华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

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、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。

本报告中的财务资料未经审计。

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	华泰柏瑞亚洲领导企业股票(QDII)
基金主代码	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
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	103,454,803.14份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	采取主动精选亚洲地区具有行业领导地位和国际竞争优势的企业,通过区域化分散投资,有效降低投资组合系统性风险,追求基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金投资研究团队将跟踪全球经济的发展趋势,重点研究亚洲地区内的宏观经济变量,采用自上而下的分析方法,以及定性和定量分析模型相结合的手段,确定基金资产在各国家/地区之间的配置。综合分析亚洲地区内的宏观经济指标、公司盈利发展趋势、资金流向、价格变动、社会政治风险、产业结构性风险等要素,采用专有定量模型作为参考工具,以确定各国股市的相对吸引力。通过将市场预期的净资产收益率、市净率及长期债券收益率等多种金融市场变量输入该模型,来确定各个市场的价值中枢,作为估值标准。
业绩比较基准	MSCI亚太综合指数(不含日本)
风险收益特征	本基金为区域性股票型证券投资基金,基金预期投资风险收益水平高于混合型基金和债券型基金。由于投资国家与地区市场的分散,长期而言风险应低于投资单一市场的股票型基金。

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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (HongKong) Limited
	中文	中国银行(香港)有限公司
注册地址		香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港花园道1号中银大厦

注:本基金不聘请境外投资顾问,华泰柏瑞基金管理有限公司对全部资产进行自行管理。

§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日至2011年6月30日)
本期已实现收益	-3,063,266.31
本期利润	-5,892,842.04
加权平均基金份额本期利润	-0.0520
本期基金份额净值增长率	-5.17%
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	-0.0465
期末基金资产净值	98,642,433.80
期末基金份额净值	0.953

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。

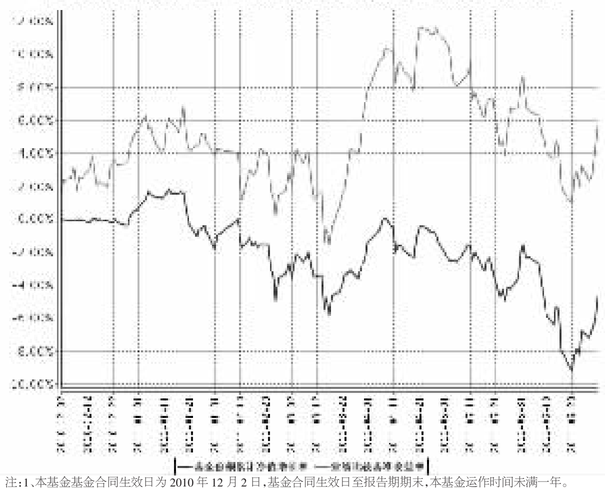
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-2.85%	1.02%	-2.34%	1.06%	-0.51%	-0.04%
过去三个月	-2.26%	0.83%	-0.98%	1.03%	-1.28%	-0.20%
过去六个月	-5.17%	0.77%	0.50%	1.01%	-5.67%	-0.24%
自基金合同生效起至今	-4.70%	0.71%	5.77%	0.97%	-10.47%	-0.26%

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2010年12月2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十四条(三)投资范围中基金投资组合比例限制中规定的各项比例,股票占基金资产的比例不低于60%;债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例不高于40%,其中,现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金不低于80%的权益类资产将投资于亚洲领导企业。

§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		
李文杰	本基金的基金经理、海外投资部总监	2010年12月2日	-	12	李文杰先生,香港中文大学工商管理学士,特许金融分析师(CFA)。1998年-1999年,任香港大福证券有限公司客户经理;1999年-2004年于香港AIGGIC,历任交易员、资深投资分析员等职位;2004年加入本公司,2004年-2007年,任华泰柏瑞(原友邦华泰)盛世中国股票基金基金经理。2007年-2009年任阿拉伯联合酋长国阿布扎比投资局组合经理。2009年9月再次加入本公司,任海外投资部总监。2010年12月起任华泰柏瑞亚洲领导企业股票基金基金经理。
黄明仁	本基金的基金经理、海外投资部副总监	2010年12月2日	-	12	黄明仁先生,美国西雅图华盛顿大学财务金融专业管理学硕士,具有11年以上境外证券投资管理经验。2004-2006年,任台湾建弘投资信托股份有限公司,建弘泛太平洋基金基金经理;2006-2008年中,加入英国保诚投资信托股份有限公司,任保诚印度基金基金经理。2008年加入本公司,现任海外投资部副总监。2010年12月起任华泰柏瑞亚洲领导企业股票基金基金经理。

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。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注:本基金不聘请境外投资顾问,华泰柏瑞基金管理有限公司对全部资产进行自行管理。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

亚洲市场回顾

亚洲市场在2011年上半年还是在缺乏方向的波动中度过。MSCI亚太指数(MXAPJ)上半年收在481水平,比起1季度结束时候微涨0.50%。

从4月开始,市场开始进入一波反弹,本来投资人还在怀疑日本地震将会带来一系列的经济后遗症,所以随后的反弹还是令人有点措手不及;MXAPJ四月底最高到过512水平,比3月份的地点高14%,但随后回落。有很多分析指,日本的地震将带来电子行业零部件的供应短缺,从而令到其他电子产品的下游企业的生产受到影响,但到2季度末,实际结果显示影响可能要大大的小于预期,只是一些汽车企业短期需要减产和某些关键电子零件短期缺货而已,整体经济还算正常运作。

令到亚洲股市随后下跌的因素并不新鲜,还是回到欧洲的债务危机。去年时候,市场也是因为希腊的债务危机有一波下跌;投资人还是担心希腊政府债务会有违约风险,如果出现违约的话,将带来骨牌效应,再来一次类似雷曼兄弟事件。也有人比喻,希腊其实就像欧洲的雷曼,如果倒下的话,后果将不可估计,因为欧洲银行大多互相持有其他欧洲国家的债务。在6月底时候,希腊政府债务危机出现了一些曙光,希腊国会否决了政府的不信任动议,后来财政预算方案也顺利通过,希腊政府将在财政上进行一系列改革,以达到欧元区的政府负债目标而符合欧盟的支持条件,最终避免违约的短期风险。其实,欧盟区的成员国也表态会继续支持希腊的财政,所以希腊的事情好像短期又告一段落。虽然长期而言,希腊或欧洲的债务风险还是没有解除,但这事情看来也能继续的拖下去。市场觉得短期风险得到释放,风险偏好又开始提升,亚洲股市又在美国股市上扬的带动下反弹。

在2011上半年,市场另外一个担忧的因素就是美国量化宽松的结束。贝南克表示所谓的QE2(量化宽松2期)将如期在6月底结束,市场由是担心宽松的流动性将无以为继,所以叠加希腊的因素造成2季度市场的偏弱走势。美国随后公布的经济数据并不特别强劲,虽然市场预计美联储不会推出QE3,但分析还是认为美联储将维持低利率一段时间,而QE到期的金额还是会继续投资在国债上,美联储将继续压低市场利率,以刺激经济。

2011年上半年,表现最差的市场还是印度,跌幅在7.6%左右,印度市场还是受到本国经济的通胀高企困扰,看来短期还是会继续受压。香港市场也是另外一个表现不好的市场,印尼市场的表现却一枝独秀,回报率在5%左右。

香港市场

香港市场在2011年上半年的表现还是落后其他亚洲区域。市场的焦点还是在中国的通胀,因为通胀这头洪水猛兽一天不受控,中国政府的调控措施就不能放松。中国5月份公布的CPI是5.5%水平,和市场预计不相上下,值得注意的是CPI环比的数据已经开始放缓,5月份环比上升0.1%,而4月份和3月份分别是0.1%和-0.2%。所以,大部分市场分析还是觉得中国CPI将可能在6、7月份见顶,然后缓慢回落。温总理在6月底在金融时报和英国发表了对物价的看法,市场解读总理认为政府将对全年的物价将有效控制,也是为经济下一步放松造成一定的条件,借此消息香港市场随后开始见底回升。

虽然物价可能已经受到控制,但去年以来的流动性收紧的结果已经开始显现。从媒体不断听到的消息是中小企业的资金已经出现很大的困难,而民间融资利率也已经达到非常高的水平,有些中小企业已经出现倒闭潮。其实不说企业,连银行的资金面也是出现了非常紧张的状况;由于人民银行不断提高准备金率,很多银行的头寸已经出现了非常紧张的情况,而要符合监管部门的风险指标,银行也不得已要把资产从表内(资产负债表)往表外挪移,就是所谓发行信托产品,这类信托产品是类似于定期存款,但有可能会有偿付风险,由于没有价格波动,投资人一般就把它理解为无风险产品。银行信托产品和房地产信托无疑是市场流动性的救命稻草,但可以想象的是实体经济的融资成本处于上升状态,随后企业的业绩可能会出现下滑,股市之前已经提前反映,但不排除市场还会有一波盈利预测向下修正的过程。

另外,融资平台贷款还是继续困扰银行股的表现,6月底,审计署公布了融资平台贷款的规模达到10.7万亿,这数据和之前银监会公布的2010年末9万亿相差不远。虽然,该规模和市场预测差不多,但随后云南高速公路建设融资平台出现的"违约"风波可以说是敲响了市场的第一个警钟。关于银行的坏账担忧应继续是银行股的梦魇,短期将制约银行股的表现。

港股方面2季度表现最差的行业要数是工业。和投资相关的工程机械、建筑等表现都不好,主要是担忧宏观调控的影响,而工程机械和重卡等投资敏感度高的行业,销售增速无不从4月份开始下滑。另外金融行业由于以上所述原因,表现也是落后大市,市场避险气氛浓厚,只有必须消费品的表现相对不错。

我们判断3季度开始,市场表现将有所改善,中国宏观经济表现可能体现通胀受控,实体经济放慢的情况将更加显现;政府如果过分收紧的话将可能带来硬着陆的风险,政策制定者是不可能没有意识到这个危险,所以,个人判断最快4季度就可能有些放松的迹象,但企业的负面消息将开始越来越多,不排除近3季度末还会有一轮波动,但我们认为由于估值水平还是处于比较低的水平,假如有大幅度的调整,将是买入的机会。越靠近2012年,情况将是越来越明朗。我们将继续看好医疗行业、产业升级换代、媒体和可选消费等行业内的公司。

中国台湾市场

在国际股市乐观行情的气氛带领下,中国台湾股市年初持续走强,指数在今年2月初冲高至9207点一年的新高,但3月中的日本地震打乱了电子产业供应链,部分零部件短缺造成四月营业收入短少,投资人陷入观望;台湾加权指数此时跌破年线8200点位,不过日本地震后受到美国股市反弹激励,台股也呈现反弹,加权指数曾经站上9000点大关;但随着国际股市开始担心希腊债务危机将扩散至欧美等银行业,投资人悲观气氛浓厚,美国标普500指数连续六周周线下跌,也拖累了台湾的科技类股,使得台湾加权指数6月下旬跌破年线,最低来到8433点。不过6月底正式开放大陆游客个人游的利好消息激励,旅游相关之酒店、百货、零售、金融等类股表现强势,推升股市重新站上年线位置。

韩国市场

韩国KOSPI指数在上半年的走势同样呈现大幅震荡,3月中受到日本地震影响,KOSPI指数最低曾经来到1882点位,随后在美股冲高带动下,KOSPI曾来到2231的高点,随后在外资的卖超以及担心欧元区债务扩大的阴影下,KOSPI冲高回落,于六月中时跌至年线附近2019点位置,造船类股受到拖累最大,因担心欧洲区造船订单急速回落;Hynix芯片公司大股东售股以及韩国银行业合并案的不确定性,造成指数持续回落;不过在汽车类股的带动下,KOSPI指数迅速反弹收复月线,指数重新站上2100点关卡。整个上半年KOSPI指数小涨2.38%;

东南亚市场

虽然受到外围不利因素如美国经济数据欠佳,希腊债务危机升温等影响,东南亚5个主要股市2011年上半年表现还是涨多跌少结束交易。5个股市指数平均上涨1.8%,以印尼和马来西亚涨幅最大,分别上扬5%和4%。菲律宾和泰国分别小涨2.1%和0.8%而新加坡则下跌2.9%。

菲律宾方面,虽然第1季财报逊于预期,但在国际评级机构上调菲律宾主权信用评级及该国政府宣布大型基建计划和成功缩减财政赤字营造了良好投资气氛从而带动投资者的情绪。 印尼由于CPI持续下降,印尼央行加息压力随着通胀减缓而有所放缓。印尼央行目前维持基准利率在6.75%水平。在GDP持续强劲成长,主权信用评级有望在今年内调升下,印尼股市第2季亮丽表现应该不是偶然的,外资目前还是继续看好印尼市场。

由于受到通胀压力,马来西亚央行上调基准利率0.25%至3%,规定储备比率从1%提高至3%。但股市没受此负面影响,主要原因是大马股市相对防御性较高,投资者往往在国际股市动荡时把资金投入这个"避风港"。新加坡在五月初举行全国大选。由资政李光耀儿子李显龙总理领导的民主行动党赢得81个国会议席而继续执政。然而,该党的受欢迎程度却创下历史新低(60.1%),主要原因是新加坡人民对房价和物价上涨不满。在缺乏催化剂和投资主题下,新加坡股市2011年上半年下跌2.9%。

泰国上市企业公布了的第一季财报基本符合市场预期或略超预期。泰国和柬埔寨两国在边界发生冲突但事件未对市场造成影响。泰国总理阿披实于5月9日宣布解散国会并于7月3日举行全国大选。虽然政治风险有所提高,投资者对泰国乐观经济还是充满信心。 该股市微涨0.8%。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.953元,本报告期份额净值增长率为-5.17%,同期业绩比较基准增长率为0.50%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年亚洲股市,反弹行情应该可以期待,惟欧洲债务违约的压力仍将使的股市短期呈现震荡的格局。香港市场方面短期可能继续受中国通胀高企和宏观调控影响难以有突出表现,加上外围欧债因素也可能对中国经济和股市造成影响,但宏观调控政策在4季度可能会有所放松,下半年可能出现前低后高的行情。韩国方面近期外资在韩国持续卖出股票,预期指数将呈现大幅震荡,对韩国持仓将紧密关注,我们将并适度增加现金水平。台湾方面展望第三季,在两岸开放旅游等利好消息的帮助下,台湾的内需板块可能会有表现,与美国苹果公司产品iPhone及iPad相关的台湾供应链企业,预期仍将持续受惠,智能手机相关的类股也将受到关注,不过在欧元区主权债务问题仍未解决的疑虑下,将适当控制基金持仓水平。新兴市场包括东南亚经济前景继续看好及估值还是处于较合理水平,相信东南亚市场反弹行情是可期待的。

4.7 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。

4.8 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4次;每次基金收益分配比例不低于该次可分配收益的10%;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-4,812,369.34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")在华泰柏瑞亚洲领导企业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 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:华泰柏瑞亚洲领导企业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		13,285,703.72	100,840,507.27
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		88,509,747.77	43,073,828.70
其中:股票投资		88,509,747.77	43,073,828.70
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收利息		761.09	41,814.17
应收股利		223,939.75	-
应收申购款		98.74	116,574.47
递延所得税资产		-	-
其他资产		1,632,601.36	-
资产总计		103,652,852.43	144,072,724.61
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		2,386,212.56	-
应付赎回款		639,071.31	3,193,345.72
应付管理人报酬		145,953.75	344,154.05
应付托管费		28,379.89	66,918.82
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		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,810,801.12	35,970.39
负债合计		5,010,418.63	3,640,388.98
所有者权益:			
实收基金		103,454,803.14	139,682,454.14
未分配利润		-4,812,369.34	749,881.49
所有者权益合计		98,642,433.80	140,432,335.63
负债和所有者权益总计		103,652,852.43	144,072,724.61

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值0.953元,基金份额总额103,454,803.14份。

6.2 利润表

会计主体:华泰柏瑞亚洲领导企业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
一、收入		-3,680,003.73
1.利息收入		73,650.59
其中:存款利息收入		73,650.59
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-74,466.40
其中:股票投资收益		-697,946.42
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益		
股利收益		623,480.02
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-2,829,575.73
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-895,266.26
5.其他收入(损失以"-"号填列)		45,654.07
减:二、费用		2,212,838.31
1.管理人报酬		992,652.12
2.托管费		193,015.70
3.销售服务费		-
4.交易费用		867,161.45
5.利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用		160,009.04
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-5,892,842.04
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-5,892,842.04

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰柏瑞亚洲领导企业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)	139,682,454.14	749,881.49	140,432,335.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-5,892,842.04	-5,892,842.04
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)	-36,227,651.00	330,591.21	-35,897,059.79
其中:1.基金申购款	631,063.20	-5,626.39	625,436.81
2.基金赎回款	-36,858,714.20	336,217.60	-36,522,496.60
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)	103,454,803.14	-4,812,369.34	98,642,433.80

注:报表附注为财务报表的组成部分。

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

华泰柏瑞亚洲领导企业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[2010]第1357号《关于核准华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金募集的批复》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《华泰柏瑞亚洲领导企业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290,510,740.98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(2010)第373号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金基金合同》于2010年12月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为290,565,328.80份基金份额,其中认购资金利息折合54,587.82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《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞亚洲领导企业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:权益类品种,包括普通股、优先股、全球及美国存托凭证、股票型基金等;固定收益类品种,包括政府债券、公司债券、可转换债券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的固定收益类证券;银行存款、回购协议、短期政府债券与货币市场基金等货币市场工具;经中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品;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。本基金投资的股票占基金资产的比例不低于60%;债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例不高于40%,其中,现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金不低于80%的权益类资产将投资于亚洲领导企业。亚洲领导企业是指在亚洲地区证券市场进行交易或至少50%的主营业务收入来自于亚洲地区而在亚洲以外交易所上市的企业,同时具有较高的市场占有率和盈利能力、卓越的研发和生产能力、先进的市场营销手段和网络、核心的品牌优势和资源储备、科学的公司治理、创新的商业模式、良好的企业管理团队等要素的,能够为股东带来超额收益的上市公司。本基金的业绩比较基准为:MSCI亚太综合指数(不含日本)。

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》、《华泰柏瑞亚洲领导企业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

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。本基金目前暂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卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

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;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,应当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。

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,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:

(1)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。

(2)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。

(3)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

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外,一般采用历史成本计量。

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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作,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)目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂免征营业税和企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

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

注:无。

6.4.8.1.2 权证交易

注:无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注:无。

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
当期发生的基金应支付的管理费	992,652.12
其中:支付销售机构的客户维护费	389,735.11

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1.80%的年费率计提,计算方法如下:

$H = E \times 1.80\% \div$ 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

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人次月首日起5个工作日内将上月基金管理费的计算结果通知基金托管人并发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财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
当期发生的基金应支付的托管费	193,015.70

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0.35%的年费率计提,计算方法如下:

$H = E \times 0.35\% \div$ 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,按月支付。由基金管理人应于次月首日起5个工作日内将上月基金托管费的计算结果书面通知基金托管人并发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

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

份额单位:份

项目	本期 2011年01月01日至2011年6月30日
基金合同生效日持有的基金份额	-
期初持有的基金份额	5,001,200.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减:期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	5,001,200.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.83%

注:基金管理人投资本基金的费用均参照本基金公布的费率收取。

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:本报告期间,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	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	3,640,756.84	73,650.53

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。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注:无。

6.4.12 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末未持有流通受限的证券。

§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	88,509,747.77	85.39
	其中:普通股	82,310,449.07	79.41
	存托凭证	6,199,298.70	5.98
2	基金投资	-	-
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	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,285,703.72	12.82
8	其他各项资产	1,857,400.94	1.79
9	合计	103,652,852.43	100.00

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	33,560,876.69	34.02
中国台湾	13,137,750.14	13.32
韩国	10,781,776.36	10.93
印度尼西亚	7,938,785.63	8.05
美国	6,199,298.70	6.28
马来西亚	5,940,903.88	6.02
泰国	5,144,843.55	5.22
澳大利亚	3,833,180.27	3.89
菲律宾	1,972,332.55	2.00
合计	88,509,747.77	89.73

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
10 能源	5,110,891.51	5.18
15 原材料	12,213,853.68	12.38
20 工业	7,564,846.91	7.67
25 非日常生活消费品	21,486,302.48	21.78
30 日常消费品	4,377,958.45	4.44
35 医疗保健	5,204,962.09	5.28
40 金融	14,814,521.28	15.02
45 信息技术	14,508,016.47	14.71
50 电信业务	3,228,394.90	3.27
合计	88,509,747.77	89.73

注:本公司采用的行业分类标准为全球行业分类标准GICS。

7.4 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益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	TAIWAN SEMI-CONDUCTOR MANUFAC	台积电	2330 TT	台湾亚交易所	台湾	240,000	3,905,944.33	3.96
2	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国农业银行	1288 HK	香港交易所	中国	1,065,000	3,622,411.98	3.67
3	MINDRAY MEDICAL INTL LTD-ADR	迈瑞公司	MR US	美国交易所	美国	18,995	3,448,131.58	3.50
4	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	泰国石油	PTTEP/F TB	泰国交易所	泰国	87,000	3,132,500.79	3.18
5	PHOENIX SATELLITE TELEVISION	凤凰卫视	2008 HK	香港交易所	中国	1,138,000	2,905,397.53	2.95
6	LARGAN PRECISION CO LTD	大立光电	3008 TT	台湾亚交易所	台湾	14,000	2,903,310.42	2.94
7	TPK HOLDING CO LTD	宸鸿科技	3673 TT	台湾亚交易所	台湾	14,000	2,761,300.67	2.80
8	ICICI BANK LTD-SPON ADR	印度工业信贷投资银行	IBN US	美国交易所	美国	8,623	2,751,167.12	2.79
9	TA ANN HOLDINGS BERHAD	TA ANN集团	TAH MK	马来西亚交易所	马来西亚	229,440	2,712,508.98	2.75
10	GUDANG GARAM TBK PT	盐仓集团	GGRM IJ	印尼交易所	印尼	69,500	2,611,348.08	2.65

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	LARGAN PRECISION CO LTD	3008 TT	5,051,770.22	3.60
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURE	2330 TT	4,993,162.97	3.56
3	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	1068 HK	4,701,685.28	3.35
4	MTR Corp. Ltd.	66 HK	4,224,403.24	3.01
5	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 HK	4,202,315.38	2.99
6	PHOENIX SATELLITE TELEVISION	2008 HK	4,144,174.68	2.95
7	TPK HOLDING CO LTD	3673 TT	4,083,044.31	2.91
8	CHINA SHINEWAY PHARMACEUTICA	2877 HK	4,039,378.66	2.88
9	AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1288 HK	4,000,901.18	2.85
10	TIANJIN PORT DVLP HLDS LTD	3382 HK	3,971,460.08	2.83
11	INDOFOOD AGRI RESOURCES LTD	IFAR SP	3,936,007.74	2.80
12	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1055 HK	3,406,269.14	2.43
13	PTT EXPLOR & PROD PUBLIC CO	PTTEP/F TB	3,256,600.14	2.32
14	AIRASIA BHD	AIRA MK	3,152,118.79	2.24
15	HANG LUNG PROPERTIES LTD	101 HK	3,092,021.98	2.20
16	I.T LTD	999 HK	2,711,541.71	1.93
17	CHINA HIGH PRECISION AUTOMAT	591 HK	2,707,801.41	1.93
18	INTIME DEPARTMENT STORE	1833 HK	2,706,351.83	1.93
19	BANK OF AYUDHYA PCL	BAY-R TB	2,689,983.56	1.92
20	TA ANN HOLDINGS BERHAD	TAH MK	2,663,956.92	1.90

注:不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	CHINA HIGH PRECISION AUTOMAT	591 HK	5,857,263.11	4.17
2	FIRST PACIFIC CO	142 HK	5,856,211.08	4.17
3	KNM GROUP BHD	KNMG MK	5,499,424.45	3.92
4	CHINA SHINEWAY PHARMACEUTICA	2877 HK	5,217,084.93	3.72
5	INDOFOOD AGRI RESOURCES LTD	IFAR SP	4,298,144.15	3.06
6	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 HK	4,085,121.84	2.91
7	MTR CORP	66 HK	4,015,578.55	2.86
8	AIRASIA BHD	AIRA MK	3,233,632.21	2.30
9	TAIWAN FAMILYMART CO LTD	5903 TT	3,177,615.96	2.26
10	HOLLYSYS AUTOMATION TECHNOLO	HOLI US	3,036,304.74	2.16
11	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	1068 HK	3,027,811.41	2.16
12	HANG LUNG PROPERTIES LTD	101 HK	3,009,160.28	2.14
13	ADHI KARYA TBK PT	ADHI IJ	2,714,982.17	1.93
14	BANK OF AYUDHYA PCL	BAY-R TB	2,665,663.31	1.90
15	MINDRAY MEDICAL INTL LTD-ADR	MR US	2,621,539.30	1.87
16	YANZHOU COAL MINING CO-H	1171 HK	2,568,288.60	1.83
17	LARGAN PRECISION CO LTD	3008 TT	2,548,124.77	1.81
18	PHOENIX SATELLITE TELEVISION	2008 HK	2,546,024.18	1.81
19	HTC CORP	2498 TT	2,432,991.86	1.73
20	BOUSTEAD HOLDINGS BHD	BOUS MK	2,386,169.93	1.70

注:不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	167,976,054.57
卖出收入(成交)总额	119,012,613.35

注:不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注:本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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情况,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2 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情况。

7.11.3 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	-
3	应收股利	223,939.75
4	应收利息	761.09
5	应收申购款	98.74
6	其他应收款	1,632,601.36
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,857,400.94

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
1717	60,253.23	7,586,275.90	7.33%	95,868,527.24	92.67%

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	1,205,344.04	1.1651%

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2010年12月2日)基金份额总额	290,565,328.80
本报告期期初基金份额总额	139,682,454.14
本报告期基金总申购份额	631,063.20
减:本报告期基金总赎回份额	36,858,714.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	103,454,803.14

§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

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	
Morgan Stanley	-	33,331,057.57	11.61%	70,566.38	11.33%	-
Samsung	-	31,242,585.41	10.89%	50,315.18	8.08%	-
KGI ASIA	-	25,902,364.08	9.03%	60,905.13	9.78%	-
CITI	-	25,748,954.86	8.97%	65,548.67	10.53%	-
Macquarie	-	22,673,220.63	7.90%	64,606.82	10.38%	-
CLSA	-	20,840,355.38	7.26%	47,559.50	7.64%	-
NOMURA	-	19,933,652.72	6.95%	52,213.60	8.39%	-
HSBC	-	18,609,060.25	6.48%	26,517.52	4.26%	-
DAIWA	-	13,065,755.15	4.55%	13,065.72	2.10%	-
KIM ENG	-	8,969,396.17	3.13%	22,187.88	3.56%	-
TC	-	8,834,349.04	3.08%	22,085.86	3.55%	-
HDBS	-	8,286,055.05	2.89%	22,023.02	3.54%	-
CIMB	-	7,848,210.19	2.73%	19,522.47	3.14%	-
DSHN	-	7,690,179.78	2.68%	7,689.76	1.24%	-
DANA	-	7,485,493.70	2.61%	22,456.49	3.61%	-
CICC	-	7,074,812.88	2.47%	14,149.64	2.27%	-
SINOPAC	-	5,234,337.86	1.82%	7,327.45	1.18%	-
OSK	-	4,997,366.98	1.74%	11,920.40	1.91%	-
CREDIT SUISSE	-	4,148,870.19	1.45%	14,521.08	2.33%	-
CAPITAL	-	2,749,346.64	0.96%	3,918.03	0.63%	-
德意志银行	-	2,320,196.30	0.81%	3,480.29	0.56%	-

注:1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下:

(1)选择标准:资力雄厚,信誉良好,注册资本不少于5亿元人民币;财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;经营行为规范,最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚;内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务;研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告;适当的地域分散化。

(2)选择程序:(a)服务评价;(b)拟定备选交易单元;(c)签约。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2011年8月24日