华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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:2019年7月17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2019年7月16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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

本基金名称自2015年8月6日起,由"华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金"更名为"华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金",基金简称为"华泰柏瑞行业领先混合",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

基金简称	华泰柏瑞行业领先混合
交易代码	460007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年8月3日
报告期末基金份额总额	124,887,134.93份
投资目标	通过采取自上而下和自下而上相结合和方法,从定量和定性的角度挖掘不同时期所蕴含的行业和个股投资机会,在充分控制风险的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	大类资产配置不作为本基金的核心策略。考虑到中国大陆A股市场现阶段仍存在较大的系统性风险,本基金将仅在股票资产整体出现较大程度高估或低估时进行适度的大类资产配置调整,一般情况下本基金将保持大类资产配置的基本稳定。 本基金在股票投资中注重自上而下的行业配置,国以行业估值为基础,以行业基本面趋势变化为契机,结合国家产业政策的导向,在不同备选之间合理配置基金资产。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×15%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属主动管理的混合型证券投资基金,其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金。低于股票型基金。本基金力争通过主动投资追求适度风险水平下的较高收益。
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

§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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	8,925,611.16
2.本期利润	-3,983,930.38
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0311
4.期末基金资产净值	212,720,193.63
5.期末基金份额净值	1.703

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	-1.45%	1.87%	-0.73%	1.23%	-0.72%	0.64%

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:图示日期为2009年8月3日至2019年6月30日。

§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		
吕慧建	投资研究部副总监、本基金的基金经理	2009年11月18日	-	21年	经济学硕士。21年证券(基金)从业经历,新加坡国立大学MBA。历任中大投资管理有限公司行业研究员及中信基金管理有限公司的行业研究员。2007年6月加入本公司,任高级行业研究员,2007年11月起担任基金经理助理,自2009年11月起担任华泰柏瑞(原友邦华泰)行业领先混合基金基金经理。2015年6月起任投资部总监与华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月至2018年11月任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019年3月起任投资研究部副总监。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年A股市场反弹上行,4月份初披露3月份PMI数据重返扩张区间,中国经济见底回升的乐观预期发酵,周期股上涨,推动上证指数反弹,在4月8日涨至本轮高点3288点。市场随后盘整回落。5月份,中国贸易谈判恶化,A股加速下跌,在2900点上下盘整。6月下旬,中美在G20前夕宣布重启谈判,市场情绪改善,指数小幅反弹,上证指数在6月底以2978.88点收盘。

行业走势分化。二季度,食品饮料、银行、家电、休闲获得正收益,而传媒、轻工、电气设备等9个行业跌幅超过10%。指数走势分化,沪深300下跌1.21%,创业板指数下跌10.75%。

本基金在4月份低配周期板块,净值走势较弱。在市场下跌中,食品、医药持仓表现稳健,而养殖、新能源车板块持仓回调较大,拖累净值。

2019年年初以来,A股市场走出一轮估值修复行情,强势行业涨幅较大,申万食品饮料指数创出历史新高。市场反弹总体上已经表现得较为充分。

中美贸易争端带来的边际冲击在弱化,但仍然是一个压制市场预期的一个负面因素。从一个更长的时间周期看,上市公司盈利向好与否是一个更重要的因素。由于2019年中国经济仍然处在探底过程中,周期板块的业绩难有较好表现,上市中报业绩预计总体上较为平淡。上市公司中部分盈利较好的消费品公司,如食品饮料,经历股价大幅上涨后,估值扩张潜力已经下降。

总体上,我们对三季度A股市场走势判断相对中性,市场较难有趋势线机会。在操作上,核心持仓将相对稳定,继续持有具有长期竞争力、盈利处在增长周期的消费品公司。我们也将继续持有景气持续上行的养殖股标的。另外,我们将适当拓展选股范围,自下而上地挖掘盈利增长和估值匹配具有吸引力的新标的,争取净值有较好表现。

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1.703元,本报告期份额净值增长率为-1.45%,同期业绩比较基准增长率为-0.73%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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	200,904,781.58	91.60
	其中:股票	200,904,781.58	91.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,307,580.27	5.61
8	其他资产	6,113,766.52	2.79
9	合计	219,326,128.37	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	31,102,046.00	14.62
B	采矿业	125,801.35	0.06
C	制造业	142,817,713.93	67.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,210.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	6,472,200.00	3.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,190,353.76	2.91
J	金融业	169,849.94	0.08
K	房地产业	63,500.00	0.03
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	13,930,000.00	6.55
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	200,904,781.58	94.45

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未通过港股通投资股票。

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

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	000858	五粮液	150,000	17,692,500.00	8.32
2	000661	长春高新	46,000	15,548,000.00	7.31
3	002714	牧原股份	238,000	13,992,020.00	6.58
4	601012	隆基股份	580,000	13,403,800.00	6.30
5	300498	温氏股份	354,100	12,698,026.00	5.97
6	603338	浙江鼎力	215,000	12,622,650.00	5.93
7	000596	古井贡酒	100,000	11,851,000.00	5.57
8	002157	正邦科技	600,000	9,996,000.00	4.70
9	600872	中炬高新	220,000	9,422,600.00	4.43
10	000333	美的集团	180,000	9,334,800.00	4.39

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。

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。

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投资。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

注: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

注: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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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情况,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	68,686.77
2	应收证券清算款	5,971,333.10
3	应收股利	-
4	应收利息	2,707.60
5	应收申购款	71,030.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,113,766.52

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

注:本基金本报告期末未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	123,567,186.03
报告期期间基金总申购份额	27,969,213.75
减:报告期期间基金总赎回份额	26,639,264.85
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	124,887,134.93

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§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
2019年7月17日

华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞医疗健康
交易代码	005805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月25日
报告期末基金份额总额	204,970,059.70份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下,把握医疗健康相关的行业投资机会,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上,结合政策面、市场资金面等情况,在经济周期不同阶段,依据市场不同表现,在大类资产中进行配置,把握医疗健康相关行业的行业投资机会,保证整体投资业绩的持续性。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率*65%+中债综合指数收益率*35%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。 本基金可能投资港股通标的股票,除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险,还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	18,810,525.45
2.本期利润	6,468,554.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0341
4.期末基金资产净值	242,830,660.74
5.期末基金份额净值	1.1847

注:1、所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。

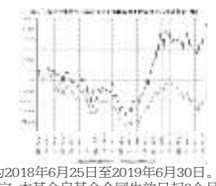
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	2.76%	1.51%	-5.80%	1.06%	8.56%	0.46%

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2018年6月25日至2019年6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投资范围中规定的比例。

§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		
徐晓杰	本基金的基金经理	2018年6月25日	-	13年	博士研究生,13年证券(基金)从业经历。2006年7月至2007年9月任邦联资产管理有限公司研究员;2007年9月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2014年4月至2015年5月任研究部总监助理。2015年5月至2018年5月任华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金的基金经理。2015年6月至2018年5月任华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年10月起任华泰柏瑞微盈动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年8月起任华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年6月起任华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金的基金经理。2018年8月起任华泰柏瑞现代服务业混合型证券投资基金的基金经理。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年中国经济增长稳健,通胀温和。19年1-5月,规模以上工业企业营业收入同比增速降幅收窄到-2.3%,其中5月当月增速1.1%,较4月回升转正。5月CPI环比持平,同比继续回升至2.7%;5月PPI同比回落至0.6%,环比上涨0.2%。

19年上半市场整体表现较好,本基金重点持仓了医药行业,上半年表现相对较好。从长期来看,我们看好医药行业在深化医疗制度改革的大背景下带来的优秀企业的投资机会。同时我们也在思考由于政策推进力度的超预期使得行业变革将加速,在加快变革的过程中,我们更要精挑细选具备核心竞争优势,能够持续胜出的企业。我们希望能够与优秀的企业共成长,见证中国医药企业由小到大,区域性成长为全国性,国内领先做到全球标准,从优秀到卓越的整个历程。我们也坚信必定有这样的优秀企业带领中国的医药行业进入到更规范、更有竞争力的生态环境。

医药行业投资策略上,19年三季度我们继续看好创新药企业的长期发展空间,长期看好政策影响相对较小的医疗服务类相关公司,同时我们也看好各细分行业的龙头公司。基金操作上,我们仍将精选个股以追求绝对收益;更加灵活控制仓位以降低系统性风险;进行合理资产配置以实现更好的收益。

4.5 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1.1847元,基金份额净值增长2.76%,本基金的业绩比较基准下降5.80%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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	216,601,938.96	87.97
	其中:股票	216,601,938.96	87.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,011,239.49	8.94
8	其他资产	7,601,034.27	3.09
9	合计	246,214,212.72	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	97,845.10	0.04
C	制造业	151,610,787.93	62.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	15,109,318.53	6.22
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.02
J	金融业	33,869.94	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,861,892.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	46,825,515.10	19.28
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	216,601,938.96	89.20

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

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	000661	长春高新	67,900	22,950,200.00	9.45
2	300347	泰格医药	269,474	20,776,445.40	8.56
3	600276	恒瑞医药	252,163	16,642,758.00	6.85
4	600763	通策医疗	181,400	16,070,226.00	6.62
5	300595	欧普康视	338,789	12,060,568.00	4.97
6	300760	迈瑞医疗	66,500	10,852,800.00	4.47
7	300015	爱尔眼科	322,210	9,978,843.70	4.11
8	300630	普利制药	136,100	7,842,082.00	3.23
9	002821	凯莱英	77,800	7,630,624.00	3.14
10	600529	山东药玻	297,345	6,773,519.10	2.79

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。

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。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

注: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

注: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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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情形,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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	211,211.25
2	应收证券清算款	6,938,469.38
3	应收股利	-
4	应收利息	5,977.24
5	应收申购款	445,376.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,601,034.27

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

注:截至本报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	242,181,996.38
报告期期间基金总申购份额	66,466,511.39
减:报告期期间基金总赎回份额	103,678,448.07
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	204,970,059.70

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
		持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比
机构	1	20190617-20190630	-	45,126,353.79	0.00		45,126,353.79	22.02%
	2	20190401-20190630	91,850,430.35	0.00	21,850,430.35		70,000,000.00	34.15%
	-	-	-	-	-		-	-
个人	-	-	-	-	-		-	-
产品特有风险								

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回,可能导致巨额赎回,从而引发流动性风险,可能对基金产生如下影响:(1)延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时,投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。(2)基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能知回的市进行资产变现,这将对基金资产净值产生不利影响,同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题,这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。(3)基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小,基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形,从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。(4)基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向,审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响,同时将完善流动性风险管控机制,最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§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
2019年7月17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

2019年第二季度报告

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:2019年7月17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2019年7月16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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

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于2018年6月13日根据收费方式分不同,新增C类份额,C类相关指标从2018年6月13日开始计算。

§2 基金产品概况

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	770,789,076.06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指数紧密跟踪的分被动指数基金,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	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞中证500ETF联接A	华泰柏瑞中证500ETF联接C
下属分级基金的交易代码	001214	006087
报告期末下属分级基金的份额总额	309,275,770.17份	461,513,305.89份

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

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。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。

§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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	华泰柏瑞中证500ETF联接A	华泰柏瑞中证500ETF联接C
1. 本期已实现收益	-4,935,597.83	-2,151,513.67
2. 本期利润	-20,269,474.91	-7,893,854.28
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0605	-0.0669
4.