

上证红利交易型开放式指数证券投资基金

[2012]第四季度报告

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司
报告送出日期：2013年1月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事局及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。基金托管人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。

基金合同生效日期：2011年1月17日

报告期末基金份额总额：867,175,703.00份

投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

投资策略：本基金将采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（流动性不足等）导致无法购买足额数量的股票时，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，追求尽可能贴近标的指数的表现。

基金经理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。

报告期自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞上证红利ETF
交易代码	51080
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月17日

报告期末基金份额总额：867,175,703.00份

投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

投资策略：本基金将采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（流动性不足等）导致无法购买足额数量的股票时，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，追求尽可能贴近标的指数的表现。

基金经理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。

报告期自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日 - 2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -96,834,697.76

2.本期利润 196,459,123.16

3.加权平均基金份额本期利润 0.2334

4.期末基金份额净值 1,655,944,402.34

5.期末基金资产净值 1,910

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示数字。
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，本期利润指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）加上本期利润。

3.本基金于2007年1月10日至2011年1月16日成立并进行了基金份额折算，折算比例为1.65527799，期间未还原后基金份额累计净值=1.65527799×折算比例。该净值可反映投资者在认购期以份额面值1.00元购买红利ETF后的实际份额净值变动情况。

3.2 基金份额净值

3.2.1 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 准收益基准差④ 准差⑤ ①-③ ②-④

过去三个月 13.06% 1.20% 13.17% 1.21% -0.11% 0.01%

3.2.2 日基合同生效以来本基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：上图显示了本基金成立以来的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较。

3.3 本报告期内基金的利润分配情况

3.3.1 报告期内本基金未进行利润分配。

3.3.2 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.3 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.4 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.5 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.6 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.7 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.8 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.9 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.10 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.11 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.12 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.13 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.14 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.15 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.16 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.17 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.18 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.19 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.20 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.21 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.22 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.23 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.24 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.25 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.26 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.27 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.28 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.29 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.30 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.31 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.32 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.33 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.34 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.35 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.36 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.37 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.38 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.39 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.40 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.41 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.42 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.43 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.44 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.45 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.46 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.47 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.48 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.49 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.50 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.51 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.52 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.53 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.54 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.55 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.56 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.57 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.58 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.59 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.60 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.61 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.62 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.63 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.64 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.65 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.66 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.67 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.68 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.69 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.70 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.71 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.72 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.73 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.74 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.75 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.76 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.77 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.78 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.79 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.80 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.81 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.82 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.83 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.84 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.85 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.86 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.87 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.88 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.89 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.90 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.91 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.92 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.93 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.94 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.95 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.96 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.97 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.98 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.99 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.100 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.101 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.102 报告期内本基金未向持有人支付过红利。

3.3.103 报告期内本基金未向持有人支付过利息。

3.3.104 报告期内本基金未向持有人支付过股息。

3.3.105 报告期内本基金未向持有人支付过基金份额。

3.3.106 报告期内本基金未向持有人支付过红利。