

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：2015年3月1日至31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、准确性及完整性承担个别及连带的法律责任。本公司承诺在三分之二以上的独立董事签署同意，并由董事长签章。

基金托管人华泰柏瑞基金管理有限公司根据本基金合同规定，在2015年3月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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本基金，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并不要求其未来实现。

本年度报告摘要自年度报告正式披露之日起六个月内有效。

本报告期2014年1月1日起至2014年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金代码 510202

基金运作方式 灵活配置型

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 38,583,984.45

报告期末基金份额总额 不定期

报告期末基金资产净值 2011-03-28

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称 上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

基金代码 510202

基金运作方式 灵活配置型

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 38,583,984.45

报告期末基金份额总额 不定期

报告期末基金资产净值 2011-03-28

2.2 基金产品说明

投资目标 紧密跟踪上证中小盘指数，追求回报幅度及回报率的最小化。

投资策略 本基金为华泰柏瑞上证中小盘ETF的联接基金，采用类似于华泰柏瑞上证中小盘ETF的投资策略，通过投资于上证中小盘ETF实现对上证中小盘指数的跟踪。本基金将综合考虑宏观经济、行业趋势、风险、成本、因素对基金的影响，择时采用买入持有、定期定额、定期赎回等不同的投资策略，从而实现本基金的长期增值。

业绩比较基准 上证中小盘指数 * 95% + 银行活期存款利率后收益率 * 5%

风险收益特征 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，从而实现对上证中小盘指数的跟踪。本基金的风险与收益水平高于混合型基金，但低于股票型基金。

业绩特征 本基金将延续严格遵守偏离度的被动式投资策略，从而为基金投资人谋求与业绩基准基本一致的回报。

2.3 基金管理人和基金托管人

基金管理人 华泰柏瑞基金管理有限公司

名称 华泰柏瑞基金管理有限公司

简称 华泰柏瑞

信息披露负责人 姚晓峰

联系电话 010-66594896

电子邮箱 cs400888001@huatai-phb.com

客户服务电话 400-888-0001

传真 021-38601779

报告期末基金资产总额 010-66594942

2.4 基金销售机构

直销机构 华泰柏瑞基金管理有限公司

代销机构 上海证券交易所

风险收益特征 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，从而实现对上证中小盘指数的跟踪。本基金的风险与收益水平高于混合型基金，但低于股票型基金。

业绩特征 本基金将延续严格遵守偏离度的被动式投资策略，从而为基金投资人谋求与业绩基准基本一致的回报。

2.5 基金份额净值

基金名称 上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金代码 510202

基金运作方式 灵活配置型

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 38,583,984.45

报告期末基金份额总额 不定期

报告期末基金资产净值 2011-03-28

2.6 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位：人民币元

3.1 主要会计数据和财务指标

报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

报告期：2011年1月1日至2011年12月31日

报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

报告期：2009年1月1日至2009年12月31日

报告期：2008年1月1日至2008年12月31日

报告期：2007年1月1日至2007年12月31日

报告期：2006年1月1日至2006年12月31日

报告期：2005年1月1日至2005年12月31日

报告期：2004年1月1日至2004年12月31日

报告期：2003年1月1日至2003年12月31日

报告期：2002年1月1日至2002年12月31日

报告期：2001年1月1日至2001年12月31日

报告期：2000年1月1日至2000年12月31日

报告期：1999年1月1日至1999年12月31日

报告期：1998年1月1日至1998年12月31日

报告期：1997年1月1日至1997年12月31日

报告期：1996年1月1日至1996年12月31日

报告期：1995年1月1日至1995年12月31日

报告期：1994年1月1日至1994年12月31日

报告期：1993年1月1日至1993年12月31日

报告期：1992年1月1日至1992年12月31日

报告期：1991年1月1日至1991年12月31日

报告期：1990年1月1日至1990年12月31日

报告期：1989年1月1日至1989年12月31日

报告期：1988年1月1日至1988年12月31日

报告期：1987年1月1日至1987年12月31日

报告期：1986年1月1日至1986年12月31日

报告期：1985年1月1日至1985年12月31日

报告期：1984年1月1日至1984年12月31日

报告期：1983年1月1日至1983年12月31日

报告期：1982年1月1日至1982年12月31日

报告期：1981年1月1日至1981年12月31日

报告期：1980年1月1日至1980年12月31日

报告期：1979年1月1日至1979年12月31日

报告期：1978年1月1日至1978年12月31日

报告期：1977年1月1日至1977年12月31日

报告期：1976年1月1日至1976年12月31日

报告期：1975年1月1日至1975年12月31日

报告期：1974年1月1日至1974年12月31日

报告期：1973年1月1日至1973年12月31日

报告期：1972年1月1日至1972年12月31日

报告期：1971年1月1日至1971年12月31日

报告期：1970年1月1日至1970年12月31日

报告期：1969年1月1日至1969年12月31日

报告期：1968年1月1日至1968年12月31日

报告期：1967年1月1日至1967年12月31日

报告期：1966年1月1日至1966年12月31日

报告期：1965年1月1日至1965年12月31日

报告期：1964年1月1日至1964年12月31日

报告期：1963年1月1日至1963年12月31日

报告期：1962年1月1日至1962年12月31日

报告期：1961年1月1日至1961年12月31日

报告期：1960年1月1日至1960年12月31日

报告期：1959年1月1日至1959年12月31日

报告期：1958年1月1日至1958年12月31日

报告期：1957年1月1日至1957年12月31日

报告期：1956年1月1日至1956年12月31日

报告期：1955年1月1日至1955年12月31日

报告期：1954年1月1日至1954年12月31日

报告期：1953年1月1日至1953年12月31日

报告期：1952年1月1日至1952年12月31日

报告期：1951年1月1日至1951年12月31日

报告期：1950年1月1日至1950年12月31日

报告期：1949年1月1日至1949年12月31日

报告期：1948年1月1日至1948年12月31日

报告期：1947年1月1日至1947年12月31日

报告期：1946年1月1日至1946年12月31日

报告期：1945年1月1日至1945年12月31日

报告期：1944年1月1日至1944年12月31日

报告期：1943年1月1日至1943年12月31日

报告期：1942年1月1日至1942年12月31日

报告期：1941年1月1日至1941年12月31日

报告期：1940年1月1日至1940年12月31日

报告期：1939年1月1日至1939年12月31日

报告期：1938年1月1日至1938年12月31日

报告期：1937年1月1日至1937年12月31日

报告期：1936年1月1日至1936年12月31日

报告期：1935年1月1日至1935年12月31日

报告期：1934年1月1日至1934年12月31日

报告期：1933年1月1日至1933年12月31日

报告期：1932年1月1日至1932年12月31日