

华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

因经济可能相关的“稳增长”政策措施近期已经开始发挥作用，基建投资在很大程度上正在对冲房地产和制造业投资的下行风险，这使得固定资产配置风险仍在下降，但是下滑的幅度在中间层段。过去几个月的数据都表明明显的回升，这应该是跟支持外贸稳增长的政策措施有较大的关系。

综上所述，与前期逻辑与结论基本一致，估值处于历史底部决定了市场下跌的空间相对有限，几个月的数据可能引发市场一定的反弹，但基本面疲弱态势决定了市场难以有趋势性机会。量化先行基金将按照既定的措施继续执行，以业绩成长性、估值和市场温度三个方向继续寻找以合理价格成长的目标公司。

4.6 管理人对于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对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制 and 基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。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任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
根据基金合同的约定，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4次；每次分配比例不低于基金期末可分配利润的10%；基金收益分配后每份基金份额净值不能低于面值。本报告期内，基金未进行利润分配。

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”）在华泰柏瑞量化先行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约定，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内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人对本半年度报告中的财务指标、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”部分不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。

5.4 半年度财务会计报告（未经审计）
6.1 资产负债表
会计主体：华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金
报告截止日：2014年6月30日

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货币资金		3,863,797.88	5,354,254.23
结算备付金		92,654.25	1,612,680.78
交易性金融资产		52,654.56	20,376.49
应收款项类金融资产		60,093,843.22	96,977,497.81
买入返售金融资产		60,093,843.22	96,977,497.81
可供出售金融资产		-	-
持有至到期投资		-	-
长期股权投资		-	-
投资性房地产		-	-
固定资产		-	-
无形资产		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		69,110,133.68	112,197,965.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
应付短期融资券		-	-
应付账款		-	-
预收账款		-	-
应付利息		-	-
应付股利		-	-
其他负债		-	-
负债合计		-	-
所有者权益：			
实收基金		83,750,046.26	118,890,940.09
未分配利润		-15,112,094.19	-7,740,648.83
所有者权益合计		68,637,952.07	111,150,291.26
负债和所有者权益总计		69,110,133.68	112,197,965.69

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.820元，基金份额总额83,750,046.26份。

6.2 利润表
会计主体：华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金
本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		-12,846,081.03	-2,540,707.03
1.利息收入		153,344.29	224,187.46
其中：存款利息收入		28,987.27	36,877.27
债券利息收入		-	51.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		124,357.02	187,258.81
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-8,972,183.44	13,197,491.67
其中：股票投资收益		-9,600,292.73	11,850,135.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
其他投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		628,109.29	1,335,665.57
4.其他收入（损失以“-”号填列）		-4,055,397.37	-15,964,527.50
5.其他收入（损失以“-”号填列）		28,155.49	2,141.34
减：费用		1,481,506.09	1,075,812.53
1.管理人报酬		715,825.12	809,579.15
2.托管费		125,304.14	148,929.85
3.销售服务费		-	-
4.其他费用		488,066.17	540,673.02
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他		116,315.66	92,632.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,327,587.12	-4,216,519.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,327,587.12	-4,216,519.56

6.3 所有者权益（基金净值）变动表
会计主体：华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金
本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初基金份额总额		118,890,940.09	118,890,940.09
二、本期基金份额变动		-35,140,893.83	6,956,341.76
其中：1.基金申购款		12,884,245.17	11,289,082.12
2.基金赎回款		-48,025,139.00	8,551,504.81
三、期末基金份额总额		83,750,046.26	125,847,321.85

注：基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司在上半年度购入本基金的交易委托华泰证券办理，适用手续费1.00020%。

6.4.1 基金份额持有人户数、户数及持有人结构
报告期末基金份额持有人户数及持有人结构

序号	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数
1	1	1	1	1
2	1	1	1	1
3	1	1	1	1
4	1	1	1	1
5	1	1	1	1
6	1	1	1	1
7	1	1	1	1
8	1	1	1	1
9	1	1	1	1
10	1	1	1	1
11	1	1	1	1
12	1	1	1	1
13	1	1	1	1
14	1	1	1	1
15	1	1	1	1
16	1	1	1	1
17	1	1	1	1
18	1	1	1	1
19	1	1	1	1
20	1	1	1	1
21	1	1	1	1
22	1	1	1	1
23	1	1	1	1
24	1	1	1	1
25	1	1	1	1
26	1	1	1	1
27	1	1	1	1
28	1	1	1	1
29	1	1	1	1
30	1	1	1	1

注：基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司在上半年度购入本基金的交易委托华泰证券办理，适用手续费1.00020%。

6.4.2 基金份额持有人户数、户数及持有人结构
报告期末基金份额持有人户数及持有人结构

序号	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数
1	1	1	1	1
2	1	1	1	1
3	1	1	1	1
4	1	1	1	1
5	1	1	1	1
6	1	1	1	1
7	1	1	1	1
8	1	1	1	1
9	1	1	1	1
10	1	1	1	1
11	1	1	1	1
12	1	1	1	1
13	1	1	1	1
14	1	1	1	1
15	1	1	1	1
16	1	1	1	1
17	1	1	1	1
18	1	1	1	1
19	1	1	1	1
20	1	1	1	1
21	1	1	1	1
22	1	1	1	1
23	1	1	1	1
24	1	1	1	1
25	1	1	1	1
26	1	1	1	1
27	1	1	1	1
28	1	1	1	1
29	1	1	1	1
30	1	1	1	1

注：基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司在上半年度购入本基金的交易委托华泰证券办理，适用手续费1.00020%。

6.4.3 基金份额持有人户数、户数及持有人结构
报告期末基金份额持有人户数及持有人结构

序号	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数
1	1	1	1	1
2	1	1	1	1
3	1	1	1	1
4	1	1	1	1
5	1	1	1	1
6	1	1	1	1
7	1	1	1	1
8	1	1	1	1
9	1	1	1	1
10	1	1	1	1
11	1	1	1	1
12	1	1	1	1
13	1	1	1	1
14	1	1	1	1
15	1	1	1	1
16	1	1	1	1
17	1	1	1	1
18	1	1	1	1
19	1	1	1	1
20	1	1	1	1
21	1	1	1	1
22	1	1	1	1
23	1	1	1	1
24	1	1	1	1
25	1	1	1	1
26	1	1	1	1
27	1	1	1	1
28	1	1	1	1
29	1	1	1	1
30	1	1	1	1

注：基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司在上半年度购入本基金的交易委托华泰证券办理，适用手续费1.00020%。

6.4.4 基金份额持有人户数、户数及持有人结构
报告期末基金份额持有人户数及持有人结构

序号	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数
1	1	1	1	1
2	1	1	1	1
3	1	1	1	1
4	1	1	1	1
5	1	1	1	1
6	1	1	1	1
7	1	1	1	1
8	1	1	1	1
9	1	1	1	1
10	1	1	1	1
11	1	1	1	1
12	1	1	1	1
13	1	1	1	1
14	1	1	1	1
15	1	1	1	1
16	1	1	1	1
17	1	1	1	1
18	1	1	1	1
19	1	1	1	1
20	1	1	1	1
21	1	1	1	1
22	1	1	1	1
23	1	1	1	1
24	1	1	1	1
25	1	1	1	1
26	1	1	1	1
27	1	1	1	1
28	1	1	1	1
29	1	1	1	1
30	1	1	1	1

注：基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司在上半年度购入本基金的交易委托华泰证券办理，适用手续费1.00020%。

6.4.5 基金份额持有人户数、户数及持有人结构
报告期末基金份额持有人户数及持有人结构

序号	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数
1	1	1	1	1
2	1	1	1	1
3	1	1	1	1
4	1	1	1	1
5	1	1	1	1
6	1	1	1	1
7	1	1	1	1
8	1	1	1	1
9	1	1	1	1
10	1	1	1	1
11	1	1	1	1
12	1	1	1	1
13	1	1	1	1
14	1	1	1	1
15	1	1	1	1
16	1	1	1	1
17	1	1	1	1
18	1	1	1	1
19	1	1	1	1
20	1	1	1	1
21	1	1	1	1
22	1	1	1	1
23	1	1	1	1
24	1	1	1	1
25	1	1	1	1
26	1	1	1	1
27	1	1	1	1
28	1	1	1	1
29	1	1	1	1
30	1	1	1	1

注：基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司在上半年度购入本基金的交易委托华泰证券办理，适用手续费1.00020%。

6.4.6 基金份额持有人户数、户数及持有人结构
报告期末基金份额持有人户数及持有人结构

序号	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数	基金份额持有人户数
1	1	1	1	1
2	1	1	1	1
3	1	1	1	1
4	1	1	1	1
5	1	1	1	1
6	1	1	1	1
7	1	1	1	1
8	1	1	1	1
9	1	1	1	1
10	1	1	1	1
11	1	1	1	1
12	1	1	1	1
13	1	1	1	1
14	1	1	1	1
15	1	1	1	1
16	1	1	1	1
17	1	1	1	1
18	1	1	1	1
19	1	1	1	1
20	1	1	1	1
21	1	1	1	1
22	1	1	1	1
23	1	1	1	1
24	1	1	1	1
25	1	1	1	1
26	1	1	1	1
27	1	1	1	1
28	1	1	1	1
29	1	1	1	1
30	1	1	1	1

注：基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司在上半年度购入本基金的交易委托华泰证券办理，适用手续费1.00020%。

6.4.7 基金份额持有人户数、户数及持有人结构
报告期末基金份额持有人户数及持有人结构

其中:卖出回购金融资产支出	-	-	6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
6.其他费用	116,315.56	92,632.51	注:无。
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-14,327,587.12	-4,216,519.56	6.4.8.7 其他关联交易事项的说明
减:所得税费用	-	-	无。
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-14,327,587.12	-4,216,519.56	6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券