

## 上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

## [2011] 第二季度报告

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2011年7月20日

重要提示  
基金管理人的董事会及高级管理人员所做出的不存在虚假记载、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。基金托管人中国银行股份有限公司根据本基

金合同规定，于2011年7月19日复核了报告中财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证

其内容的真实、准确和完整，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。

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、本报告中的财务资料未经审计。本报

告日期:2011年4月1日起至2011年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 华泰柏瑞上证中小盘ETF  
交易代码 510220  
基金运作方式 爆发型开放式  
基金合同生效日 2011年1月26日  
报告期末基金份额总额 51,229,161.00份

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。

本基金将采取完全复制法，即完全按照标的指数的构成及其权重来构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，但在因特殊情况导致本基金无法获得足够数量的标的股票时，基金管理人将根据风险管理的原则，在综合考虑跟踪误差和风险的基础上，选择其他金融工具进行替代，以确保本基金的正常运作。

本基金在投资运作过程中将充分考虑标的指数成份股的流动性限制，如果出现流动性不足的情况，基金管理人将根据实际情况，对投资组合进行调整，以降低流动性不足带来的负面影响。

投资策略 本基金将严格按照《基金合同》的约定，通过逐日跟踪标的指数并定期对投资组合的构成与标的指数的构成进行比较，对投资组合的构成与标的指数的构成的差异进行分析，从而确定投资组合的调整方向。

业绩比较基准 上证中小盘指数

风险收益特征 本基金为股票型基金，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标 单位:人民币元

1.本期已实现收益 -300,921.97

2.本期利润 -13,605,262.46

3.加权平均基金份额本期利润 -0.2550

4.期末基金份额净值 170,296,205.33

5.期末基金份额总额 3,324

注:1.本基金在业绩比较基准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将低于业绩比较基准；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）减去期间费用后的余额，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2011年3月11日建仓完毕并开始进行基金份额折算，折算比例为1.07371199，期间折算后基金份额净值为170,296,205.33元，折算后基金份额总额为3,324份。

3.2.1 本期报告期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 准收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.31% 1.26% -7.37% 1.28% 0.06% -0.02%

3.2.2 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:1.本基金在业绩比较基准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将低于业绩比较基准；2.本基金在业绩比较基准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将低于业绩比较基准；3.本基金于2011年3月11日建仓完毕并开始进行基金份额折算，折算比例为1.07371199，期间折算后基金份额净值为170,296,205.33元，折算后基金份额总额为3,324份。

3.2.3 本期报告期业绩比较基准收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金在业绩比较基准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将低于业绩比较基准；2.本基金在业绩比较基准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将低于业绩比较基准；3.本基金于2011年3月11日建仓完毕并开始进行基金份额折算，折算比例为1.07371199，期间折算后基金份额净值为170,296,205.33元，折算后基金份额总额为3,324份。

4. 管理人报告

4.1 基金经理、较基金经理简介

姓名 职务 在本基金的任职期限 证券从业年限 说明

张斌 基金经理、指数投资部总监 2011年1月26日 - 7年 张斌女士，美国俄亥俄州阿特兰大大学金融学硕士，MBA，具有10年证券从业经验，历任华泰柏瑞期货有限公司研究员、资产管理部研究员、基金经理助理、基金经理等职务。2006年11月起担任华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数基金基金经理，2009年6月起担任华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数基金基金经理，2011年1月起担任华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数基金基金经理，2011年6月起担任华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，通过科学

严谨的制度安排，从制度、人员和事后监督三个层面严格执行基金买卖时间间隔限制，对投资组合的合规性、公平性和独立性进行监控，从而保证投资组合的公平交易执行，确保公平交易的实施。同时，风险监控制度对报告期内的交易行为进行监控和分析评估。

4.3.2 不同投资组合之间其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

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，通过科学

严谨的制度安排，从制度、人员和事后监督三个层面严格执行基金买卖时间间隔限制，对投资组合的合规性、公平性和独立性进行监控，从而保证投资组合的公平交易执行，确保公平交易的实施。同时，风险监控制度对报告期内的交易行为进行监控和分析评估。

4.3.3 公平交易制度的专题说明

报告期内，本基金管理人未发现本基金存在不公平对待不同投资组合的现象。

4.4 报告期内基金的估值政策和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金的估值政策和估值方法

4.4.2 报告期内基金的估值政策和估值方法

4.4.3 报告期内基金的估值政策和业绩表现的说明

4.5 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.6 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.7 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.8 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.9 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.10 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.11 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.12 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.13 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.14 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.15 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.16 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.17 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.18 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.19 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.20 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.21 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.22 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.23 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.24 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.25 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.26 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.27 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.28 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.29 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.30 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.31 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.32 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.33 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.34 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.35 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.36 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.37 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.38 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.39 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.40 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.41 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.42 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.43 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.44 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.45 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.46 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.47 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.48 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.49 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内，本基金运作符合相关法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行

4.50 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

报告期内