华泰柏瑞货币市场证券投资基金

【2010】第四季度报告

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2011年1月22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2011年1月21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2010年10月1日起至2010年12月31日止。

本基金名称自2010年4月30日起,由"友邦华泰货币市场证券投资基金"更名为"华泰柏瑞货币市场证券投资基金",基金简称为"华泰柏瑞货币",基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见2010年4月30日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰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:	华泰柏瑞货币
交易代码:	460006
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2009年5月6日
报告期末基金份额总额:	166,637,313.94 份
投资目标:	在有效保持基金资产安全和高流动性的前提下,追求超过业绩基准的稳健投资收益。
投资策略:	本基金采取主动的投资管理策略对短期货币市场工具进行投资,在投资中将充分利用现代金融工程理论以及数量分析方法来提高投资决策的及时性与合理性,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,获得稳健的投资收益。
业绩比较基准:	当期银行活期存款税后收益率
风险收益特征:	本基金属于证券投资基金较高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
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

下属两级基金简称:	华泰柏瑞货币A	华泰柏瑞货币B
下属两级交易代码:	460006	460106
下属两级基金报告期末份额总额:	17,489,024.83 份	149,148,289.11 份

§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10月1日 - 2010年12月31日)	
	华泰柏瑞货币A	华泰柏瑞货币B
1. 本期已实现收益	31,647.94	527,132.38
2.本期利润	31,647.94	527,132.38
3.期末基金资产净值	17,489,024.83	149,148,289.11

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞货币A

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	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	0.3282%	0.0010%	0.0920%	0.0000%	0.2362%	0.0010%

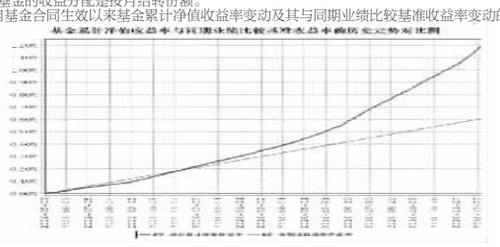
注:本基金的收益分配是按月结转份额。

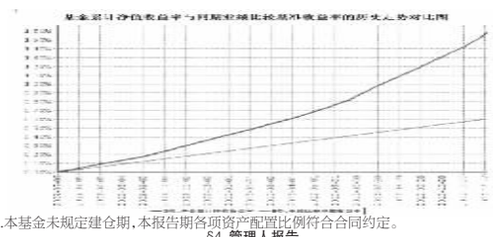
华泰柏瑞货币B

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	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	0.3885%	0.0010%	0.0920%	0.0000%	0.2965%	0.0010%

注:本基金的收益分配是按月结转份额。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:1.本基金未规定建仓期,本报告期各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
沈涛	本基金的基金经理	2009年5月6日	-	17年	沈涛先生,经济学博士。2005年9月至2007年11月任易方达基金管理有限公司月月收益中短期债券投资基金基金经理。2007年11月加入本公司,2008年3月起任华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型基金基金经理;2009年5月起兼任华泰柏瑞货币市场基金基金经理。

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。其次集中交易室对投指令的合规性、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。

4.3.2 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

注:本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格均不相同。

4.3.3 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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国庆以后,央行大大加强了货币政策的收紧力度,两次加息和三次调准备金率使债券市场整体收益率大为提高,而作为短期端收益率重要指标的央票和回购收益率也得到大幅提升。但货币市场由于流动性仍较为充沛,所以在短期端利率波动较大,在年末商业银行头寸紧张的影响下,12月末的7天回购利率一度超过6%的高位,但在10月的大部分时间,该利率仅在2.0%附近波动。

央行将稳定物价放在突出位置,显然仍将不断收紧流动性,但也显然并不乐见货币市场收益率的大幅提升,从其对央票的发行数量和利率的平衡上就体现出这一点,但随着一年期定存利率的逐渐提升,短期端利率的上升也越来越难以避免。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金A类和B类分别上涨0.3282%和0.3885%,同期本基金的业绩比较基准上涨0.0920%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前看,控通胀以及稳物价并不会在一个很短的时间段内结束,随着银监会加强对商业银行的风险控制,10年每逢季末资金紧张的局面可能会进一步发展,而对加息以抑制通胀的预期,也将提升央票的发行利率。这样看,货币市场的总体回报将进一步提升。

本基金仍将以流动性和安全性作为最重要指标,尽可能为持有人争取回报。

§5 投资组合报告

5.1 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	固定收益投资	130,007,162.20	77.79
	其中:债券	130,007,162.20	77.79
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	24,000,000.00	14.36
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,675,773.44	1.00
4	其他资产	11,443,503.52	6.85
5	合计	167,126,439.16	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.00
	其中:买断式回购融资	0.00

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 期末基金组合剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	43
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	73
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	8

注:在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	33.39	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	30.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	29.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		93.43	-

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	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	100,052,755.57	60.04
3	金融债券	29,954,406.63	17.98
	其中:政策性金融债	29,954,406.63	17.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	其他	-	-
7	合计	130,007,162.20	78.02
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801017	08央行票据17	500,000	50,112,817.53	30.07
2	100221	10国开21	300,000	29,954,406.63	17.98
3	1001017	10央行票据17	300,000	29,889,500.60	17.94
4	0801029	08央行票据29	100,000	10,026,422.90	6.02
5	0801026	08央行票据26	100,000	10,024,014.54	6.02

5.6 影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0174%
报告期内偏离度的最低值	-0.1591%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0517%

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 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

本基金计价采用摊余成本法,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额资产净值保持在人民币1.00 元。

5.8.2 本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券情况

本基金本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,217.22
3	应收利息	2,744,196.34
4	应收申购款	8,697,089.96
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	11,443,503.52

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华泰柏瑞货币A	华泰柏瑞货币B
本报告期期初基金份额总额	10,492,982.00	128,713,873.23
本报告期基金总申购份额	27,620,057.88	32,139,045.60
减:本报告期基金总赎回份额	20,624,015.05	11,704,629.72
本报告期期末基金份额总额	17,489,024.83	149,148,289.11

§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
2011年1月22日

上证红利交易型开放式指数证券投资基金

【2010】第四季度报告

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2011年1月22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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年1月21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2010年10月1日起至2010年12月31日止。

本基金简称自2010年4月30日起,由"友邦华泰上证红利ETF"更名为"华泰柏瑞上证红利ETF",基金名称、代码保持不变。基金管理人更名等的详细内容见2010年4月30日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰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	华泰柏瑞上证红利ETF
交易代码	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
报告期末基金份额总额	1,125,675,703.00 份
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。
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

§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10月1日 - 2010年12月31日)
1.本期已实现收益	-154,295,290.07
2.本期利润	213,708,018.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.1613
4.期末基金资产净值	2,457,795,994.32
5.期末基金份额净值	2.183

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。

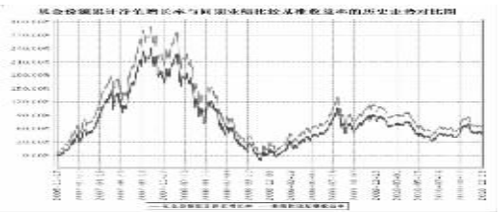
3、本基金于2007年1月10日建仓完毕并进行了基金份额折算,折算比例为0.65527799。期末还原后基金份额累计净值=(期末基金份额净值+基金份额累计分红金额)×折算比例,该净值可反映投资者在认购期以份额面值1.00元购买红利ETF后的实际份额净值变动情况。

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	3.77%	1.56%	3.95%	1.56%	-0.18%	0.00%

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、图示日期为2006年11月17日至2010年12月31日。
2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起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		
张娅	本基金的基金经理	2006年11月17日	-	6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。
柳军	本基金的基金经理	2009年6月4日	-	10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。

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。其次集中交易室对投指令的合规性、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。

4.3.2 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

注:本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格均不相同。

4.3.3 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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度A股市场呈现先扬后抑的走势,国庆期间外围市场对美联储的再次量化宽松保持了较高的预期,美元指数持续下跌,带动了海外股市和大宗商品的强劲走势,10月份A股市场在外围市场的带动下,大盘周期类股票获得了较强的估值修复机会,但随着10月份数据公布,通胀风险成为投资者关注的焦点,四季度成为今年以来央行货币政策出台最密集的时期,三度提高存款准备金率(不包括差别化)和两次加息,修复估值的行情发生逆转,上证A股截至11月11日反弹超过18%,在随后的一个半月中,又下跌了11%,整个四季度上涨5.7%。

12月召开的中央经济工作会议为2011年的货币政策定调,从适度宽松转向稳健,恰逢年底市场回笼资金的压力,货币市场资金利率一度超过8%,达到了近两年半以来的最高水平,并数倍于2008年和2009年年末同期的资金利率,资金面异常紧张,压制了市场走势。

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。该期间内,本基金的累计跟踪偏离为-0.18%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.018%,期间日跟踪误差为0.021%,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2.183元,还原后基金份额累计净值为1.488元,本报告期内基金份额净值上涨3.77%,本基金的业绩比较基准上涨3.95%。自建仓完毕日起至本报告期末,基金份额净值上涨9.44%,同期业绩基准上涨5.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011年,我们认为通胀预期仍然是困扰市场的主要因素,而通胀数据的两个比较敏感的时间点分别为1季度春节前后以及2季度末和3季度初之间,就短期而言,伴随12月下半月物价又有抬头趋势,高企的通胀预期将持续到春节期间,预期央行在此期间继续提高存款准备金率或加息都具有可能性。而目前央票市场一、二级市场利率倒挂,同时1月和2月均有较大数量的央票到期,央行政策出台更多的是起到对冲流动性的作用,货币紧缩对于A股市场的影响最大时期已过,边际效用将逐渐减弱。如果上半年物价总体处于可控状态,2季度末和3季度初的通胀压力也将会被市场逐渐淡化。

而2011年货币政策和信贷具体目标迟迟未见踪影,市场对于货币政策回归稳健的理解差异和猜疑,也会加大短期市场的分歧,因此政策预期较强以及投资者情绪分化,将使一季度A股市场总体处于震荡走势。

上证红利指数在2011年初进行了成分股调整,调入成分股权重超过调出权重,大类行业权重分布向金融、保险业,采掘业和电力、煤气及水的生产和供应业三个行业集中,但大类行业内的子行业出现多样化,如金融、保险业除原有银行子行业外,新增了证券行业,黑色金属行业权重继续下降。

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。

§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	2,406,726,078.44	96.52
	其中:股票	2,406,726,078.44	96.52
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	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	86,645,539.72	3.48
6	其他资产	3,034.42	0.00
7	合计	2,493,374,652.58	100.00

注:上述股票投资包括可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末指数投资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	25,882,669.26	1.05
B	采掘业	509,566,139.39	20.73
C	制造业	394,277,153.98	16.04
C0	食品、饮料	20,844,823.20	0.85
C1	纺织、服装、皮毛	44,756,153.33	1.82
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	60,884,133.32	2.48
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	142,664,611.26	5.80
C7	机械、设备、仪表	31,680,978.64	1.29
C8	医药、生物制品	75,217,374.63	3.06
C99	其他制造业	18,229,079.60	0.74
D	电力、煤气及水的生产和供应业	197,543,479.49	8.04
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	178,459,386.12	7.26
G	信息技术业	25,385,380.20	1.03
H	批发和零售贸易	47,630,337.20	1.94
I	金融、保险业	969,033,281.43	39.43
J	房地产业	18,910,481.49	0.77
K	社会服务业	40,032,078.88	1.63
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,406,720,387.44	97.92

注:上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

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

5.3.1报告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

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	601328	交通银行	55,668,975	305,065,983.00	12.41
2	601398	工商银行	41,786,722	177,175,701.28	7.21
3	600030	中信证券	13,755,385	173,180,297.15	7.05
4	601006	大秦铁路	16,112,952	126,003,284.64	5.13
5	601939	建设银行	26,435,695	121,339,840.05	4.94
6	600348	国阳新能	3,307,520	94,859,673.60	3.86
7	600028	中国石化	11,441,739	92,220,416.34	3.75
8	600019	宝钢股份	14,366,716	91,803,315.24	3.74
9	600015	华夏银行	8,228,376	89,689,298.40	3.65
10	601857	中国石油	7,592,509	85,187,950.98	3.47

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,034.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,034.42

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

5.8.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:截至本报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

§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	1,625,175,703.00
本报告期基金总申购份额	286,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	785,500,000.00
本报告期期末基金份额总额	1,125,675,703.00

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准上证红利交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

2、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

4、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、上证红利交易型开放式指数证券投资基金的公告

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
2011年1月22日

华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

【2010】第四季度报告

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2011年1月22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2011年1月21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2010年10月1日起至2010年12月31日止。

本基金名称自2010年4月30日起,由"友邦华泰盛世中国股票"更名为"华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金",基金简称为"华泰柏瑞盛世中国股票",基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见2010年4月30日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰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	13,029,546,398.67 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(2010年10月1日 - 2010年12月31日)
1.本期已实现收益	456,431,084.45
2.本期利润	947,571,899.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.0708
4.期末基金资产净值	9,132,652,495.84
5.期末基金份额净值	0.7009

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	11.48%	1.66%	4.53%	1.21%	6.95%	0.45%

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、图示日期为2005年4月27日至2010年12月31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0%-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、投资部总监	2009年11月18日	-	16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22日起兼任华泰柏瑞量化先行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