

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
送出日期:2013年8月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员存在虚假记载、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,并由董事长签章。

基金托管人招行银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月22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,保证复核后不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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摘要。

本年度报告所披露摘要自半年度报告公告,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 华泰柏瑞上证红利ETF

基金代码 510880

基金运作方式 交易型开放式

基金合同生效日 2006年11月17日

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

报告期末基金份额总额 707,175,703.00份

基金管理合同存续期 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 2007-01-18

2.2 基金产品说明

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。

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。但在因特殊情况下(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造基金的实际投资组合,追求尽可能贴近标的指数的基本走势。

业绩比较基准 上证红利指数

本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证红利指数,是股票基金中风险较高,收益中等的产品。

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 招商银行股份有限公司

姓名 陈晔 张燕

信息披露负责人 联系电话 021-38601777

电子邮箱 cs4008880001@huatai-ph.com yan_zhang@cmcbchina.com

客户服务电话 400-888-0001 95555

传真 021-38601799 0755-83195201

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-ph.com

基金半年度报告置地 上海市浦东新区民生路1199弄嘉定五道口广场1号17层

§3 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

3.1 主要会计数据和财务指标

报告期(2013年1月1日 – 2013年6月30日)

本期已实现收益 52,151,896.66

本期利润 -123,320,978.20

加权平均基金份额本期利润 -0.1659

本期基金份额净值增长率 -11.20%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 0.1699

期末基金份额净值 1,199,346,459.09

期末基金资产净值 1,696

注:1.上表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示的数字。
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、公允价值变动收益减去相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金的表决权

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变动的比较

阶段 份额净值增长率为% 增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率增长率为% 准备收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -13.95% 1.93% -15.82% 1.94% 1.87% -0.01%

过去三个月 -11.25% 1.48% -13.27% 1.50% 2.02% -0.02%

过去六个月 -11.20% 1.68% -13.07% 1.70% 1.87% -0.02%

过去一年 -4.68% 1.41% -7.39% 1.43% 2.71% -0.02%

过去三年 -9.94% 1.29% -15.87% 1.30% 5.93% -0.01%

自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:图表数据截至2013年6月30日,基金份额净值1,696元,基金份额总额707,175,703.00份。

注:图表数据截至2013年6月30日,基金份额净值1,696元,基金份额总额707,175,703.00份。