基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2012 年 8 月 28 日

上证红利交易型开放式指数证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012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、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2012 年 8 月 27 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 2012 年 1 月 1 日起至 2012 年 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞上证红利 ETF
基金主代码	510880
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006年 11 月 17 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	877,175,703.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2007-01-18

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,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复制法,即完全按照标的指数的成份股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股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	上证红利指数
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证红利指数,是股票基金中风险较低、收益中等的产品。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	张燕
	联系电话	021-38601777	0755-83199084
	电子邮箱	es4008880001@huatai-pb.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95555
传真		021-38601799	0755-83195201

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(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-56,951,787.44
本期利润	59,906,545.07
加权平均基金份额本期利润	0.0644
本期基金份额净值增长率	2.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.2944
期末基金资产净值	1,596,866,517.64
期末基金份额净值	1.820

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。

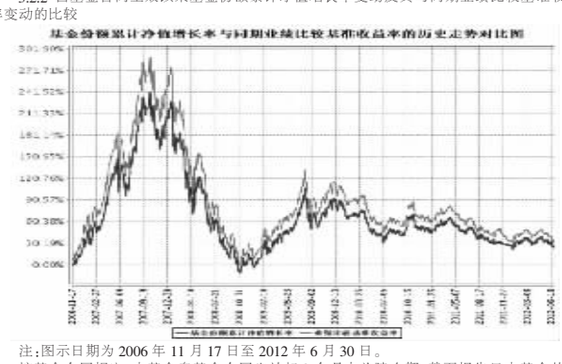
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-5.70%	1.04%	-7.05%	1.05%	1.35%	-0.01%
过去三个月	-1.73%	1.01%	-3.57%	1.02%	1.84%	-0.01%
过去六个月	2.13%	1.14%	0.49%	1.16%	1.64%	-0.02%
过去一年	-15.60%	1.17%	-17.32%	1.18%	1.72%	-0.01%
过去三年	-19.42%	1.50%	-23.87%	1.51%	4.45%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	26.43%	2.18%	34.05%	2.20%	-7.62%	-0.02%

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 2006 年 11 月 17 日至 2012 年 6 月 30 日。

按基金合同规定,本基金自基金合同生效起 3 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十六条(二)投资范围及投资比例中规定的比例,即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%。

§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、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。截至 2012 年 6 月 30 日,公司基金管理规模为 367.75 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		
张娅	本基金的基金经理、指数投资部总监	2006年 11 月 17 日	-	8年	张娅女士,美国俄亥俄州肯特州立大学金融工程硕士、MBA,具有多年海内外金融从业经验。曾在芝加哥期货交易所、Danzas-AEI 公司、SunGard Energy 和联合证券工作,2004 年初加入本公司,从事投资研究和金融工程工作,2006 年 11 月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数基金基金经理,2010 年 10 月 1 日起任华泰柏瑞指数投资部总监,2011 年 1 月起担任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 及华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起担任华泰柏瑞沪深 300ETF 及华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金基金经理。
柳军	本基金的基金经理、指数投资部副总监	2009年 6 月 4 日	-	11年	柳军,10 年证券(基金)从业经历,复旦大学财务管理硕士,2000 年至 2001 年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作,2001 年至 2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员,2004 年 7 月起加入本公司,历任基金事务部总监、基金经理助理,2009 年 6 月起任华泰柏瑞(原友邦华泰)上证红利交易型开放式指数基金基金经理,2010 年 10 月 1 日起任华泰柏瑞指数投资部副总监,2011 年 1 月起担任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 及华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理,2012 年 5 月起担任华泰柏瑞沪深 300ETF 及华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金基金经理。

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《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 公司整体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。其次交易部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 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

2012 年上半年 A 股市场可以用"预期很美好、现实很残酷"来形容。在去年年底降准兑现后,在流动性预期改善的背景下,引发了 1-2 月份的上升行情,市场对政策触底的判断形成共识,而伴随 3 月份较差经济数据公布市场出现了短暂的回调,而与此同时预调微调政策预期再次强烈,随后出台了节能产品补贴政策以及发改委加快下项目审批步伐,市场获得了短暂的刺激,4 月份走出了单边上涨的走势,而随后两个月公布的信贷数据低于预期,预调微调政策在实体经济层面并没有得到有效印证,政策调整短期尚无法看到成效,经济仍处于下滑态势之中,谨慎情绪主导了 5、6 月份的走势,加上临近年中,资金面整体趋紧和海外市场的不确定性降低了投资者对风险资产的偏好,市场表现较为疲弱。上半年,上证红利指数上涨 0.49%,上证中小盘指数上涨 4.48%,沪深 300 指数上涨 4.94%。

总结上半年的行情,其实就是政策预期和基本面不断博弈的过程,当基本面越差,政策放松的预期越强烈,在预期推动下市场出现小幅反弹,但由于政策放松不可能出现 V 型反转,市场上涨的表现也较为谨慎,此外同步经济数据显示基本面没有明显好转之时,预期改善主导的行情在没有基本面配合的情况下,也难以走出趋势性的行情,投资者大多以交易型的心态参与反弹,市场总体表现为窄幅震荡的走势。

我们严格按照基金合同的规定,紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内,本基金的累计跟踪偏离为+1.65%,日均跟踪偏离度的绝对值为 0.035%,期间日跟踪误差为 0.066%,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,本基金份额净值为 1.820 元,还原后基金份额累计净值为 1.273 元,本报告期内基金份额净值上涨 2.13%,本基金的业绩比较基准上涨 0.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

央行在 6 月和 7 月连续两个月下调存贷款利率,仍然没有改变市场的运行轨迹,在利率市场化改革的背景下,法定存款利率的下调已不同于过往对股票市场的估值提升效果显著。利率市场化程度更高的银行理财产品在两次法定存贷款利率下调后,理财产品的利率呈现缓慢下降的走势且利率水平大幅高于法定存款利率和 CPI 水平,存款正利率仍然十分显著,法定存款利率的下调短期还难以引发居民对资产配置的调整。

此外,从资本市场本身而言,经过 6、7 月份的大幅下跌之后,A 股市场市盈率并没有出现明显的下降,随着 2012 年中报的陆续披露,估值水平逐渐切换到 12 年,如果将已披露中报的上市公司数据纳入统计,A 股市场静态市盈率的估值水平相对而言显得并不那么具有吸引力。

如果站在大的宏观政策角度而言,"稳增长"是今年工作的总基调,即意味着政策层面上今年不会有太大的变化,信贷投放也不会有显著的超预期可能,上半年市场在政策预期以及基本面博弈中出现上下波动,而随着政策预期以及预调微调政策效果不明显,在政策"不折腾"的大环境下,市场上半年运行逻辑如果在未来被证伪之后,难免会出现做空的动力。而在中国经济转型的大方向上,"去杠杆、去投资、去出口"是未来中国经济必须面对和解决的问题,经济运行的弹性也将逐渐降低,A 股市场的波动性也随之逐渐下降,经济企稳后回升的力度可能较弱,时间跨度将更长。因此,经济数据的短期企稳信号难以促发行情的大幅反弹,金融创新的推进也使得股票市场的多空力量越发均衡,市场较大回升的力量仍然来自于对经济触底回升和企业盈利上升的不断确认,而这个过程可能并不会那么顺利,当前采取"右侧"市场策略或许比"左侧"更加安全。

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标的指数基本一致的投资回报。

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,基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上,方可进行收益分配。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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:上证红利交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2012 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年 6 月 30 日	上年度末 2011年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款		4,758,241.98	27,632,422.66
结算备付金		70,748.56	8,043.49
存出保证金		-	-
交易性金融资产		1,581,385,734.00	1,804,165,737.10
其中:股票投资		1,578,893,240.10	1,801,822,593.70
基金投资		-	-
债券投资		2,492,493.90	2,343,143.40
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		10,916.60	8,953.85
应收股利		12,133,918.62	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,598,359,559.76	1,831,815,157.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年 6 月 30 日	上年度末 2011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		20,329.52	5,035,355.16
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		669,720.38	782,202.03
应付托管费		133,944.07	156,440.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		27,319.85	637,384.84
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		641,728.30	621,000.00
负债合计		1,493,042.12	7,232,382.42
所有者权益:			
实收基金		1,338,629,118.93	1,562,961,005.69
未分配利润		258,237,398.71	261,621,768.99
所有者权益合计		1,596,866,517.64	1,824,582,774.68
负债和所有者权益总计		1,598,359,559.76	1,831,815,157.10

注:报告截止日 2012 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.820 元,基金份额总额 877,175,703.00 份。

6.2 利润表

会计主体:上证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		66,011,444.25	47,499,708.52
1.利息收入		57,350.75	36,338.46
其中:存款利息收入		52,286.72	36,338.46
债券利息收入		5,064.03	-
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)		-50,854,498.01	8,545,876.02
其中:股票投资收益		-84,125,057.48	-33,792,997.42
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		33,270,559.47	42,338,873.44
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		116,858,332.51	38,960,318.20
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-49,741.00	-42,824.16
减:二、费用		6,104,899.18	7,708,184.58
1.管理人报酬		4,424,651.26	5,910,982.97
2.托管费		884,930.25	1,182,196.62
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		545,426.93	365,890.59
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		249,890.74	249,114.40
三、利润总额 (亏损总额以"-"号填列)		59,906,545.07	39,791,523.94
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		59,906,545.07	39,791,523.94

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2012年 1 月 1 日至 2012 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)	1,562,961,005.69	261,621,768.99	1,824,582,774.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	59,906,545.07	59,906,545.07
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)	-224,331,886.76	-63,290,915.35	-287,622,802.11
其中:1.基金申购款	169,393,465.62	39,506,472.60	208,899,938.22
2.基金赎回款	-393,725,352.38	-102,797,387.95	-496,522,740.33
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)	1,338,629,118.93	258,237,398.71	1,596,866,517.64
项目	上年度可比期间 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)	1,717,856,832.13	739,939,162.19	2,457,795,994.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	39,791,523.94	39,791,523.94
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)	-276,218,173.29	-146,368,649.15	-422,586,822.44
其中:1.基金申购款	536,412,640.85	266,266,885.52	802,679,526.37
2.基金赎回款	-812,630,814.14	-412,635,534.67	-1,225,266,348.81
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)	1,441,638,658.84	633,362,036.98	2,075,000,695.82

注: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:

_____韩勇_____ _____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

上证红利交易型开放式指数证券投资基金(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[2006]第 196 号《关于同意上证红利交易型开放式指数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《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,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 2,222,962,819.00 元(含募集股票市值),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(2006)第 170 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2006 年 11 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,222,985,094.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 22,275.00 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。根据《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金于 2007 年 1 月 10 日进行了基金份额折算,折算比例为 0.65527799,并于 2007 年 1 月 11 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称"上交所")上证债字[2007]第 4 号文审核同意,本基金 1,456,675,703 份基金份额于 2007 年 1 月 18 日在上交所挂牌交易。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的主要投资范围为标的指数成份股和备选成份股,该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。本基金的业绩基准为上证红利指数。

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 2012 年 8 月 28 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》、《上证红利交易型开放式指数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 2012 年半年度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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年度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、会计估值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
招商银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、一级交易商

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 2012年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 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	-	-	19,787,769.30	7.88%

债券交易

无。

债券回购交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

注:本报告期及上年度可比期间本基金与关联方未进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年 1 月 1 日至 2012 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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	16,819.45	7.88%	7,918.54	66.62%

注:上述佣金按股票交易量的千分之一计算,以扣除证管费、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 2012年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	4,424,651.26	5,910,982.97
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.50%的年费率计提,计算方法如下: H = E × 0.50% ÷ 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 2012年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	884,930.25	1,182,196.62

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 0.10%的年费率计提,计算方法如下: H = E × 0.10% ÷ 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。

6.4.8.2.3 销售服务费

无。

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:本基金本报告期内以及上年度可比期间内均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

注:本报告期内以及上年度可比期间内,基金管理公司未投资本基金。

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:本报告期末及上年度末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 2012年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 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
招商银行股份有限公司	4,758,241.98	45,051.49	28,043,219.03	29,581.47

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:本基金在本报告期内及上年可比期间内未参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.9 期末(2012 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:截至本报告期末,本基金未持有流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:截至本报告期末,本基金未持有流通受限的股票。

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

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元,无债券作为质押。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止,本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元,无债券作为质押。

§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	1,578,893,240.10	98.78
	其中:股票	1,578,893,240.10	98.78
2	固定收益投资	2,492,493.90	0.16
	其中:债券	2,492,493.90	0.16
	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	4,828,990.54	0.30
6	其他各项资产	12,144,835.22	0.76
7	合计	1,598,359,559.76	100.00

注:股票投资包含可退替代款估值增(减)值;

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资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	9,203,931.15	0.58
B	采掘业	335,588,217.41	21.02
C	制造业	220,960,428.97	13.84
C0	食品、饮料	14,474,530.92	0.91
C1	纺织、服装、皮毛	19,528,901.76	1.22
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	30,529,109.66	1.91
C5	电子	6,212,681.90	0.39
C6	金属、非金属	78,624,928.83	4.92
C7	机械、设备、仪表	40,912,839.44	2.56
C8	医药、生物制品	22,509,705.38	1.41
C99	其他制造业	8,167,731.08	0.51
D	电力、煤气及水的生产和供应业	138,252,188.15	8.66
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	102,286,389.08	6.41
G	信息技术业	12,895,356.18	0.81
H	批发和零售贸易	24,910,175.08	1.56
I	金融、保险业	710,497,232.82	44.49
J	房地产业	8,313,235.79	0.52
K	社会服务业	4,786,009.60	0.30
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	11,200,055.87	0.70
	合计	1,578,893,220.10	98.87

注:上述股票投资组合不包含可退替代款估值增(减)值。

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

7.3.1 期末指数投资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(%)