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 年半年度报告

2017年6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

送出日期: 2017年8月26日

§1 重要提示及目录

1.1 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的法律责任。本半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 2017 年 8 月 25 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 基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要	提示及目录	2
	1.1	重要提示	2
	1.2	目录	3
§2	基金	简介	6
	2.1	基金基本情况	6
	2.2	基金产品说明	6
	2.3	基金管理人和基金托管人	8
	2.4	信息披露方式	8
	2.5	其他相关资料	9
§ 3	主要	财务指标和基金净值表现	10
	3.1	主要会计数据和财务指标	10
	3.2	基金净值表现	10
	3.3	其他指标错误! 未定义书	签。
§4	管理	人报告	13
	4.1	基金管理人及基金经理情况	13
	4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	15
	4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
	4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	16
	4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
	4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
	4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
	4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5	托管	人报告	18
	5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	18
	5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
	5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§ 6	半年	度财务会计报告(未经审计)	19
	6.1	资产负债表	19
	6.2	利润表	20

	6.3 所有者权益(基金净值)变动表	22
	6.4 报表附注	24
§7	投资组合报告	44
	7.1 期末基金资产组合情况	44
	7.2 期末按行业分类的股票投资组合	44
	7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
	7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
	7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
	7.6 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	48
	7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
	7.8 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贵金属投资明细	48
	7.9 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	48
	7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	48
	7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
	7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
	7.13 投资组合报告附注	49
§8	基金份额持有人信息	51
	8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
	8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
	8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	51
§9	开放式基金份额变动	52
§1 () 重大事件揭示	53
	10.1 基金份额持有人大会决议	53
	10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
	10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
	10.4 基金投资策略的改变	53
	10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
	10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
	10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
	10.8 其他重大事件	56

§11	影响投资者决策的其他重要信息	58
	11.1 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	58
	11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12	备查文件目录	60
	12.1 备查文件目录	60
	12.2 存放地点	60
	12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

甘人石和	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联
基金名称	接基金
基金简称	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接
基金主代码	460300
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月29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
报告期末基金份额总额	201, 644, 856. 18 份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年5月4日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012年5月28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	中国工商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

	紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差
汉贝白你	的最小化。
投资策略	本基金为沪深 300ETF 的联接基金。沪深 300ETF 是主

	要采用完全复制法实现对沪深 300 指数紧密跟踪的全
	被动指数基金,本基金主要通过投资于沪深 300ETF 实
	现对业绩比较基准的紧密跟踪。 在投资运作过程中,
	本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素
	的基础上,决定采用一级市场申购赎回的方式或二级
	市场买卖的方式投资于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放
	式指数证券投资基金。
ルルクキーレケ☆ 甘ツ砂・	沪深 300 指数 × 95% +银行活期存款税后收益率 ×
业绩比较基准	5%
	本基金为沪深 300ETF 的联接基金, 采用主要投资于华
	泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金实现
风险收益特征	对业绩比较基准的紧密跟踪。因此,本基金的业绩表
	现与沪深 300 指数的表现密切相关。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。

2.2.1 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
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	沪深 300 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,股票最低仓
	位为95%,并采用完全复制的被动式投资策略:一方面,
	相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言,其
	风险和收益较高,属于股票型基金中高风险、高收益
	的产品;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。

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	中国工商银行股份有限公司
公 自 林 東 A 末	姓名	陈晖	郭明
信息披露负责	联系电话	021-38601777	010-66105799
人	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	010-66105798
		上海市浦东新区民生路 1199	北京主要林豆有W沿山上外。「「
注册地址		弄上海证大五道口广场1号17	北京市西城区复兴门内大街 55
		层	묵
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199	北京主要林豆有W沿山上外。「「
		弄上海证大五道口广场1号17	北京市西城区复兴门内大街 55 号
		层	7
邮政编码		200135	100140
法定代表人		贾波	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
----------------	------------------

登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址	http://www.huatai-pb.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
分 III	化丰拉迪甘入英四左四八司	上海市浦东新区民生路1199弄证大
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	五道口广场 1 号楼 17 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	4, 861, 153. 82
本期利润	38, 084, 536. 26
加权平均基金份额本期利润	0. 1508
本期加权平均净值利润率	9.87%
本期基金份额净值增长率	10. 42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	65, 632, 369. 94
期末可供分配基金份额利润	0. 3255
期末基金资产净值	328, 321, 564. 22
期末基金份额净值	1. 6282
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	62. 82%

- 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、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

	小兔店	份额净值	业绩比较	业绩比较基		
阶段	份额净值	增长率标	基准收益	准收益率标	1)-3	2-4
	增长率①	准差②	率③	准差④		

过去一个月	5. 26%	0. 62%	4. 73%	0. 64%	0. 53%	-0. 02%
过去三个月	6. 48%	0. 58%	5. 79%	0.59%	0. 69%	-0. 01%
过去六个月	10. 42%	0. 53%	10. 23%	0.54%	0. 19%	-0. 01%
过去一年	17. 49%	0. 63%	15. 44%	0.63%	2. 05%	0. 00%
过去三年	73. 82%	1. 58%	65. 95%	1.66%	7. 87%	-0. 08%
自基金合同	62, 82%	1 490/	39. 04%	1 400/	23. 78%	0. 07%
生效起至今	02.82%	1. 42%	59 . 04%	1. 49%	23. 18%	-0. 07%

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、图示日期为2012年5月29日至2017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十一部分(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%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批 准,于2004年11月18日成立的合资基金管理公司,注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成 为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司(原 AIGGIC)和苏州新区高新技术产业股份有 限公司,出资比例分别为49%、49%和2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基 金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、 华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币 市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资 基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、 华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投 资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、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、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证 券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华 泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵 活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱 动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配 置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、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、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华 泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华 泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型证券 投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金、 华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基 金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场 基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基 金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投

资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞森利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞称利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金。截至 2017 年 6 月 30 日,公司基金管理规模为 916. 45 亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金	经理(助理)期限	证券从	说明	
灶石	4N.77	任职日期	离任日期	业年限	נקי טע	
					16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,2004年7	
	指数投					月起加入本公司, 历任基金事务
	资部总			16 年	部总监、基金经理助理。2009	
柳军	监、本	2012年5月29			年6月起任华泰柏瑞(原友邦华	
1911 —	基金的	日		10 +	泰) 上证红利交易型开放式指数	
	基金经				基金基金经理。2010年10月起	
	理				任指数投资部副总监。2011年1	
					月起担任上证中小盘ETF及华泰	
					柏瑞上证中小盘ETF联接基金基	
					金经理。2012年5月起担任华泰	
					柏瑞沪深 300ETF 及华泰柏瑞沪	
					深 300ETF 联接基金基金经理。	
					2015年2月起任指数投资部总	

		监。2015年5月起任华泰柏瑞中
		证 500 ETF 及华泰柏瑞中证
		500ETF 联接基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《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基金合同》的约定,在严格控制风险的基础上,忠实履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离,实行集中交易制度,由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务,为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况,不同业务类别的投资经理之间互不干扰,独立做出投资决策。公司机构设置合理,公平交易的相关管理制度健全,投资决策流程完善,各项制度执行情况良好。

交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待,不存在非公平交易和利益输送的行为。 经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现,报告期内基金之间的买卖交 易价差总体上处于正常的合理水平,只在少数情况下"存在显著的倾向性"。针对这些少量的"具 有显著倾向性"的交易价差进行研究表明,交易价差方向没有规律性,即没有明确的利益输送方 向。同时潜在利益输送金额比较小(全部低于基金规模的 0.5%),因此不构成利益输送。造成少 量显著交易价差的原因来自两方面:一是报告期内股票市场的波动幅度较大,为基金之间股票交 易出现显著价差创造了客观条件;二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异,对证券买 卖时点的把握也不同,导致股票买卖存在价差。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 上半年 A 股市场分化显著,大盘蓝筹稳步走强,中小盘股票则经历估值下调。截至 6 月底,沪深 300 指数累计涨幅 10.78%,中证 500 和中证 1000 指数分别下跌-2.00%和-12.07%。从投资线索来看,一方面,市场对于经济"周期复苏"的预期,驱动钢铁、有色金属、建筑建材等板块上涨;另一方面,得益于资金对具有低估值、稳定盈利、高分红类型股票的追捧,消费、医药生物、金融服务等板块表现亮眼。

我们严格按照基金合同的规定,紧密跟踪业绩基准、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 **0.179%**,日均绝对跟踪偏离度为 **0.016%**,期间日跟踪误差为 **0.038%**,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 1.6282 元;本报告期基金份额净值增长率为 10.42%,业 绩比较基准收益率为 10.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年经济走势我们并不悲观。在政策打压房地产投机和金融降杠杆的大背景下,宏观经济展现出较好的韧性。下半年三、四线房地产数据有望超预期,而经过前期较为严格的金融降杠杆,经济和市场出现系统性风险的可能性大幅降低。但年内经济发生显著好转的概率也不大,加之当前市场情绪偏低,我们认为当前风格将得以延续。具有稳定业绩增长、估值合理、高分红等价值蓝筹仍是首选。需要特别指出的是,伴随股价上涨,当前龙头白马股的估值已处于历史相对高位,价值资金抱团现象显著。此外,随着本轮调整,小盘股估值趋于合理,后期有望超跌反弹。

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业绩基准 第 16 页 共 60 页 基本一致的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,基金管理人严格执行基金估值控制流程,定期评估估值技术的合理性,每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人,基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定,在符合有关基金分红条件的前提下,基金每年收益分配次数最多为 12次;每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%,若基金合同生效不满 3 个月,可不进行收益分配。截至本报告期末,本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,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的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,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未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体: 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

报告截止日: 2017年6月30日

单位: 人民币元

		本期末	
资产	附注号	2017年6月30日	2016年12月31日
资 产:			
银行存款	6. 4. 7. 1	17, 106, 502. 15	22, 202, 893. 67
结算备付金		54, 306. 81	5, 190, 929. 88
存出保证金		109, 311. 46	325, 397. 94
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	311, 525, 187. 00	377, 497, 201. 87
其中: 股票投资		482, 612. 00	21, 480. 00
基金投资		311, 042, 575. 00	377, 475, 721. 87
债券投资		-	_
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6. 4. 7. 3	-	-
买入返售金融资产	6. 4. 7. 4	-	_
应收证券清算款		20, 450. 73	-
应收利息	6. 4. 7. 5	3, 387. 02	6, 131. 99
应收股利		-	_
应收申购款		49, 799. 78	8, 517. 20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 6	-	_
资产总计		328, 868, 944. 95	405, 231, 072. 55
在建和庇士老和米	1744.5 } 12	本期末	上年度末
负债和所有者权益	附注号	2017年6月30日	2016年12月31日

负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		359, 279. 63	145, 978. 21
应付管理人报酬		6, 902. 71	10, 993. 96
应付托管费		1, 380. 54	2, 198. 80
应付销售服务费		-	_
应付交易费用	6. 4. 7. 7	206. 39	25, 470. 84
应交税费			-
应付利息			-
应付利润		-	_
递延所得税负债			-
其他负债	6. 4. 7. 8	179, 611. 46	380, 386. 50
负债合计		547, 380. 73	565, 028. 31
所有者权益:			
实收基金	6. 4. 7. 9	201, 644, 856. 18	274, 423, 723. 22
未分配利润	6. 4. 7. 10	126, 676, 708. 04	130, 242, 321. 02
所有者权益合计		328, 321, 564. 22	404, 666, 044. 24
负债和所有者权益总计		328, 868, 944. 95	405, 231, 072. 55

注:报告截止日 2017 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.6282 元,基金份额总额 201,644,856.18 份。

6.2 利润表

会计主体: 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

本报告期: 2017年1月1日至2017年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间

		2017年1月1日至	2016年1月1日至
		2017年6月30日	2016年6月30日
一、收入		38, 374, 570. 03	-240, 784, 155. 76
1.利息收入		129, 236. 85	293, 584. 69
其中:存款利息收入	6.4.7.11	129, 236. 85	293, 584. 69
债券利息收入		_	_
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		_	-
其他利息收入		_	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		4, 710, 372. 43	-103, 926, 869. 02
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	31, 934. 02	-
甘入机次业光	6 4 7 12	-1, 929, 330. 8	-127, 587, 891. 6
基金投资收益	6.4.7.13	9	4
债券投资收益	6.4.7.14	_	_
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	_	
贵金属投资收益	6.4.7.15	_	-
衍生工具收益	6.4.7.16	435, 480. 00	-
股利收益	6.4.7.17	6, 172, 289. 30	23, 661, 022. 62-
3.公允价值变动收益(损失以"-"	6 4 7 10	22 222 222 44	120 040 704 00
号填列)	6.4.7.18	33, 223, 382. 44	-138, 248, 794. 00
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		_	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.19	311, 578. 31	1, 097, 922. 57
减:二、费用		290, 033. 77	421, 478. 16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	67, 496. 52	163, 991. 59
2. 托管费	6.4.10.2.2	13, 499. 32	32, 798. 36
3. 销售服务费	6.4.10.2.3		
4. 交易费用	6.4.7.20	30, 329. 44	45, 497. 83
5. 利息支出		_	-
其中: 卖出回购金融资产支出		_	_

6. 其他费用	6.4.7.21	178, 708. 49	179, 190. 38
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		38, 084, 536. 26	-241, 205, 633. 92
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		38, 084, 536. 26	-241, 205, 633. 92

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 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

本报告期: 2017年1月1日至2017年6月30日

单位: 人民币元

	本期					
-Œ FI	2017年1月1日至2017年6月30日					
项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计			
一、期初所有者权益(基	274, 423, 723. 22	130, 242, 321. 02	404, 666, 044. 24			
金净值)	214, 420, 120. 22	130, 242, 321. 02	404, 000, 044. 24			
二、本期经营活动产生的						
基金净值变动数(本期利	_	38, 084, 536. 26	38, 084, 536. 26			
润)						
三、本期基金份额交易产						
生的基金净值变动数	70 770 007 04	41 650 140 94	114 400 016 00			
(净值减少以"-"号填	-72, 778, 867. 04	-41, 650, 149. 24	-114, 429, 016. 28			
列)						
其中: 1. 基金申购款	118, 140, 449. 75	62, 367, 532. 42	180, 507, 982. 17			
2. 基金赎回款	-190, 919, 316. 79	-104, 017, 681. 66	-294, 936, 998. 45			
四、本期向基金份额持有						
人分配利润产生的基金						
净值变动(净值减少以	_	_	_			
"-"号填列)						

五、期末所有者权益(基 金净值)	201, 644, 856. 18	126, 676, 708. 04	328, 321, 564. 22	
	上年度可比期间			
- 	2016年	1月1日至2016年6月	30 日	
项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	
一、期初所有者权益(基	1, 051, 225, 112. 32	633, 876, 844. 64	1, 685, 101, 956. 96	
金净值)	1, 001, 223, 112. 32	000, 010, 011. 01	1, 003, 101, 330. 30	
二、本期经营活动产生的				
基金净值变动数(本期利	_	-241, 205, 633. 92	-241, 205, 633. 92	
润)				
三、本期基金份额交易产				
生的基金净值变动数	-513, 107, 886. 39	-185, 051, 691. 44	-698, 159, 577. 83	
(净值减少以"-"号填	-515, 107, 660. 59	-100, 001, 091. 44	-090, 109, 077. 03	
列)				
其中: 1.基金申购款	121, 700, 821. 44	58, 904, 836. 34	180, 605, 657. 78	
2. 基金赎回款	-634, 808, 707. 83	-243, 956, 527. 78	-878, 765, 235. 61	
四、本期向基金份额持有				
人分配利润产生的基金				
净值变动(净值减少以	_	_	_	
"-"号填列)				
五、期末所有者权益(基	E90 117 00E 00	207 610 510 00	745 796 745 91	
金净值)	538, 117, 225. 93	207, 619, 519. 28	745, 736, 745. 21	

注:报表附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

		赵景云
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]392 号《关于核准华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 366,989,094.83 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 171 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于 2012 年 5 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 367,019,682.35 份基金份额,其中认购资金利息折合 30,587.52 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"目标 ETF")的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对沪深 300 指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括目标ETF、沪深 300 指数成份股及备选成份股、非成份股、债券、新股(一级市场初次发行和增发)、权证、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。正常情况下,本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%; 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%; 股指期货以套期保值为目的,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数× 95% +银行活期存款税后收益率× 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2017年8月26日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则一基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期采用的会计政策和会计估计与上年度相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

- (1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。
- (2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票的差价收入,股权的股息、红利收入其他收入,暂不征收企业所得税。
- (3)对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时计入个人应纳税所得额。个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
 - (4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末	
	2017年6月30日	
活期存款	17, 106, 502. 15	
定期存款	-	
其中: 存款期限 1-3 个月	_	
其他存款	-	
合计	17, 106, 502. 15	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

		本期末		
项目	2017年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	445, 093. 57	482, 612. 00	37, 518. 43	
贵金属投资-金交所	_	-	_	

黄金合:	约			
债券	交易所市场	_	_	_
灰分 	银行间市场	_	_	-
	合计	_	_	-
资产支	持证券	_	_	-
基金		294, 093, 614. 72	311, 042, 575. 00	16, 948, 960. 28
其他		_	_	
合计		294, 538, 708. 29	311, 525, 187. 00	16, 986, 478. 71

注:基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额,按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。 本基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 份额的买卖。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注: 截至本报告期末,本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注: 截至本报告期末,本基金买入返售金融资产余额为0。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注: 截至本报告期末,本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

福日	本期末	
项目	2017年6月30日	
应收活期存款利息	3, 308. 53	
应收定期存款利息	_	
应收其他存款利息	-	
应收结算备付金利息	29. 29	
应收债券利息	-	
应收买入返售证券利息	-	
应收申购款利息	_	

应收黄金合约拆借孳息	_
其他	49. 20
合计	3, 387. 02

6.4.7.6 其他资产

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位: 人民币元

· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	本期末	
项目	2017年6月30日	
交易所市场应付交易费用	206. 39	
银行间市场应付交易费用	_	
合计	206. 39	

6.4.7.8 其他负债

单位: 人民币元

福日	本期末		
项目	2017年6月30日		
应付券商交易单元保证金	_		
应付赎回费	1, 092. 97		
预提费用	178, 518. 49		
合计	179, 611. 46		

6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

	本期		
项目	2017年1月1日至2017年6月30日		
	基金份额(份)	账面金额	
上年度末	274, 423, 723. 22	274, 423, 723. 22	

本期申购	118, 140, 449. 75	118, 140, 449. 75
本期赎回(以"-"号填列)	-190, 919, 316. 79	-190, 919, 316. 79
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	_	-
本期末	201, 644, 856. 18	201, 644, 856. 18

注: 申购含转换入份额; 赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计	
上年度末	84, 853, 469. 93	45, 388, 851. 09	130, 242, 321. 02	
本期利润	4, 861, 153. 82	33, 223, 382. 44	38, 084, 536. 26	
本期基金份额交易	04 000 052 01	17 567 005 49	41 650 140 94	
产生的变动数	-24, 082, 253. 81	-17, 567, 895. 43	-41, 650, 149. 24	
其中:基金申购款	39, 049, 257. 12	23, 318, 275. 30	62, 367, 532. 42	
基金赎回款	-63, 131, 510. 93	-40, 886, 170. 73	-104, 017, 681. 66	
本期已分配利润				
本期末	65, 632, 369. 94	61, 044, 338. 10	126, 676, 708. 04	

6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	96, 784. 54
定期存款利息收入	_
其他存款利息收入	_
结算备付金利息收入	30, 501. 91

其他	1, 950. 40
合计	129, 236 . 85

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位: 人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	10, 288. 00
股票投资收益——赎回差价收入	_
股票投资收益——申购差价收入	21, 646. 02
合计	31, 934. 02

注: 本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位: 人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	20, 473. 00
减: 卖出股票成本总额	10, 185. 00
买卖股票差价收入	10, 288. 00

注: 本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

注:本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位: 人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
申购基金份额总额	24, 724, 080. 00

减: 现金支付申购款总额	12, 238, 497. 76
减: 申购股票成本总额	12, 463, 936. 22
申购差价收入	21, 646. 02

6.4.7.13 基金投资收益

单位: 人民币元

福日	本期
项目	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	234, 358, 981. 61
减: 卖出/赎回基金成本总额	236, 288, 312. 50
基金投资收益	-1, 929, 330. 89

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

注:本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注: 本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注: 本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注: 本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注:无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

注:无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注:无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注:无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注:无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注:无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位: 人民币元

项目	本期收益金额
	2017年1月1日至2017年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	435, 480. 00

6.4.7.17 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	3, 469. 00
基金投资产生的股利收益	6, 168, 820. 30
合计	6, 172, 289. 30

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	33, 223, 382. 44

——股票投资	42, 753. 86
——债券投资	_
——基金投资	33, 180, 628. 58
——资产支持证券投资	_
——贵金属投资	_
——其他	_
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	_
合计	33, 223, 382. 44

6.4.7.19 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	282, 411. 80
转换费收入	29, 166. 51
合计	311, 578. 31

6.4.7.20 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
交易所市场交易费用	30, 329. 44	
银行间市场交易费用	_	
合计	30, 329. 44	

6.4.7.21 其他费用

单位:人民币元

福日	本期	
项目	2017年1月1日至2017年6月30日	
审计费用	29, 752. 78	
信息披露费	148, 765. 71	
银行划款手续费	190.00	
合计	178, 708. 49	

6.4.7.22 分部报告

注: 本基金本报告期内无分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日,本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系	
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构	
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构	
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构	
华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券	本基金的基金管理人管理的其他基金	
投资基金		

注: 1、关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注: 本报告期本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 基金交易

注: 本报告期本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.3 权证交易

注:本报告期本基金与关联方未进行权证交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

注:本报告期本基金无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

	本期	上年度可比期间	
项目	2017年1月1日至2017年6	2016年1月1日至2016年6月30	
月 30 日		日	
当期发生的基金应支付	67 406 59	163, 991. 59	
的管理费	67, 496. 52		
其中:支付销售机构的客	EO 496 49	44, 926. 68	
户维护费	50, 426. 48		

注:本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费,支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取 0)的 0.5%年费率计提,计算方法如下: H = E × 0.50% ÷ 当年天数。H 为每日应支付的管理人报酬; E 为前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值。基金管理人报酬每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

	本期	上年度可比期间	
项目	2017年1月1日至2017年6	2016年1月1日至2016年6月3	
	月 30 日	日	
当期发生的基金应支付	12 400 22	22, 700, 26	
的托管费	13, 499. 32	32, 798. 36	

注:本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费,支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取 0)的 0.1%年费率计提。计算方法如下: H = E × 0.10% ÷ 当年天数。 H 为每日应支付的托管费; E 为前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值。基金托管费每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.2.3 销售服务费

注:本基金本报告期未支付关联方销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注: 本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本期		期	上年度可比期间	
关联方	2016年1月1日至2016年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
名称	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	17, 106, 502. 15	96, 784. 54	43, 889, 031. 87	258, 224. 51

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注:于本报告期末,本基金持有84,250,000份目标ETF基金份额,占目标ETF基金总份额的比例为1.62%。

6.4.11 利润分配情况

注:无。

6.4.12 期末 (2017 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称		停牌原因	估值单	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300104	乐视网	年4月		30. 68			600	26, 715. 43	18, 408. 00	_

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注:无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为目标 ETF 的联接基金,采用主要投资于目标 ETF 基金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沪深 300 指数的表现密切相关。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。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资及债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现"风险和收益相匹配"的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由"组织、制度、流程和报告"等四个方面构成。 组织是指由公司总经理领导,以风险控制委员会为核心,由督察长、风险管理部、法律监察部组 成的风险管理机构,它是风险管理体系的运作基础;制度是指风险管理相关的规章制度,是对组 织职能及其工作流程等的具体规定;流程是风险管理的工作流程,它详细规定了各部门之间风险 管理工作的内容和程序;报告是对流程的必要反映和记录,既是风险管理工作的重要环节,也是 对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去 估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风 险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工 具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度, 及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款 存放在本基金的托管行中国工商银行,与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进 行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可 能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。于 2017 年 6 月 30 日,本基金未持有信用类债券。

6.4.13.2.1 投资

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%,主要采用二级市场交易的方式买卖,均能以合理价格适时变现。

于 2017 年 6 月 30 日,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不 计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合 约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量 在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末	1 4 11 11 4	1-3 个	3 个月-1	1 F F	- ケハー	ポ ソ 白	A 11	
2017年6月30日	1 个月以内	月	年	1-5 牛	5年以上	不计息	合计	
资产								
银行存款	17, 106, 502. 15	_	_	1	-	_	17, 106, 502. 15	
结算备付金	54, 306. 81	-	_		-	-	54, 306. 81	
存出保证金	109, 311. 46	_	_	1	-	_	109, 311. 46	
交易性金融资产	_	-	_	l	_	311, 525, 187. 00	311, 525, 187. 00	
应收证券清算款	_	l		l	-	20, 450. 73	20, 450. 73	
应收利息		l		I	l	3, 387. 02	3, 387. 02	
应收申购款	_	-	_	l	_	49, 799. 78	49, 799. 78	
资产总计	17, 270, 120. 42	-	_	1	-	311, 598, 824. 53	328, 868, 944. 95	
负债								
应付赎回款	_	_	_	_	_	359, 279. 63	359, 279. 63	

应付管理人报酬	_	_		_	_	6, 902. 71	6, 902. 71
应付托管费	_	_	_	_	_	1, 380. 54	1, 380. 54
应付交易费用	_	-	_	-	_	206. 39	206. 39
其他负债	-	_	-	_	-	179, 611. 46	179, 611. 46
负债总计	_	_	_	_	_	547, 380. 73	547, 380. 73
利率敏感度缺口	17, 270, 120. 42	_	_	_	_	311, 051, 443. 80	328, 321, 564. 22
上年度末	1 A F N d	1 0 4 1	0 & 日 1 左	1. F.左	e 左NLL	オ ソ 白	A.11
2016年12月31日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	22, 202, 893. 67	_	_	_	_	-	22, 202, 893. 67
结算备付金	5, 190, 929. 88	_	_	_	_	-	5, 190, 929. 88
存出保证金	325, 397. 94	_	_	_	_	_	325, 397. 94
交易性金融资产	_	_	_	_	_	377, 497, 201. 87	377, 497, 201. 87
应收利息	_	_	-	_	_	6, 131. 99	6, 131. 99
应收申购款	_	_	-	_	_	8, 517. 20	8, 517. 20
资产总计	27, 719, 221. 49	_	-	_	_	377, 511, 851. 06	405, 231, 072. 55
负债							
应付赎回款	_	_	_	_	_	145, 978. 21	145, 978. 21
应付管理人报酬	_	_	-	_	_	10, 993. 96	10, 993. 96
应付托管费	_	_	_	_	_	2, 198. 80	2, 198. 80
应付交易费用	-	-	_	-	_	25, 470. 84	25, 470. 84
其他负债	_	_	-	_	_	380, 386. 50	380, 386. 50
负债总计	_	_	_	_	_	565, 028. 31	565, 028. 31
利率敏感度缺口	27, 719, 221. 49	_	_	_	_	376, 946, 822. 75	404, 666, 044. 24

注:表中所示为本基金资产及负债的账面价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注:于 2017 年 6 月 30 日,本基金未持有交易性债券投资,因此市场利率的变动对于本基金资产 净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基 金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于目标 ETF,所面临的其他价格风险主要来源于沪深 300 指数波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资,正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%;本基金投资于目标 ETF 的方式以二级市场交易买卖为主。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金资产中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

	本期末		上年度末		
	2017年6月30	日	2016年12月31日		
项目		占基金		占基金资	
グロ	公允价值	资产净	八分价店	产净值比	
	公儿게但	值比例			
		(%)		例 (%)	
交易性金融资产-股票投资	482, 612. 00	0. 15	21, 480. 00	0.01	
交易性金融资产-基金投资	311, 042, 575. 00	94. 74	377, 475, 721. 87	93. 28	
交易性金融资产-债券投资	-	l	l	_	
交易性金融资产一贵金属投					
资	_				
衍生金融资产一权证投资	_	_	_	_	

其他	_	_	_	-
合计	311, 525, 187. 00	94. 88	377, 497, 201. 87	93. 29

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除"沪深300指数"以外的其他市场变量保持不变						
		对资产负债表日基金资产净值的					
	担关风险亦具的亦动	影响金额(单位:人民币万元)					
分析	相关风险变量的变动	本期末(2017年6月	上年度末(2016 年 12 月				
75 101		30 日)	31日)				
	1. 沪深 300 指数上升 5%	1557. 70	1, 888. 00				
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-1557. 70	-1, 888. 00				

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	482, 612. 00	0. 15
	其中: 股票	482, 612. 00	0. 15
2	基金投资	311, 042, 575. 00	94. 58
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	17, 160, 808. 96	5. 22
8	其他各项资产	182, 948. 99	0.06
9	合计	328, 868, 944. 95	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位: 人民币元

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	_	-
В	采矿业	4, 368. 00	0.00
С	制造业	264, 952. 00	0.08

D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	59, 794. 00	0.02
Е	建筑业	_	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	19, 140. 00	0. 01
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31, 168. 00	0. 01
J	金融业	43, 306. 00	0.01
K	房地产业	59, 884. 00	0.02
L	租赁和商务服务业	_	-
M	科学研究和技术服务业	1	_
N	水利、环境和公共设施管理业	1	-
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育	1	-
Q	卫生和社会工作	1	-
R	文化、体育和娱乐业	-	_
S	综合	-	
	合计	482, 612. 00	0. 15

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	000651	格力电器	1, 600	65, 872. 00	0. 02

2	000333	美的集团	1, 500	64, 560. 00	0. 02
3	000002	万 科A	2, 200	54, 934. 00	0. 02
4	000858	五 粮 液	600	33, 396. 00	0. 01
5	600352	浙江龙盛	3, 500	33, 355. 00	0. 01
6	600900	长江电力	2, 100	32, 298. 00	0. 01
7	000725	京东方A	7, 700	32, 032. 00	0. 01
8	601198	东兴证券	1, 600	27, 584. 00	0. 01
9	600674	川投能源	2, 800	27, 496. 00	0. 01
10	600029	南方航空	2, 200	19, 140. 00	0. 01
11	300104	乐视网	600	18, 408. 00	0. 01
12	600372	中航电子	1, 000	17, 370. 00	0. 01
13	601555	东吴证券	1, 400	15, 722. 00	0.00
14	600703	三安光电	700	13, 790. 00	0.00
15	600570	恒生电子	200	9, 336. 00	0.00
16	600208	新湖中宝	1, 100	4, 950. 00	0.00
17	600038	中直股份	100	4, 577. 00	0.00
18	600583	海油工程	700	4, 368. 00	0.00
19	600588	用友网络	200	3, 424. 00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1, 011, 706. 00	0. 25
2	601166	兴业银行	576, 522. 00	0. 14
3	600016	民生银行	553, 280. 00	0. 14
4	600036	招商银行	498, 300. 00	0. 12

5	601328	交通银行	430, 760. 00	0. 11
6	600000	浦发银行	375, 748. 25	0. 09
7	601668	中国建筑	358, 288. 00	0.09
8	600030	中信证券	333, 255. 00	0. 08
9	600837	海通证券	331, 985. 05	0. 08
10	601169	北京银行	311, 540. 96	0. 08
11	600887	伊利股份	292, 681. 00	0. 07
12	601766	中国中车	256, 678. 00	0. 06
13	601601	中国太保	221, 920. 00	0. 05
14	600900	长江电力	220, 788. 00	0. 05
15	600104	上汽集团	217, 800. 00	0. 05
16	601988	中国银行	196, 656. 00	0. 05
17	601989	中国重工	190, 440. 00	0. 05
18	601390	中国中铁	176, 640. 00	0. 04
19	600048	保利地产	174, 524. 00	0.04
20	601818	光大银行	171, 392. 00	0.04

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300655	晶瑞股份	14, 600. 00	0.00
2	601258	庞大集团	4, 185. 00	0.00
3	600783	鲁信创投	1, 688. 00	0.00

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位: 人民币元

买入股票成本(成交)总额	12, 892, 499. 36
--------------	------------------

卖出股票收入(成交)总额	20, 473. 00
--------------	-------------

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细 注:本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位:人民币元

						占基金资产
序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	净值比例
						(%)
1	华泰柏瑞	指数型	交易型开	华泰柏瑞		
	沪深		放式	基金管理	311, 042, 575. 00	94. 74
	300ETF			有限公司		

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:无。

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

- 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 7.12.1 本期国债期货投资政策

无。

7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:无。

7.12.3 本期国债期货投资评价

无。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

报告期内本基金及目标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。

7.13.2

本基金及目标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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	109, 311. 46
2	应收证券清算款	20, 450. 73
3	应收股利	-
4	应收利息	3, 387. 02
5	应收申购款	49, 799. 78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	_
9	合计	182, 948. 99

7.13.4 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。

7.13.5 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

			持有人结构					
持有人户	均数	户均持有的	机构投资者 个人投资者					
(户)		基金份额	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份额比例		
4,	315	46, 731. 14	169, 445, 115. 10	84. 03%	32, 199, 741. 08	15. 97%		

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员	040.22	0.000/
持有本开放式基金	949.32	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注: 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。 该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

§ 9 开放式基金份额变动

单位: 份

基金合同生效日(2012年5月29日)基金份额总额	367, 019, 682. 35
本报告期期初基金份额总额	274, 423, 723. 22
本报告期基金总申购份额	118, 140, 449. 75
减:本报告期基金总赎回份额	190, 919, 316. 79
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	_
本报告期期末基金份额总额	201, 644, 856. 18

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	股票交易	应支付该券商的佣金	
------	------	-----------	--

	交易单元数量	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金总量的比例	备注
东兴证券	2	12, 683, 199. 36	98. 25%	11, 811. 88	98. 28%	_
国都证券	1	205, 840. 00	1. 59%	187. 59	1. 56%	_
中金公司	2	20, 473. 00	0. 16%	18. 80	0. 16%	_
方正证券	2	_	_	_	_	_
华泰证券	2	_	_	_	_	_
兴业证券	1	_	_	_	_	_
瑞银证券	1	_	_	_	_	_
海通证券	1	_	_		_	_
国泰君安	2	_	_	_	_	_
国盛证券	1				_	
银河证券	2	_	_	_	_	_
齐鲁证券	3	_	_	_	_	_
湘财证券	2	_	_	_	_	_
上海证券	2	_	_	_	_	_
爱建证券	1	_	_	_	_	_
东方证券	1	_	_	_	_	_
中信建投	2	_	_	_	_	_
广发证券	4	_	_	_	_	_
山西证券	1	_	_	_	_	_
申银万国	2	_	_	_	_	_
华宝证券	1	_	_	_	_	_
长江证券	2		_		_	
平安证券	2	_	_	_	_	_
招商证券	2	_	_		_	_
中投证券	2	_	_	-	-	_
安信证券	1	_	_	_	_	_

德邦证券	1	-	-	_	-	_
中信证券	2	_	_	_	_	_

注: 1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准: 公司应选择财务状况良好,经营行为规范,具备研究实力的证券公司及专业研究机构,向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件: 1)具有相应的业务经营资格; 2)诚信记录良好,最近两年无重大违法违规行为,未受监管机构重大处罚; 3)资金雄厚,信誉良好。内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足本基金运作高度保密的要求; 4)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务; 5)具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的特定要求,提供专题研究报告。2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。3、本报告期内未新增租用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债 券 成交总额 的比例	成交金额	占债券购 成额的 例	成交金额	占当期 权证 成交总 额的比 例	成交金额	占当期基 金 成交总额 的比例
东兴证券	_	_	_	_	_	_	344, 300, 058. 51	99. 42%
国都证券	_	_	_	_	_	_	_	_
中金公司	_	_	_	_	_	_	1, 999, 250. 00	0. 58%
方正证券	_	_	_	_	_	_	_	_
华泰证券	_	_	_	_	_	_	_	_
兴业证券	_	_	_	_	_	_	_	_

瑞银证券	_	_	_	-	-	_	_	_
海通证券	_	_		-	-	_	_	_
国泰君安	_	_		_	-	_	_	_
国盛证券	_	_		_	-	_	_	_
银河证券	_			_	l		_	_
齐鲁证券	_	_		_	-	_	_	_
湘财证券	_	_		_	l	_	_	_
上海证券	_			_	l		_	_
爱建证券	_			_	l		_	_
东方证券	_			_	l		_	_
中信建投	_	_		_		_	_	_
广发证券	_	_		-	-	_	_	_
山西证券	_	_		-	-	_	_	_
申银万国	_	_		_	l	_	_	_
华宝证券	_			_	l		_	_
长江证券	_			_	l		_	_
平安证券	-	_	_	-	-	_	_	_
招商证券	_	_	_		_	_	_	_
中投证券	_	_	_	_	_	_	_	_
安信证券	_	_	_	_	_	_	_	_
德邦证券	_	_	_	_	_	_	_	_
中信证券	_	_	_	_	_		_	_

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期	
1	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投	中国证券报、上海证券	2017-04-24	
	资基金联接基金 2017 年第 1 季度报告	报、证券时报		

9	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 2016 年年度报告	中国证券报、上海证券	2017-03-29	
2	摘要	报、证券时报		
3	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 2016 年年度报告	中国证券报、上海证券	2017-03-29	
	子条作师扩张 300EIF 联按 2010 午平/交顶百	报、证券时报	2017-03-29	
4	华泰柏瑞 300ETF 联接 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券	2017.01.10	
	华州加加 300E1F 联按 2010 年第 4 学/是报言	报、证券时报	2017-01-19	

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

		报告期]内持有基金份符	额变化情况	报告期末持有基金情 况		
投资	序号	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
者类别	1	2017/2/14-2017/3 /16	-	98, 328, 416. 91	98, 328, 416. 91	-	0.0000
	2	2017/1/1-2017/6/	239, 445, 115. 10		70, 000, 000. 00	169, 445, 115. 10	84. 031 5%

产品特有风险

本基金报告期內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短时间内进行资产变现,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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

_

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 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

12.3 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 2017年8月26日