

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:2014年3月26日

\$ 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责任。本基金年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2014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当仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日。

\$ 2 基金简介

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联接基金
基金代码	466300
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	115,943,331.65份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞沪深300ETF联接
基金代码	466300
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	115,943,331.65份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 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
基金代码	510300
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	115,943,331.65份
基金合同存续期	不定期

2.1.2 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
基金代码	510300
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	115,943,331.65份
基金合同存续期	不定期

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	本基金是沪深300ETF的联接基金,投资300ETF是主要采用完全复制法来构造沪深300指数基金的被动管理型基金,本基金主要是通过投资于沪深300ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。风险、收益或波动率的基础上,决定采用一级市场申赎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*95%+银行存款利率*5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,风险收益特征与沪深300指数的表观风险切合。本基金的风格与收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.2.1 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
基金代码	510300
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	115,943,331.65份
基金合同存续期	不定期

2.2.2 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	本基金是沪深300ETF的联接基金,投资300ETF是主要采用完全复制法来构造沪深300指数基金的被动管理型基金,本基金主要是通过投资于沪深300ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。风险、收益或波动率的基础上,决定采用一级市场申赎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*95%+银行存款利率*5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,风险收益特征与沪深300指数的表观风险切合。本基金的风格与收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.2.3 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数的表现,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构成及其权重来构建基金资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应比例的调整,以使得基金净值尽可能地跟踪标的指数的表现。
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,风险收益特征与沪深300指数的表观风险切合。本基金的风格与收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.2.4 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数的表现,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构成及其权重来构建基金资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应比例的调整,以使得基金净值尽可能地跟踪标的指数的表现。
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,风险收益特征与沪深300指数的表观风险切合。本基金的风格与收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.2.5 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数的表现,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构成及其权重来构建基金资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应比例的调整,以使得基金净值尽可能地跟踪标的指数的表现。
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,风险收益特征与沪深300指数的表观风险切合。本基金的风格与收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.2.6 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数的表现,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构成及其权重来构建基金资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应比例的调整,以使得基金净值尽可能地跟踪标的指数的表现。
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,风险收益特征与沪深300指数的表观风险切合。本基金的风格与收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.2.7 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数的表现,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构成及其权重来构建基金资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应比例的调整,以使得基金净值尽可能地跟踪标的指数的表现。
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,风险收益特征与沪深300指数的表观风险切合。本基金的风格与收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.2.8 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数的表现,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构成及其权重来构建基金资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应比例的调整,以使得基金净值尽可能地跟踪标的指数的表现。
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,风险收益特征与沪深300指数的表观风险切合。本基金的风格与收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.2.9 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数的表现,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构成及其权重来构建基金资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应比例的调整,以使得基金净值尽可能地跟踪标的指数的表现。
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,风险收益特征与沪深300指数的表观风险切合。本基金的风格与收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.2.10 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数的表现,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构成及其权重来构建基金资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应比例的调整,以使得基金净值尽可能地跟踪标的指数的表现。
业绩比较基准</	