华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012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：2012年8月28日

§1 重要提示及目录

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

基金名称	华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金
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	86,896,544.57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	tgcxxpl@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。

2.5 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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	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	463,633.76
本期利润	2,290,982.49
加权平均基金份额本期利润	0.0255
本期基金份额净值增长率	2.93%
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	-0.2275
期末基金资产净值	67,129,830.71
期末基金份额净值	0.773

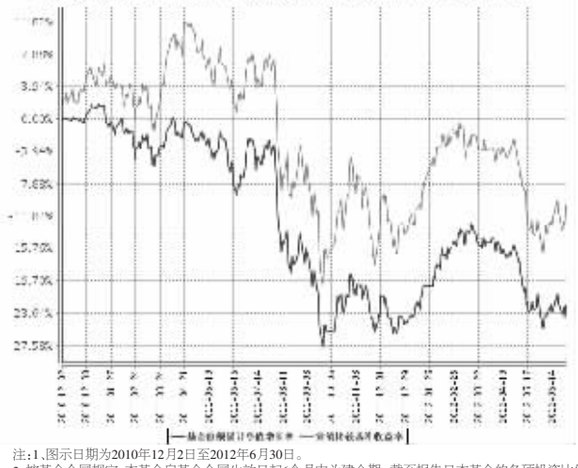
3.2 基金净值表现

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	0.13%	1.15%	3.54%	1.33%	-3.41%	-0.18%
过去三个月	-9.17%	0.98%	-7.40%	1.16%	-1.77%	-0.18%
过去六个月	2.93%	0.91%	3.59%	1.08%	-0.66%	-0.17%
过去一年	-18.89%	1.20%	-15.45%	1.52%	-3.44%	-0.32%
自基金合同生效日起至今	-22.70%	1.05%	-10.58%	1.34%	-12.12%	-0.29%

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、图示日期为2010年12月2日至2012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

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，公司的公募基金管理规模为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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李文杰	本基金的基金经理、海外投资部总监	2010年12月2日	-	13	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	-	13	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，加入美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

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

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 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

上半年亚洲股市经历了过山车，一季度由于希腊选举，保守派支持紧缩政策获得选民支持，希腊退出欧元区危机暂解，亚洲股市明显反弹，MSCI亚洲不含日本指数大涨11.87%，香港恒生指数也大涨11.51%；然第二季欧元区的西班牙与意大利国债收益率达到接近7%的危险水平，使得投资人担心欧元区债务危机再度恶化，全球资金又从新兴市场回流美国，MSCI亚太不含日本指数回跌7.4%，港股也下跌超过5.42%。亚洲领导企业基金在上半年超配港股，港股仓位比重较高接近四成。

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0.773元，本报告期份额净值增长率为2.93%，同期业绩比较基准增长率为3.59%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

亚太股市于今年一季度大幅上涨之后，于二季度明显回落，主要反应投资人对欧债危机与全球经济放缓的担忧。整体来看，上半年以东南亚股市表现较佳，泰国、新加坡、马来西雅等股市都跑赢业绩比较基准，主要是由于以内需市场为主的东南亚国家受到欧美经济增长放缓的冲击较小。而香港国企指数上半年下跌6.12%，大幅落后同期业绩基准，主要是受到国内经济增长放缓的拖累。

展望未来半年，虽然欧债危机仍在，但在美国经济逐渐复苏的带领下，观察到近期国际资金已经逐步回流亚洲新兴市场，亚洲股市仍将有不错的投资机会，基金将慎选估值合理，有强劲现金流，较高净值回报率的行业领导企业来建立投资组合，并保持适度仓位，以因应市场未来的不确定性。

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-19,766,713.86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：华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金

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	6.4.7.1	8,461,260.11	15,927,511.74
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	59,157,849.80	53,403,374.45
其中：股票投资		58,157,085.73	52,459,233.23
基金投资		1,000,764.07	944,141.22
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,482,964.86
应收利息	6.4.7.5	462.53	1,559.09
应收股利		129,820.26	36,967.92
应收申购款		1,987.28	888.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	674,701.30
资产总计		67,751,379.98	71,527,967.99
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		152,460.81	31,399.03
应付管理人报酬		98,592.73	109,067.08
应付托管费		19,170.81	21,207.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	351,324.92	1,012,243.51
负债合计		621,549.27	1,173,917.09
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	86,896,544.57	93,677,415.14
未分配利润	6.4.7.10	-19,766,713.86	-23,323,364.24
所有者权益合计		67,129,830.71	70,354,050.90
负债和所有者权益总计		67,751,379.98	71,527,967.99

注：报告截止日2012年6月30日，基金份额净值0.773元，基金份额总额86,896,544.57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：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		3,763,495.83	-3,680,003.73
1.利息收入		14,943.78	73,650.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,943.78	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）		1,905,553.33	-74,466.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,367,885.30	-697,946.42
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	537,668.03	623,480.02
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	6.4.7.17	1,827,348.73	-2,829,575.73
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）		12,041.41	-895,266.26
5.其他收入（损失以"-"号填列）	6.4.7.18	3,608.58	45,654.07
减：二、费用		1,472,513.34	2,212,838.31
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	654,954.28	992,652.12
2.托管费	6.4.10.2.2	127,352.25	193,015.70
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4.交易费用	6.4.7.19	527,735.01	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	6.4.7.20	162,471.80	160,009.04
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		2,290,982.49	-5,892,842.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		2,290,982.49	-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：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）	93,677,415.14	-23,323,364.24	70,354,050.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,290,982.49	2,290,982.49
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）	-6,780,870.57	1,265,667.89	-5,515,202.68
其中：1.基金申购款	202,691.64	-38,719.72	163,971.92
2.基金赎回款	-6,983,562.21	1,304,387.61	-5,679,174.60
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）	86,896,544.57	-19,766,713.86	67,129,830.71
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）	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。

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

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》的规定公开募集。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2012年1月1日至2012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2012年6月30日的财务状况以及2012年1月1日至2012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［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

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 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	654,954.28	992,652.12
其中：支付销售机构的客户维护费	258,510.46	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 × 1.80% ÷ 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 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	127,352.25	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 × 0.35% ÷ 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 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
基金合同生效日（2010年12月2日）持有的基金份额	5,001,200.00	5,001,200.00
期初持有的基金份额	-	-
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	5,001,200.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.76%	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 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
中国银行股份有限公司	2,210,777.74	14,943.78	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。

6.4.9 利润分配情况

6.4.9.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：无。

6.4.10 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末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。

6.4.10.2 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
591 hk	中国高精密	2011年10月27日	重大事项	2.19	未知	未知	504,000	1,157,443.50	1,103,188.31	-

注：1、本基金截至2012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。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.10.3.2 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	58,157,085.73	85.84
	其中：普通股	58,157,085.73	85.84
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	1,000,764.07	1.48
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	8,461,260.11	12.49
8	其他各项资产	132,270.07	0.20
9	合计	67,751,379.98	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（%）
新加坡交易所	3,036,262.48	4.52
马来西亚交易所	2,139,802.12	3.19
香港交易所	25,195,114.33	37.53
菲律宾交易所	1,036,172.13	1.54
印尼交易所	5,241,582.72	7.81
台湾证券交易所	7,483,461.22	11.15
泰国交易所	3,043,999.04	4.53
韩国交易所	5,698,723.29	8.49
美国交易所	5,281,968.40	7.87
合计	58,157,085.73	86.63

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	4,016,668.84	5.98
15 原材料	1,757,659.16	2.62
20 工业	8,777,774.63	13.08
25 非日常生活消费品	16,447,091.94	24.50
30 日常消费品	7,981,960.65	11.89
35 医疗保健	2,864,394.73	4.27
40 金融	2,424,622.23	3.61
45 信息技术	10,847,425.20	16.16
50 电信业务	3,039,488.35	4.53
合计	58,157,085.73	86.63

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大权益投资明细

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	PHOENIX SATELLITE TELEVISION	凤凰卫视	2008 HK	香港交易所	香港	1,664,000	3,079,314.20	4.59
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	三星电子	005930 KS	韩国交易所	韩国	366	2,427,402.22	3.62
3	GUDANG GARAM TBK PT	益仓集团	GGRM IJ	印尼交易所	印尼	47,500	1,967,075.77	2.93
4	DYNAPACK INTERNATIONAL TECH	顺达科	3211 TT	台湾证券交易所	台湾	55,000	1,887,831.42	2.81
5	HYUNDAI MOBIS	现代汽车	012330 KS	韩国交易所	韩国	1,238	1,876,638.60	2.80
6	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	中国交通建设	1800 HK	香港交易所	香港	340,000	1,876,473.40	2.80
7	EBAY INC	易趣网	EBAY US	美国交易所	美国	6,923	1,839,503.75	2.74
8	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	太平洋	522 HK	香港交易所	香港	22,100	1,773,710.84	2.64
9	BBMG CORPORATION-H	金隅股份	2009 HK	香港交易所	香港	401,500	1,757,659.16	2.62
10	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中石化	386 HK	香港交易所	香港	300,000	1,682,614.08	2.51

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。

7.5 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	BBMG CORPORATION-H	2009 HK	4,345,402.28	6.18
2	EMPEROR WATCH & JEWELLERY	887 HK	3,066,079.97	4.36
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	005930 KS	2,608,275.69	3.71
4	BIOSENSORS INTERNATIONAL GRO	BIG SP	2,