

华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金

[2010] 第三季度报告

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2010年10月28日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告期间内未将资金存入虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质内容、准确性、完整性承担个别及连带责任。基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2010年10月27日复核了本报告中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。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2010年7月1日起至2010年9月30日止。

本基金名称于2010年4月30日起，由“华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金”，基金简称称为“华泰柏瑞行业领先股票”，基金代码保持不变。本基金基金管理人等在内的详细内容见2010年4月30刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

§ 2 基金产品概况

基金简称:华泰柏瑞行业领先股票

交易代码:460007

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2009年6月3日

报告期末基金份额总额:82,348,348.80份

投资目标:通过采取自上而下和自下而上相结合的方法，从定量分析和定性分析两个方面把握不同时期所蕴含的行业和个股投资机会，在充分控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。

投资策略:大类资产配置不作为本基金的核心策略，考虑到中国大陆股票市场阶段特征存在较大的系统性风险，本基金将仅在股权投资资产组合中安排适度高估或低估时进行适度的大类资产配置调整。一般情况下本基金将保持大类资产配置的基本稳定。本基金在股权投资中注重自上而下的行业配置，以行业估值为基础，以行业基本面趋势变化为契机，结合国家产业政策的导向，在不回避风险的前提下合理配置大类资产。

业绩比较基准:沪深300指数×80%+上证国债指数×15%+同业存款利率×5%

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:中国工商银行股份有限公司

§ 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(2010年7月1日-2010年9月30日)

1.本期已实现收益 28,127,010.67

2.本期利润 306,063,820.94

3.加权平均基金份额本期利润 0.2026

4.期末基金资产净值 1,335,230,332.31

5.期末基金份额净值 0.907

注:1.本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相应的数字。

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.期末可供分配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 本基金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 28.84% 11.71% 10.5% 17.13% 0.23%

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:1.本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相应的数字。

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.期末可供分配利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4.2 基金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。

4.3 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定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、有效性和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，上述公平交易制度运行执行情况良好。

4.3.2 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

本基金管理人和其他基金经理人所管理的其他投资组合的风格均不相同。

4.3.3 非公平交易行为的说明

本基金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 报告期内基金管理人对本基金运作的分析

2010年三季度中国经济处在增速下滑通道中，工业增加值同比增速环比回落，而通胀压力进一

步显现，8月份CPI同比上涨3.5%。各种迹象表明，宏观调控重点阶段性地从通胀管理转向防止经济过度回落，虽然通胀压力有所抬头，但信贷控制并未进一步加剧，8、9月份的M2增速甚至出现了小幅反弹。

A股市场经过二季度的大幅调整，估值吸引力进一步提升。在宏观调控阶段性地从通胀管理转向防止经济过度回落，虽然通胀压力有所抬头，但信贷控制并未进一步加剧，8、9月份的M2增速甚至出现了小幅反弹。

基金管理人的董事会及监事会在报告期间内未将资金存入虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质内容、准确性、完整性承担个别及连带责任。基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2010年10月27日复核了本报告中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。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2010年7月1日起至2010年9月30日止。

本基金名称于2010年4月30日起，由“华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金”，基金简称称为“华泰柏瑞行业领先股票”，基金代码保持不变。本基金基金管理人等在内的详细内容见2010年4月30刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

§ 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 1,201,414,408.05 89.56

其中:股票 1,201,414,408.05 89.56

2 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

资产支持证券 - -

3 金融衍生品投资 - -

4 其他投资 - -

5 衍生工具及备付金合计 137,014,342.09 10.21

6 其他资产 3,105,646.33 0.23

7 合计 1,341,534,396.47 100.00

投资目标:本基金通过投资于市场估值相对较低，基本面良好的股票，为股东持续创造价值的公司，重点关注其基本面变化情况，从行业角度逐步挑选出优质的个股，在充分控制投资组合风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略:基于对宏观经济和投资环境的分析和预判，全面评估市场的中长期预期和风险，确定基金资产在股权投资和固定收益投资中的比例，通过行业配置，以行业基本面趋势变化为契机，结合国家产业政策的导向，在不回避风险的前提下合理配置大类资产。

业绩比较基准:沪深300指数×80%+上证国债指数×15%+同业存款利率×5%

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:中国工商银行股份有限公司

§ 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 1,201,414,408.05

本报告期期间内申购份数 33,070,239.04

本报告期期间内赎回份数 3,105,646.33

本报告期末基金份额总额 1,472,828,348.80

§ 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准予募集注册文件

2.基金的《基金合同》

3.基金的《基金托管协议》

4.基金的《托管协议》

5.基金的《业务资格批件、营业执照》

6.基金的《公告》

7.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄大同五道口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(免长途话费) 021-3878 4638

公司网址:www.huatai-ph.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2010年10月10日 2010年10月28日

§ 8 基金份额净值

§ 9 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。

4.3 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

研究部通过规定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、

有效性和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

度运行执行情况良好。

4.3.2 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

本基金管理人和其他基金经理人所管理的其他投资组合的风格均不相同。

4.3.3 非公平交易行为的说明

本基金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 报告期内基金管理人对本基金运作的分析

2010年三季度中国经济处在增速下滑通道中，工业增加值同比增速环比回落，而通胀压力进一

步显现，8月份CPI同比上涨3.5%。各种迹象表明，宏观调控重点阶段性地从通胀管理转向防止经济过度

回落，虽然通胀压力有所抬头，但信贷控制并未进一步加剧，8、9月份的M2增速甚至出现了小幅反弹。

A股市场经过二季度的大幅调整，估值吸引力进一步提升。在宏观调控阶段性地从通胀管理转向防止经济过度

回落，虽然通胀压力有所抬头，但信贷控制并未进一步加剧，8、9月份的M2增速甚至出现了小幅反弹。

基金管理人的董事会及监事会在报告期间内未将资金存入虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质内容、准确性、完整性承担个别及连带责任。基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2010年10月27日复核了本报告中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。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2010年7月1日起至2010年9月30日止。

本基金名称于2010年4月30日起，由“华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金”，基金简称称为“华泰柏瑞行业领先股票”，基金代码保持不变。本基金基金管理人等在内的详细内容见2010年4月30刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

§ 10 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.本基金的中国证监会准予募集注册文件

2.基金的《基金合同》

3.基金的《基金托管协议》

4.基金的《托管协议》

5.基金的《业务资格批件、营业执照》

6.基金的《公告》

7.2 存放地点