

# 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 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 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

送出日期：2011 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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 2011 年 8 月 23 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仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 26 日起至 2011 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务报表(未经审计)</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票指数投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	39
7.10 投资组合报告附注.....	39
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	40

<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>40</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>40</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	43
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>45</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>45</b>
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

## § 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
基金简称	华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接
基金主代码	460220
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
报告期末基金份额总额	94,098,856.09 份
基金合同存续期	不定期

#### 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
基金主代码	510220
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年1月26日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011年3月28日
基金管理人名称	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的联接基金。华泰柏瑞上证中小盘 ETF 是采用完全复制法实现对上证中小盘指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式对华泰柏瑞上证中小盘 ETF 进行投资。
业绩比较基准	上证中小盘指数 × 95% + 银行活期存款税后收益率 × 5%
风险收益特征	本基金为华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的联接基金，采用主要投资于上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的

	业绩表现与上证中小盘指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
--	--

### 2.2.1 目标基金产品说明

目标基金投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
目标基金投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
目标基金业绩比较基准	上证中小盘指数
目标基金风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，股票最低仓位为95%，并采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

### 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
信息披露负责人	姓名	陈晖	唐州徽
	联系电话	021-38601777	010-66594855
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层	北京市复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层	北京市复兴门内大街1号
邮政编码		200135	100818
法定代表人		齐亮	肖钢

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2011年1月26日至2011年6月30日)
本期已实现收益	2,024,820.70
本期利润	-6,929,773.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0425
本期加权平均净值利润率	-4.34%
本期基金份额净值增长率	-9.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	-8,581,232.09
期末可供分配基金份额利润	-0.0912
期末基金资产净值	85,517,624.00
期末基金份额净值	0.909
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-9.10%

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公允价值变动收益。

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

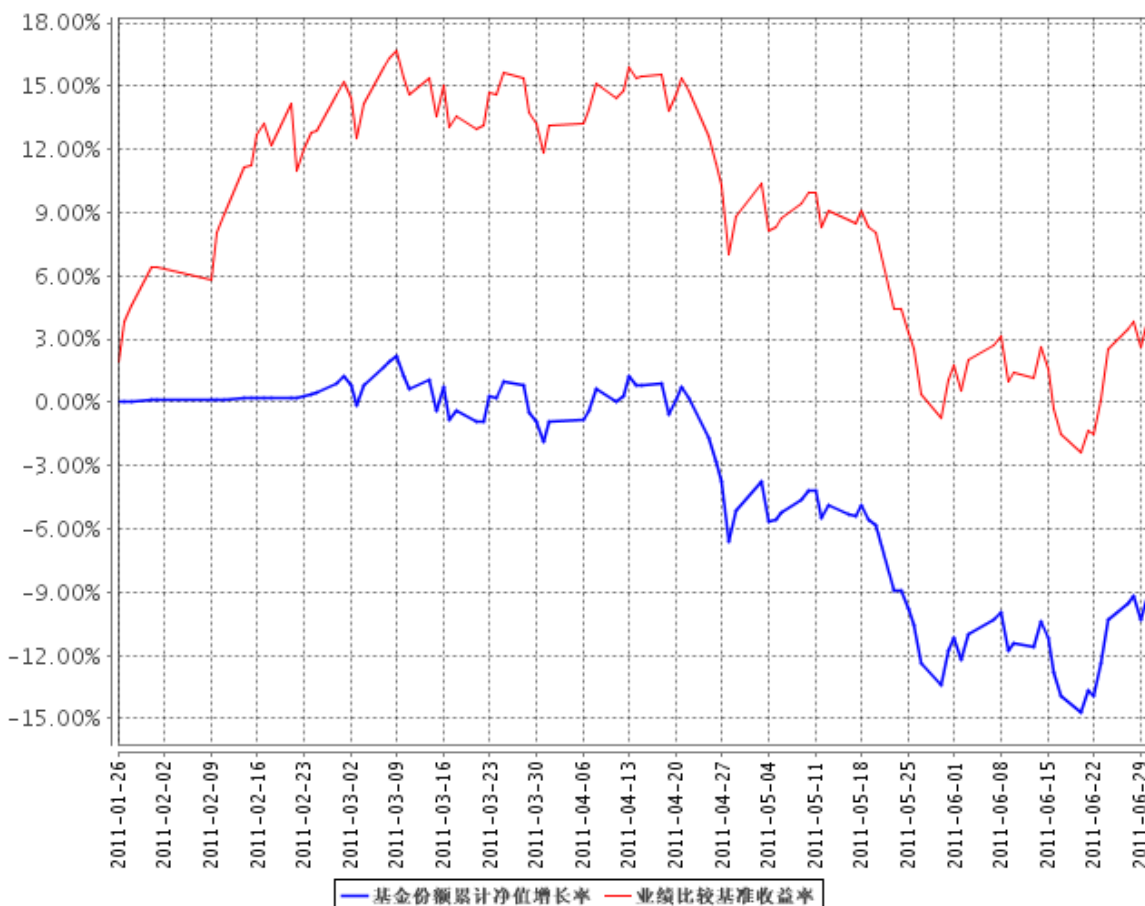
### 3.2 基金净值表现

#### 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.06%	1.24%	2.92%	1.25%	0.14%	-0.01%
过去三个月	-7.34%	1.19%	-6.99%	1.21%	-0.35%	-0.02%
自基金合同生效日起至 今	-9.10%	1.00%	3.99%	1.22%	-13.09%	-0.22%

#### 3.2.2 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2011 年 1 月 26 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。

2、按基金合同规定，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十四条（二）投资范围中规定的比例，即投资于华泰柏瑞上证中小



盘 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金和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。截至 2011 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 162.36 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张娅	本基金的基金经理、指数投资部总监	2011 年 1 月 26 日	-	7 年	张娅女士，美国俄亥俄州肯特州立大学金融工程硕士、MBA，具有多年海内外金融从业经验。曾在芝加哥期货交易所、Danzas-AEI 公司、SunGard Energy 和联合证券工作，2004 年初加入本公司，从事投资研究和金融工程工作，2006 年 11 月起任华泰

					柏瑞上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010 年 10 月 1 日起任华泰柏瑞指数投资部总监。2011 年 1 月起担任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 及华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。
柳军	本基金的基金经理、指数投资部副总监	2011 年 1 月 26 日	-	10 年	柳军, 10 年证券(基金)从业经历, 复旦大学财务管理硕士, 2000 年至 2001 年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作, 2001 年至 2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员, 2004 年 7 月起加入本公司, 历任基金事务部总监、基金经理助理。2009 年 6 月起任华泰柏瑞(原友邦华泰)上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010 年 10 月 1 日起任华泰柏瑞指数投资部副总监。2011 年 1 月起担任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 及华泰柏瑞上证中小盘

					ETF 联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	---------------

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期指基金管理公司作出决定之日。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《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合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次集中交易室对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

注：本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格均不相同。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年 A 股市场两落两起，大中盘指数在市场下跌中具有相对优势，而中小盘指数凭借良好的弹性，在阶段性反弹行情中领先，但总体而言上半年市场风格偏向大中盘指数，其中上证红利指数-0.91%，上证中小盘指数-5.03%。估值分化在 2010 年演绎到极致之后，在 2011 年上半年得到了一定程度的纠正和回归。

2011 年上半年市场整体处于弱势震荡之中，通胀水平逐月走高、经济增速呈逐季下滑态势，

A 股在经济下滑和通胀上行之之间的夹缝中，难以获得趋势性的机会。而政策也随通胀亦步亦趋，存准金率达到历史最高水平，市场资金面几度出现紧张，引爆了银行理财产品的发行，A 股财富效应的缺失难以吸引场外资金。在上半年估值水平趋势性下降过程中，受到资金阶段性缓解以及政策放松预期的影响，A 股出现了场内存量资金引发的估值修复超跌反弹的短暂行情。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 0.909 元，累计净值为 0.909 元，本报告期内基金份额净值下跌 9.10%，本基金的业绩比较基准上涨 3.99%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度末 A 股在政策预期放松的背景下开始了一轮反弹，但进入三季度谨慎情绪开始在 A 股市场蔓延，在猪肉价格的扰动下 7 月通胀将再达高点以及美债上限问题迟迟不能敲定的担忧下，本轮反弹很快止住了脚步。而投资者的担忧在 8 月逐渐成现实，7 月 CPI 超越 6 月达到三年来的最高点 6.5%，尽管美债上限问题最终在大限来临之前解决，但伴随而来的美国主权债务评级被下调，引发了市场的恐慌。毕竟通过大量超发货币、国家举债刺激经济的政策终有不能为继的那一天，海外股市在 3 年之后重新回到金融危机之前的水平，其基础是非常不牢固的，谁都知道海外经济“金玉其外败絮其中”的真实面目，谁都知道终有这么一天这样的游戏玩不下去，在“遮羞布”一旦被揭开的时候，大家都做鸟兽散状，没有人愿意再继续这样的游戏，全球股市的暴跌也再所难免。

下半年我国经济整体处于缓慢回落的态势，预计投资和消费增速较上半年将有所回落，但仍存不稳定性因素，美债和欧债危机如果进一步发酵，是否会引发全球经济再次陷入衰退，进而对我国的出口产生负面影响，是下半年投资者需要密切关注的问题。刚刚过去的 8 月份全球市场的危机，如果说 A 股还仅仅是受到了恐慌情绪传染的话，接下来 A 股还有可能经历全球经济衰退的疫情。美联储的“定期宽松”政策，为新一轮的通胀埋下了种子，新兴市场与通胀的斗争，就像汽车人与怪兽的战斗将没完没了，而欧洲的问题还存重大不确定性，真不知道如何收场？看来 A 股的事情还得靠咱自己才靠谱。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与业绩基准基本一致的投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研

究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金每年收益分配次数最多为 12 次；每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在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（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务报表(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：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  
 报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日
----	-----	------------------------

<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	4,557,614.82
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	81,009,811.50
其中：股票投资		967,559.10
基金投资		80,042,252.40
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		84,965.68
应收利息	6.4.7.5	925.30
应收股利		246.96
应收申购款		5,307.79
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		85,658,872.05
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年6月30日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		4,986.21
应付管理人报酬		2,302.26
应付托管费		460.46
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	5,011.21
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
其他负债	6.4.7.8	128,487.91
递延所得税负债		-
负债合计		141,248.05
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	94,098,856.09
未分配利润	6.4.7.10	-8,581,232.09
所有者权益合计		85,517,624.00
负债和所有者权益总计		85,658,872.05

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.909 元，基金份额总额 94,098,856.09 份。

本基金基金合同生效日为 2011 年 1 月 26 日。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2011 年 1 月 26 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 1 月 26 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-6,338,996.11
1. 利息收入		1,295,033.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	148,578.14
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,146,455.79
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		829,896.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	949,343.21
基金投资收益	6.4.7.13	-128,592.42
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	9,145.71
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-8,954,594.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	490,668.15
<b>减：二、费用</b>		590,777.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	253,267.01
2. 托管费	6.4.10.2.2	50,653.38
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.20	154,210.94
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.21	132,646.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-6,929,773.99
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-6,929,773.99

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2011 年 1 月 26 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 26 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金合同生效日 (2011 年 1 月 26 日)	482,562,901.50	-	482,562,901.50
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期利 润)	-	-6,929,773.99	-6,929,773.99
三、本期基金份额交易产 生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填 列)	-388,464,045.41	-1,651,458.10	-390,115,503.51
其中：1. 基金申购款	2,489,211.17	-71,003.99	2,418,207.18
2. 基金赎回款	-390,953,256.58	-1,580,454.11	-392,533,710.69
四、本期向基金份额持有 人分配利润产生的基金 净值变动(净值减少以 “-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基 金净值)	94,098,856.09	-8,581,232.09	85,517,624.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
陈国杰

基金管理公司负责人

\_\_\_\_\_  
房伟力

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
陈培

会计机构负责人

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

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(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2010]第 1535 号《关于核准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不



包括认购资金利息共募集人民币 482,542,072.50 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 26 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2011 年 1 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 482,562,901.50 份基金份额,其中认购资金利息折合 20,829.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括华泰柏瑞上证中小盘 ETF、上证中小盘指数成份股及备选成份股、非成份股、债券、新股(一级市场初次发行和增发)、股指期货、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。正常情况下,本基金资产中投资于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为上证中小盘指数  $\times$  95% + 银行活期存款税后收益率  $\times$  5%。

本财务报表由本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2011 年 8 月 24 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：(i)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。(ii)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。(iii)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金包含对外发行的基金份额总额和基金份额折算调整。基金份额折算调整的初始金额用于基金份额折算日根据基金份额折算公式折算后的基金份额与对外发行的基金份额之间的差额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动和基金份额折算变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。在符合有关基金分红条件的前提下，基金每年收益分配次数最多为 12 次；每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配。基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

#### 6.4.4.12 分部报告

无。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	4,557,614.82
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	4,557,614.82

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,049,426.21	967,559.10	-81,867.11
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-

基金	88,914,979.98	80,042,252.40	-8,872,727.58
其他	-	-	-
合计	89,964,406.19	81,009,811.50	-8,954,594.69

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末，本基金买入返售金融资产余额为 0。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	925.30
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	925.30

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,011.21
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,011.21

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	18.79
预提费用	128,469.12
合计	128,487.91

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	482,562,901.50	482,562,901.50
本期申购	2,489,211.17	2,489,211.17
本期赎回(以“-”号填列)	-390,953,256.58	-390,953,256.58
本期末	94,098,856.09	94,098,856.09

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,024,820.70	-8,954,594.69	-6,929,773.99
本期基金份额交易产生的变动数	-1,055,477.44	-595,980.66	-1,651,458.10
其中：基金申购款	26,360.40	-97,364.39	-71,003.99
基金赎回款	-1,081,837.84	-498,616.27	-1,580,454.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	969,343.26	-9,550,575.35	-8,581,232.09

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月26日至2011年6月30日
活期存款利息收入	130,277.62
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	18,300.52
其他	-
合计	148,578.14

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月26日至2011年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-151,475.03
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	1,100,818.24
合计	949,343.21

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月26日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	22,260,437.37
减：卖出股票成本总额	22,411,912.40
买卖股票差价收入	-151,475.03

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月26日至2011年6月30日
申购基金份额总额	92,332,000.00
减：现金支付申购款总额	8,985,292.96
减：申购股票成本总额	82,245,888.80
申购差价收入	1,100,818.24

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月26日至2011年6月30日
----	-----------------------------



卖出/赎回基金成交总额	3,563,874.80
减：卖出/赎回基金成本总额	3,692,467.22
基金投资收益	-128,592.42

#### 6.4.7.14 债券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

注：无。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月26日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,145.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,145.71

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月26日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-8,954,594.69
——股票投资	-81,867.11
——债券投资	-
——基金投资	-8,872,727.58
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-8,954,594.69

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2011 年 1 月 26 日至 2011 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	490,083.19
转换费收入	584.96
合计	490,668.15

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 26 日至 2011 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	154,210.94
银行间市场交易费用	-
合计	154,210.94

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 26 日至 2011 年 6 月 30 日
审计费用	27,529.32
信息披露费	100,939.80
银行划款手续费	3,777.43
其他费用	400.00
合计	132,646.55

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
------------	-----------------

注：1、关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本报告期本基金与关联方未进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期本基金与关联方未进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本报告期本基金无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	253,267.01
其中：支付销售机构的客户维护费	157,474.87

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 0.50%的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$  H为每日应支付的管理人报酬 E为前一日的基金资产净值 基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	50,653.38

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$  H为每日应支付的托管费 E为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	4,557,614.82	130,277.62

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	-----	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

			因							
600369	西南证 券	2011- 03-01	重大 事项 停牌	11.87	2011-08 -16	12.49	6,300	71,859.99	74,781.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，适用于本基金的市场风险包括利率风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款及结算备付金，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,557,614.82	-	-	-	-	-	4,557,614.82
交易性金融资产	-	-	-	-	-	81,009,811.50	81,009,811.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	84,965.68	84,965.68
应收利息	-	-	-	-	-	925.30	925.30
应收股利	-	-	-	-	-	246.96	246.96
应收申购款	2,466.28	-	-	-	-	2,841.51	5,307.79
资产总计	4,560,081.10	-	-	-	-	81,098,790.95	85,658,872.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,986.21	4,986.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,302.26	2,302.26
应付托管费	-	-	-	-	-	460.46	460.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,011.21	5,011.21
其他负债	-	-	-	-	-	128,487.91	128,487.91
负债总计	-	-	-	-	-	141,248.05	141,248.05
利率敏感度缺口	4,560,081.10	-	-	-	-	-80,957,542.90	85,517,624.00

注：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：截至 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项

的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的联接基金。华泰柏瑞上证中小盘 ETF 是采用完全复制法实现对上证中小盘指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式对华泰柏瑞上证中小盘 ETF 进行投资。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括跟踪误差等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	967,559.10	1.13
交易性金融资产—基金投资	80,042,252.40	93.60
交易性金融资产—债券投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	81,009,811.50	94.73

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“上证中小盘指数”以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2011年6月30日）
	指数上涨 5%	4,490,000.00
	指数下跌 5%	-4,490,000.00

#### 6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

注：本基金运用跟踪误差法管理风险，未采用风险价值法。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。



## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	967,559.10	1.13
	其中：股票	967,559.10	1.13
2	基金投资	80,042,252.40	93.44
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,557,614.82	5.32
7	其他各项资产	91,445.73	0.11
8	合计	85,658,872.05	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票指数投资组合

#### 7.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	102,512.30	0.12
C	制造业	380,589.40	0.45
C0	食品、饮料	52,601.00	0.06
C1	纺织、服装、皮毛	21,536.00	0.03
C2	木材、家具	5,049.00	0.01
C3	造纸、印刷	15,753.00	0.02
C4	石油、化学、塑胶、塑料	26,056.40	0.03
C5	电子	27,876.50	0.03
C6	金属、非金属	27,354.00	0.03
C7	机械、设备、仪表	129,337.00	0.15
C8	医药、生物制品	59,110.50	0.07
C99	其他制造业	15,916.00	0.02
D	电力、煤气及水的生产和供应业	49,267.00	0.06
E	建筑业	83,555.40	0.10
F	交通运输、仓储业	41,221.00	0.05

G	信息技术业	15,860.00	0.02
H	批发和零售贸易	31,324.00	0.04
I	金融、保险业	113,839.00	0.13
J	房地产业	21,250.00	0.02
K	社会服务业	27,135.00	0.03
L	传播与文化产业	17,024.00	0.02
M	综合类	83,982.00	0.10
	合计	967,559.10	1.13

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600369	西南证券	6,300	74,781.00	0.09
2	600887	伊利股份	1,800	29,970.00	0.04
3	600068	葛洲坝	2,400	28,776.00	0.03
4	601299	中国北车	3,800	25,460.00	0.03
5	601186	中国铁建	3,600	21,780.00	0.03
6	601009	南京银行	2,400	21,528.00	0.03
7	600276	恒瑞医药	700	20,979.00	0.02
8	600875	东方电气	800	20,400.00	0.02
9	601666	平煤股份	1,430	20,034.30	0.02
10	600415	小商品城	1,600	19,664.00	0.02
11	600881	亚泰集团	2,200	18,326.00	0.02
12	600497	驰宏锌锗	780	17,199.00	0.02
13	601727	上海电气	2,300	15,916.00	0.02
14	601607	上海医药	900	15,120.00	0.02
15	601117	中国化学	1,700	15,062.00	0.02
16	600999	招商证券	800	14,704.00	0.02
17	601106	中国一重	3,000	14,550.00	0.02
18	600832	东方明珠	1,800	13,950.00	0.02
19	601001	大同煤业	800	13,600.00	0.02
20	601333	广深铁路	3,300	13,563.00	0.02
21	600970	中材国际	480	13,118.40	0.02
22	601101	昊华能源	200	12,622.00	0.01
23	601808	中海油服	700	12,502.00	0.01
24	600859	王府井	300	11,991.00	0.01

25	600812	华北制药	1,000	11,520.00	0.01
26	600997	开滦股份	700	11,172.00	0.01
27	600636	三爱富	300	10,659.00	0.01
28	600811	东方集团	1,500	10,320.00	0.01
29	601866	中海集运	2,800	10,192.00	0.01
30	600879	航天电子	800	9,728.00	0.01
31	600888	新疆众和	400	9,700.00	0.01
32	600839	四川长虹	2,875	9,602.50	0.01
33	601179	中国西电	1,500	9,150.00	0.01
34	601158	重庆水务	1,100	9,086.00	0.01
35	600039	四川路桥	900	8,568.00	0.01
36	600895	张江高科	900	8,496.00	0.01
37	600971	恒源煤电	200	8,072.00	0.01
38	600815	厦工股份	500	7,370.00	0.01
39	600537	海通集团	200	7,324.00	0.01
40	600508	上海能源	300	7,311.00	0.01
41	601918	国投新集	600	7,296.00	0.01
42	600259	广晟有色	100	7,292.00	0.01
43	600522	中天科技	300	7,092.00	0.01
44	601888	中国国旅	300	7,089.00	0.01
45	600880	博瑞传播	500	7,020.00	0.01
46	600851	海欣股份	700	6,937.00	0.01
47	600893	航空动力	400	6,916.00	0.01
48	600963	岳阳林纸	800	6,848.00	0.01
49	601588	北辰实业	1,800	6,588.00	0.01
50	600820	隧道股份	600	6,402.00	0.01
51	600330	天通股份	500	6,265.00	0.01
52	600637	广电信息	500	6,225.00	0.01
53	600863	内蒙华电	700	6,202.00	0.01
54	600866	星湖科技	600	6,192.00	0.01
55	601872	招商轮船	1,600	6,128.00	0.01
56	600872	中炬高新	900	6,048.00	0.01
57	600176	中国玻纤	200	6,044.00	0.01
58	600410	华胜天成	400	5,984.00	0.01
59	600835	上海机电	500	5,915.00	0.01
60	600823	世茂股份	400	5,852.00	0.01
61	600867	通化东宝	675	5,656.50	0.01
62	601002	晋亿实业	300	5,547.00	0.01
63	600884	杉杉股份	300	5,481.00	0.01

64	600339	天利高新	440	5,350.40	0.01
65	600831	广电网络	500	5,340.00	0.01
66	600322	天房发展	1,000	5,310.00	0.01
67	600387	海越股份	400	5,304.00	0.01
68	600844	丹化科技	300	5,238.00	0.01
69	600300	维维股份	1,000	5,150.00	0.01
70	600886	国投电力	700	5,075.00	0.01
71	600961	株冶集团	300	5,058.00	0.01
72	600978	宜华木业	900	5,049.00	0.01
73	601991	大唐发电	900	5,022.00	0.01
74	600284	浦东建设	300	4,911.00	0.01
75	600877	中国嘉陵	600	4,872.00	0.01
76	600517	置信电气	400	4,828.00	0.01
77	600618	氯碱化工	300	4,809.00	0.01
78	601107	四川成渝	800	4,496.00	0.01
79	601369	陕鼓动力	400	4,388.00	0.01
80	601268	二重重装	400	4,336.00	0.01
81	600995	文山电力	400	4,292.00	0.01
82	600838	上海九百	500	4,280.00	0.01
83	600858	银座股份	200	4,088.00	0.00
84	600713	南京医药	300	3,987.00	0.00
85	600597	光明乳业	500	3,965.00	0.00
86	600830	香溢融通	400	3,888.00	0.00
87	600268	国电南自	300	3,840.00	0.00
88	600523	贵航股份	200	3,810.00	0.00
89	600846	同济科技	600	3,648.00	0.00
90	600824	益民集团	600	3,642.00	0.00
91	601678	滨化股份	200	3,530.00	0.00
92	600246	万通地产	700	3,500.00	0.00
93	601877	正泰电器	200	3,466.00	0.00
94	600825	新华传媒	500	3,435.00	0.00
95	600894	广钢股份	400	3,408.00	0.00
96	600460	士兰微	200	3,398.00	0.00
97	601139	深圳燃气	300	3,144.00	0.00
98	601003	柳钢股份	600	3,144.00	0.00
99	600874	创业环保	500	3,030.00	0.00
100	600836	界龙实业	300	3,027.00	0.00
101	600966	博汇纸业	400	2,992.00	0.00
102	601801	皖新传媒	200	2,914.00	0.00

103	600163	福建南纸	600	2,886.00	0.00
104	601099	太平洋	300	2,826.00	0.00
105	600756	浪潮软件	200	2,784.00	0.00
106	600862	南通科技	200	2,550.00	0.00
107	600983	合肥三洋	200	2,386.00	0.00
108	600834	申通地铁	200	1,954.00	0.00
109	600829	三精制药	150	1,848.00	0.00
110	600273	华芳纺织	200	1,826.00	0.00
111	601999	出版传媒	200	1,750.00	0.00
112	601000	唐山港	200	1,538.00	0.00
113	600818	中路股份	100	1,361.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601766	中国南车	1,495,719.00	1.75
2	600068	葛洲坝	1,258,291.41	1.47
3	600795	国电电力	1,241,835.00	1.45
4	600887	伊利股份	1,229,314.01	1.44
5	600585	海螺水泥	1,197,918.05	1.40
6	601299	中国北车	1,155,872.94	1.35
7	601186	中国铁建	1,092,592.00	1.28
8	601989	中国重工	1,016,627.00	1.19
9	601009	南京银行	976,824.00	1.14
10	600256	广汇股份	936,088.33	1.09
11	600406	国电南瑞	880,215.96	1.03
12	600029	南方航空	842,052.00	0.98
13	600011	华能国际	816,611.00	0.95
14	600276	恒瑞医药	769,524.00	0.90
15	601666	平煤股份	759,349.00	0.89
16	600518	康美药业	734,015.71	0.86
17	600875	东方电气	716,685.00	0.84
18	600664	哈药股份	710,921.00	0.83
19	600018	上港集团	693,608.32	0.81

20	600115	东方航空	684,486.00	0.80
----	--------	------	------------	------

注：不考虑相关交易费用。本基金基金合同于报告期内生效，占比计算采用期末基金资产净值。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601766	中国南车	597,446.00	0.70
2	600795	国电电力	556,406.00	0.65
3	600887	伊利股份	437,034.00	0.51
4	601186	中国铁建	414,058.00	0.48
5	600068	葛洲坝	405,318.00	0.47
6	601009	南京银行	365,093.04	0.43
7	601299	中国北车	364,179.09	0.43
8	600011	华能国际	333,435.02	0.39
9	600029	南方航空	324,356.00	0.38
10	601666	平煤股份	284,405.00	0.33
11	600276	恒瑞医药	280,589.24	0.33
12	600406	国电南瑞	275,629.00	0.32
13	600115	东方航空	255,721.00	0.30
14	600694	大商股份	248,091.00	0.29
15	600664	哈药股份	240,000.56	0.28
16	601001	大同煤业	237,934.00	0.28
17	600655	豫园商城	224,591.30	0.26
18	600703	三安光电	214,065.96	0.25
19	601866	中海集运	203,863.00	0.24
20	600642	申能股份	201,861.00	0.24

注：不考虑相关交易费用。本基金基金合同于报告期内生效，占比计算采用期末基金资产净值。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	102,185,640.41
卖出股票收入（成交）总额	22,260,437.37

注：不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	中小盘 ETF	股票型	交易型开放式	华泰柏瑞基金管理有限公司	80,042,252.40	93.60

### 7.10 投资组合报告附注

7.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

7.10.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

#### 7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	84,965.68
3	应收股利	246.96
4	应收利息	925.30
5	应收申购款	5,307.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	91,445.73

#### 7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

### 7.10.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600369	西南证券	74,781.00	0.09	重大事项停牌

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,030	46,354.12	2,072,208.98	2.20%	92,026,647.11	97.80%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	19,762.85	0.0210%

## § 9 开放式基金份额变动

份额单位：份

基金合同生效日 (2011 年 1 月 26 日) 基金份额总额	482,562,901.50
本报告期基金总申购份额	2,489,211.17
减:本报告期基金总赎回份额	390,953,256.58
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	94,098,856.09

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。



## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金基金管理人的重大人事变动：

华泰柏瑞基金管理有限公司第三届董事会 2011 年第二次会议审议通过刘宏友辞去副总经理的申请，免去其副总经理职务，离任日期：2011 年 2 月 11 日。

本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理；因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司。报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-

银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	78,087,949.74	62.75%	66,375.27	62.75%	-
西南证券	1	46,356,408.68	37.25%	39,403.75	37.25%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准 1) 资金雄厚，信誉良好。 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。 5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。 2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
财通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	496,000,000.00	23.70%	-
西南证券	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	1,597,000,000.00	76.30%	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金参加浙商证券网上交易、电话委托等基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年6月30日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年6月29日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年6月8日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金增加中信证券股份有限公司及天相投资顾问有限公司为定期定额申购业务办理机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年5月28日
5	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 2011 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年4月25日
6	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金 2011 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年4月25日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于网上直销平台开通“汇付天下”天天盈”模式的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年4月18日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加“华夏银行·盈基金 2011”网上银行基金申购最低 4 折优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年4月1日
9	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年3月23日
10	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购赎回的	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年3月23日

	公告		
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 3 月 15 日
12	关于上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算日的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 3 月 9 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司参加海通证券股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 2 月 23 日
14	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开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资、费率优惠等业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 2 月 16 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司高级管理人员离任公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 2 月 12 日
16	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合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 1 月 27 日
17	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 1 月 27 日
18	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增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 1 月 18 日
19	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增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 1 月 15 日
20	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 1 月 15 日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 1 月 15 日
22	关于上证中小盘 ETF 基金发售的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 1 月 12 日
23	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增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 1 月 8 日
24	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 1 月 8 日
25	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 1 月 6 日
26	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增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 1 月 6 日
27	华泰柏瑞上证中小盘交易型开放	中国证券报、上海证	2011 年 1 月 4 日

	式指数证券投资基金联接基金增加代销机构的公告	券报、证券时报	
28	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 1 月 4 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件
- 2、《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合同》
- 3、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》
- 4、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的公告

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费）021-3878 4638 公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司  
2011 年 8 月 24 日