华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年 9 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
报告送出日期:2012年10月26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责任。

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10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞盛世中国股票
交易代码	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
报告期末基金份额总额	12,206,048,569.86份
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
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年7月1日 - 2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-289,073,142.03
2.本期利润	-265,562,737.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0216
4.期末基金资产净值	6,068,181,034.64
5.期末基金份额净值	0.4971

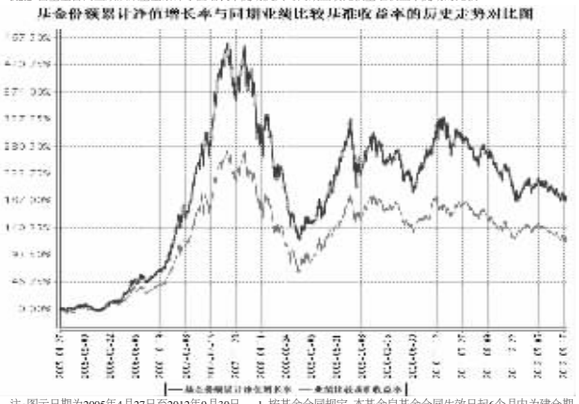
注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-4.18%	0.87%	-4.41%	0.81%	0.23%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2012年9月30日。 1.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30%-40%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、投资总监	2009年11月18日	-	18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月至2011年8月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。
张诣	本基金的基金经理	2012年6月29日	-	8	张诣先生,8年证券(基金)从业经验,经济学硕士。曾任职于申银万国证券股份有限公司、上海申银万国证券研究所有限公司、德勤咨询(上海)有限公司。2007年5月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员及基金经理助理。2012年6月起任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金经理。

4.2 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、法规以及本基金合同的约定,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度A股市场大幅度调整,沪深300指数下跌6.84%。经济下行趋势越来越明朗,政府对冲经济下滑的政策力度也明显低于市场预期。另外,上市公司半年报显示受到宏观经济景气下降的影响,上市公司利润增速出现负增长。基本面不利因素加剧市场悲观预期,导致市场出现较大调整。行业方面,交通运输、纺织服装、机械、地产等行业跌幅较大;信息服务、餐饮旅游、有色金属和医药行业跌幅较小。

本基金在三季度较好控制仓位,在资产配置方面有较好超额收益。本基金净值在报告期内增长率-4.18%,高于业绩基准0.23个百分点。

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0.4971元,累计净值为2.3508元,本报告期内基金份额净值下跌4.18%,本基金的业绩比较基准下跌4.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,本基金认为中国经济仍然处于下行周期,经济周期底部是否见到尚难以判断。从一些宏观和微观经济数据看,实体经济仍然处于加杠杆趋势之中,导致市场利率保持在较高水平。去产能、去杠杆、去投资还没有真正开始,流动性紧张状态没有得到有效缓解,这是压制市场估值提升的重要因素。从经济基本面角度看,市场不具备大幅度趋势性上涨的机会。

市场经历三季度调整,市场风险进一步释放,有反弹内在动力。特别是四季度党的十八大召开,维稳预期可能是触发反弹的因素。本基金将继续保持原有的投资策略,保持资产配置弹性,在控制仓位前提下强化自下而上精选企业思路,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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,220,296,415.68	65.11
	其中:股票	4,220,296,415.68	65.11
2	固定收益投资	250,300,000.00	3.86
	其中:债券	250,300,000.00	3.86
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	621,201,958.30	9.58
	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	1,381,666,350.38	21.32
6	其他资产	8,536,673.61	0.13
7	合计	6,482,001,397.97	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农,林,牧,渔业	119,330,277.19	1.97
B	采掘业	301,403,665.80	4.97
C	制造业	2,132,492,528.78	35.14
C0	食品,饮料	1,100,360,835.68	18.13
C1	纺织,服装,皮毛	85,658,942.35	1.41
C2	木材,家具	-	-
C3	造纸,印刷	5,739,672.00	0.09
C4	石油,化学,塑胶,塑料	196,950,494.75	3.25
C5	电子	13,617,688.99	0.22
C6	金属,非金属	149,445,452.59	2.46
C7	机械,设备,仪表	155,835,841.11	2.57
C8	医药,生物制品	424,883,601.31	7.00
C99	其他制造业	-	-
D	电力,煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	83,860,519.33	1.38
F	交通运输,仓储业	108,508,928.26	1.79
G	信息技术业	297,416,147.10	4.90
H	批发和零售贸易	81,705,734.46	1.35
I	金融,保险业	637,678,905.50	10.51
J	房地产业	144,330,600.73	2.38
K	社会服务业	282,533,409.16	4.66
L	传播与文化产业	27,649,117.37	0.46
M	综合类	3,386,582.00	0.06
	合计	4,220,296,415.68	69.55

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	12,994,616	276,785,320.80	4.56
2	600519	贵州茅台	1,092,282	268,482,915.60	4.42
3	601318	中国平安	4,998,453	209,635,118.82	3.45
4	002063	远光软件	12,647,213	196,031,801.50	3.23
5	601601	中国太保	9,545,301	193,101,439.23	3.18
6	000423	东阿阿胶	4,403,315	170,496,356.80	2.81
7	600837	海通证券	15,915,670	152,472,118.60	2.51
8	600597	光明乳业	15,415,661	131,341,431.72	2.16
9	600844	丹化科技	10,289,066	111,842,147.42	1.84
10	002069	獐子岛	6,159,746	107,487,567.70	1.77

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	103,790,000.00	1.71
2	央行票据	96,670,000.00	1.59
3	金融债券	49,840,000.00	0.82
	其中:政策性金融债	49,840,000.00	0.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	250,300,000.00	4.12

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110019	11国债19	1,000,000	103,790,000.00	1.71
2	1101088	11央票88	1,000,000	96,670,000.00	1.59
3	120228	12国开28	500,000	49,840,000.00	0.82

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

5.8.2

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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,575,813.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,361,028.67
4	应收利息	4,575,858.43
5	应收申购款	23,972.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,536,673.61

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	12,335,778,334.67
本报告期基金总申购份额	8,705,585.68
减:本报告期基金总赎回份额	138,435,350.49
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,206,048,569.86

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》

4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

7.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问,可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线:400-888-0001(免长途费)021-3878 4638 公司网址:www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2012年10月26日

华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年 9 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
报告送出日期:2012年10月26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责任。 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10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。 本报告中的财务资料未经审计。 本报告期自2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况

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)
交易代码	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
报告期末基金份额总额	84,882,859.42份
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。
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

2.2 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 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年7月1日 - 2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-5,241,345.14
2.本期利润	1,258,768.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0147
4.期末基金资产净值	66,823,801.79
5.期末基金份额净值	0.787

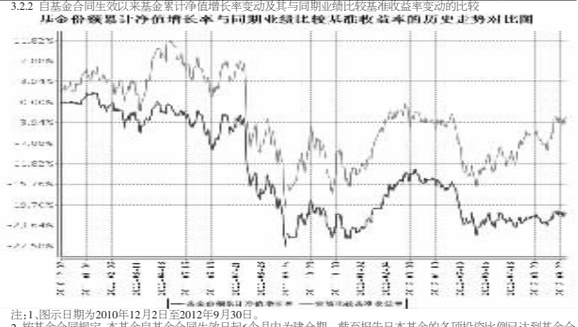
注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	1.81%	0.61%	8.45%	0.97%	-6.64%	-0.36%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:1、图示日期为2010年12月2日至2012年9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(二)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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2012年7月11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月至2012年7月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。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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。首先海外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。

4.4.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度的亚太股市在二季度跌深之后明显反弹,MSCI亚太不含日本指数在三季度上涨8.45%,主要受到美国美联储的第三次量化宽松政策利好刺激上扬。投资人预期宽松的流动性将会使资金重回新兴市场,因此增加对风险资产的投资。三季度表现最好的是泰国股市上涨超过10.8%,主要是泰国在水灾之后国内经济迅速复苏,基建的需求带动相关类股反弹。香港恒生指数在第三季上涨7.2%表现不俗,但香港恒生国企指数只微幅上涨2.68%,落后亚洲股市的这波反弹,主要是投资人担心中国经济放缓仍未见底,周期性板块股票表现落后拖累。以出口贸易为主的经济体如韩国、中国台湾与新加坡股市都看到明显上涨,三季度涨幅分别有7.6%,7.5%与6.3%,主要受到外资回流上述的股市。

三季度亚洲领导企业基金上涨3.55%,指标MSCI亚太不含日本指数上涨8.45%,主要是香港市场的持股表现不如预期,港股的中小盘股在三季度跌幅较大,拖累了基金的表现;此外由于担心欧元区债务问题扩大,基金的持仓在七成左右也拖累了业绩。而美元对人民币在三季度贬值1.09%对业绩也造成拖累。

欧洲央行虽然推出OMT(Outright Monetary Transaction)无限购债计划压低欧元区债务国的利率水平,但市场仍在揣测西班牙很快将提出纾困申请,再加上欧元区经济衰退,都加深了投资人对欧债危机的担忧;此外,美国财政悬崖问题在总统大选后是否获得解决仍未定,包括了2013年将启动的自动减支(年削减2.1万亿)、小布什时代减税、失业救济金延长等,预估合计金额将达到5800亿美元,占美国GDP约莫4%,若2013年自动减支启动,加上减税政策全面到期终止,将大幅度拖累美国经济,IMF预测若财政悬崖发生,美国明年一季度经济将陷入衰退。

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0.787元,本报告期份额净值增长率为1.81%,同期业绩比较基准增长率为8.45%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第四季,虽然全球货币供应趋向宽松,有可能因为资金流入新兴市场而持续推动股市上涨,但全球实体经济增长仍在下滑,第三次量化宽松效果仍待观察,股市有可能呈现震荡向上的行情, 本基金仍将秉持价值的选股哲学,挑选长期具有竞争力的亚洲企业,耐心等待合适价位并长期持有。基金的仓位将同时待海外股市回调后再提高至80%左右,投资策略将采取较集中持仓的策略,挑选长期具有可持续性竞争力的优秀企业加入基金组合。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	47,728,381.86	70.79
	其中:普通股	47,728,381.86	70.79
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	2,524,217.79	3.74
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	17,140,009.58	25.42
8	其他资产	32,917.98	0.05
9	合计	67,425,527.21	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
新加坡交易所	2,292,285.53	3.43
香港交易所	21,816,260.37	32.65
菲律宾交易所	267,861.74	0.40
印尼交易所	4,431,963.09	6.63
台湾亚交易所	10,889,699.80	16.30
泰国交易所	2,098,439.67	3.14
韩国交易所	5,931,871.66	8.88
合计	47,728,381.86	71.42

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
10 能源	5,217,299.05	7.81
15 原材料	1,708,405.53	2.56
20 工业	3,505,760.98	5.25
25 非日常生活消费品	13,121,471.08	19.64
30 日常消费品	3,230,813.67	4.83
35 医疗保健	3,376,360.86	5.05
40 金融	3,832,878.15	5.74
45 信息技术	6,862,665.43	10.27
50 电信业务	5,567,241.04	8.33
55 公用事业	1,305,486.07	1.95
合计	47,728,381.86	71.42

注:本公司采用的行业分类标准为全球行业分类标准GICS。

5.4 报告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及存托凭证投资明细

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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	MEDIATEK INC	联发科	2454 TT	台湾证交易所	台湾	53,000	3,549,914.06	5.31
2	MERIDA INDUSTRY CO LTD	美利达	9914 TT	台湾证交易所	台湾	104,350	2,438,919.83	3.65
3	HYUNDAI MOBIS	现代汽车	012330 KS	韩国交易所	韩国	1,238	2,189,339.20	3.28
4	TOTAL ACCESS COMMUNICATION	DTAC	DTAC TB	泰国交易所	泰国	110,200	2,098,439.67	3.14
5	SK TELECOM	SK电讯	017670 KS	韩国交易所	韩国	2,506	2,098,114.60	3.14
6	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	银河娱乐	27 HK	香港交易所	香港	94,000	1,998,752.08	2.99
7	PHOENIX SATELLITE TELEVISION	凤凰卫视	2008 HK	香港交易所	香港	994,000	1,975,378.78	2.96
8	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	1171 HK	香港交易所	香港	204,000	1,971,993.01	2.95
9	IND & COMM BK OF CHINA-H	工商银行	1398 HK	香港交易所	香港	492,000	1,842,842.88	2.76
10	SINO BIOPHARMACEUTICAL	中国生物制药	1177 HK	香港交易所	香港	772,000	1,805,681.13	2.70

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告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金融衍生品。

5.9 报告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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	SPDR GOLD TRUST	股票型	交易型开放式	贝莱德资产管理北亚有限公司	1,356,861.52	2.03
2	ISHARES BSE SENSEX INDIA IND	股票型	交易型开放式	贝莱德资产管理北亚有限公司	1,167,356.27	1.75

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明:

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,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

5.10.2 基金投资的前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明:

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	32,350.89
4	应收利息	567.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,917.98

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注:由于四舍五入的原因,比例的分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	86,896,544.57
本报告期基金总申购份额	45,473.30
减:本报告期基金总赎回份额	2,059,158.45
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	84,882,859.42

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》

4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

7.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问,可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线:400-888-0001(免长途费)021-3878 4638 公司网址:www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2012年10月26日

华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年 9 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
报告送出日期:2012年10月26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责任。

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10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞量化先行股票
交易代码	460009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月22日
报告期末基金份额总额	110,948,661.72份
投资目标	以定量估值分析为主,结合基本面定性研究,力求发现价值被市场低估且具潜在发展机遇的企业,在风险可控的前提下,追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	1.股票投资策略:以定量估值识别为主,并结合行业和公司基本面趋势分析,以识别非完全有效市场中蕴含的各种投资机会,先行发现和介入那些企业价值被低估却具有某些隐藏价值可以提升未来股价的公司。2.债券投资策略:采用主动性投资策略,确定和构造能够提供稳定收益且流动性较高的债券组合,在获取较高的利息收入的同时兼顾资本利得。3.权证投资策略:权证投资为本基金的辅助性投资工具。4)大类资产配置策略:通过对宏观经济周期、货币供应量、市场估值水平、宏观政策导向以及市场氛围等因素的分析,形成对大类资产收益率在不同市场周期的预测和判断,从而确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例,适度降低组合系统性风险。基于以往的投资经验,过于频繁的大类资产调整不利于本基金的管理。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	较高风险、较高收益
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年7月1日 - 2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,660,146.92
2.本期利润	-3,705,078.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0307
4.期末基金资产净值	89,991,265.24
5.期末基金份额净值	0.811

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