华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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:2013年8月26日

§1 重要提示

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一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2013年8月23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2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞盛世中国股票
基金主代码	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
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	8,463,280,500.50份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

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	95566
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942

2.4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

§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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	-186,928.21
本期利润	203,490,867.74
加权平均基金份额本期利润	0.0223
本期基金份额净值增长率	3.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1798
期末基金资产净值	4,484,457,631.19
期末基金份额净值	0.5299

注:1.区间基金资产净值增长率不包括持有人认购或交易基础费的各项费用,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)累计扣减相关费用后的余额,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 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	-7.68%	1.69%	-10.77%	1.31%	3.09%	0.38%
过去三个月	0.08%	1.29%	-7.69%	1.00%	7.77%	0.29%
过去六个月	3.15%	1.31%	-7.64%	1.03%	10.79%	0.28%
过去一年	2.14%	1.10%	-5.51%	0.93%	7.65%	0.17%
过去三年	1.46%	1.18%	-6.00%	0.95%	7.46%	0.23%
自基金合同生效日起至今	213.42%	1.51%	120.45%	1.31%	92.97%	0.20%

注:本基金的业绩基准由中信标普300指数和中信国债指数按照70%与30%之比构建,并按日进行再平衡。

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:图示日期为2005年4月27日至2013年6月30日。

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 基金管理人及其经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本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、华泰柏瑞价值精选股票型证券投资基金、华泰证券投资基金、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、华泰柏瑞盛世洲际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、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和华泰柏瑞健收益债券型证券投资基金。截至2013年6月30日,公司的公募基金管理规模为296.16亿元。

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
汪晖	本基金的基金经理、投资总监	2009年11月18日	-	19年	19年证券投资从业经历,工学硕士、经济学硕士。2004年7月加入本公司,曾任华泰柏瑞(原友邦华泰)稳本增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金、华泰柏瑞(原友邦华泰)价值增长股票型证券投资基金的基金经理。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(原友邦华泰)盛世中国股票型证券投资基金的基金经理。2009年12月起任投资部总监。2011年2月起任投资总监。
张谊	本基金的基金经理	2012年6月29日	2013年4月16日	8	张谊先生,8年证券(基金)从业经验。经济学硕士。曾任职于中银万国证券股份有限公司、上海中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。

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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定,在严格控制风险的基础上,忠实履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司按投资管理能和交易执行职能完全隔离,实行集中交易制度,由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务,为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况,不属业务类别的投资经理之间互不干扰,独立做出投资决策。公司机构设置合理,公平交易的相关管理制度健全,投资决策流程完善,各项制度执行情况良好。

交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待,不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现,报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平,只在少数情况下,存在显著的倾向性。针对这些少数情况,我们是审慎地认定其为合理的投资决策,交易价差方向没有规律性,即没有明确的利益输送方向。同时通过对公司投资决策流程的核查(在市场上显著规模的0.5%),因此不构成利益输送。造成少量显著交易价差的原因来自两方面:一是股指期货因跟踪指数的波动幅度较大,为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件;二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异,对证券买卖时点的把握也不同,导致股票买卖存在价差。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前控期和检查,交易部负责对异常交易行为的事中监督和控期,风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内,该制度执行情况良好,无论在一级市场还是在大宗交易或者一级市场中购等交易中,均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期内公司旗下基金所管理的投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量5%的同日反向交易。

4.4 管理人对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

进入2013年,中国经济宏观政策都发生较大变化。一季度,货币政策取向紧松,人民币持续升值,资金日等发达经济体定量宽松,外汇占款持续增加使国内货币信贷环境出现持续相对宽松。货币供给M1、M2和社会融资总额增速趋势性上升,特别是社会融资总额增长,一季度增速达到58%,为近五年来仅次于2009年99%的次高点。流动性充裕给一季度股市带来较好投资机会,周期价值股和成长股均有较好表现,沪深300指数在银行股带动下从2012年末的2108点上涨至2013年2月2791点,涨幅达到32%。但是,宽松的信贷和融资环境并没有使中国经济遵循历史规律复苏上的动力,经济增速持续趋势性恶化,工业增加值、投资量、发电量和PMI等不断走低。同时,环境问题等一系列非反民生因素的不断越发突出,扩张性宏观经济政策不再是中国经济的灵丹妙药。二季度,货币环境开始转向趋紧,经济增长的威胁越来越明确,市场对传统产业盈利预期下降,对改革和新兴产业预期强烈,如环保、医药、TMT等。市场风格迅速从周期价值转向成长,成长股大幅度上涨,周期股震荡下跌。上半年,代表成长风格的创业板指数上涨41.72%,而沪深300指数则下跌12.78%。行业方面,TMT上涨最过20%和医药涨幅也达到17%,煤炭、有色、钢铁和非银行金融则跌幅超过20%。

本基金上半年保持大类资产配置稳定,配置方面由价值转向成长,注重自下而上精选个股获取超额收益。上半年,本基金净值增长率为3.15%,高于业绩基准10.79个百分点。

4.4.2 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0.5299元,本报告期份额净值增长率为3.15%,同期业绩比较基准增长率为-7.64%。

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2013年下半年,本基金认为市场将继续呈现震荡格局,以沪深300为代表的整体市场缺乏系统性机会,难以形成新牛市推动力,但是个股机会将持续不断。中国经济已经拉开改革和转型序幕,政府力图打造经济增长升级版,意味着传统经济增长方式遭遇困境,而新的增长动力处于萌芽阶段的状态。从货币政策角度看,面对金融机构和实体经济高杠杆,防控金融风险和加快经济结构方面要求使货币政策回归中性,流动性推动的市场机会难以再现。在丧失刺激政策的背景下中国经济还将运行于回落趋势中,总需求不振的局面短期很难改变。经济下行和货币偏紧的组合对整体市场不利。成长股经历了上半年大幅度上涨,估值较高,风险累积。下半年可能有一个去伪存真的过程,伪成长将风险暴露,真成长将占益本盈。

本基金将继续保持原有的投资策略,耐心等待机会,进一步强化自下而上精选企业思路,紧紧把握改革预期和行业景气运行态势,精选个股,争取获得超额收益。

4.6 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。参与估值程序的人员包括负责证券估值的投研团队以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人,基金经理人参与估值决策程序。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利益关系和冲突,已实用的估值技术相关参数或定价服务均采用独立第三方。

4.7 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6次;全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的90%;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-1,522,061,002.36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")在对华泰柏瑞盛世中国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:华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		527,478,116.05	243,412,854.17
结算备付金		8,639,171.88	6,648,437.98
存出保证金		1,389,592.33	4,250,000.00
交易性金融资产		3,808,128,953.37	5,081,264,899.28
其中:股票投资		3,303,142,124.87	4,928,479,899.28
基金投资		-	-
债券投资		504,986,828.50	152,785,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		109,990,269.99	169,970,687.46
应收证券清算款		34,877,278.95	25,469,867.65
应收利息		10,673,386.30	2,459,642.85
应收股利		163,870.58	-
应收申购款		69,688.23	15,292.85
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		4,501,410,327.68	5,533,491,682.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,349,333.70	2,255,308.27
应付管理人报酬		5,722,671.31	6,570,579.99
应付托管费		953,778.56	1,095,096.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		5,686,822.67	4,939,573.66
应交税费		214,950.00	214,950.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		3,025,140.25	5,604,124.54
负债合计		16,952,696.49	20,679,633.13
所有者权益:			
实收基金		3,541,038,941.22	4,490,113,893.98
未分配利润		943,418,689.97	1,022,698,155.13
所有者权益合计		4,484,457,631.19	5,512,812,049.11
负债和所有者权益总计		4,501,410,327.68	5,533,491,682.24

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.5299元,基金份额总额8,463,280,500.50份。

6.2 利润表

会计主体:华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		267,875,832.29	153,165,624.53
1.利息收入		7,567,280.82	8,243,685.06
其中:存款利息收入		1,399,427.52	3,369,727.91
债券利息收入		5,461,572.20	3,931,191.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		706,281.10	942,765.57
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		56,234,159.51	-122,486,935.61
其中:股票投资收益		35,573,722.67	-158,165,570.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益		109,860.67	36,460.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		20,550,576.17	35,642,174.43
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		203,677,795.95	267,291,987.56
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		396,596.01	116,887.52
减:二、费用		64,384,964.55	74,296,945.07
1.管理人报酬		36,724,753.82	48,720,017.81
2.托管费		6,120,792.28	8,120,002.98
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		21,291,062.17	17,201,919.00
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		248,356.28	255,005.28
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		203,490,867.74	78,868,679.46
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		203,490,867.74	78,868,679.46

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	4,490,113,893.98	1,022,698,155.13	5,512,812,049.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	203,490,867.74	203,490,867.74
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)	-949,074,952.76	-282,770,332.90	-1,231,845,285.66
其中:1.基金申购款	12,246,298.19	3,533,733.91	15,780,032.10
2.基金赎回款	-961,321,250.95	-286,304,066.81	-1,247,625,317.76
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)	3,541,038,941.22	943,418,689.97	4,484,457,631.19
项目	上年度可比期间 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)	5,271,231,223.24	1,187,022,016.95	6,458,253,240.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	78,868,679.46	78,868,679.46
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)	-109,893,549.51	-27,804,151.19	-137,697,700.70
其中:1.基金申购款	41,286,462.25	11,999,759.61	53,286,221.86
2.基金赎回款	-151,180,011.76	-39,803,910.80	-190,983,922.56
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)	5,161,337,673.73	1,238,086,545.22	6,399,424,218.95

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____

基金管理人负责人 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

华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金(原友邦华泰盛世中国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[2005]第19号《关于同意友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金设立的批复》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《华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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900,348,752.84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(2005)第48号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金合同》于2005年4月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为900,519,775.77份基金份额,其中认购资金利息折合171,022.93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。

根据本基金招募说明书和《友邦华泰基金管理有限公司关于友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定,本基金于2007年9月3日进行了基金份额拆分,拆分比例为2.390029438,并于2007年9月4日进行了变更登记。因基金管理人更名,经中国证监会批准,本基金名称自2010年4月30日起由"友邦华泰盛世中国证券投资基金"更名为"华泰柏瑞盛世中国证券投资基金",基金简称为"华泰柏瑞盛世中国股票"。基金代码保持不变。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞盛世中国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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金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%。此外,本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的资产比例合计不低于基金净资产的5%。本基金的业绩比较基准为:中信标普300指数×70%+中信国债指数×30%。

本财务报表由本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2013年8月26日批准报出。

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》、《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的划时界报表附注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2013年1月1日至2013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2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至2013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[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,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)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票的差价收入、股权的股息、红利收入其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时计入个人应纳税所得额。个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

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
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
华泰联合证券有限责任公司	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

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

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	491,336,144.68	3.65%	310,986,205.50	2.78%
华泰联合证券有限责任公司	-	-	163,865,739.28	1.46%

6.4.8.1.2 权证交易

注:无。

6.4.8.1.3应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券股份有限公司	434,783.46	3.60%	182,723.32	3.22%
	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日			
关联方名称	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券股份有限公司	252,679.67	2.69%	90,910.14	2.31%
华泰联合证券有限责任公司	139,286.58	1.48%	-	-

注:上述佣金按股票交易量的千分之一计算,以扣除证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

关联方的佣金比率和计算方式与非关联方一致。

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	36,724,753.82	48,720,017.81
其中:支付销售机构的客户维护费	6,935,958.61	7,173,813.87

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1.50%的年费率计提,计算方法如下:

H = E × 1.50% ÷ 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

基金管理人报酬每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,120,792.28	8,120,002.98

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0.25%的年费率计提,计算方法如下:

H = E × 0.25% ÷ 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,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.2.3 销售服务费

注:无。

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:本基金本期与上年度可比期间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

注:本报告期及2012年度,基金管理人未投资本基金。

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:本报告期及2012年度,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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	527,478,116.05	1,297,272.37	643,670,571.41	3,283,874.93

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

金额单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入 数量(单位:份)	总金额
华泰联合证券有限责任公司	71301003	13招商CP003	招标发行	500,000	49,987,500.00
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入 数量(单位:份)	总金额

注:无。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

6.4.9.2 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
000999	华润三九	2013年6月3日	重大事项	29.60	2013年8月19日	26.51	857,430	25,178,938.85	25,379,928.00	-
600292	九龙电力	2013年6月5日	重大事项	19.37	2013年7月1日	17.50	961,812	16,944,427.35	18,630,298.44	-
300027	华谊兄弟	2013年6月5日	重大事项	28.55	2013年7月24日	31.41	99,965	1,726,695.16	2,854,000.75	-
600598	北大荒	2013年5月27日	重大事项	8.35	2013年7月19日	8.35	200,000	1,686,700.00	1,670,000.00	-
600436	片仔癀	2013年6月21日	重大事项	136.82	2013年7月1日	118.73	8,920	853,030.61	1,220,434.40	-
601989	中国重工	2013年5月17日	重大事项	4.52	-	-	190,000	856,027.24	858,800.00	-
300326	凯利泰	2013年6月17日	重大事项	35.55	-	-	18,614	607,641.99	661,727.70	-
300020	银汇股份	2013年6月3日	重大事项	22.67	-	-	18,950	357,770.31	429,596.50	-

注:1.本基金截至2013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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注: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	3,303,142,124.87	73.38
	其中:股票	3,303,142,124.87	73.38
2	固定收益投资	504,986,828.50	11.22
	其中:债券	504,986,828.50	11.22
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	109,990,269.99	2.44
	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	536,117,287.93	11.91
6	其他各项资产	47,173,816.39	1.05
7	合计	4,501,410,327.68	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,670,000.00	0.04
B	采矿业	26,112,155.94	0.58
C	制造业	1,886,393,820.41