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

华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年 6 月 30 日

§1 重要提示

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2011年1月1日起至2011年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞盛世中国股票
基金主代码	460001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年4月27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	12,594,407,351.06份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	主要通过股票选择,辅以适度的大类资产配置调整,追求管理资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票类资产为主要投资工具,通过精选个股获取资产的长期增值;以债券类资产作为降低组合风险的策略性投资工具,通过适当的大类资产配置来降低组合的系统性风险。
业绩比较基准	中信标普300指数×70%+中信国债指数×30%
风险收益特征	较高风险、较高收益

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

2.4信息披露方式

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

§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1日 - 2011年6月30日)
本期已实现收益	648,817,692.35
本期利润	-983,494,875.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0791
本期基金份额净值增长率	-11.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0680
期末基金资产净值	7,814,652,197.75
期末基金份额净值	0.6205

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。

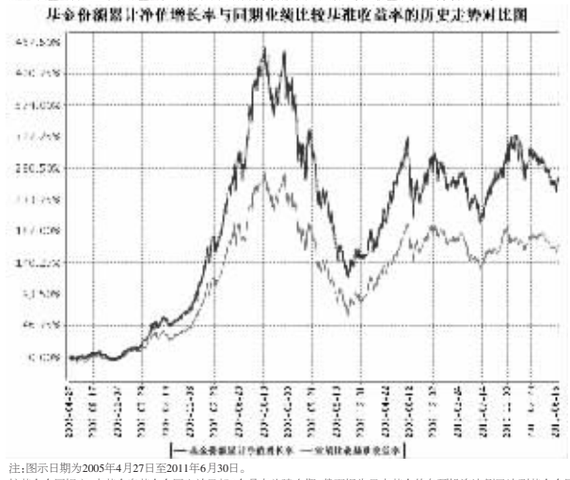
3.2 基金净值表现

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	2.06%	1.01%	0.89%	0.84%	1.17%	0.17%
过去三个月	-4.63%	0.88%	-3.80%	0.76%	-0.83%	0.12%
过去六个月	-11.47%	1.12%	-1.88%	0.86%	-9.59%	0.26%
过去一年	18.80%	1.29%	13.44%	0.97%	5.36%	0.32%
过去三年	11.72%	1.59%	14.31%	1.39%	-2.59%	0.20%
自基金合同生效日起至今	267.01%	1.61%	166.03%	1.41%	100.98%	0.20%

注:本基金的业绩基准由中信标普300指数和中信国债指数按照70%与30%之比构建,并每日进行再平衡。

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



注:图示日期为2005年4月27日至2011年6月30日。

按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为基金净资产的0%-40%。

§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		
汪晖	本基金的基金经理、投资部总监	2009年11月18日	-	17年	汪晖先生,硕士。历任华泰证券股份有限公司高级经理、华宝信托投资有限公司信托基金经理、华泰证券股份有限公司投资经理。2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。历任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金经理助理、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金经理、华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金经理。2008年7月起任华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金基金经理。2009年8月起任华泰柏瑞投资部副总监。2009年11月18日起兼任华泰柏瑞盛世基金经理。2009年12月起任华泰柏瑞投资部总监。2010年6月22日起兼任华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金基金经理。2011年2月起任华泰柏瑞投资总监。

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。任职日期和离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、法规的规定以及本基金的《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中的公平交易模块,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

2011年上半年A股市场总体震荡走低,但市场风格差异较大。以大盘蓝筹为主沪深300指数跌幅较小,下跌2.69%。以中小市值为主的中证500指数下跌7.24%。2010年表现出色的中小板和创业板大幅度调整,分别下跌14.83%和25.64%。行业表现,周期性行业建材、钢铁、家电、地产、银行和煤炭取得正收益;2010年表现较好的成长性行业如电子元器件、计算机、医药等跌幅超过10%。

本基金在上半年对市场风格变化和资产配置调整未能很好把握,组合业绩总体上落后沪深300指数。上半年,本基金净值增长率-11.47%,低于业绩基准9.59个百分点。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

至本报告期末,本基金份额净值为0.6205元,累计净值为2.6458元,本报告期内基金份额净值下跌11.47%,本基金的业绩比较基准下跌1.88%。

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,本基金认为市场将呈现低位震荡的走势。全球主要经济体为应对金融危机而实施的宽松货币政策负面效应开始显现。通货膨胀加剧、信用货币危机以及政府和居民的杠杆率上升、欧债、美债和中国地方政府融资平台问题都是上述矛盾的显性化,全球经济都需要再平衡过程。再平衡过程需要去杠杆化,必然引起经济和金融市场的震荡。我们上半年所看到的黄金持续上涨、货币市场动荡、股市和债券市场低迷都反映投资者预期的高度不确定性,这些因素在下半年仍然影响股票市场,估值提升可能性较小。

但是中国经济增长趋势不变,优秀企业在不确定经济环境将继续保持成长性,具备穿越周期的竞争力。因此本基金将在控制仓位前提下强化自下而上精选企业策略,紧紧把握政策和经济运行态势,主动把握时机精选个股,争取获得超额收益。

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,基金收益分配每年至多6次;全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的80%;基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本期末,基金可供分配利润为-856,769,760.42元,报告期内基金未实施收益分配。

§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")在华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金(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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

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	上年度末 2010年12月31日
资 产:			
银行存款		1,463,868,897.22	510,642,526.46
结算备付金		9,077,415.22	11,094,567.71
存出保证金		4,893,386.55	4,889,269.81
交易性金融资产		6,169,155,114.10	8,615,586,416.23
其中:股票投资		6,139,599,114.10	8,214,326,416.23
基金投资		-	-
债券投资		29,556,000.00	401,260,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		192,764,533.81	-
应收利息		475,832.29	13,747,223.53
应收股利		1,840,234.86	-
应收申购款		113,893.27	1,572,077.14
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		7,842,189,307.32	9,157,532,080.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010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		4,206,309.99	-
应付赎回款		3,172,803.25	3,486,618.36
应付管理人报酬		9,126,384.03	11,968,730.42
应付托管费		1,521,063.98	1,994,788.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		6,785,749.52	4,897,781.71
应交税费		35,750.00	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		2,689,048.80	2,531,666.17
负债合计		27,537,109.57	24,879,585.04
所有者权益:			
实收基金		5,269,548,361.46	5,451,607,529.00
未分配利润		2,545,103,836.29	3,681,044,966.84
所有者权益合计		7,814,652,197.75	9,132,652,495.84
负债和所有者权益总计		7,842,189,307.32	9,157,532,080.88

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值0.6205元,基金份额总额12,594,407,351.06份。

6.2 利润表

会计主体:华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

本报告期:2011年1月1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1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
一、收入		-889,234,408.59	-1,778,761,722.19
1.利息收入		8,962,687.38	13,345,749.38
其中:存款利息收入		4,081,220.03	6,580,825.69
债券利息收入		4,820,605.04	4,613,364.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		60,862.31	2,151,559.36
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		733,788,214.32	-552,814,355.56
其中:股票投资收益		701,102,122.81	-578,601,847.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-9,465,005.84	4,214,519.86
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		42,151,097.35	21,572,972.01
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-1,632,312,568.34	-1,239,543,048.18
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		327,258.05	249,932.17
减:二、费用		94,260,467.40	94,090,449.21
1.管理人报酬		60,204,897.79	61,355,825.07
2.托管费		10,034,149.62	10,225,970.85
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		23,766,888.45	22,257,915.15
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		254,531.54	250,738.14
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-983,494,875.99	-1,872,852,171.40
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-983,494,875.99	-1,872,852,171.40

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

本报告期:2011年1月1日 至 2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1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、期初所有者权益(基金净值)	5,451,607,529.00	3,681,044,966.84	9,132,652,495.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-983,494,875.99	-983,494,875.99
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)	-182,059,167.54	-152,446,254.56	-334,505,422.10
其中:1.基金申购款	358,175,748.82	172,139,804.57	530,315,553.39
2.基金赎回款	-540,234,916.36	-324,586,059.13	-864,820,975.49
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)	5,269,548,361.46	2,545,103,836.29	7,814,652,197.75
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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)	5,896,961,609.50	3,368,825,863.54	9,265,787,473.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,872,852,171.40	-1,872,852,171.40
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)	-123,527,388.31	-61,870,469.97	-185,397,858.28
其中:1.基金申购款	182,968,766.21	75,414,596.53	258,383,362.74
2.基金赎回款	-306,496,154.52	-137,285,066.50	-443,781,221.02
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)	5,773,434,221.19	1,434,103,222.17	7,207,537,443.36

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_____ _____房伟力_____ _____陈培___

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金(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[2005]第19号《关于同意友邦华泰华泰盛世中国股票型证券投资基金设立的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金合同》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900,348,752.84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(2005)第048号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金合同》于2005年4月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为900,519,775.77份基金份额,其中认购资金利息折合171,022.93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。

根据《华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金招募说明书》和《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定,本基金于2007年9月3日进行了基金份额拆分,拆分比例为2.390029438,并于2007年9月4日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为基金净资产的0%-40%。此外,本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的资产比例合计不低于基金净资产的5%。本基金的业绩比较基准为:中信标普300指数×70%+中信国债指数×30%。

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》、《关华华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》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1月1日至2011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2011年6月30日的财务状况以及2011年1月1日至2011年6月30日止期间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

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

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 关联方关系

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

未发生变化。

6.4.7.2 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
华泰联合证券有限责任公司	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司、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。

6.4.8 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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	479,153,842.20	3.15%	1,366,744,383.71	9.75%
华泰联合证券有限责任公司	513,699,314.38	3.37%	1,367,081,468.08	9.75%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰联合证券有限责任公司	-	-	11,407,362.80	23.66%

6.4.8.1.3 债券回购交易

注:无。

6.4.8.1.4 权证交易

注:无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券股份有限公司	389,313.83	3.05%	-	-
华泰联合证券有限责任公司	436,641.40	3.42%	436,641.40	6.44%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券股份有限公司	1,110,487.50	9.47%	423,417.89	5.77%
华泰联合证券有限责任公司	1,162,016.54	9.91%	743,282.35	10.13%

注:上述佣金按股票交易量的千分之一计算,以扣除证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

关联方的佣金比率和计算方式与非关联方一致。

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 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	60,204,897.79	61,355,825.07
其中:支付销售机构的客户维护费	9,537,726.64	10,270,239.24

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1.50%的年费率计提,计算方法如下:

H = E × 1.50% ÷ 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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,034,149.62	10,225,970.85

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0.25%的年费率计提,计算方法如下:

H = E × 0.25% ÷ 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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的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

注:本报告期及2010年度,基金管理人未投资本基金。

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

注:本报告期及2010年度,除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

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

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	1,463,868,897.22	3,999,033.25	1,847,466,020.70	6,522,264.96

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,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:无。

6.4.9 期末(2011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

注:无。

6.4.9.2 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	停牌原因	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
601998	中信银行	2011年6月29日	配股停牌	4.75	2011年7月7日	4.59	5,031,961	28,479,244.51	23,901,814.75	-
000917	电广传媒	2010年12月27日	重大资产重组	24.40	2011年7月6日	26.84	222,500	5,836,669.46	5,429,000.00	-

注:1、本基金截至2011年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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	6,139,599,114.10	78.29
	其中:股票	6,139,599,114.10	78.29
2	固定收益投资	29,556,000.00	0.38
	其中:债券	29,556,000.00	0.38
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,472,946,312.44	18.78
6	其他各项资产	200,087,880.78	2.55
7	合计	7,842,189,307.32	100.00

7.2 期末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	68,213,092.35	0.87
B	采掘业	467,267,706.47	5.98
C	制造业	3,216,551,784.83	41.16
C0	食品、饮料	674,195,544.04	8.63
C1	纺织、服装、皮毛	147,438,844.95	1.89
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	286,322,075.80	3.66
C5	电子	49,623,452.28	0.64
C6	金属、非金属	451,574,941.25	5.78
C7	机械、设备、仪表	890,444,567.03	11.39
C8	医药、生物制品	716,943,587.03	9.17
C99	其他制造业	8,772.45	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	135,276,203.96	1.73
F	交通运输、仓储业	85,475,692.44	1.09
G	信息技术业	381,095,544.71	4.88
H	批发和零售贸易	418,040,050.53	5.35
I	金融、保险业	751,117,453.78	9.61
J	房地产业	384,157,096.12	4.92
K	社会服务业	142,168,651.45	1.82
L	传播与文化产业	5,429,000.00	0.07
M	综合类	84,806,837.46	1.09
	合计	6,139,599,114.10	78.57

7.3 期末按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

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	002063	远光软件	12,291,229	232,672,964.97	2.98
2	000858	五 粮 液	4,520,157	161,460,008.04	2.07
3	601101	昊华能源	2,512,502	158,564,001.22	2.03
4	600276	恒瑞医药	5,067,480	151,872,375.60	1.94
5	600362	江西铜业	4,080,429	144,610,403.76	1.85
6	601166	兴业银行	9,976,467	134,482,775.16	1.72
7	000651	格力电器	5,513,515	129,567,602.50	1.66
8	600036	招商银行	9,474,768	123,361,479.36	1.58
9	000799	酒 鬼 酒	6,593,336	122,636,049.60	1.57
10	601699	潞安环能	3,610,218	118,451,252.58	1.52

注: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.huatai-pb.com)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	占期初基金资产净值比例(%)
1	601101	昊华能源	266,327,212.29	2.92
2	600015	华夏银行	262,055,638.21	2.87
3	601166	兴业银行	228,155,144.39	2.50
4	600000	浦发银行	203,401,573.95	2.23
5	601169	北京银行	203,376,702.90	2.23
6	600362	江西铜业	200,143,351.42	2.19
7	600036	招商银行	192,868,078.39	2.11
8	000001	深发展A	152,732,851.