

# 华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券 投资基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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 3 月 26 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。

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

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18

6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表.....</b>	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
8.3 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.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
8.6 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.....	65
8.7 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.....	65
8.8 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.....	65
8.9 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.....	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
8.12 投资组合报告附注.....	65
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>67</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	67
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
9.5 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.....	68
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>69</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>70</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	70
11.2 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.....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70

11.4 基金投资策略的改变 .....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	70
11.8 其他重大事件 .....	73
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>75</b>
12.1 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 .....	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>76</b>
13.1 备查文件目录 .....	76
13.2 存放地点 .....	76
13.3 查阅方式 .....	76

## § 2 基金简介

### 2.1 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
基金简称	华泰柏瑞沪深 300ETF
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	10,847,287,690.00 份
基金合同存续期	不定期
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

### 2.2 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	010-66105798
	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	010-66105799
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-281,683,346.65	1,677,250,539.63	-1,930,111,043.71
本期利润	-6,791,291,528.60	3,817,456,230.85	-2,019,215,521.85
加权平均基金份额本期利润	-0.9576	0.7594	-0.3137
本期加权平均净值利润率	-26.89%	20.58%	-9.68%
本期基金份额净值增长率	-23.91%	23.14%	-9.63%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	4,057,985,762.08	6,885,791,891.01	3,559,566,039.66
期末可供分配基金份额利润	0.3741	1.3816	0.6696
期末基金资产净值	33,299,963,612.95	20,321,022,282.29	17,890,067,315.64
期末基金份额净值	3.0699	4.0774	3.3654
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	24.44%	63.55%	32.81%

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、本基金于 2012 年 5 月 11 日建仓完毕并进行了基金份额折算，折算比例为 0.37094933。期末还原后基金份额累计净值=（期末基金份额净值+基金份额累计分红金额）×折算比例，该净值可反映投资者在认购期以份额面值 1.00 元购买沪深 300ETF 后的实际份额净值变动情况。

#### 3.2 基金净值表现

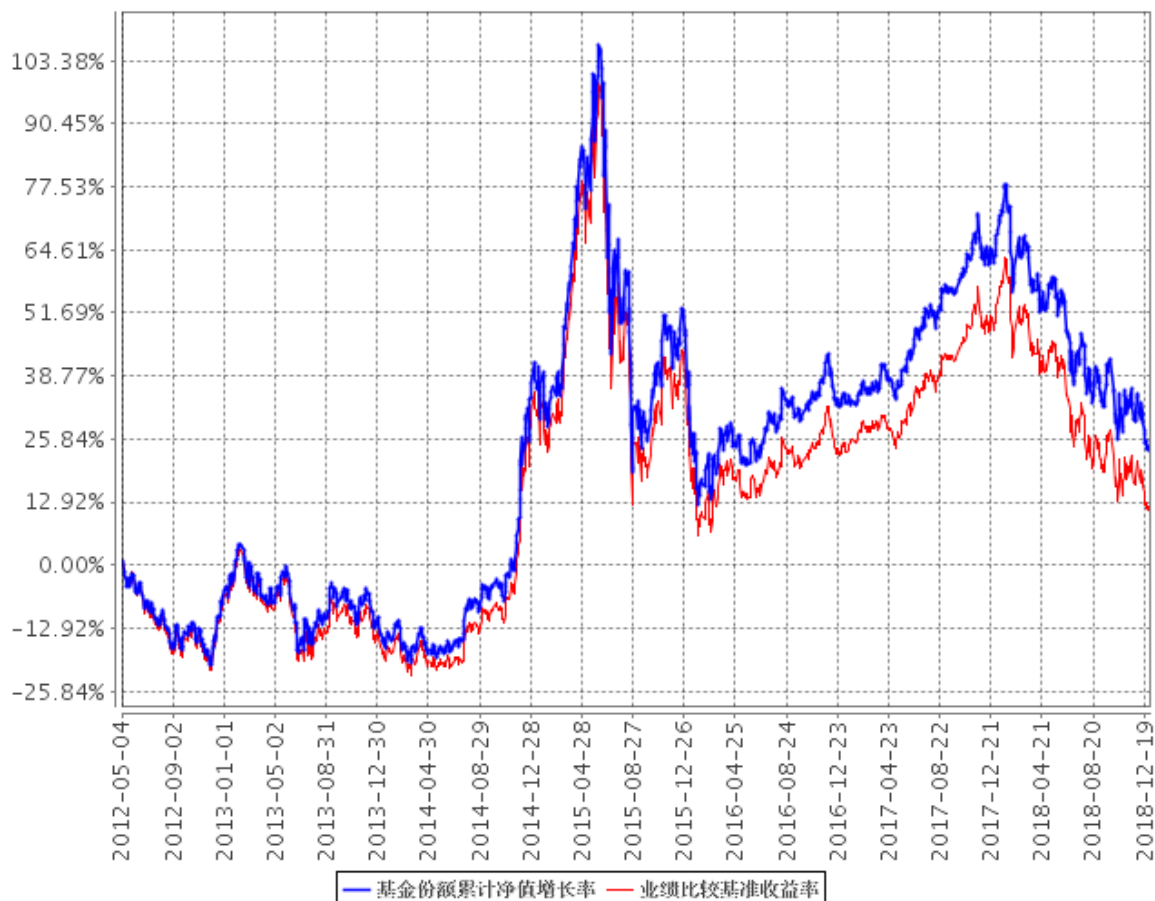
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-12.46%	1.64%	-12.45%	1.64%	-0.01%	0.00%
过去六个月	-13.30%	1.50%	-14.25%	1.50%	0.95%	0.00%
过去一年	-23.91%	1.34%	-25.31%	1.34%	1.40%	0.00%
过去三年	-15.33%	1.17%	-19.31%	1.18%	3.98%	-0.01%
过去五年	39.10%	1.52%	29.21%	1.53%	9.89%	-0.01%
自基金合同生效起至今	24.44%	1.47%	11.86%	1.48%	12.58%	-0.01%



### 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

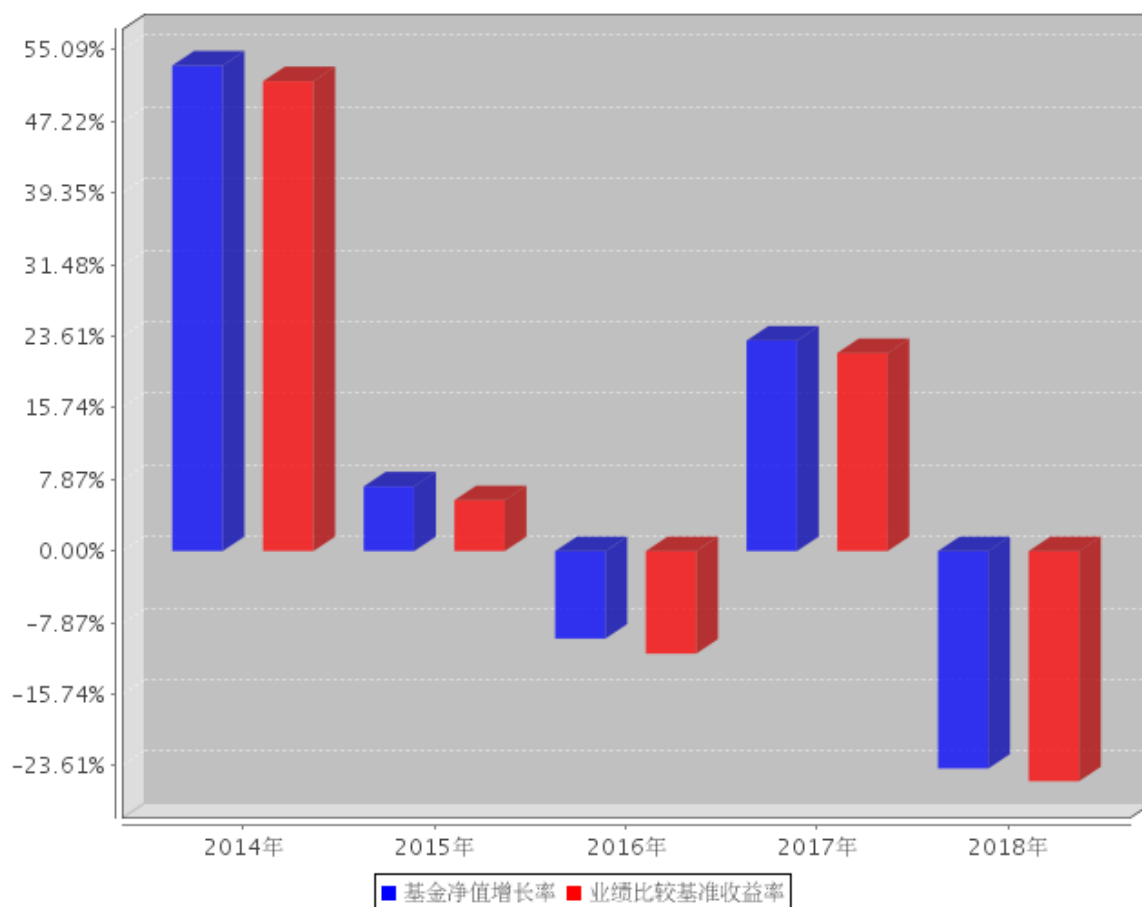
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2012 年 5 月 4 日至 2018 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.46	226,480,433.70	-	226,480,433.70	
2017	0.55	305,293,332.30	-	305,293,332.30	
2016	0.51	350,700,873.83	-	350,700,873.83	
合计	1.52	882,474,639.83	-	882,474,639.83	

## § 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发起式证券投资基金、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、华泰柏瑞亨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。截至 2018 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 980.05 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4日	-	17年	17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500ETF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。任职日期和离职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 公平交易制度和控制方法

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，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。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，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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 8 次。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

2018 年全年市场整体不佳，除年初市场有所表现外，其余时间市场整体呈现出单边下跌走势，在国内金融去杠杆以及中美贸易战阴影的笼罩下，全年上证红利、沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板指分别下跌 16.96%、25.31%、33.32%、36.87% 和 28.65%。从市场整体风格来看，具有高分红的低估值股票表现较为抗跌，大盘风格优于小盘。分各行业来看，28 个申万一级行业无一录得正收益，其中休闲服务和银行板块表现相对较优。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 1.401%，日均绝对跟踪偏离度为 0.012%，期间日跟踪误差为 0.025%，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 3.0699 元；本报告期基金份额净值增长率为-23.91%，业绩比较基准收益率为-25.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，A 股市场在经历 2018 年的大幅调整以后，PE 和 PB 等估值指标已处于多年以来的历史低位，市场已经处于底部区域，我们认为当下市场已充分计入外部贸易环境恶化、国内经济下行导致的上市公司业绩下滑等不利因素，投资者可以对当前股票市场保持适当乐观，可择机加大对权益类资产的配置。目前 A 股市场国际化进程仍在持续，MSCI 即将公布是否将 A 股纳入因子从 5%提高到 20%的决定，不论结果如何，我们认为 A 股市场国际化的趋势不会改变。根据以往经验，外资更为偏好业绩良好且具有高分红的大盘蓝筹，这一偏好有望继续影响着市场的风格选择，在目前市场风险偏好仍相对较低的背景下，这类具有高分红的大盘蓝筹股或将继续获得超越市场的收益。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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2018 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统事先进行合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的

专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

### (3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

### (4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

## 4.7 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。

## 4.8 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，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。截至本报告期末，本基金于 2018 年 1 月 23 日进行收益分配，每 10 份基金份额分配 0.46 元。

## 4.9 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对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 226,480,433.70 元。

### 5.3 托管人对本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 2018 年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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“沪深 300 ETF”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了沪深 300 ETF2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于沪深 300 ETF,并</p>

	<p>履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>沪深 300 ETF 的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估沪深 300 ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算沪深 300 ETF、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督沪深 300 ETF 的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重</p>

	<p>大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对沪深 300 ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致沪深 300 ETF 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰   曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2019 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	72,433,585.69	114,687,078.85
结算备付金		6,477,831.43	9,369,177.95
存出保证金		2,151,972.55	1,143,224.87
交易性金融资产	7.4.7.2	33,240,388,301.62	20,274,908,376.70
其中：股票投资		33,240,388,301.62	20,274,908,376.70
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		32,456,121.97	3,024,953.32
应收利息	7.4.7.5	19,869.04	26,841.34
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		33,353,927,682.30	20,403,159,653.03
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		1,391,408.30	3,752,143.24
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,530,464.72	45,829,697.41
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		14,267,010.99	8,273,761.62
应付托管费		2,853,402.18	1,654,752.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	7,822,370.28	4,966,497.87
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	24,099,412.88	17,660,518.27
负债合计		53,964,069.35	82,137,370.74
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	29,241,977,850.87	13,435,230,391.28
未分配利润	7.4.7.10	4,057,985,762.08	6,885,791,891.01
所有者权益合计		33,299,963,612.95	20,321,022,282.29
负债和所有者权益总计		33,353,927,682.30	20,403,159,653.03

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.0699 元，基金份额总额 10,847,287,690.00 份。

## 7.2 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

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-6,601,863,554.55	3,958,244,273.88
1.利息收入		1,201,545.89	959,942.64
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,200,951.60	951,004.15
债券利息收入		594.29	8,938.49
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）		-72,312,618.21	1,800,522,284.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-573,318,269.96	1,429,349,198.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	51,827.96	2,045,336.71
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	500,953,823.79	369,127,749.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-6,509,608,181.95	2,140,205,691.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-21,144,300.28	16,556,355.52
<b>减：二、费用</b>		189,654,455.27	140,788,043.03

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	126,138,365.25	92,710,637.60
2. 托管费	7.4.10.2.2	25,227,672.97	18,542,127.45
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	29,659,663.99	22,223,513.31
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2.15	-
7. 其他费用	7.4.7.20	8,628,750.91	7,311,764.67
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-6,791,518,009.82	3,817,456,230.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-6,791,518,009.82	3,817,456,230.85

### 7.3 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

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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)	13,435,230,391.28	6,885,791,891.01	20,321,022,282.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,791,518,009.82	-6,791,518,009.82
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)	15,806,747,459.59	4,190,192,314.59	19,996,939,774.18
其中：1.基金申购款	27,835,888,503.14	8,341,002,858.08	36,176,891,361.22
2.基金赎回款	-12,029,141,043.55	-4,150,810,543.49	-16,179,951,587.04
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)	-	-226,480,433.70	-226,480,433.70
五、期末所有者权益(基金净值)	29,241,977,850.87	4,057,985,762.08	33,299,963,612.95
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	14,330,501,275.98	3,559,566,039.66	17,890,067,315.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,817,456,230.85	3,817,456,230.85
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）	-895,270,884.70	-185,937,047.20	-1,081,207,931.90
其中：1. 基金申购款	11,548,751,787.17	4,485,992,415.79	16,034,744,202.96
2. 基金赎回款	-12,444,022,671.87	-4,671,929,462.99	-17,115,952,134.86
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）	-	-305,293,332.30	-305,293,332.30
五、期末所有者权益（基金净值）	13,435,230,391.28	6,885,791,891.01	20,321,022,282.29

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 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 韩勇 _____	_____ 房伟力 _____	_____ 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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(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基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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 32,967,336,606.00 元(含募集股票市值)，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 121 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基金合同》于 2012 年 5 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 32,968,633,875.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,297,269.00



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。

根据《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于 2012 年 5 月 11 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.37094933，并于 2012 年 5 月 14 日进行了变更登记。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证基字[2012]14 号文审核同意，本基金 12,229,687,690.00 份基金份额于 2012 年 5 月 28 日在上交所挂牌交易。

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基金合同》的有关规定，本基金以标的指数沪深 300 指数成份股、备选成份股为主要投资对象；此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股（一级市场初次发行或增发）、债券、权证、股指期货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。本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度（剔除成份股分红因素）的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2012 年 5 月 29 日募集成立了华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金”）。华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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（以下简称“中国基金业协会”）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基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 2018 年 12

月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(1) 金融资产的分类**

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### **(2) 金融负债的分类**

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以交易性金融负债列示。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

##### **7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应

收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。本基金的基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；基于本基金的性质和特点，本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。

基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配，基金收益分配每年至多 4 次。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

无。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### **7.4.6 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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。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。

(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。

(5) 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	72,433,585.69	114,687,078.85
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-

存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计:	72,433,585.69	114,687,078.85

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	37,603,905,447.58	33,240,388,301.62	-4,363,517,145.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	37,603,905,447.58	33,240,388,301.62	-4,363,517,145.96
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	18,128,899,057.71	20,274,908,376.70	2,146,009,318.99
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	18,128,899,057.71	20,274,908,376.70	2,146,009,318.99

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本报告期末及上年度末，本基金买入返售金融资产余额为 0。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末及上年度末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	15,597.30	21,637.79
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	3,206.50	4,637.71
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
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	1,065.24	565.84
合计	19,869.04	26,841.34

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	7,822,370.28	4,966,497.87
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	7,822,370.28	4,966,497.87

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	750,000.00
应付赎回费	-	-
预提费用	470,000.00	470,000.00



应付指数使用费	2,474,848.25	1,442,632.31
应付替代款	20,654,564.63	14,997,885.96
合计	24,099,412.88	17,660,518.27

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,983,787,690.00	13,435,230,391.28
本期申购	10,325,700,000.00	27,835,888,503.14
本期赎回(以“-”号填列)	-4,462,200,000.00	-12,029,141,043.55
- 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	10,847,287,690.00	29,241,977,850.87

注：1、投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

#### 7.4.7.10 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	10,497,464,449.61	-3,611,672,558.60	6,885,791,891.01
本期利润	-281,909,827.87	-6,509,608,181.95	-6,791,518,009.82
本期基金份额交易产生的变动数	12,620,354,201.35	-8,430,161,886.76	4,190,192,314.59
其中：基金申购款	22,184,001,829.42	-13,842,998,971.34	8,341,002,858.08
基金赎回款	-9,563,647,628.07	5,412,837,084.58	-4,150,810,543.49
本期已分配利润	-226,480,433.70	-	-226,480,433.70
本期末	22,609,428,389.39	-18,551,442,627.31	4,057,985,762.08

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

	月 31 日	日
活期存款利息收入	985,613.57	838,544.73
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	191,062.17	96,031.79
其他	24,275.86	16,427.63
合计	1,200,951.60	951,004.15

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-545,078,914.17	427,329,635.77
股票投资收益——赎回差价收入	-28,239,355.79	1,002,019,562.35
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-573,318,269.96	1,429,349,198.12

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
卖出股票成交总额	7,848,645,488.50	7,526,122,531.70
减：卖出股票成本总额	8,393,724,402.67	7,098,792,895.93
买卖股票差价收入	-545,078,914.17	427,329,635.77

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
赎回基金份额对价总额	16,179,951,587.04	17,115,952,134.86
减：现金支付赎回款总额	4,812,755,561.04	5,317,515,424.86
减：赎回股票成本总额	11,395,435,381.79	10,796,417,147.65

赎回差价收入	-28,239,355.79	1,002,019,562.35
--------	----------------	------------------

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	51,827.96	2,045,336.71
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	51,827.96	2,045,336.71

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,363,431.38	36,814,275.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,311,000.00	34,760,000.00
减：应收利息总额	603.42	8,938.49
买卖债券差价收入	51,827.96	2,045,336.71

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	500,953,823.79	369,127,749.67
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	500,953,823.79	369,127,749.67

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
------	-----------------------------	----------------------------------

1. 交易性金融资产	-6,509,526,464.95	2,140,631,086.22
——股票投资	-6,509,526,464.95	2,140,631,086.22
——债券投资	-	-
——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	-81,717.00	-425,395.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-6,509,608,181.95	2,140,205,691.22

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
替代损益	-21,144,300.28	16,556,355.52
合计	-21,144,300.28	16,556,355.52

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31 日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
交易所市场交易费用	29,659,663.99	22,223,513.31
银行间市场交易费用	-	-
合计	29,659,663.99	22,223,513.31

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	170,000.00	170,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
注册登记费（中登上海）	300,000.00	300,000.00
银行划款手续费	3,967.83	3,398.78
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	7,568,301.86	5,562,638.22
分红手续费	226,481.22	915,727.67
合计	8,628,750.91	7,311,764.67

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2019 年 1 月 10 日宣告 2018 年度第一次分红，向截至 2019 年 1 月 15 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.59 元。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
PineBridgeInvestmentLLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东

华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司
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(“沪深 300ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	2,673,027,176.42	12.30%	839,390,513.72	5.72%

###### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31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	2,447,194.70	12.31%	2,447,194.70	31.28%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	776,468.68	5.78%	-	-

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	126,138,365.25	92,710,637.60
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,227,672.97	18,542,127.45

注：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 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

### 7.4.10.3 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。



#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年可比期间，基金管理人未投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
华泰证券股份有 限公司	2,726,000.00	0.03%	-	-
沪深 300ETF 联接 基金	251,680,500.00	2.32%	12,495,100.00	0.25%

##### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	72,433,585.69	985,613.57	114,687,078.85	838,544.73

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。

##### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

##### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有 76,509,724 股工商银行，成本总额为人民币 424,982,742.43 元，估值总额为人民币 404,736,439.96 元，占基金资产净值的比例为 1.22%(2017 年 12 月 31 日：本基金持有 37,369,460 股工商银行，成本总额为人民币 190,682,454.16 元，估值总额为人民币 231,690,652.00 元，占基金资产净值的比例为 1.14%)。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有 11,765,318 股华泰证券，成本总额为人民币

194,877,556.62 元, 估值总额为人民币 190,598,151.60 元, 占基金资产净值的比例为 0.57%(2017 年 12 月 31 日: 本基金持有 5,656,962 股华泰证券, 成本总额为人民币 105,161,661.14 元, 估值总额为人民币 97,639,164.12 元, 占基金资产净值的比例为 0.48%)。

### 7.4.11 利润分配情况

金额单位: 人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形 式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2018 年 1 月 22 日	2018 年 1 月 23 日	0.46	226,480,433.70		-226,480,433.70	
合计	-	-	0.46	226,480,433.70		-226,480,433.70	

### 7.4.12 期末 (2018 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

7.4.12.1.1 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
601860	紫金 银行	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 3 日	新股流 通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

注: 基金可使用以基金名义开设的股票账户, 选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股, 根据基金与上市公司所签订申购协议的规定, 在新股上市后的约定期限内不能自由转让; 基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股, 从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 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	股票	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量 (股)	期末	期末估值总额	备
-----	----	----	----	----	----	----	--------	----	--------	---

码	名称	日期	原因	估值单 价	日期	开盘单 价		成本总额		注
600030	中信 证券	2018 年 12 月 25 日	重要 事项 未公 告	16.01	2019 年 1 月 10 日	17.15	27,680,710	471,403,923.09	443,168,167.10	-
000540	中天 金融	2017 年 08 月 21 日	重大 资产 重组	4.87	2019 年 1 月 2 日	4.38	6,640,917	31,121,380.48	32,341,265.79	-
600485	信威 集团	2016 年 12 月 26 日	重大 资产 重组	14.59	-	-	2,073,669	31,589,161.93	30,254,830.71	-

注：本基金截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。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，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和法律监察部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控

制系统和维持其有效性承担最终责任，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。

#### **7.4.13.2 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人中国工商银行，因而与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 2018 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2017 年 12 月 31 日：同)。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 7.4.13.3 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 1.52%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 7.4.13.4 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，适用于本基金的市场风险包括利率风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担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、结算备付金、存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	72,433,585.69	-	-	-	-	-	72,433,585.69

结算备付金	6,477,831.43	-	-	-	-	-	6,477,831.43
存出保证金	2,151,972.55	-	-	-	-	-	2,151,972.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-33,240,388,301.62	33,240,388,301.62
应收证券清算款	-	-	-	-	-	32,456,121.97	32,456,121.97
应收利息	-	-	-	-	-	19,869.04	19,869.04
资产总计	81,063,389.67	-	-	-	-	-33,272,864,292.63	33,353,927,682.30
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	1,391,408.30	1,391,408.30
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,530,464.72	3,530,464.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,267,010.99	14,267,010.99
应付托管费	-	-	-	-	-	2,853,402.18	2,853,402.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,822,370.28	7,822,370.28
其他负债	-	-	-	-	-	24,099,412.88	24,099,412.88
负债总计	-	-	-	-	-	53,964,069.35	53,964,069.35
利率敏感度缺口	81,063,389.67	-	-	-	-	-33,218,900,223.28	33,299,963,612.95
上年度末 2017 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	114,687,078.85	-	-	-	-	-	114,687,078.85
结算备付金	9,369,177.95	-	-	-	-	-	9,369,177.95
存出保证金	1,143,224.87	-	-	-	-	-	1,143,224.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-20,274,908,376.70	20,274,908,376.70
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,024,953.32	3,024,953.32
应收利息	-	-	-	-	-	26,841.34	26,841.34
资产总计	125,199,481.67	-	-	-	-	-20,277,960,171.36	20,403,159,653.03
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	3,752,143.24	3,752,143.24
应付证券清算款	-	-	-	-	-	45,829,697.41	45,829,697.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,273,761.62	8,273,761.62
应付托管费	-	-	-	-	-	1,654,752.33	1,654,752.33
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,966,497.87	4,966,497.87
其他负债	-	-	-	-	-	17,660,518.27	17,660,518.27
负债总计	-	-	-	-	-	82,137,370.74	82,137,370.74
利率敏感度缺口	125,199,481.67	-	-	-	-	-20,195,822,800.62	20,321,022,282.29

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2017 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2017 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 95%。此外，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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	33,240,388,301.62	99.82	20,274,908,376.70	99.77
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-1,391,408.30	0.00	-3,752,143.24	-0.02



合计	33,238,996,893.32	99.82	20,271,156,233.46	99.75
----	-------------------	-------	-------------------	-------

注：其他为可退替代款。

#### 7.4.13.4.3.2 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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	174,763.98	105,194.00
	沪深 300 指数下降 5%	-174,763.98	-105,194.00

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2018 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 36,176,891,361.22 元（2017 年度：16,034,744,202.96 元），其中包括以股票支付的申购款 25,373,522,044.57 元和以现金支付的申购款 10,803,369,316.65 元（2017 年度：其中包括以股票支付的申购款 10,876,754,676.43 元和以现金支付的申购款 5,157,989,526.53 元）。

##### (2) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 32,734,573,892.22 元, 属于第二层次的余额为 505,814,409.40 元, 无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日: 第一层次 19,813,932,186.63 元, 第二层次 444,237,429.43 元, 第三层次 16,738,760.64 元)。于 2018 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次(2017 年 12 月 31 日: 同)

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产	权益工具投资
2018 年 1 月 1 日	16,738,760.64	
购买	-	
出售	-	
转入第三层级	-	
转出第三层级	-16,738,760.64	
当期利得或损失总额	-	
计入损益的利得或损失	-	
2018 年 12 月 31 日	-	

2018 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2018 年度损益的未实现利得或损失的变动(从年初起算)

——公允价值变动损益	-
------------	---

上年度可比期间第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产	权益工具投资
2017 年 1 月 1 日	-	
购买	-	
出售	16,738,760.64	
转入第三层级	-	

转出第三层级	-
当期利得或损失总额	-
计入损益的利得或损失	-
2017 年 12 月 31 日	16,738,760.64
2017 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2017 年度损益的未实现利得或损失的变动(从年初起算)	
——公允价值变动损益	-54,774,440.73

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

	2017 年		不可观察输入值			
	12 月 31 日	公允价值	估值技术	名称	范围/加权平均	与公允价值之间的关系
交易性金融资产——						
权益工具投资	16,738,760.64		市场法	市净率倍数	1	正相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(3)除基金申购款和公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	33,240,388,301.62	99.66%
	其中：股票	33,240,388,301.62	99.66%
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	78,911,417.12	0.24%
8	其他各项资产	34,627,963.56	0.10%
9	合计	33,353,927,682.30	100.00%

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	66,846,625.00	0.20
B	采矿业	1,187,144,362.38	3.57
C	制造业	13,010,421,583.06	39.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,020,567,439.36	3.06
E	建筑业	1,274,420,923.03	3.83
F	批发和零售业	549,394,609.83	1.65
G	交通运输、仓储和邮政业	1,063,481,680.01	3.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,157,725,302.08	3.48
J	金融业	11,465,707,363.23	34.43
K	房地产业	1,616,328,551.55	4.85
L	租赁和商务服务业	420,251,893.24	1.26
M	科学研究和技术服务业	24,606,482.00	0.07

N	水利、环境和公共设施管理业	80,338,478.97	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	187,802,804.85	0.56
R	文化、体育和娱乐业	115,350,203.03	0.35
S	综合	-	-
	合计	33,240,388,301.62	99.82

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期内未持有港股通股票。

### 8.3 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	601318	中国平安	38,515,274	2,160,706,871.40	6.49
2	600519	贵州茅台	1,780,695	1,050,627,856.95	3.16
3	600036	招商银行	36,617,596	922,763,419.20	2.77
4	601166	兴业银行	44,239,246	660,934,335.24	1.98
5	000651	格力电器	17,104,961	610,476,058.09	1.83
6	000333	美的集团	16,395,344	604,332,379.84	1.81
7	601328	交通银行	97,440,062	564,177,958.98	1.69
8	600016	民生银行	89,429,693	512,432,140.89	1.54
9	600887	伊利股份	21,564,513	493,396,057.44	1.48
10	601288	农业银行	135,903,479	489,252,524.40	1.47
11	600030	中信证券	27,680,710	443,168,167.10	1.33
12	601668	中国建筑	74,477,665	424,522,690.50	1.27
13	600276	恒瑞医药	7,990,557	421,501,881.75	1.27
14	000002	万科A	17,261,898	411,178,410.36	1.23
15	600000	浦发银行	41,711,336	408,771,092.80	1.23
16	601398	工商银行	76,509,724	404,736,439.96	1.22
17	600900	长江电力	23,408,337	371,724,391.56	1.12
18	000858	五粮液	7,009,020	356,618,937.60	1.07
19	002415	海康威视	13,126,390	338,135,806.40	1.02
20	600104	上汽集团	12,428,864	331,477,802.88	1.00
21	601601	中国太保	11,120,947	316,168,523.21	0.95
22	601766	中国中车	33,803,568	304,908,183.36	0.92
23	600048	保利地产	25,319,679	298,519,015.41	0.90

24	601169	北京银行	52,588,038	295,018,893.18	0.89
25	000001	平安银行	30,501,513	286,104,191.94	0.86
26	601988	中国银行	74,818,080	270,093,268.80	0.81
27	600837	海通证券	28,729,164	252,816,643.20	0.76
28	601211	国泰君安	15,531,591	237,943,974.12	0.71
29	000725	京东方 A	84,170,600	221,368,678.00	0.66
30	601229	上海银行	19,396,860	217,050,863.40	0.65
31	600028	中国石化	42,621,330	215,237,716.50	0.65
32	601888	中国国旅	3,519,186	211,854,997.20	0.64
33	601818	光大银行	56,508,158	209,080,184.60	0.63
34	002304	洋河股份	2,204,382	208,799,063.04	0.63
35	600585	海螺水泥	7,104,127	208,008,838.56	0.62
36	600019	宝钢股份	31,613,167	205,485,585.50	0.62
37	601857	中国石油	27,276,317	196,662,245.57	0.59
38	603288	海天味业	2,803,009	192,847,019.20	0.58
39	601688	华泰证券	11,765,318	190,598,151.60	0.57
40	600690	青岛海尔	12,995,030	179,981,165.50	0.54
41	601186	中国铁建	16,493,633	179,285,790.71	0.54
42	600009	上海机场	3,482,489	176,771,141.64	0.53
43	601006	大秦铁路	21,115,296	173,778,886.08	0.52
44	600050	中国联通	33,048,649	170,861,515.33	0.51
45	601390	中国中铁	24,362,071	170,290,876.29	0.51
46	600015	华夏银行	22,787,030	168,396,151.70	0.51
47	002594	比亚迪	3,295,768	168,084,168.00	0.50
48	000063	中兴通讯	8,456,057	165,654,156.63	0.50
49	600309	万华化学	5,900,748	165,161,936.52	0.50
50	300059	东方财富	12,977,001	157,021,712.10	0.47
51	600031	三一重工	18,467,890	154,022,202.60	0.46
52	601939	建设银行	23,925,002	152,402,262.74	0.46
53	002142	宁波银行	9,374,451	152,053,595.22	0.46
54	600340	华夏幸福	5,821,994	148,169,747.30	0.44
55	600919	江苏银行	24,626,111	147,017,882.67	0.44
56	001979	招商蛇口	8,426,930	146,207,235.50	0.44
57	601989	中国重工	32,497,559	138,114,625.75	0.41
58	002027	分众传媒	26,262,824	137,617,197.76	0.41
59	601899	紫金矿业	41,175,793	137,527,148.62	0.41
60	601009	南京银行	21,089,663	136,239,222.98	0.41
61	000776	广发证券	10,615,645	134,606,378.60	0.40
62	000538	云南白药	1,819,097	134,540,414.12	0.40



63	000338	潍柴动力	17,208,052	132,502,000.40	0.40
64	002024	苏宁易购	13,239,783	130,411,862.55	0.39
65	600999	招商证券	9,653,000	129,350,200.00	0.39
66	601088	中国神华	7,081,954	127,191,893.84	0.38
67	002230	科大讯飞	5,087,009	125,343,901.76	0.38
68	601336	新华保险	2,957,314	124,916,943.36	0.38
69	002475	立讯精密	8,763,390	123,213,263.40	0.37
70	601012	隆基股份	7,041,813	122,809,218.72	0.37
71	601628	中国人寿	5,931,594	120,945,201.66	0.36
72	600406	国电南瑞	6,502,458	120,490,546.74	0.36
73	600886	国投电力	14,471,692	116,497,120.60	0.35
74	600011	华能国际	15,404,397	113,684,449.86	0.34
75	600660	福耀玻璃	4,946,971	112,691,999.38	0.34
76	600795	国电电力	41,901,724	107,268,413.44	0.32
77	601933	永辉超市	13,604,832	107,070,027.84	0.32
78	601225	陕西煤业	14,295,700	106,360,008.00	0.32
79	600741	华域汽车	5,719,387	105,236,720.80	0.32
80	000568	泸州老窖	2,547,482	103,580,618.12	0.31
81	600958	东方证券	12,993,856	103,561,032.32	0.31
82	600518	康美药业	10,776,504	99,251,601.84	0.30
83	000166	申万宏源	24,016,207	97,745,962.49	0.29
84	600703	三安光电	8,639,231	97,709,702.61	0.29
85	601669	中国电建	20,089,291	97,633,954.26	0.29
86	002044	美年健康	6,481,687	96,901,220.65	0.29
87	600436	片仔癀	1,107,056	95,926,402.40	0.29
88	002008	大族激光	3,140,251	95,338,020.36	0.29
89	000100	TCL 集团	38,564,377	94,482,723.65	0.28
90	300015	爱尔眼科	3,456,334	90,901,584.20	0.27
91	600352	浙江龙盛	9,309,860	89,840,149.00	0.27
92	600089	特变电工	13,218,198	89,751,564.42	0.27
93	600271	航天信息	3,868,087	88,540,511.43	0.27
94	600570	恒生电子	1,693,344	88,020,021.12	0.26
95	601985	中国核电	16,685,454	87,932,342.58	0.26
96	601800	中国交建	7,796,905	87,793,150.30	0.26
97	000069	华侨城 A	13,761,729	87,386,979.15	0.26
98	000661	长春高新	498,336	87,208,800.00	0.26
99	600010	包钢股份	56,761,868	84,007,564.64	0.25
100	600196	复星医药	3,587,824	83,488,664.48	0.25
101	000895	双汇发展	3,532,572	83,333,373.48	0.25

102	601600	中国铝业	23,369,209	82,960,691.95	0.25
103	601111	中国国航	10,717,661	81,882,930.04	0.25
104	603993	洛阳钼业	21,738,590	81,737,098.40	0.25
105	600029	南方航空	12,247,805	81,325,425.20	0.24
106	300142	沃森生物	4,249,930	81,173,663.00	0.24
107	600487	亨通光电	4,749,027	80,970,910.35	0.24
108	002202	金风科技	8,069,644	80,615,743.56	0.24
109	600606	绿地控股	12,993,016	79,387,327.76	0.24
110	600383	金地集团	8,216,273	79,040,546.26	0.24
111	601155	新城控股	3,315,290	78,539,220.10	0.24
112	300003	乐普医疗	3,739,960	77,828,567.60	0.23
113	601901	方正证券	14,630,272	77,686,744.32	0.23
114	600547	山东黄金	2,559,532	77,425,843.00	0.23
115	601377	兴业证券	16,677,601	77,384,068.64	0.23
116	601877	正泰电器	3,189,587	77,315,588.88	0.23
117	600221	海航控股	40,986,520	77,054,657.60	0.23
118	600588	用友网络	3,511,036	74,785,066.80	0.22
119	600332	白云山	2,083,590	74,509,178.40	0.22
120	002736	国信证券	8,627,641	72,213,355.17	0.22
121	300124	汇川技术	3,568,828	71,876,195.92	0.22
122	600893	航发动力	3,306,159	71,809,773.48	0.22
123	002466	天齐锂业	2,436,915	71,450,347.80	0.21
124	600637	东方明珠	6,955,795	71,227,340.80	0.21
125	000783	长江证券	13,777,870	70,956,030.50	0.21
126	600176	中国巨石	7,337,200	70,950,724.00	0.21
127	002236	大华股份	6,113,412	70,059,701.52	0.21
128	600482	中国动力	3,133,359	69,779,904.93	0.21
129	601618	中国中冶	22,369,948	69,570,538.28	0.21
130	600522	中天科技	8,530,521	69,523,746.15	0.21
131	002007	华兰生物	2,114,809	69,365,735.20	0.21
132	600867	通化东宝	4,965,908	69,026,121.20	0.21
133	600023	浙能电力	14,506,252	68,614,571.96	0.21
134	600498	烽火通信	2,405,400	68,481,738.00	0.21
135	600100	同方股份	6,994,791	68,059,316.43	0.20
136	600111	北方稀土	7,758,970	68,046,166.90	0.20
137	600705	中航资本	15,972,532	67,723,535.68	0.20
138	600115	东方航空	14,162,308	67,270,963.00	0.20
139	601607	上海医药	3,936,913	66,927,521.00	0.20
140	000963	华东医药	2,527,680	66,882,412.80	0.20

141	002714	牧原股份	2,325,100	66,846,625.00	0.20
142	600177	雅戈尔	9,035,254	64,963,476.26	0.20
143	000768	中航飞机	4,892,153	64,772,105.72	0.19
144	002456	欧菲科技	7,028,541	64,592,291.79	0.19
145	600535	天士力	3,326,819	63,874,924.80	0.19
146	300122	智飞生物	1,639,300	63,539,268.00	0.19
147	002311	海大集团	2,709,663	62,782,891.71	0.19
148	000423	东阿阿胶	1,575,224	62,300,109.20	0.19
149	601788	光大证券	7,082,694	62,115,226.38	0.19
150	601727	上海电气	12,558,922	62,041,074.68	0.19
151	300408	三环集团	3,656,400	61,866,288.00	0.19
152	600068	葛洲坝	9,760,941	61,689,147.12	0.19
153	002422	科伦药业	2,983,800	61,615,470.00	0.19
154	600516	方大炭素	3,686,300	61,598,073.00	0.18
155	000413	东旭光电	13,685,355	61,584,097.50	0.18
156	601998	中信银行	10,920,407	59,516,218.15	0.18
157	600438	通威股份	7,081,700	58,636,476.00	0.18
158	600109	国金证券	8,149,402	58,349,718.32	0.18
159	002460	赣锋锂业	2,631,109	58,094,886.72	0.17
160	300136	信维通信	2,664,370	57,577,035.70	0.17
161	601555	东吴证券	8,533,907	57,177,176.90	0.17
162	000157	中联重科	16,028,645	57,061,976.20	0.17
163	600018	上港集团	10,953,042	56,736,757.56	0.17
164	600085	同仁堂	2,060,247	56,656,792.50	0.17
165	600066	宇通客车	4,724,282	55,982,741.70	0.17
166	601919	中远海控	13,607,335	54,973,633.40	0.17
167	002450	康得新	7,140,129	54,550,585.56	0.16
168	300070	碧水源	6,984,352	54,477,945.60	0.16
169	600674	川投能源	6,262,303	54,294,167.01	0.16
170	000425	徐工机械	16,760,814	54,137,429.22	0.16
171	600926	杭州银行	7,296,352	53,993,004.80	0.16
172	000876	新希望	7,393,611	53,825,488.08	0.16
173	300144	宋城演艺	2,509,481	53,577,419.35	0.16
174	600027	华电国际	11,263,800	53,503,050.00	0.16
175	603799	华友钴业	1,768,642	53,253,810.62	0.16
176	600219	南山铝业	25,139,260	53,043,838.60	0.16
177	600489	中金黄金	6,099,296	52,331,959.68	0.16
178	601997	贵阳银行	4,871,146	52,023,839.28	0.16
179	600398	海澜之家	6,122,900	51,922,192.00	0.16

180	002352	顺丰控股	1,561,700	51,145,675.00	0.15
181	000728	国元证券	7,208,785	50,317,319.30	0.15
182	300024	机器人	3,769,238	49,829,326.36	0.15
183	002146	荣盛发展	6,131,730	48,747,253.50	0.15
184	002241	歌尔股份	7,078,530	48,700,286.40	0.15
185	600362	江西铜业	3,665,289	48,235,203.24	0.14
186	000703	恒逸石化	4,178,300	48,134,016.00	0.14
187	600170	上海建工	15,857,730	48,048,921.90	0.14
188	600739	辽宁成大	4,591,522	48,027,320.12	0.14
189	002065	东华软件	6,893,747	47,911,541.65	0.14
190	002081	金螳螂	5,862,074	47,482,799.40	0.14
191	601018	宁波港	14,168,174	47,321,701.16	0.14
192	002673	西部证券	6,153,273	47,195,603.91	0.14
193	002493	荣盛石化	4,673,650	47,157,128.50	0.14
194	000625	长安汽车	7,085,995	46,696,707.05	0.14
195	601198	东兴证券	4,873,268	46,588,442.08	0.14
196	002050	三花智控	3,598,000	45,658,620.00	0.14
197	601138	工业富联	3,897,900	45,176,661.00	0.14
198	600208	新湖中宝	15,460,843	44,836,444.70	0.13
199	000630	铜陵有色	22,634,003	44,588,985.91	0.13
200	002179	中航光电	1,315,250	44,297,620.00	0.13
201	002001	新和成	2,888,400	43,354,884.00	0.13
202	000709	河钢股份	15,164,527	43,067,256.68	0.13
203	002558	巨人网络	2,196,960	42,555,115.20	0.13
204	600038	中直股份	1,121,666	41,905,441.76	0.13
205	000786	北新建材	3,024,100	41,611,616.00	0.12
206	601992	金隅集团	11,862,808	41,519,828.00	0.12
207	300072	三聚环保	4,189,477	41,224,453.68	0.12
208	600153	建发股份	5,811,158	40,968,663.90	0.12
209	002271	东方雨虹	3,116,900	40,363,855.00	0.12
210	600583	海油工程	8,174,263	40,053,888.70	0.12
211	002797	第一创业	7,381,480	40,007,621.60	0.12
212	000503	国新健康	2,495,974	39,636,067.12	0.12
213	300017	网宿科技	5,029,042	39,377,398.86	0.12
214	002572	索菲亚	2,345,062	39,279,788.50	0.12
215	600118	中国卫星	2,256,879	39,089,144.28	0.12
216	300296	利亚德	5,042,300	38,775,287.00	0.12
217	601333	广深铁路	12,123,734	38,310,999.44	0.12
218	601117	中国化学	7,135,200	38,244,672.00	0.11

219	600760	中航沈飞	1,368,200	37,912,822.00	0.11
220	000961	中南建设	6,627,643	37,181,077.23	0.11
221	002624	完美世界	1,315,500	36,636,675.00	0.11
222	600549	厦门钨业	3,028,579	36,585,234.32	0.11
223	603858	步长制药	1,442,130	36,457,046.40	0.11
224	002085	万丰奥威	4,700,200	36,426,550.00	0.11
225	600977	中国电影	2,522,139	36,117,030.48	0.11
226	600566	济川药业	1,064,000	35,675,920.00	0.11
227	600369	西南证券	10,082,463	35,086,971.24	0.11
228	600297	广汇汽车	8,577,070	34,822,904.20	0.10
229	600688	上海石化	6,976,943	34,814,945.57	0.10
230	600004	白云机场	3,452,300	34,695,615.00	0.10
231	600809	山西汾酒	987,600	34,615,380.00	0.10
232	000792	盐湖股份	4,908,335	34,260,178.30	0.10
233	600816	安信信托	7,811,618	34,136,770.66	0.10
234	600415	小商品城	9,730,692	33,960,115.08	0.10
235	000898	鞍钢股份	6,593,935	33,826,886.55	0.10
236	603833	欧派家居	421,843	33,629,323.96	0.10
237	002310	东方园林	4,797,600	33,391,296.00	0.10
238	600346	恒力股份	2,518,700	33,372,775.00	0.10
239	601021	春秋航空	1,036,769	32,979,621.89	0.10
240	000839	中信国安	9,758,660	32,886,684.20	0.10
241	000540	中天金融	6,640,917	32,341,265.79	0.10
242	000983	西山煤电	5,837,497	32,047,858.53	0.10
243	601881	中国银河	4,692,100	32,000,122.00	0.10
244	601216	君正集团	12,060,350	31,598,117.00	0.09
245	300033	同花顺	825,700	31,541,740.00	0.09
246	002508	老板电器	1,558,469	31,465,489.11	0.09
247	002602	世纪华通	1,509,354	31,168,160.10	0.09
248	601238	广汽集团	2,983,640	30,701,655.60	0.09
249	601878	浙商证券	4,220,200	30,638,652.00	0.09
250	002153	石基信息	1,178,366	30,590,381.36	0.09
251	000671	阳光城	5,892,129	30,580,149.51	0.09
252	601898	中煤能源	6,525,202	30,342,189.30	0.09
253	600485	信威集团	2,073,669	30,254,830.71	0.09
254	600188	兖州煤业	3,388,472	29,750,784.16	0.09
255	002032	苏泊尔	558,280	29,309,700.00	0.09
256	000402	金融街	4,541,988	29,250,402.72	0.09
257	600909	华安证券	6,132,300	28,944,456.00	0.09

258	000627	天茂集团	5,122,411	28,736,725.71	0.09
259	002294	信立泰	1,372,355	28,668,495.95	0.09
260	603986	兆易创新	455,480	28,385,513.60	0.09
261	002601	龙蟠佰利	2,289,000	28,154,700.00	0.08
262	600704	物产中大	6,095,899	27,919,217.42	0.08
263	601991	大唐发电	8,797,569	27,712,342.35	0.08
264	600061	国投资本	3,015,592	27,110,172.08	0.08
265	601360	三六零	1,296,700	26,413,779.00	0.08
266	600998	九州通	1,805,800	26,364,680.00	0.08
267	601228	广州港	6,653,300	26,347,068.00	0.08
268	600372	中航电子	2,014,781	26,151,857.38	0.08
269	000826	启迪桑德	2,488,983	25,860,533.37	0.08
270	300251	光线传媒	3,375,757	25,655,753.20	0.08
271	601633	长城汽车	4,554,492	25,505,155.20	0.08
272	000938	紫光股份	815,234	25,484,214.84	0.08
273	002252	上海莱士	3,137,695	25,132,936.95	0.08
274	603259	药明康德	328,700	24,606,482.00	0.07
275	000415	渤海金控	6,642,100	23,911,560.00	0.07
276	002555	三七互娱	2,375,616	22,425,815.04	0.07
277	603160	汇顶科技	282,318	22,218,426.60	0.07
278	000959	首钢股份	5,862,314	21,866,431.22	0.07
279	000408	藏格控股	1,946,400	21,838,608.00	0.07
280	600339	中油工程	6,006,600	21,803,958.00	0.07
281	002411	必康股份	961,010	20,258,090.80	0.06
282	600157	永泰能源	14,530,812	19,471,288.08	0.06
283	600025	华能水电	6,138,600	19,336,590.00	0.06
284	601808	中海油服	2,248,300	19,200,482.00	0.06
285	002468	申通快递	1,149,000	18,901,050.00	0.06
286	300433	蓝思科技	2,674,940	17,413,859.40	0.05
287	001965	招商公路	2,166,500	17,396,995.00	0.05
288	601611	中国核建	2,521,759	16,467,086.27	0.05
289	002773	康弘药业	472,400	16,094,668.00	0.05
290	600390	五矿资本	2,102,700	14,634,792.00	0.04
291	002120	韵达股份	475,200	14,398,560.00	0.04
292	002625	光启技术	1,325,040	13,117,896.00	0.04
293	601828	美凯龙	1,169,205	12,908,023.20	0.04
294	002925	盈趣科技	292,500	12,834,900.00	0.04
295	601066	中信建投	1,457,600	12,695,696.00	0.04
296	600233	圆通速递	1,219,000	12,190,000.00	0.04

297	603260	合盛硅业	236,300	10,349,940.00	0.03
298	601838	成都银行	1,271,499	10,235,566.95	0.03
299	601108	财通证券	1,265,500	9,136,910.00	0.03
300	601212	白银有色	3,071,000	9,059,450.00	0.03
301	603156	养元饮品	186,800	7,767,144.00	0.02
302	000553	沙隆达 A	843,600	7,702,068.00	0.02
303	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.00
304	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.00
305	603629	利通电子	1,051	40,684.21	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	000651	格力电器	728,131,275.78	3.58
2	000333	美的集团	699,400,100.18	3.44
3	000858	五粮液	451,418,095.46	2.22
4	000002	万科 A	448,207,972.11	2.21
5	002415	海康威视	401,435,717.14	1.98
6	000001	平安银行	325,642,334.83	1.60
7	000725	京东方 A	304,999,362.02	1.50
8	002304	洋河股份	264,089,718.52	1.30
9	002027	分众传媒	246,020,838.55	1.21
10	002594	比亚迪	182,897,643.49	0.90
11	000538	云南白药	168,608,656.12	0.83
12	002024	苏宁易购	161,274,322.87	0.79
13	002142	宁波银行	161,051,925.41	0.79
14	000063	中兴通讯	157,510,103.29	0.78
15	001979	招商蛇口	155,976,254.48	0.77
16	300059	东方财富	154,539,377.85	0.76
17	002008	大族激光	144,626,975.71	0.71
18	002475	立讯精密	144,433,310.95	0.71
19	000776	广发证券	143,775,309.75	0.71
20	000338	潍柴动力	139,455,875.62	0.69

注：不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000651	格力电器	369,528,492.47	1.82
2	000333	美的集团	345,255,604.21	1.70
3	000002	万科A	231,777,202.64	1.14
4	600519	贵州茅台	213,845,166.84	1.05
5	000858	五粮液	213,813,745.88	1.05
6	002415	海康威视	208,419,258.06	1.03
7	000725	京东方A	161,023,510.86	0.79
8	000001	平安银行	160,244,589.86	0.79
9	601318	中国平安	132,145,372.98	0.65
10	002304	洋河股份	130,939,720.82	0.64
11	600016	民生银行	96,357,692.74	0.47
12	000538	云南白药	95,427,735.54	0.47
13	002027	分众传媒	91,933,636.90	0.45
14	002594	比亚迪	89,480,920.36	0.44
15	002008	大族激光	81,796,849.95	0.40
16	002024	苏宁易购	80,552,075.42	0.40
17	000623	吉林敖东	79,345,744.88	0.39
18	000063	中兴通讯	78,118,238.06	0.38
19	001979	招商蛇口	76,660,064.82	0.38
20	002142	宁波银行	75,779,492.29	0.37

注：不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 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	13,890,644,129.76
卖出股票收入（成交）总额	7,848,645,488.50

注：不考虑相关交易费用。

### 8.5 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。



## 8.6 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。

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	2,151,972.55
2	应收证券清算款	32,456,121.97
3	应收股利	-
4	应收利息	19,869.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,627,963.56

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 本基金的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
108,296	100,163.33	7,955,257,725.47	73.34%	2,892,029,964.53	26.66%

### 9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
联接基金	251,680,500.00	2.32%

### 9.3 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中央汇金投资有限责任公司	2,423,958,601.00	22.35%
2	中国人寿保险股份有限公司	471,707,700.00	4.35%
3	中国人民财产保险股份有限公司— 传统—普通保险产品—008C—CT	403,691,312.00	3.72%
4	中国人寿保险股份有限公司	251,599,477.00	2.32%
5	华宝信托有限责任公司—恒盛配置 三号理财产品资金信托	235,982,978.00	2.18%
6	中国人民人寿保险股份有限公司— 分红—一个险分红	203,319,394.00	1.87%
7	中国人寿保险（集团）公司	185,226,599.00	1.71%
8	银华财富资本—建设银行—银华资 本—粤盈1号专项资产管理计划	96,101,400.00	0.89%
9	银华财富资本—建设银行—银华资 本—粤盈2号专项资产管理计划	95,489,600.00	0.88%
10	中国平安人寿保险股份有限公司— 投连—发展投资账户	90,000,000.00	0.83%
	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金	251,680,500.00	2.32%

注：前十名持有人为除华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金之外的前十名持有人。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

## 9.5 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：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年5月4日）基金份额总额	32,968,633,875.00
本报告期期初基金份额总额	4,983,787,690.00
本报告期期间基金总申购份额	10,325,700,000.00
减:本报告期期间基金总赎回份额	4,462,200,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	10,847,287,690.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 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

2018 年 8 月 20 日，公司任命李晓西先生为公司副总经理，李晓西先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试，其任命已在中国证券投资基金业协会备案。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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 170,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 7 年的审计服务。

### 11.6 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、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
广发证券	4	5,227,930,041.60	24.06%	4,801,025.39	24.15%	-
长江证券	2	4,452,786,246.04	20.50%	4,057,839.02	20.41%	-
华泰证券	2	2,673,027,176.42	12.30%	2,447,194.70	12.31%	-
申银万国	2	2,590,934,628.65	11.93%	2,361,387.53	11.88%	-
平安证券	2	1,786,559,963.18	8.22%	1,653,989.50	8.32%	-
兴业证券	1	1,649,841,892.53	7.59%	1,503,507.34	7.56%	-
银河证券	2	1,311,312,211.47	6.04%	1,195,004.18	6.01%	-
方正证券	2	480,732,781.08	2.21%	438,095.31	2.20%	-
国泰君安	2	454,016,180.30	2.09%	413,746.63	2.08%	-
瑞银证券	2	384,846,529.16	1.77%	350,712.37	1.76%	-
中信建投	2	337,721,041.24	1.55%	314,520.61	1.58%	-
湘财证券	2	197,008,559.30	0.91%	179,534.98	0.90%	-
中信证券	3	179,291,851.13	0.83%	166,975.92	0.84%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	3	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	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。

### 11.7.2 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	
	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
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	1,363,440.00	100.00%	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-



爱建证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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资基金收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 1 月 17 日
2	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金增加一级交易商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 2 月 10 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 54 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 3 月 23 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 4 月 2 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 8 月 21 日
6	华泰柏瑞基金关于网上直销平台(含移动终端)开通中国建设银行基金快捷支付业务并实施交易费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 9 月 19 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加基金直销账户的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 9 月 25 日
8	华泰柏瑞基金关于网上直销平台(含移动终端)开通中国银行基金快捷支付业务并实施交易费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 10 月 9 日
9	华泰柏瑞基金关于网上直销平台(含移动终端)开通中国民生银行基金快捷支付业务并实施交易费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 10 月 9 日
10	华泰柏瑞基金关于网上直销平台(含移动终端)开通招商银行直付通支付业务并实施交易费率优惠	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 12 月 25 日

---

	活动		
--	----	--	--

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20180101-20181231	2,423,958,601.00	0.00	0.00	2,423,958,601.00	22.35%
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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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

### 13.3 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019 年 3 月 27 日