

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司 送出日期:2014年8月25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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月22日复核了本报告中的贩 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。 基金的讨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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。 本报告期自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况		
基金简称	华泰柏瑞沪深300ETF联接	
基金主代码	460300	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年5月29日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	79,079,699.88份	
基金合同存续期	不定期	

2.1.1目标基金基本情况 2012年5月4日 2012年5月28日

2.2 26 並) ロロパリケ	
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	本基金方沪深300ETF的联接基金。沪深300ETF是主要采用完全复制法支强对沪深300HT等现货数紧密限度的全被动指数基金,本基金主要通过效货于涉%200ETF实现生绩比较基础的紧密限踪。本基金主要资运作过程中、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削赎回的方式或二级有形式完变的方式投资于华季柏瑞沪深300交易型形成尤指数证券投资基金。
业绩比较基准	沪深300指数 × 95% +银行活期存款税后收益率 × 5%
风险收益特征	本基金分产深。200ETF的联接基金、采用主要投资干华基柏端沪深 300交易型开放式指数证券投资基金实现对业绩化较基准的紧密跟 跳。因此、本基金的业绩表现当产深300指数的表现密切用关。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

	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	本基金主要采取完全新制法,即完全控照标的指数的成份整组成及 其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份最及其权重的 变动进行相应调整。但在因构体情态(加流动性不足)等极无法获得 足够效量的股票时,基金管理,将宽用其他合理的投资方法构建本 基金的实现投资组合,组来学师临版宣任标指数的表现。
业绩比较基准	沪深300指数
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%。; 宋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。其风险和收益特征特度能率除的指数型基金

250	H	邓本昌年八	26 並 11 目 八
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
	姓名	陈晖	赵会军
信息披露负责人	联系电话	021-38601777	010-66105799
电子邮箱		cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	010-66105798
a (/> d 14/m)			

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

3.1 主要会计数据和财务指标

	金额单位:人民币
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-1,296,900.32
本期利润	-6,946,132.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0773
本期基金份额净值增长率	-6.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0633
期末基金资产净值	74,074,406.91
物士甘ムハ郷各体	0.03(7

3.2 基金净值表现

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	1.16%	0.73%	0.39%	0.74%	0.77%	-0.01%
过去三个月	1.85%	0.82%	0.85%	0.83%	1.00%	-0.01%
过去六个月	-6.10%	0.98%	-6.70%	0.99%	0.60%	-0.01%
过去一年	-0.19%	1.10%	-1.44%	1.11%	1.25%	-0.01%
自基金合同生 效起至今	-6.33%	1.14%	-16.22%	1.20%	9.89%	-0.06%

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基準收益率的历史走势对比图 14,12% 6.55W 2.33% 0,008 2,90% -19,308 一人以公安和北中的农产公本 注:1、图示日期为2012年5月29日至2014年6月30日

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十一部分(二)投资范围中规定的比例,即投资于沪深300ETF的比例不低于基金资产

§ 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(原友邦华泰基金管理有限公司)。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、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、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、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金 华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金和华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金。截至2014年6月30日,公司的公募基金管理规

4.1.2 基金	经埋(或基金	经理小组)及基金	总 经埋助埋简介		1
姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业	说明
AL-/LI	4/120	任职日期	离任日期	年限	00/71
张娅	本基金的基金的基金经理、指数投资都总监	2012年5月29日	-	10年	张娅女士. 美国俄亥俄州肖特州位大学金融工程硕士、
柳军	本基金的基金投资部副总监	2012年5月29日	-	13年	期军、13年证券。基金)从业经历,复旦大学财务管压力。 是经历,复旦大学财务管理商,主、2000年至2001年在公司从事件。2000年至2001年至001年至001年至001年至001年至001年至001

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《华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证

华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2014 半年度 报告摘要

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

本报告期内,公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离,实行集中交易制度,由交易部为公募基 金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务,为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、 专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况,不同业务类别的投资经理 之间互不干扰,独立做出投资决策。公司机构设置合理,公平交易的相关管理制度健全,投资决策流程完善

交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待,不存在非公平交易和利益输送的行为。 经过对 不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现,报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处 于正常的合理水平,只在少数情况下"存在显著的倾向性"。针对这些少量的"具有显著倾向性"的交易价差进行研究表明,交易价差方向没有规律性,即没有明确的利益输送方向。同时潜在利益输送金额比较小 (全部低于基金规模的0.5%),因此不构成利益输送。造成少量显著交易价差的原因来自两方面;一是报告期内股票市场的波动幅度较大,为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件;二是不同基金经理在 报告期内的投资策略存在差异,对证券买卖时点的把握也不同,导致股票买卖存在价差。

4.3.2 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。本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开

竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%。 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 一季度在经济下行较快、信用风险开始暴露的悲观预期下、A股迎来了较大幅度的调整,市场风格仍然 延续了13年的结构性行情,以沪深300指数为代表的大盘蓝筹表现相对较差。但风格偏离的程度有所弱化。随着二季度"微刺激"政策的出台,政策预期出现改善,在经济下有托底、上涨不易的背景下,A股进入相对 窄幅的箱体运行,整体波动幅度较小。期间货币政策出现了改善的迹象,"定向降准"扩围,但总体保持了 "结构性放松"的基调,全面放松的概率较小。

上半年,沪深300指数下跌7.08%,上证红利指数下跌3.63%,上证中小盘指数下跌3.55% 我们严格按照基金合同的规定,紧密跟踪业绩基准,跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告 期內,本基金的累计跟踪偏离为+0.60%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.022%,期间日跟踪误差为0.032%,较 好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现 截至本报告期末、本基金份额争值为0.9367元,还原后基金份额累计净值为0.9367元。本报告期内基金份额争值下跌6.10%,本基金的业绩比较基准下跌6.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 展望下半年,我们预计经济基本面运行仍然较为平淡,尽管"微刺激"政策发力将带动经济企稳,但同 时也看不到明显带动经济上行的动力,经济在相对狭窄的区间运行。资本市场方面,企业盈利和估值水平也 缺乏向上的市场环境,盈利向下和估值企稳可能是下半年的主基调,而下半年房地产是观察经济和政策的 校佳时间窗口,当前房地产限购等政策已有所松动,而政策松动后地产销量能否企稳将成为一个重要变量, 影响投资者情绪和对盈利和估值的预期。

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

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。截至本报告期末,本基金未进行利润分配。

§ 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,本基金托管人在对华泰柏瑞沪深300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过 程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有 人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,华泰柏瑞沪深300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——华泰柏瑞基金 音理有限公司在华泰柏瑞沪深300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计 算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在 各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,华泰柏瑞沪深300 交易型开放式指数证券 投资基金联接基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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 本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的华泰柏瑞沪深300 交易型开放式指数证券 投资基金联接基金2014年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

会计主体:华泰柏瑞沪深300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日: 2014年6月30日

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款		1,776,506.09	6,584,018.4
结算备付金		_	
存出保证金		12,338.28	27,552.6
交易性金融资产		72,409,547.86	109,264,083.13
其中:股票投资		-	
基金投资		70,408,947.86	109,264,083.13
债券投资		2,000,600.00	
资产支持证券投资		-	
贵金属投资		-	
衍生金融资产		-	
买人返售金融资产		-	
应收证券清算款		-	
应收利息		69,371.26	1,412.7
应收股利		-	
应收申购款		5,452.22	12,648.7
递延所得税资产		-	
其他资产		-	
资产总计		74,273,215.71	115,889,715.6
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债:			
短期借款		-	
交易性金融负债		-	
衍生金融负债		-	
卖出回购金融资产款		-	
应付证券清算款		-	
应付赎回款		92,862.57	2,731.6
应付管理人报酬		1,504.96	2,370.2
应付托管费		300.98	474.0
应付销售服务费		-	
应付交易费用		-	
应交税费		-	
应付利息		-	
应付利润		-	
其他负债		104,140.29	230,008.4
		-	
		198,808.80	235,584.3
负债合计		170,000.00	
负债合计		170,000.00	
负债合计 所有者权益: 实收基金		79,079,699.88	115,943,331.6
负债合计 所有者权益: 实收基金 未分配利润		·	115,943,331.6 -289,200.4
遊延所得稅负债 负债合计 所有者权益; 实收基金 未分配利润 所有者权益合计 负债和所有者权益总计		79,079,699.88	

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月 30日
一、收入		-6,827,267.37	-8,640,497.80
1.利息收入		27,607.16	28,899.07
其中:存款利息收入		14,449.90	28,899.07
债券利息收入		13,157.26	
资产支持证券利息收入		-	
买人返售金融资产收人		-	-
其他利息收入		-	
2.投资收益(损失以"-"填列)		-1,247,271.47	4,121,694.98
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-3,370,613.87	-
债券投资收益		-	
资产支持证券投资收益		-	4,121,694.98
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		2,123,342.40	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-5,649,231.85	-12,992,221.06
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		41,628.79	201,129.21
减:二、费用		118,864.80	104,439.70
1.管理人报酬		11,001.36	14,901.11
2.托管费		2,200.26	2,980.27
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,344.83	7,048.66
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		104,318.35	79,509.66
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-6,946,132.17	-8,744,937.50
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-6,946,132.17	-8,744,937.50

会计主体:华泰柏瑞沪深300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

			单位:人民币	
项目	2014	本期 1年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	
一、期初所有者权益(基金净 值)	115,943,331.65	-289,200.40	115,654,131.25	
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数(本期净利润)	-	-6,946,132.17	-6,946,132.17	
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)	-36,863,631.77	2,230,039.60	-34,633,592.17	
其中:1.基金申购款	4,040,116.97	-266,065.52	3,774,051.45	
2.基金赎回款	-40,903,748.74	2,496,105.12	-38,407,643.62	
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)	79,079,699.88	-5,005,292.97	74,074,406.91	
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	
一、期初所有者权益(基金净 值)	161,208,149.51	7,262,607.46	168,470,756.97	
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数(本期净利润)	-	-8,744,937.50	-8,744,937.50	
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)	-73,462,008.14	-3,914,015.37	-77,376,023.51	
其中:1.基金申购款	80,087,421.19	4,825,371.79	84,912,792.98	
2.基金赎回款	-153,549,429.33	-8,739,387.16	-162,288,816.49	
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)	87,746,141.37	-5,396,345.41	82,349,795.96	
但主附分为时夕但主始组出	ter /\			

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:

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人 6.4 报表附注

华泰柏瑞沪深300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 员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]392号《关于核准华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券 投资基金及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《华泰柏瑞沪深300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366,989,094.83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(2012)第171号验资报告予以验证。经向中国证监会备 案,《华秦柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于2012年5月29日正式生效,基 金合同生效日的基金份额总额为367,019,682.35份基金份额,其中认购资金利息折合30,587.52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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"目标ETF")的联接基金。目标 ETF是采用完全复制法实现对沪深300指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标ETF实 现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争使本基金日均跟院偏离度的绝对值不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞沪深300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。本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括目标ETF.沪深300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)、权证、股指期货、货币市场工具以及法律 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目标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%;股指期货以套 期保值为目的. 权证. 股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数× 95% +银行活期存款税后收益率× 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2014年8月25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"),中国证监会公告颁布的《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 证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基 金行业实务操作编制。
6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年1月1日至2014年6月30日止期间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2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。 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

6.4.5.2 会计估计变更的说明

6.4.5.3 差错更正的说明

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 [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》、财税[2012]85号《关于实施上市 公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如

(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)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票的差价收入,股权的股息、红利收入其他收入,暂不

(3)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、红利时计人个人应纳税所得 个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所 得全额计人应纳税所得额:持股期限在1个月以上至1年(含1年)的, 暂减按50%计人应纳税所得额:持股期 限超过1年的,暂减按25%计人应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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。 6.4.7.1 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

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
中国工商银行股份有限公司	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
华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金	本基金的基金管理人管理的其他基金
注,1 关联方与其全进行的关联交易均在7	党业多范围内控昭—•机商业多卦而计立的

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易 注:本报告期本基金与关联方未进行股票交易

6.4.8.1.2基金交易

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

				金额单位:人民币
关联方名称	本期 2014年1月1日至20	14年6月30日	上年度可 2013年1月1日至2	
大联刀右桥	成交金額	占当期基金 成交总额的比例	成交金額	占当期基金 成交总额的比例
华泰证券股份 有限公司	2,341,580.00	7.85%	156,631,607.12	100.00%
6.4.8.1.3 权	证交易			

注:本报告期本基金与关联方未进行权证交易。 64814 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

		单位:人民币元
项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理 费	11,001.36	14,901.11
其中:支付销售机构的客户维 护费	47,058.49	76,288.90
注, 本基金基金财产中投	资于目标ETF的部分不收取管理费	. 支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限

公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为 负数,则取0)的0.5%年费率计提,计算方法如下: $H=E\times0.50\%$ - 当年天数。 H为每日应支付的管理 人报酬;E为前一日基金资产净值 - 基金财产中目标ETF份额所对应的资产净值。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三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金

6.4.8.2.2 基金托管费

本期 1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
2,200.26	2,980.27
FETF份额所对应资产	,支付基金托管人中国工商银行的托管费 净值后剩余部分(若为负数,则取0)的0.19
K	的部分不收取托管费

金资产净值-基金财产中目标ETF份额所对应的资产净值。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三个工作日内从基金资产中一次性支取。 6.4.8.2.3 销售服务费

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 注:本基金本期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.2 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

6.4.8.5 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 1.776.506.09 14.321.9 5,068,763,63

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:于本报告期末,本基金持有32,266,600.00份目标ETF基金份额,占目标ETF基金总份额的比例为

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

7.1 期末基金资产组合情况

§ 7 投资组合报告

			金额里位:人民巾
序号	项目	金额	占基金总资产的比 例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	70,408,947.86	94.80
3	固定收益投资	2,000,600.00	2.69
	其中:债券	2,000,600.00	2.69
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	_	-
6	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	_	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,776,506.09	2.39
8	其他各项资产	87,161.76	0.12
9	合计	74,273,215.71	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 7.4.1 累计买人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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:无。 75 期末按债券品种分类的债券投资组合

7.3 %	51个1头灰分四件万大时灰分又灰	H D	
			金额单位:人民币元
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,000,600.00	2.70
2	央行票据	-	_
3	金融债券	-	_
	其中:政策性金融债	-	_
4	企业债券	-	_
5	企业短期融资券	-	_
6	中期票据	-	_
7	可转债	-	_
0	tr/sh		

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 金额单位:人民币元

1 019314 13国债14 7.7 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报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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 注:本基金本报告期末未持有权证

7.10 期末按公介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 公允价值 指数型 交易型开放式

7.11.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

7.11.2本基金投资股指期货的投资政策

7.12报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12.3本期国债期货投资评价

7.13 投资组合报告附注

报告期内本基金及目标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

本基金及目标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。 7.13.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元 12,338.28 5,452.2 87,161.76

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明约

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 7.13.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:截至本报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

81 期末基金份额持有人户数及持有人结构

68,944.81

份额单位:份

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0 该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间

§ 9 开放式基金份额变动 367,019,682.35

本报告期期末基金份额总额 79,079,699.88 § 10 重大事件揭示 10.1 基金份额持有人大会决议

2014年5月15日,公司任命高山先生为公司副总经理,高山先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试,其任命已在中国证券投资法金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案。公告,在股部内,因中国工商银行股份有限公司(以下简称"本行")工作需要,周月秋同志不再担任本行资产托管都总经理、在新任政产托管都总经理平到同志完成是投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前,由副总经理王立被同志代为行使本行资产托管都总经理部分业务授权职责。 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、基金托管业务的记 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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情 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 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

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

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

成交总等 的比例	成交金額	成交总额的比例	成交金額	成 成 交 統 を を を の の の の の の の の の の の の の	成交金額	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	券商名称
92.15	27,496,909.60	-	-	-	-	100.00%	2,059,670.69	招商证券
	_	-	-	-	-	-	-	国都证券
	-	-	-	-	-	-	-	中投证券
	-	-	-	-	-	-	-	方正证券
	-	-	-	-	-	-	-	兴业证券
	-	-	-	-	-	-	-	瑞银证券
	-	-	-	-	-	-	-	海通证券
	-	-	-	-	-	-	-	国泰君安
	-	-	-	-	-	-	-	国盛证券
	-	-	-	-	-	-	-	银河证券
	-	-	-	-	-	-	-	齐鲁证券
	-	-	-	-	-	-	-	湘财证券
	-	-	-	-	-	-	-	上海证券
	-	-	-	-	-	-	-	安信证券
	-	-	-	-	-	-	-	东兴证券
	-	-	-	-	-	-	-	东方证券
	-	-	-	-	-	-	-	中信建投
	-	-	-	-	-	-	-	广发证券
	-	-	-	-	-	-	-	山西证券
	-	-	-	-	-	-	-	申银万国
	-	-	-	-	-	-	-	华宝证券
	-	-	-	-	-	-	-	中金公司
	-	-	-	-	-	-	-	长江证券
	-	-	-	-	-	-	-	平安证券
	-	-	-	-	-	-	-	中信证券
	-	-	-	-	-	-	-	德邦证券
7.85	2,341,580.00	-	-	-	-	-	_	华泰证券

2014年8月25日

金额单位:人民币元

占当期基