本期基金份额净值增长率标准差	0.03%	0.00%	
3.18 过去六个月	6.35%	5.03%	0.53%
3.19 过去一年	20.42%	16.31%	0.53%
3.20 过去三年	28.87%	17.25%	1.73%
3.21 过去五年	83.95%	15.88%	57.68%
3.22 自基金合同生效以来	149.6%	1.89%	124.35%

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,费用影响后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利润减去收入,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。

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3 基金合同生效以来基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.4 基金份额净值

3.2.5 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

3.2.6 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.7 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.8 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.9 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.10 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.11 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.12 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.13 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.14 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.15 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.16 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.17 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.18 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.19 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.20 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.21 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.22 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.23 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.24 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.25 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.26 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.27 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.28 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.29 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.30 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.31 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.32 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.33 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.34 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.35 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.36 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.37 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.38 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.39 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.40 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.41 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.42 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.43 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.44 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.45 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.46 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.47 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.48 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.49 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.50 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.51 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.52 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.53 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.54 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.55 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.56 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.57 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.58 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.59 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.60 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.61 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.62 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.63 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.64 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.65 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.66 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.67 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.68 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.69 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.70 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.71 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较

3.2.72 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较