

上证红利交易型开放式指数证券投资基金

[2014]第三季度报告

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2014年10月24日

§ 1

重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人和银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2014年10月23日复核了本报告中的财务数据，复核意见表明报告的内容不存在虚假记载、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认真阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§ 2

基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞上证红利ETF
交易代码	510880
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006年11月7日
报告期末基金份额总额	573,675,703.00份
投资目标	紧密跟踪上证红利指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
风险收益特征	本基金主要采取定额投资法，即以恒定比例的资产投资于指数成分股及其他金融工具，通过定期调整资产配置，从而在一定程度上分散投资于股票市场的风险。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标		单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)	
1.本期已实现收益	14,626,114.81	
2.本期利润	154,726,586.21	
3.期末可供分配基金份额利润	0.2606(元)	2.546
4.期末基金资产净值	1,091,076,783.24	1.902
5.期末基金份额净值		

注:1.上述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列示的数字。

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(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期利润。

3.本基金于2007年1月10日建仓完毕并进行了基金资产折算，折算比例为0.65527799。期末还原后基金份额净值=1/(期初基金份额净值×折算比例)，该净值可反映投资者以公允价值1.00元购买ETF时的实时份额净值变动情况。

基金净值表现

3.2.1 本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

3.2.2 本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

3.2.3 本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

3.2.4 本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

3.2.5 本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

3.2.6 本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

3.2.7 本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

3.2.8 本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

3.2.9 本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

3.2.10 本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

3.2.11 本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

3.2.12 本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

3.2.13 本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

3.2.14 本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

3.2.15 本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

3.2.16 本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

3.2.17 本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

3.2.18 本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

3.2.19 本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

3.2.20 本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

3.2.21 本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

3.2.22 本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

3.2.23 本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

3.2.24 本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

3.2.25 本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

3.2.26 本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

3.2.27 本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

3.2.28 本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

3.2.29 本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

3.2.30 本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

3.2.31 本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

3.2.32 本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

3.2.33 本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

3.2.34 本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

3.2.35 本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

3.2.36 本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

3.2.37 本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

3.2.38 本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

3.2.39 本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

3.2.40 本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

3.2.41 本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

3.2.42 本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

3.2.43 本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

3.2.44 本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

3.2.45 本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

3.2.46 本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

3.2.47 本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

3.2.48 本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

3.2.49 本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

3.2.50 本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

3.2.51 本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

3.2.52 本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

3.2.53 本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

3.2.54 本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

3.2.55 本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

3.2.56 本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

3.2.57 本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

3.2.58 本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

3.2.59 本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

3.2.60 本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

3.2.61 本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

3.2.62 本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

3.2.63 本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

3.2.64 本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

3.2.65 本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

3.2.66 本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

3.2.67 本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

3.2.68 本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

3.2.69 本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

3.2.70 本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

3.2.71 本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

3.2.72 本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

3.2.73 本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

3.2.74 本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

3.2.75 本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

3.2.76 本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

3.2.77 本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

3.2.78 本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

3.2.79 本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

3.2.80 本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

3.2.81 本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

3.2.82 本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

3.2.83 本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

3.2.84 本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

3.2.85 本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

3.2.86 本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

3.2.87 本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

3.2.88 本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

3.2.89 本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

3.2.90 本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

3.2.91 本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

3.2.92 本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

3.2.93 本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

3.2.94 本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

3.2.95 本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

3.2.96 本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

3.2.97 本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

3.2.98 本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

3.2.99 本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

3.2.100 本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

3.2.101 本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

3.2.102 本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

3.2.103 本报告期基金份额净值增长率及其