华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

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:2015年10月27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2015年10月26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7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞量化智慧混合
交易代码	001244
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月3日
报告期末基金份额总额	696,976,205.37份
投资目标	利用定量投资模型,在有效控制风险的前提下,追求资产的长期增值,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略如下: 1.股票投资策略 本基金主要通过定量投资模型,选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合,在有效控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。但在极端市场情况下,为保护投资者的本金安全,股票资产比例可降至0%。 2.固定收益资产投资策略 本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。 3.资产支持证券投资策略 在对市场利率环境深入研究的基础上,本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略,结合定量分析和定性分析的方法,综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素,选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。 4.权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具,其投资原则为有利于基金资产增值,有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资行将对权证标的证券的基本面进行研究,同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。 5.其他金融衍生工具投资策略 在法律法规允许的范围内,本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险,提高投资效率,本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种,本基金将以风险管理和组合优化为目的,根据届时法律法规的相关规定参与投资。
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	本基金为混合型基金,其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。
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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-60,350,588.48
2.本期利润	-113,970,755.24
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1527
4.期末基金资产净值	563,086,639.43
5.期末基金份额净值	0.8079

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。

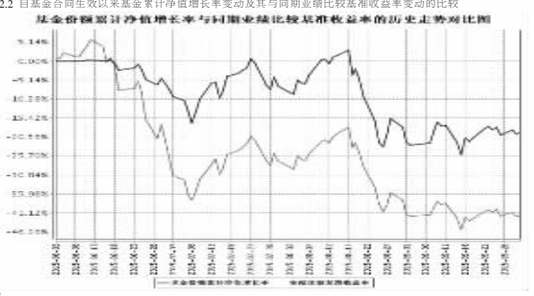
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-15.29%	3.24%	-29.76%	3.82%	14.47%	-0.58%

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6月3日至2015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,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条(二)投资范围、(四)之1、基金投资组合比例限制中规定的各项比例,股票资产的投资比例占基金资产的0-95%;在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

§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		
田汉卿	副总经理、本基金的基金经理	2014年12月17日	-	11	副总经理,曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司(BGI)担任投资经理;2012年8月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,2013年8月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2013年10月起任公司副总经理,2014年12月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年3月起任华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化联动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学。MBA毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。

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

在监管层一系列及时、有效的救市措施下,6月中旬到7月初由配资强平引起的流动性危机得以解决。但受到8月份汇率波动,A股再次重挫。随着9月份去杠杆去泡沫进入尾声,以及政策利空出尽,市场正进入安全区间。而三季末市场反弹也一定程度上反映了市场微观结构正在恢复。

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+0.29%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.027%,期间日跟踪误差为0.036%,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1.2221元,还原后基金份额累计净值为0.6076元,本报告期内基金份额净值下降30.91%,本基金的业绩比较基准下降31.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来A股表现仍取决于中国经济转型和改革的进一步深化,以及市场风险偏好的恢复,四季度保持乐观。市场普遍担心美国加息和人民币贬值对于A股市场的影响。一方面,从美联储连续推迟加息步伐以及美国经济数据疲软,市场对于美联储短期加息预期减弱;另一方面,人民币汇率从"非稳态"逐步回到阶段性"稳态"。基本面方面,目前国内的传统行业下行趋势并没有结束,重资产行业的投资冲动小、资金需求少,这有利于利率的进一步下行。不过随着国内"保增长"政策的不断加码,实体经济可能在明年上半年实现企稳,届时利率下行的空间就会面临限制了。

大机会仍在新兴产品,转型经济领域,但投资者将更为理性和稳健。在市场信心未明确恢复前,低估值、高红利的蓝筹板块相对投资价值更佳。

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

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	380,867,609.47	67.33
	其中:股票	380,867,609.47	67.33
2	固定收益投资	20,074,000.00	3.55
	其中:债券	20,074,000.00	3.55
	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	100,000,000.00	17.68
	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	54,158,488.71	9.57
7	其他资产	10,570,607.00	1.87
8	合计	565,670,705.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,806,298.00	0.85
B	采矿业	10,995,932.30	1.95
C	制造业	275,251,734.46	48.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,003,127.70	2.31
E	建筑业	15,279,000.51	2.71
F	批发和零售业	14,540,593.12	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	11,812,775.07	2.10
H	住宿和餐饮业	2,260,491.00	0.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,966,765.50	0.88
J	金融业	739,390.80	0.13
K	房地产业	20,589,170.61	3.66
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	3,705,082.40	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,917,248.00	0.52
S	综合	-	-
	合计	380,867,609.47	67.64

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	002202	金风科技	617,132	8,337,453.32	1.48
2	002179	中航光电	216,140	7,655,678.80	1.36
3	601668	中国建筑	1,266,400	7,319,792.00	1.30
4	600973	宝胜股份	639,680	7,177,209.60	1.27
5	002080	中材科技	434,800	6,948,104.00	1.23
6	002538	司尔特	684,316	6,843,160.00	1.22
7	600176	中国巨石	318,743	6,674,478.42	1.19
8	603001	奥康国际	259,679	6,595,846.60	1.17
9	002588	史丹利	297,321	6,478,624.59	1.15
10	000418	小天鹅A	340,500	6,363,945.00	1.13

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,074,000.00	3.56
	其中:政策性金融债	20,074,000.00	3.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	20,074,000.00	3.56

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150307	15进出07	100,000	10,052,000.00	1.79
2	140230	14国开30	100,000	10,022,000.00	1.78

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1512	IC1512	40	44,566,400.00	-9,002,800.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-9,002,800.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-9,002,800.00

注:按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定,"其他衍生工具-股指期货投资"与"证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款",符合金融资产与金融负债相抵销的条件,故将"其他衍生工具-股指期货投资"的期末公允价值以抵销后的净额列报,净额为零。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据公募基金相关法规和本基金合同,我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期初,股指期货大幅贴水,我们选择买入相对便宜的股指期货替代一部分股票仓位,同时也提升了组合的流动性。

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

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

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	9,067,334.08
2	应收证券清算款	962,043.99
3	应收股利	-
4	应收利息	539,147.35
5	应收申购款	2,081.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,570,607.00

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:本基金期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	906,942,174.07
报告期期间基金总申购份额	18,815,737.33
减:报告期期间基金总赎回份额	228,781,706.03
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	696,976,205.37

§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
2015年10月27日

华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

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:2015年10月27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2015年10月26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7月1日起至2015年9月30止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞消费成长混合
交易代码	001069
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月20日
报告期末基金份额总额	886,465,477.66份
投资目标	通过深入研究,本基金投资于消费相关行业优质的成长性公司,在有效控制风险的前提下,力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用"自上而下"和"自下而上"相结合方法来构建投资组合,通过定量和定性分析,对宏观经济、市场环境、行业估值等因素做深入系统研究,分析比较股票和债券预期收益率变化,优化股票和债券的投资比例从而确定大类资产配置。
业绩比较基准	申银万国消费品指数*80%+中证全债指数*20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。
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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	8,931,981.13
2.本期利润	51,941,571.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0496
4.期末基金资产净值	904,026,325.02
5.期末基金份额净值	1.020

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	3.87%	2.85%	-22.15%	2.88%	26.02%	-0.03%

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20日至2015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,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§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		
方纬	基金经理	2015年5月20日	-	12	经济学硕士,2003年9月至2005年1月任上海金信研究所研究员;2005年1月任上海金信研究所研究员;2005年1月至2007年2月任万家基金管理有限公司高级研究员;2007年2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8月起任华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金的基金经理,2015年4月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年5月起任华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年8月起任华泰柏瑞中国新动2025灵活配置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

2015年三季度,A股大幅度调整,沪深300指数下跌28.39%,中证500指数下跌31.24%,创业板指数下跌27.14%。市场快速去杠杆,股指大幅度波动。

投资策略上,本基金严格控制风险,谨慎建仓部分规避了市场快速下跌风险。

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1.020元,上涨3.87%,同期本基金的业绩比较基准下降22.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A股在三季度经历了快速的牛熊转换,转换的主要因素是风险偏好的变化,今年6月风险偏好达到最高峰,到9月风险偏好则下降到了冰点。我们认为四季度风险偏好会逐步改善。主要原因之一就是监管机构对于配资清理完毕,市场整体面临的金融风险得到了有效控制。场内两融下降到了9400亿的水平,接近去年12月的水平。另一个原因就是央行对货币政策进行了重大调整,为了保持国内的流动性宽松,应对美元加息周期,央行采取更加灵活的汇率定价机制来维持国内流动性宽松的预期,货币政策从以"外部均衡"为主向"内部均衡"为主转变。

四季度,新一轮刺激即将展开,国企改革有序推进,十三五规划陆续出台,预计在各类主题刺激下,机构被动提升仓位,市场将会出现不错的反弹。在传统经济不振的背景下,我们认为未来的投资机会依旧是结构性的。经济转型,国企改革是我们这个时代的主题,我们将顺应这一趋势,为投资者创造收益。

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	841,585,067.96	92.36
	其中:股票	841,585,067.96	92.36
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	66,402,033.54	7.29
7	其他资产	3,236,701.20	0.36
8	合计	911,223,802.70	100.00

5.2 报告期末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	-	-
B	采矿业	6,773,465.00	0.75
C	制造业	529,119,488.36	58.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,428,784.00	1.04
E	建筑业	9,392,832.00	1.04
F	批发和零售业	14,090,447.00	1.56
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	2,181,888.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	173,565,604.76	19.20
J	金融业	9,649,554.00	1.07
K	房地产业	34,696,489.58	3.84
L	租赁和商务服务业	13,061,000.00	1.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,780,808.00	1.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,173,996.00	1.01
R	文化、体育和娱乐业	20,670,711.26	2.29
S	综合	-	-
	合计	841,585,067.96	93.09

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	300144	宋城演艺	536,959	12,124,534.22	1.34
2	601799	星宇股份	506,400	11,059,776.00	1.22
3	300271	华宇软件	313,752	11,059,758.00	1.22
4	600271	航天信息	202,001	10,845,433.69	1.20
5	002657	中科金财	172,200	10,488,702.00	1.16
6	300327	中颖电子	607,366	10,477,063.50	1.16
7	002390	信邦制药	1,007,100	10,463,769.00	1.16
8	002326	永太科技	842,400	10,445,760.00	1.16
9	002465	海格通信	815,800	10,417,766.00	1.15
10	603020	爱普股份	258,450	10,412,950.50	1.15

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

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

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

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	625,863.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,824.41
5	应收申购款	2,591,012.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,236,701.20

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	1,463,856,695.50
报告期期间基金总申购份额	160,801,059.57
减:报告期期间基金总赎回份额	738,192,277.41
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	886,465,477.66

§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
2015年10月27日

华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

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:2015年10月27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2015年10月26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7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞中证500ETF
场内简称	ETF500
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	332,429,801.00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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-29,417,153.14
2.本期利润	-165,240,188.24
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5192
4.期末基金资产净值	406,266,470.06
5.期末基金份额净值	1.2221

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	-30.95%	4.05%	-31.24%	4.03%	0.29%	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9月30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;