

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 第二季度 报告

2011年6月30日

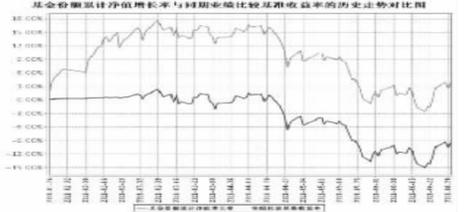
基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告截止日期:2011年7月20日

8.1 重要提示
基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,报告期内,基金的投资运作规范,基金资产净值及基金份额净值均实现增长,基金业绩表现良好。

8.2 基金产品概况
基金名称:华泰柏瑞上证中小盘ETF联接
基金代码: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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期末(2011年6月30日)
1.本期已实现收益 -316,774.13
2.本期利润 -6,691,700.59
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0701
4.期末基金份额净值 85.517,624.00

3.2 基金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
基金合同生效以来基金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.本基金合同生效日为2011年1月26日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。
2.本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比,是指基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比。

Table 8.4: Management Team. Lists names, titles, and tenures of the fund manager and other key personnel.

4.2 基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,报告期内,基金的投资运作规范,基金资产净值及基金份额净值均实现增长,基金业绩表现良好。

8.1 重要提示
基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,报告期内,基金的投资运作规范,基金资产净值及基金份额净值均实现增长,基金业绩表现良好。

8.2 基金产品概况
基金名称:华泰柏瑞上证中小盘ETF联接
基金代码:460010
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2010年12月2日

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期末(2011年6月30日)
1.本期已实现收益 -2,970,318.22
2.本期利润 -2,281,452.98
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0214
4.期末基金份额净值 98.641,433.80

3.2 基金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
基金合同生效以来基金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.本基金合同生效日为2010年12月2日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。
2.本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比,是指基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比。

Table 8.4: Management Team. Lists names, titles, and tenures of the fund manager and other key personnel.

4.2 基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,报告期内,基金的投资运作规范,基金资产净值及基金份额净值均实现增长,基金业绩表现良好。

2. 报告期内的基金业绩表现
截至报告期末,本基金基金份额净值为0.909元,累计净值为0.909元。本报告期内基金份额净值下跌7.34%,本基金的业绩表现良好。

Table 8.2: Portfolio Composition. Lists the top 10 holdings of the fund, including various stocks and bonds.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期末(2011年6月30日)
1.本期已实现收益 -390,921.07
2.本期利润 -13,405,262.46
3.加权平均基金份额本期利润 -0.2550
4.期末基金份额净值 170.296,203.33

3.2 基金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
基金合同生效以来基金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.本基金合同生效日为2011年4月1日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。
2.本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比,是指基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比。

Table 8.4: Management Team. Lists names, titles, and tenures of the fund manager and other key personnel.

4.2 基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,报告期内,基金的投资运作规范,基金资产净值及基金份额净值均实现增长,基金业绩表现良好。

8.1 重要提示
基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,报告期内,基金的投资运作规范,基金资产净值及基金份额净值均实现增长,基金业绩表现良好。

8.2 基金产品概况
基金名称:华泰柏瑞上证中小盘ETF联接
基金代码:80.042,252.40
基金运作方式:契约型开放式

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期末(2011年6月30日)
1.本期已实现收益 -3,360,876.69
2.本期利润 -1,857,400.94
3.加权平均基金份额本期利润 -0.10020
4.期末基金份额净值 104.682,852.43

3.2 基金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
基金合同生效以来基金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.本基金合同生效日为2011年4月1日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。
2.本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比,是指基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比。

Table 8.4: Management Team. Lists names, titles, and tenures of the fund manager and other key personnel.

4.2 基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,报告期内,基金的投资运作规范,基金资产净值及基金份额净值均实现增长,基金业绩表现良好。

华泰柏瑞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

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
报告截止日期:2011年7月20日

8.1 重要提示
基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,报告期内,基金的投资运作规范,基金资产净值及基金份额净值均实现增长,基金业绩表现良好。

8.2 基金产品概况
基金名称:华泰柏瑞上证中小盘ETF
基金代码:510220
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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期末(2011年6月30日)
1.本期已实现收益 -390,921.07
2.本期利润 -13,405,262.46
3.加权平均基金份额本期利润 -0.2550
4.期末基金份额净值 170.296,203.33

3.2 基金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
基金合同生效以来基金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.本基金合同生效日为2011年1月26日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。
2.本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比,是指基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比。

Table 8.4: Management Team. Lists names, titles, and tenures of the fund manager and other key personnel.

4.2 基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,报告期内,基金的投资运作规范,基金资产净值及基金份额净值均实现增长,基金业绩表现良好。

8.1 重要提示
基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,报告期内,基金的投资运作规范,基金资产净值及基金份额净值均实现增长,基金业绩表现良好。

8.2 基金产品概况
基金名称:华泰柏瑞上证中小盘ETF联接
基金代码:80.042,252.40
基金运作方式:契约型开放式

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期末(2011年6月30日)
1.本期已实现收益 -3,360,876.69
2.本期利润 -1,857,400.94
3.加权平均基金份额本期利润 -0.10020
4.期末基金份额净值 104.682,852.43

3.2 基金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
基金合同生效以来基金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.本基金合同生效日为2011年4月1日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。
2.本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比,是指基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比。

Table 8.4: Management Team. Lists names, titles, and tenures of the fund manager and other key personnel.

4.2 基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,报告期内,基金的投资运作规范,基金资产净值及基金份额净值均实现增长,基金业绩表现良好。

2. 报告期内的基金业绩表现
截至报告期末,本基金基金份额净值为0.909元,累计净值为0.909元。本报告期内基金份额净值下跌7.34%,本基金的业绩表现良好。

Table 8.2: Portfolio Composition. Lists the top 10 holdings of the fund, including various stocks and bonds.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期末(2011年6月30日)
1.本期已实现收益 -390,921.07
2.本期利润 -13,405,262.46
3.加权平均基金份额本期利润 -0.2550
4.期末基金份额净值 170.296,203.33

3.2 基金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
基金合同生效以来基金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.本基金合同生效日为2011年4月1日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。
2.本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比,是指基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比。

Table 8.4: Management Team. Lists names, titles, and tenures of the fund manager and other key personnel.

4.2 基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,报告期内,基金的投资运作规范,基金资产净值及基金份额净值均实现增长,基金业绩表现良好。

8.1 重要提示
基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,报告期内,基金的投资运作规范,基金资产净值及基金份额净值均实现增长,基金业绩表现良好。

8.2 基金产品概况
基金名称:华泰柏瑞上证中小盘ETF联接
基金代码:80.042,252.40
基金运作方式:契约型开放式

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期末(2011年6月30日)
1.本期已实现收益 -3,360,876.69
2.本期利润 -1,857,400.94
3.加权平均基金份额本期利润 -0.10020
4.期末基金份额净值 104.682,852.43

3.2 基金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
基金合同生效以来基金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.本基金合同生效日为2011年4月1日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。
2.本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比,是指基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比。

Table 8.4: Management Team. Lists names, titles, and tenures of the fund manager and other key personnel.

4.2 基金管理人及基金托管人按照基金合同规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,报告期内,基金的投资运作规范,基金资产净值及基金份额净值均实现增长,基金业绩表现良好。

华泰柏瑞基金管理有限公司 2011年7月20日