

上证红利交易型开放式指数证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

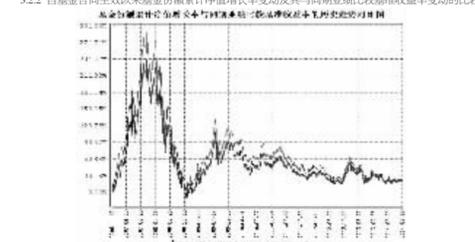
基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2014年8月25日
1.1 重要提示
基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

Table with 2 columns: 基金基本情况, 2.1 基金基本情况. Includes details on fund type, manager, and investment strategy.

Table with 2 columns: 2.2 基金产品说明, 2.3 基金管理人及基金托管人. Includes investment strategy and contact information.

3 主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Includes performance metrics and net asset value trends.



注:图示日期为2006年11月17日至2014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...

4.1 基金管理人及基金基金经理情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金基金经理简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期. Lists the fund manager and other key personnel.

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对资产交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和...
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望下半年,我们预计经济基本面运行仍然较为平淡,尽管“微刺激”政策发力将带动经济企稳...

5 托管人报告

5.1 报告期内基金托管人遵守法律法规、履行托管人职责的情况说明

6 半年度财务会计报告(未经审计)

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 2014年6月30日, 2013年12月31日. Shows the fund's balance sheet.

Table with 4 columns: 负债, 附注号, 2014年6月30日, 2013年12月31日. Shows the fund's liabilities.

Table with 4 columns: 所有者权益, 附注号, 2014年6月30日, 2013年12月31日. Shows the fund's equity.

6.2 利润分配

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2014年1月1日至2014年6月30日, 2013年1月1日至2013年6月30日. Shows profit distribution details.

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 2014年1月1日至2014年6月30日, 2013年1月1日至2013年6月30日. Shows other financial data.

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 4 columns: 项目, 2014年1月1日至2014年6月30日, 2013年1月1日至2013年6月30日. Shows the change in net asset value.

6.4 报表附注
6.4.1 基金基本情况
6.4.2 会计政策和会计估计

6.4.3 重要会计政策和会计估计
6.4.4 重要会计政策和会计估计
6.4.5 关联方关系及其交易的披露

7 投资组合报告

Table with 4 columns: 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(%)

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期. Shows portfolio turnover and other metrics.

8 基金份额持有人信息

Table with 4 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者持有基金份额, 个人投资者持有基金份额

9 开放式基金份额变动

Table with 4 columns: 基金合同生效日, 本报告期初基金份额总额, 本报告期末基金份额总额

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议
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

10.3 涉及基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼
10.4 基金投资策略的改变

10.5 为基金投资所涉及的会计师事务所变更情况
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

10.7 基金租用证券公司交易单元变更的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期股票成交金额比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

Table with 4 columns: 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(%)

注:股票投资不包含可替代估值增值(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前十名股票投资明细

Table with 4 columns: 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(%)

注:股票投资不包含可替代估值增值(减)值。
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股票投资明细

Table with 4 columns: 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(%)

注:股票投资不包含可替代估值增值(减)值。
7.4.1 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

Table with 4 columns: 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(%)

注:股票投资不包含可替代估值增值(减)值。
7.4.2 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

注:不考虑相关交易费用。
7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的成本总额

Table with 2 columns: 买入股票成本, 卖出股票成本

注:不考虑相关交易费用。
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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。

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。

7.13 期末其他各项资产构成

Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额

注:1.期末持有的处于转股期的可转换债券明细
2.本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者持有基金份额, 个人投资者持有基金份额

8.2 期末上市基金前十名持有人

Table with 4 columns: 序号, 姓名, 持有份额(份), 占上市总份额比例

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:1.期末基金从业人员持有本基金份额为0。
2.本基金本报告期末,基金从业人员持有本基金基金份额的数量区间为0。

3.该只基金的基金经理持有该只基金份额的数量区间为0。

9 开放式基金份额变动

Table with 4 columns: 基金合同生效日, 本报告期初基金份额总额, 本报告期末基金份额总额

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议
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

10.3 涉及基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼
10.4 基金投资策略的改变

10.5 为基金投资所涉及的会计师事务所变更情况
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

10.7 基金租用证券公司交易单元变更的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。

5.具备研究实力,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的需要,提供专题研究报告。

6.基金管理人及被选择的证券经纪机构签订交易单元租约协议和证券研究服务协议。

7.本基金在报告期内未增加交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 4 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 成交笔数, 占当期股票成交笔数比例

注:1.选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准
2.选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序

3.基金申购、赎回良好,内部控制规范,具备健全的内部控制制度,并能满足本基金运作高度保密的要求。
4.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务。