

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8月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、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,并由董事长签发。
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2014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。

本半年度报告摘要能简要地反映半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

§ 2 基金简介

基金简称	华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金
基金代码	640220
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011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 49,424,383.57元

基金份额净值 1.00元

报告期末基金份额总额 49,424,383.57份

基金类型 封闭式

交易币种 人民币

上市交易所 上证交易所

基金管理费计提比例 0.50%

基金托管费计提比例 0.10%

2.1 基金基本情况

基金名称 上证中小盘交易型开放式指数证券投资基

基金代码 640220

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2011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 49,424,383.57元

基金份额净值 1.00元

2.2 基金产品说明

投资目标 采用跟踪上证中小盘指数的基本策略,追求跟踪误差和跟踪偏离度的最小化。

投资策略 本基金是采用完全复制法跟踪上证中小盘指数的指数基金,采样时数数据源及其权重动态调整,本基金主要通过投资于华泰柏瑞上证中小盘ETF实现对上证中小盘指数的跟踪,在投资过程中,本基金将根据市场情况,适时调整股票组合,在控制跟踪误差的前提下,通过定期调整、定期抽样和不定期抽样的方式择机卖出持有的上证中小盘ETF进行投资。

业绩比较基准 上证中小盘指数 * 95% + 银行存款利率(税后) * 5%

风险收益特征 本基金为华泰柏瑞上证中小盘的联接基金,采样时数数据源及其权重动态调整,本基金主要通过投资于华泰柏瑞上证中小盘ETF实现对上证中小盘指数的跟踪,在投资过程中,本基金将根据市场情况,适时调整股票组合,在控制跟踪误差的前提下,通过定期调整、定期抽样和不定期抽样的方式择机卖出持有的上证中小盘ETF进行投资。

2.3 目标基金产品说明

投资目标 紧密跟踪标的指数,追求跟踪误差和跟踪偏离度的最小化。

投资策略 本基金是采用完全复制法跟踪上证中小盘指数的指数基金,采样时数数据源及其权重动态调整,本基金主要通过投资于华泰柏瑞上证中小盘ETF实现对上证中小盘指数的跟踪,在投资过程中,本基金将根据市场情况,适时调整股票组合,在控制跟踪误差的前提下,通过定期调整、定期抽样和不定期抽样的方式择机卖出持有的上证中小盘ETF进行投资。

业绩比较基准 上证中小盘指数 * 95% + 银行存款利率(税后) * 5%

风险收益特征 本基金属于股票型基金,其风险和收益较高,属于中等股票型基金,本基金与货币市场基金而言,其风险和收益较高,属于中等股票型基金,本基金与货币市场基金而言,其风险和收益较低,属于中等股票型基金,本基金与货币市场基金而言,其风险和收益较低,属于中等股票型基金。

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的公告网址 http://www.huatai-ph.com

基金半年度报告备置地点 上海市浦东新区民生路1199号证大五道口广场1号楼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 期间数据和指标 报告期(2014年1月1日至 2014年6月30日)

本期已实现收益 -2,395,019.37

本期利润 -1,439,542.89

加权平均基金份额利润 -0.026%

基金份额净值增长率为 -3.52%

3.2 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与已实现部分的孰低数。

3.3 基金净值表现

3.3.1 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

阶段 份额净值增长 率 (%) 份额净值 增长率 样本法基 准收益率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去一个月 1.63% 0.79% 1.34% 0.78% 0.29% 0.01%

过去三个月 0.73% 0.88% 0.59% 0.89% 0.14% -0.01%

过去六个月 -3.52% 1.06% -3.33% 1.07% -0.19% -0.01%

过去一年 9.76% 1.16% 10.61% 1.16% -0.85% 0.00%

过去三年 -24.53% 1.28% -23.46% 1.29% -0.07% -0.01%

自份额首次募集日起 -31.40% 1.25% -20.40% 1.28% -11.00% -0.03%

3.3.2 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

3.3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

项目 附注号 本期 2014年6月30日 2013年12月31日 上年度末

资产: 负债: 衍生工具: 其他: 1,776,413.17 2,157,518.58

银行存款和结算备付金 29.70 -

在途保证金 5,139.46 10,199.98

交易性金融资产 32,298,869.69 39,632,985.60

其中:股票投资 1,679,561.80 501,458.00

基金投资 30,619,307.89 39,131,527.60

应收利息 318.57 457.45

应收股利 -

应收申购款 - 1,187.26

递延所得税资产 -

其他资产 -

负债: 104,203.38 330,003.72

应付管理费用 158,762.07 338,927.88

应付托管费 -

应付交易费用 40,428.57 4,475.54

应付申购款 93.59 1,137.90

应付赎回费 186.73 227.57

应付信息披露费 -

应付手续费 3,069.26 3,083.15

应付利息 -

应付利润 -

其他负债 -

负债合计 34,008,770.59 41,820,339.87

3.3.2.2 基金份额净值 -

3.3.3 基金净值表现

3.3.3.1 基金份额净值

项目 附注号 本期 2014年6月30日 2013年12月31日 上年度末

资产: 负债: 衍生工具: 其他: 1,776,413.17 2,157,518.58

银行存款和结算备付金 29.70 -

在途保证金 5,139.46 10,199.98

交易性金融资产 32,298,869.69 39,632,985.60

其中:股票投资 1,679,561.80 501,458.00

基金投资 30,619,307.89 39,131,527.60

应收利息 318.57 457.45

应收股利 -

应收申购款 - 1,187.26

递延所得税资产 -

负债: 104,203.38 330,003.72

应付管理费用 158,762.07 338,927.88

应付托管费 -

应付交易费用 3,069.26 3,083.15

应付利息 -

应付利润 -

其他负债 -

负债合计 34,008,770.59 41,820,339.87

3.3.3.2 基金份额净值 -

3.3.3.3 基金份额净值

项目 附注号 本期 2014年6月30日 2013年12月31日 上年度末

资产: 负债: 衍生工具: 其他: 1,776,413.17 2,157,518.58

银行存款和结算备付金 29.70 -

在途保证金 5,139.46 10,199.98

交易性金融资产 32,298,869.69 39,632,985.60

其中:股票投资 1,679,561.80 501,458.00

基金投资 30,619,307.89 39,131,527.60

应收利息 318.57 457.45

应收股利 -

应收申购款 - 1,187.26

递延所得税资产 -

负债: 104,203.38 330,003.72

应付管理费用 158,762.07 338,927.88

应付托管费 -

应付交易费用 3,069.26 3,083.15

应付利息 -

应付利润 -

其他负债 -

负债合计 34,008,770.59 41,820,339.87

3.3.3.4 基金份额净值 -

3.3.3.5 基金份额净值

项目 附注号 本期 2014年6月30日 2013年12月31日 上年度末

资产: 负债: 衍生工具: 其他: 1,776,413.17 2,157,518.58

银行存款和结算备付金 29.70 -

在途保证金 5,139.46 10,199.98

交易性金融资产 32,298,869.69 39,632,985.60

其中:股票投资 1,679,561.80 501,458.00

基金投资 30,619,307.89 39,131,527.60