

# 信息披露 Disclosure

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司  
基金托管人：中国银行股份有限公司  
送出日期：2014年3月26日

重要提示

1.1 重要提示  
基金管理人的董事、董事会、监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的独立董事签字同意，并由董事长签发。  
基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定，于2014年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利率调整情况、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。

基金销售机构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。

本年度报告财务数据已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

2.1 基金简介

基金名称	华泰柏瑞中小盘ETF
基金主代码	510202
交易方式	交易所开放式
基金合同生效日	2001年1月26日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	30,229,161.00份
基金存续期间	不定期
上市交易所	上海证券交易所
上市日期	2001-3-26

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。
投资策略	本基金采用完全复制法，即完全按照标的指数的构成比例与权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化定期调整组合，以确保组合与标的指数的风险收益特征相一致。
业绩比较基准	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。
风险收益特征	本基金具有较高的预期收益，但同时亦存在较高的风险。

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	中国银行股份有限公司

2.4 信息披露方式

信息披露方式	网站
登载在中国证监会指定的报刊上的公告	http://www.huatai-ph.com
登载在中国证监会指定的互联网网址	http://www.huatai-ph.com

2.5 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

项目	2013年	2012年	当年比上年增长
本期已实现收益	-17,356,958.21	-21,448,140.42	+9,080,591.60
本期利润	6,171,162.53	-137,066,533	-61,939,919.03
期末可供分配基金份额余额	0.9160	-0.0031	-1.0443
期末持有的现金比例	6.75%	0.29%	-33.80%
期末持有的现金比例	-1,267.2	-1,284	-1,235.7
期末总资产净值	78,419,510.57	88,053,919.11	-10.50%
期末可供分配基金份额总额	2,938	4,436	-31.80%

注：本基金的业绩指标不包括持有人认购或交易基金份额的费用，计算费用后实际收益将低于列示数据。

2.6 本期利润指基金本期利息收入、收入资本收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除本期费用后的余额，本期利润率为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 对期末可供分配利润，采用期末资产负值表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4. 基金成立日期为2001年1月26日

3.2.1 基金净值表现

3.2.1.1 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

注：本基金合同生效以来基金每年净值增长率率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金净值增长率=基金每年净值增长率率及其与同期业绩比较基准收益率的比

例

注：图示日期为2011年1月26日至2013年12月31日。

2.7 基金合同规定，本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一章（二）投资范围中规定的比例，即投资于指数成份股，成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金每年净值增长率率及其与同期业绩比较基准收益率的比

较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率率及其与同期业绩比较基准收益率的比