

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：2012年8月28日
1.1 重要提示
基金管理人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。

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

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

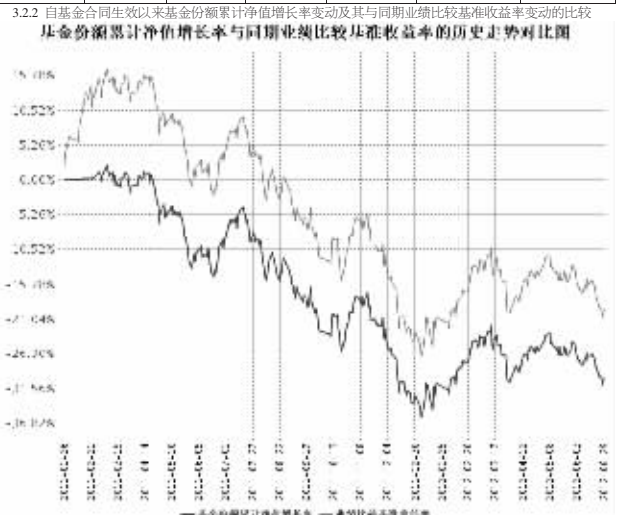
2.1 基金基本情况
基金名称 华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称 华泰柏瑞上证中小盘ETF联接
基金代码 460220
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日期 2011年11月26日
基金管理人 华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人 中国银行股份有限公司
基金合同生效日期 2011年11月26日

2.2 基金产品说明
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。
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采用完全复制法实现对上证中小盘指数跟踪的被动投资。
业绩比较基准 上证中小盘指数×95%+银行活期存款利率×5%

2.3 基金管理人及基金托管人
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
信息数据负责人 联系电话 021-38601777 010-66294855
电子邮箱 cao400888@uiba.com.cn tps@ccb.com.cn

Table with 3 columns: 项目, 名称, 办公地址. Lists various departments and their locations.

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据
项目 报告期(2012年6月30日)
本期已实现收益 -1,280,987.48
本期基金份额净值增长率 0.072%



注1: 图示日期为2011年11月26日至2012年6月30日。
注2: 本基金合同约定, 本基金基金合同生效日起6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C、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%。现在或到期在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

4.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“华泰柏瑞”)于2004年11月18日成立, 注册资本2亿元人民币, 目前的股权结构为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资管理有限公司、AIGC和杭州高新区(滨江)高新技术产业投资有限公司, 出资比例分别为49%、49%和2%。

4.1.2 基金管理人及其管理基金的经验
基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“华泰柏瑞”)于2004年11月18日成立, 注册资本2亿元人民币, 目前的股权结构为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资管理有限公司、AIGC和杭州高新区(滨江)高新技术产业投资有限公司, 出资比例分别为49%、49%和2%。

4.2 基金管理人及其管理基金的经验
基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“华泰柏瑞”)于2004年11月18日成立, 注册资本2亿元人民币, 目前的股权结构为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资管理有限公司、AIGC和杭州高新区(滨江)高新技术产业投资有限公司, 出资比例分别为49%、49%和2%。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明
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》约定, 在严格控制风险的基础上, 忠实地履行基金管理职责, 为基金份额持有人谋求合法权益。

4.3 管理人对于报告期内本基金公平交易情况的说明
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流程, 事前、事中和事后各环节严格控制不同基金之间的利益输送。

4.4 管理人对于报告期内本基金投资业绩和业绩表现的说明
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流程, 事前、事中和事后各环节严格控制不同基金之间的利益输送。

4.5 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.6 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.7 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.8 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.9 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.10 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.11 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.12 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.13 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.14 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.15 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.16 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.17 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.18 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.19 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.20 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.21 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.22 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.23 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.24 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.25 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.26 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.27 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.28 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.29 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.30 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.31 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.32 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.33 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.34 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.35 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.36 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

4.37 管理人对于报告期内本基金资产净值的说明
截至本报告期末, 本基金份额净值为0.699元, 累计净值为0.699元。本报告期内基金份额净值上涨4.02%, 基金份额净值较基准上涨4.33%。

报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告期, 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》约定, 在严格控制风险的基础上, 忠实地履行基金管理职责, 为基金份额持有人谋求合法权益。

6.1 资产负债表
项目 附注 期末 2012年6月30日 上年末 2011年12月31日
资产:
银行存款 6.4.7.1 3,435,714.35 4,404,053.70
结算备付金 -- -- --

6.2 利润表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
营业收入 9,750.70 253,267.01
其中: 支付销售机构的客户维护费 71,611.12 157,474.87

6.3 所有者权益变动表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
所有者权益 1,950.17 60,653.38

6.4 现金流量表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
经营活动产生的现金流量净额 1,950.17 60,653.38

6.5 资产负债表
项目 附注 期末 2012年6月30日 上年末 2011年12月31日
资产:

6.6 利润表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
营业收入 9,750.70 253,267.01
其中: 支付销售机构的客户维护费 71,611.12 157,474.87

6.7 所有者权益变动表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
所有者权益 1,950.17 60,653.38

6.8 现金流量表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
经营活动产生的现金流量净额 1,950.17 60,653.38

6.9 资产负债表
项目 附注 期末 2012年6月30日 上年末 2011年12月31日
资产:

6.10 利润表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
营业收入 9,750.70 253,267.01
其中: 支付销售机构的客户维护费 71,611.12 157,474.87

6.11 所有者权益变动表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
所有者权益 1,950.17 60,653.38

6.12 现金流量表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
经营活动产生的现金流量净额 1,950.17 60,653.38

6.13 资产负债表
项目 附注 期末 2012年6月30日 上年末 2011年12月31日
资产:

6.14 利润表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
营业收入 9,750.70 253,267.01
其中: 支付销售机构的客户维护费 71,611.12 157,474.87

6.15 所有者权益变动表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
所有者权益 1,950.17 60,653.38

6.16 现金流量表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
经营活动产生的现金流量净额 1,950.17 60,653.38

6.17 资产负债表
项目 附注 期末 2012年6月30日 上年末 2011年12月31日
资产:

6.18 利润表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
营业收入 9,750.70 253,267.01
其中: 支付销售机构的客户维护费 71,611.12 157,474.87

6.19 所有者权益变动表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
所有者权益 1,950.17 60,653.38

6.20 现金流量表
项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年7月26日至2011年6月30日
经营活动产生的现金流量净额 1,950.17 60,653.38

7.3 期末按投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

注1: 股票期间持仓可替代估值增值 0.00。
注2: 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细, 应阅读载于基金管理人网站 www.htb.com.cn 的半年度报告正文。

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初基金资产净值2%或前20名的股票明细
7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 不考虑相关交易费用。
7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票成本, 卖出股票收入

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
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

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

Table with 5 columns: 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(%)

7.10 投资组合报告附注
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。

7.11 基金投资的前十名股票, 没有投资于超出基金合同规定备选股票之外的。
7.12 期末其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

注: 本基金基金财产中投资于目标ETF的不收取管理费, 支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理报酬按前一基金资产净值中投资于目标ETF的份额所对应的资产净值后剩余部分(若为负数, 则取0)。0.5%年费率计提, 计算方法如下: H = E × 0.50% × 当年天数。H 为每日应计提的管理报酬; E 为前一基金资产净值。基金管理人于每月末计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由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。

7.10.1 投资组合报告附注
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。

7.10.2 基金投资的前十名股票, 没有投资于超出基金合同规定备选股票之外的。
7.10.3 期末其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

注: 本基金基金财产中投资于目标ETF的不收取管理费, 支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理报酬按前一基金资产净值中投资于目标ETF的份额所对应的资产净值后剩余部分(若为负数, 则取0)。0.5%年费率计提, 计算方法如下: H = E × 0.10% × 当年天数。H 为每日应计提的管理报酬; E 为前一基金资产净值。基金管理人于每月末计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由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。

7.10.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
7.10.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

7.10.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

7.10.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
7.10.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.12 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.13 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.14 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.15 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.16 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.17 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.18 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.19 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.20 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.21 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.22 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.23 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.24 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.25 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.26 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.27 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.28 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.29 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.30 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.31 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.32 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.33 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.34 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.35 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.36 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.37 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.38 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.39 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.40 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.41 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.42 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.43 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.44 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.45 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.46 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.47 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.48 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.49 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.50 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.51 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

7.10.52 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10.53 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细