

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 2019 年半年度报告摘要

2019 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：2019 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

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 2019 年 8 月 28 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。（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于 2018 年 7 月 2 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 7 月 2 日开始计算。）

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	1,751,108,075.98 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞 300ETF 联接 A	华泰柏瑞 300ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码:	460300	006131
报告期末下属分级基金的份额总额	913,399,811.22 份	837,708,264.76 份

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

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	本基金为沪深 300ETF 的联接基金。沪深 300ETF 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。	
业绩比较基准	沪深 300 指数 $\times$ 95% + 银行活期存款税后收益率 $\times$ 5%	
风险收益特征	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。	
	华泰柏瑞 300ETF 联接 A	华泰柏瑞 300ETF 联接 C

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
信息披露负责人	姓名	陈晖	郭明
	联系电话	021-38601777	010-66105799
	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

2.4 信息披露方式

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

§ 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

基金级别	华泰柏瑞 300ETF 联接 A	华泰柏瑞 300ETF 联接 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	50,681,043.75	38,141,913.48
本期利润	159,004,238.26	158,984,586.69
加权平均基金份额本期利润	0.3082	0.4361
本期基金份额净值增长率	26.18%	26.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.2220	0.1725
期末基金资产净值	1,116,175,600.62	1,022,582,495.53
期末基金份额净值	1.2220	1.2207

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

3.3 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

华泰柏瑞 300ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	5.28%	1.06%	5.13%	1.10%	0.15%	-0.04%
过去三个月	-0.12%	1.43%	-1.11%	1.45%	0.99%	-0.02%
过去六个月	26.18%	1.46%	25.65%	1.47%	0.53%	-0.01%

过去一年	10.53%	1.43%	8.66%	1.45%	1.87%	-0.02%
过去三年	25.44%	1.04%	20.45%	1.05%	4.99%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	73.84%	1.36%	45.08%	1.42%	28.76%	-0.06%

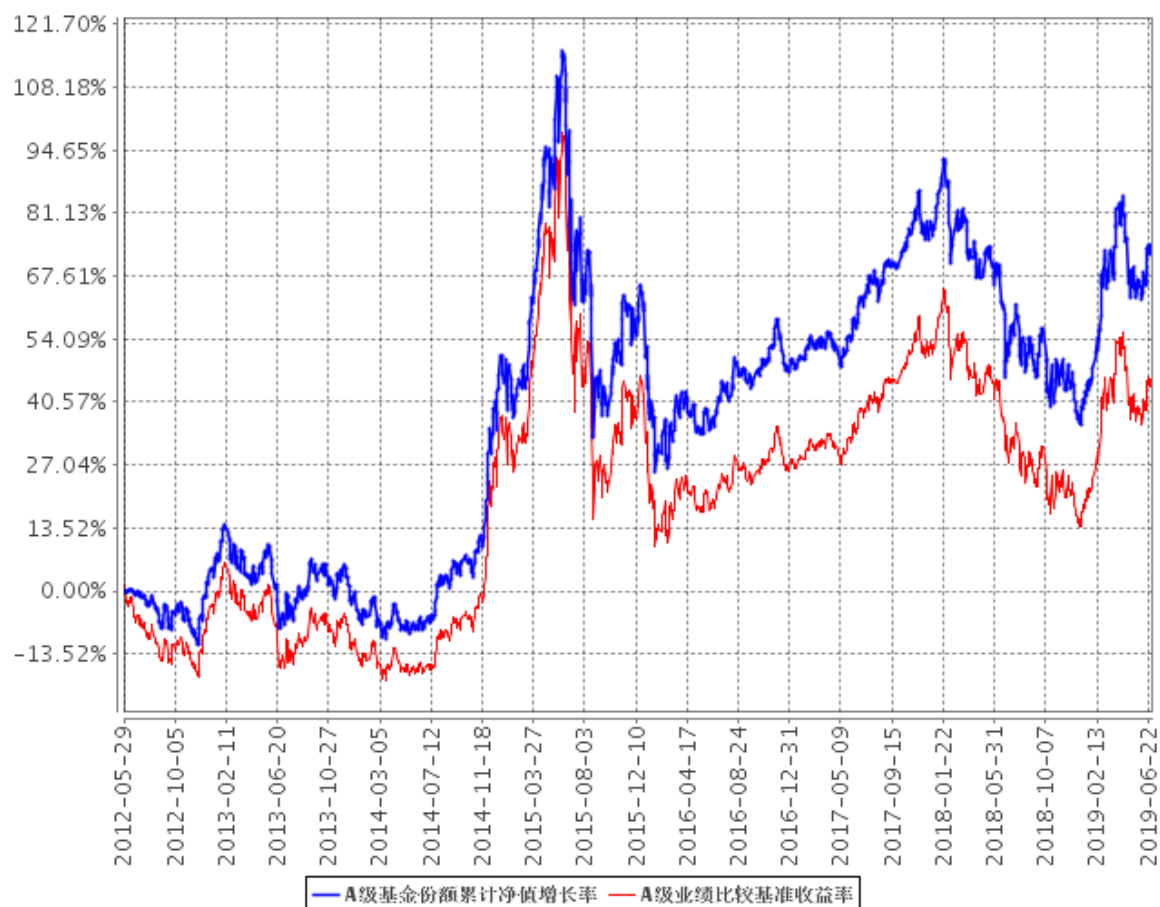
华泰柏瑞 300ETF 联接 C

阶段	份额净值增 长率①	份额净值 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
过去一个月	5.26%	1.06%	5.13%	1.10%	0.13%	-0.04%
过去三个月	-0.18%	1.43%	-1.11%	1.45%	0.93%	-0.02%
过去六个月	26.00%	1.45%	25.65%	1.47%	0.35%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	10.41%	1.43%	8.66%	1.45%	1.75%	-0.02%

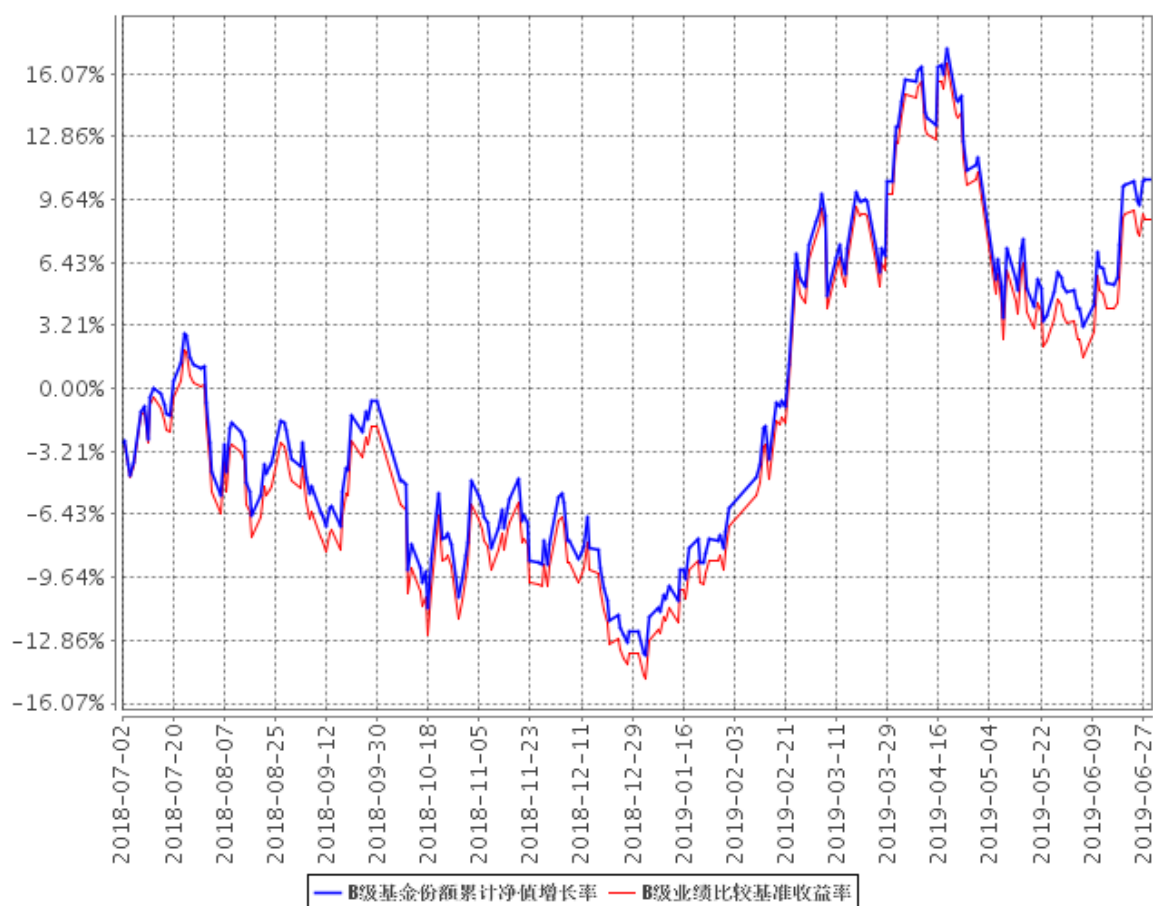
注：C 类份额业绩计算期间为 2018 年 7 月 2 日至 2018 年 12 月 31 日。

3.3.1 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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：A类图示日期为2012年5月29日至2019年6月30日。C类图示日期为2018年7月2日至2019年6月30日。

§ 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、华泰柏瑞多策略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、华泰柏瑞亨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、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型

证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞现代服务业混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞核心优势混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金。截至 2019 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 1030.82 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	2012 年 5 月 29 日	-	18 年	18 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 月起加入本公司，历任基金事务部总监、基金经理助理。2009 年 6 月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010 年 10 月起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。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、法规的规定以及本基金的《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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期内本基金与公司所管理的其他投资组合参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易共 1 次。系因被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

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

今年上半年股票市场整体表现较佳，年初至四月中旬在政策面偏暖、外部环境缓和的背景下，A 股市场走出了一波估值修复行情，市场量能出现了显著放大，部分概念和主题板块表现活跃。而在四月中旬以后，随着投资者在高位获利回吐以及外部不确定性增加，市场从高位开始回落。整个上半年，沪深 300、中证 500 和创业板指分别上涨 27.07%、18.77% 和 20.87%，成长风格总体表现要优于价值风格。分行业来看，食品饮料、非银金融和农林牧渔等板块涨幅居前，而建筑装饰、钢铁、传媒等板块则表现相对落后。

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 0.456%，日均绝对跟踪偏离度为 0.030%，期间日跟踪误差为 0.056%，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

截至本报告期末华泰柏瑞 300ETF 联接 A 基金份额净值为 1.2220 元，本报告期基金份额净值增长率为 26.18%；截至本报告期末华泰柏瑞 300ETF 联接 C 基金份额净值为 1.2207 元，本报告期基金份额净值增长率为 26.00%；同期业绩比较基准收益率为 25.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前市场表现来看，投资者风险偏好仍较低，以白酒为代表的消费股机构投资者抱团较为严重。部分抱团股的估值已经处于历史偏高水平，投资者对于这些股票的业绩抱有较为乐观预期，一旦未来它们业绩不及预期，容易发生踩踏风险，投资者需对其谨慎对待。考虑到当前市场情绪仍较为脆弱，建议投资者关注历史业绩稳定，当前估值水平较低且今年表现滞涨的高股息板块，以提升投资组合的确定性。

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。本报告期内，本基金符合分红条件，于 2019 年 3 月 14 日、2019 年 5 月 29 日和 2019 年 6 月 27 日进行分配。本基金于 2019 年 3 月 14 日，每 10 份基金份额派发红利 0.65 元，利润分配合计 39,697,966.82 元；于 2019 年 5 月 29 日，每 10 份基金份额派发红利 0.63 元，利润分配合计 61,974,795.69 元；于 2019 年 6 月 27 日，每 10 份基金份额派发红利 0.62 元，利润分配合计 106,138,986.61 元。

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

注：无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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对基金份额持有人进行了 3 次利润分配，分配金额为 207,811,749.12 元。

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 2019 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	97,939,604.79	48,106,508.11
结算备付金	4,091,541.32	5,033,110.05
存出保证金	442,711.25	138,897.34
交易性金融资产	2,032,017,812.68	772,959,777.95
其中：股票投资	32,322,731.71	325,811.00
基金投资	1,987,765,632.17	772,633,966.95
债券投资	11,929,448.80	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	3,342,550.91	20,078.13
应收利息	155,862.38	12,329.80
应收股利	-	-
应收申购款	2,246,715.75	942,323.81
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	1,266.20
资产总计	2,140,236,799.08	827,214,291.39
负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：		

短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	313,893.58	259,049.07
应付管理人报酬	47,722.51	20,581.24
应付托管费	9,544.51	4,116.25
应付销售服务费	142,326.98	70,098.93
应付交易费用	857,718.57	2,669.61
应交税费	2,335.53	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	105,161.25	210,557.14
负债合计	1,478,702.93	567,072.24
所有者权益：		
实收基金	1,751,108,075.98	735,633,824.07
未分配利润	387,650,020.17	91,013,395.08
所有者权益合计	2,138,758,096.15	826,647,219.15
负债和所有者权益总计	2,140,236,799.08	827,214,291.39

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A 单位净值 1.2220 元，份额 913,399,811.22 份；华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C 单位净值 1.2207 元，份额 837,708,264.76 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至
-----	-----------------------	----------------------------

	2019 年 6 月 30 日	2018 年 6 月 30 日
一、收入	320,226,420.12	-37,337,263.10
1.利息收入	373,238.35	77,774.44
其中：存款利息收入	364,890.69	58,314.10
债券利息收入	8,347.66	19,460.34
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）	90,315,663.13	902,120.64
其中：股票投资收益	2,025,579.28	380,594.00
基金投资收益	72,742,911.51	517,239.64
债券投资收益	312.26	848.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-221,344.08	-
股利收益	15,768,204.16	3,439.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	229,165,867.72	-38,337,214.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	371,650.92	20,056.20
减：二、费用	2,237,595.17	256,475.25
1. 管理人报酬	236,772.37	34,297.42
2. 托管费	47,354.49	6,859.53
3. 销售服务费	570,756.23	-
4. 交易费用	1,277,632.28	111,019.95
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	231.45	-

7. 其他费用	104,848.35	104,298.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	317,988,824.95	-37,593,738.35
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	317,988,824.95	-37,593,738.35

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	735,633,824.07	91,013,395.08	826,647,219.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	317,988,824.95	317,988,824.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,015,474,251.91	186,459,549.26	1,201,933,801.17
其中：1. 基金申购款	2,063,968,478.52	532,976,794.60	2,596,945,273.12
2. 基金赎回款	-1,048,494,226.61	-346,517,245.34	-1,395,011,471.95
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）	-	-207,811,749.12	-207,811,749.12

五、期末所有者权益（基金净值）	1,751,108,075.98	387,650,020.17	2,138,758,096.15
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	30,729,688.55	23,950,590.89	54,680,279.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-37,593,738.35	-37,593,738.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	252,572,550.78	175,051,723.69	427,624,274.47
其中：1. 基金申购款	263,682,676.83	183,660,613.75	447,343,290.58
2. 基金赎回款	-11,110,126.05	-8,608,890.06	-19,719,016.11
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）	-	-21,716,670.47	-21,716,670.47
五、期末所有者权益（基金净值）	283,302,239.33	139,691,905.76	422,994,145.09

注：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：

韩勇

基金管理人负责人

房伟力

主管会计工作负责人

赵景云

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 $\times$ 95% + 银行活期存款税后收益率 $\times$ 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 2019 年 8 月 29 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—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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 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 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[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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(2) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的

基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(3) 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，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

(5) 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) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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投资基金	本基金的基金管理人管理的其他基金

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	39,891,699.36	3.49%	4,850.00	0.01%

6.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	37,151.77	3.49%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	4.42	0.00%	-	-

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	236,772.37	34,297.42
其中：支付销售机构的客	129,919.86	60,540.84

户维护费		
------	--	--

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： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ 。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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	47,354.49	6,859.53

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： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ 。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。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞 300ETF 联接 A	华泰柏瑞 300ETF 联接 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	561,254.62	561,254.62

合计	0.00	561,254.62	561,254.62
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞 300ETF 联接 A	华泰柏瑞 300ETF 联接 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	0.00	0.00

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期及上年可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

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：本报告期及上年度可比期间内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	97,939,604.79	319,394.94	21,519,559.12	51,651.15

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位： 股)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
601236	红塔 证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流 通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信 出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流 通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

§ 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	32,322,731.71	1.51
	其中：股票	32,322,731.71	1.51
2	基金投资	1,987,765,632.17	92.88
3	固定收益投资	11,929,448.80	0.56
	其中：债券	11,929,448.80	0.56
	资产支持证券	—	0.00
4	贵金属投资	—	0.00
5	金融衍生品投资	—	0.00
6	买入返售金融资产	—	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	102,031,146.11	4.77
8	其他各项资产	6,187,840.29	0.29
9	合计	2,140,236,799.08	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	164,612.00	0.01
B	采矿业	1,053,937.25	0.05
C	制造业	14,918,020.49	0.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	744,986.00	0.03

E	建筑业	721,290.00	0.03
F	批发和零售业	645,145.60	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,014,734.40	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,164,071.76	0.05
J	金融业	9,006,644.41	0.42
K	房地产业	1,945,856.00	0.09
L	租赁和商务服务业	495,073.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	8,668.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	54,530.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	256,176.20	0.01
R	文化、体育和娱乐业	128,986.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	32,322,731.71	1.51

7.2.2 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。

7.3 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

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	600036	招商银行	35,539	1,278,693.22	0.06
2	601166	兴业银行	66,800	1,221,772.00	0.06
3	000651	格力电器	19,600	1,078,000.00	0.05

4	000858	五 粮 液	8,400	990,780.00	0.05
5	000333	美的集团	18,200	943,852.00	0.04
6	600000	浦发银行	60,800	710,144.00	0.03
7	600519	贵州茅台	600	590,400.00	0.03
8	000002	万 科 A	19,600	545,076.00	0.03
9	601318	中国平安	6,000	531,660.00	0.02
10	000001	平安银行	35,000	482,300.00	0.02

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

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	124,993,526.07	15.12
2	600036	招商银行	53,675,914.24	6.49
3	600519	贵州茅台	46,054,491.46	5.57
4	601166	兴业银行	35,989,442.00	4.35
5	600887	伊利股份	26,778,417.29	3.24
6	600276	恒瑞医药	25,967,822.36	3.14
7	600030	中信证券	23,726,853.25	2.87
8	600016	民生银行	23,049,157.00	2.79
9	601328	交通银行	22,707,218.68	2.75
10	601288	农业银行	21,112,388.98	2.55
11	600000	浦发银行	20,855,856.20	2.52
12	601668	中国建筑	18,683,293.78	2.26
13	600900	长江电力	16,905,577.98	2.05
14	601601	中国太保	15,762,989.95	1.91
15	601169	北京银行	13,685,175.94	1.66

16	600048	保利地产	13,396,665.00	1.62
17	600104	上汽集团	13,309,536.86	1.61
18	600837	海通证券	12,789,858.70	1.55
19	601766	中国中车	12,414,348.01	1.50
20	601988	中国银行	11,835,200.00	1.43

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

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	600989	宝丰能源	414,052.00	0.05
2	603379	三美股份	126,362.16	0.02
3	300762	上海瀚讯	114,365.44	0.01
4	300770	新媒股份	92,821.13	0.01
5	300773	拉卡拉	89,400.00	0.01
6	002955	鸿合科技	83,272.24	0.01
7	300766	每日互动	83,271.40	0.01
8	300765	新诺威	74,553.60	0.01
9	603267	鸿远电子	74,328.02	0.01
10	603967	中创物流	72,014.80	0.01
11	603068	博通集成	71,717.88	0.01
12	603915	国茂股份	59,719.41	0.01
13	002951	金时科技	59,193.00	0.01
14	002797	第一创业	51,996.00	0.01
15	000503	国新健康	51,576.00	0.01
16	002572	索菲亚	51,492.00	0.01
17	603982	泉峰汽车	49,169.25	0.01
18	300772	运达股份	48,101.20	0.01

19	000839	中信国安	47,376.00	0.01
20	300768	迪普科技	43,788.96	0.01

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

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	1,141,535,473.99
卖出股票收入（成交）总额	2,385,538.09

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	11,929,448.80	0.56
10	合计	11,929,448.80	0.56

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019611	19 国债 01	119,390	11,929,448.80	0.56

7.7 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。

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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	华泰柏瑞 沪 深 300ETF	指数型	交易型开 放式	华泰柏瑞 基金管理 有限公司	1,987,765,632.17	92.94

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

注：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

注：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

注：无。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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 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

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	442,711.25
2	应收证券清算款	3,342,550.91
3	应收股利	—
4	应收利息	155,862.38
5	应收申购款	2,246,715.75
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,187,840.29

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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华泰柏瑞 300ETF 联接 A	15,109	60,454.02	805,993,450.76	88.24%	107,406,360.46	11.76%
华泰柏瑞 300ETF 联接 C	1,613	519,347.96	826,661,195.58	98.68%	11,047,069.18	1.32%
合计	16,722	104,718.82	1,632,654,646.34	93.24%	118,453,429.64	6.76%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰柏瑞 300ETF 联接 A	2,570,087.35	0.2814%
	华泰柏瑞 300ETF 联接 C	2,381.93	0.0003%

	合计	2, 572, 469. 28	0. 1469%
--	----	-----------------	----------

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞 300ETF 联接 A	>100
	华泰柏瑞 300ETF 联接 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞 300ETF 联接 A	0
	华泰柏瑞 300ETF 联接 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞 300ETF 联接 A	华泰柏瑞 300ETF 联接 C
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	449,501,289.92	286,132,534.15
本报告期期间基金总申购份额	809,884,331.33	1,254,084,147.19
减：本报告期期间基金总赎回份额	345,985,810.03	702,508,416.58
本报告期期末基金份额总额	913,399,811.22	837,708,264.76

§ 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

2019 年 3 月 11 日，公司股东批准 Anthony Gerard Fasso 先生为公司董事。上述人事变动已按相关规定备案、报告。

2019 年 4 月 4 日，公司股东批准王永筠女士为公司监事。

2019 年 4 月 15 日，经公司董事会批准刘万方先生为公司副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
上海证券	2	847,753,101.11	74.19%	789,516.04	74.21%	—
平安证券	2	242,361,006.98	21.21%	225,712.90	21.21%	—
华泰证券	2	39,891,699.36	3.49%	37,151.77	3.49%	—
方正证券	2	11,552,118.93	1.01%	10,527.35	0.99%	—
中投证券	2	1,130,841.76	0.10%	1,030.60	0.10%	—
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	—	—	—	—	—
爱建证券	1	—	—	—	—	—
东兴证券	2	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
广发证券	4	—	—	—	—	—
山西证券	1	—	—	—	—	—
华宝证券	1	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
长江证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	2	—	—	—	—	—
德邦证券	1	—	—	—	—	—

招商证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	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，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；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。

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	占当期债券回购成交总额的比例	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
上海证券	4,509,010.80	37.75%	-	-	-	-	1,142,810,244.33	90.78%

平安证 券	7,434,637.00	62.24%	-	-	-	-	96,957,137.02	7.70%
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	19,147,943.10	1.52%
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证 券	2,302.30	0.02%	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
齐鲁证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
爱建证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
华宝证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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
机构	1	20190314-20190314; 20190318-20190320; 20190401-20190508	0.00	122,428,720.55	0.00	122,428,720.55	6.99%
	2	20190509-20190630	0.00	385,979,228.55	0.00	385,979,228.55	22.04%
	3	20190611-20190630	0.00	430,710,561.27	0.00	430,710,561.27	24.60%
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

无。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019 年 8 月 29 日