

华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金 2011 年第 4 季度报告

2011 年 12 月 31 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

报告送出日期：2012 年 1 月 20 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 2012 年 1 月 19 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 2011 年 10 月 1 日起至 2011 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 华泰柏瑞亚洲领导企业股票(QDII) |
| 交易代码 | 460010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010 年 12 月 2 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 93,677,415.14 份 |
| 投资目标 | 采取主动精选亚洲地区具有行业领导地位和国际竞争优势的企业，通过区域化分散投资，有效降低投资组合系统性风险，追求基金资产长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金投资研究团队将跟踪全球经济的发展趋势，重点研究亚洲地区内的宏观经济变量，采用自上而下的分析方法，以及定性和定量分析模型相结合的手段，确定基金资产在各国家/地区之间的配置。综合分析亚洲地区内的宏观经济指标、公司盈利发展趋势、资金流向、价格变动、社会政治风险、产业结构性风险等要素，采用专有定量模型作为参考工具，以确定各国股市的相对吸引力。通过将市场预期的净资产收益率、市净率及长期债券收益率等多种金融市场变量输入该模型，来确定各个市场的价值中枢，作为估值标准。 |
| 业绩比较基准 | MSCI 亚太综合指数(不含日本) |
| 风险收益特征 | 本基金为区域性股票型证券投资基金，基金预期投资风险收益水平高于混合型基金和债券型基金。由于投资国家与地区市场的分散，长期而言风险应低于投资单一市场的股票型基金。 |
| 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 |

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外资产托管人 |
|------|----|----------------------------------|
| 名称 | 英文 | Bank of China (HongKong) Limited |
| | 中文 | 中国银行（香港）有限公司 |
| 注册地址 | | 香港花园道 1 号中银大厦 |
| 办公地址 | | 香港花园道 1 号中银大厦 |

注：本基金不聘请境外投资顾问，华泰柏瑞基金管理有限公司对全部资产进行自行管理。

§ 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（2011 年 10 月 1 日 — 2011 年 12 月 31 日） |
|-----------------|---|
| 1. 本期已实现收益 | -3,653,273.99 |
| 2. 本期利润 | 1,269,788.87 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0133 |
| 4. 期末基金资产净值 | 70,354,050.90 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.751 |

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。

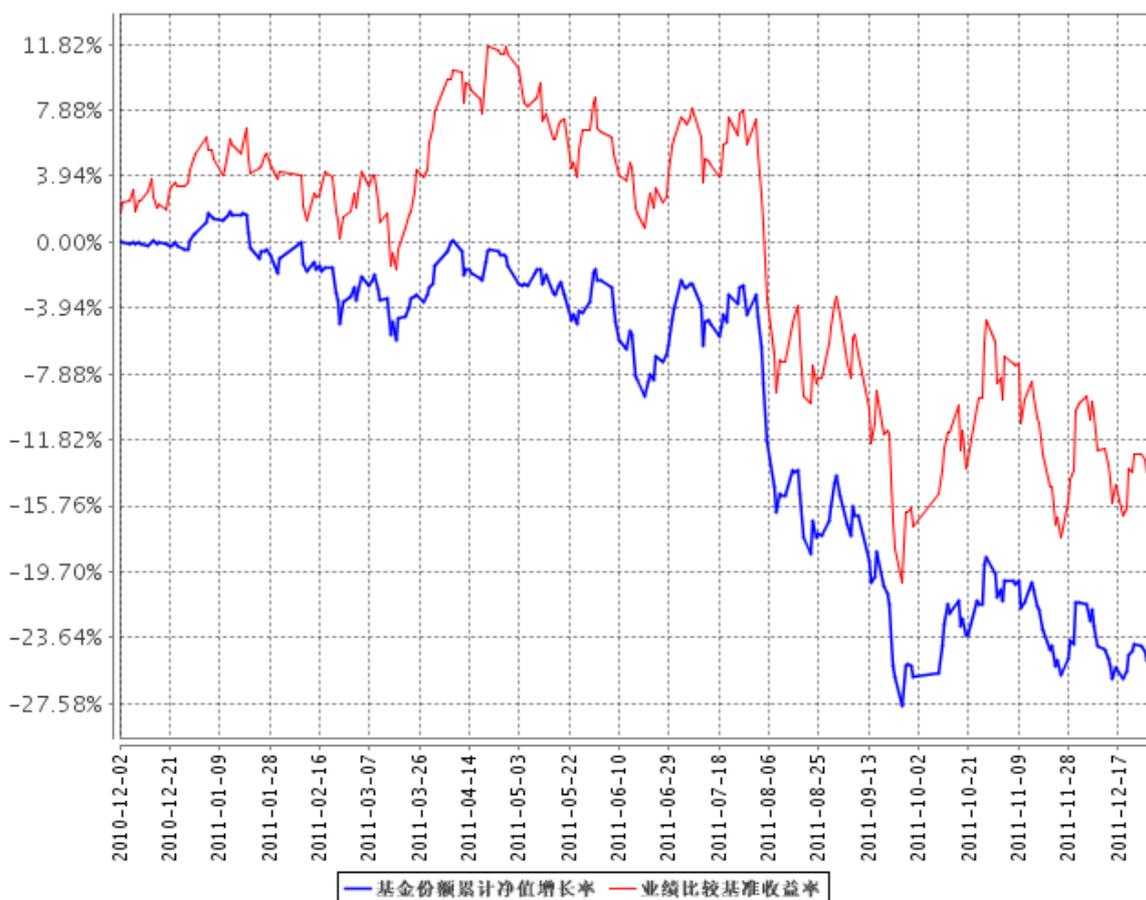
3.2 基金净值表现

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 | 1.49% | 1.22% | 3.96% | 1.73% | -2.47% | -0.51% |

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2010 年 12 月 2 日至 2011 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十四条（三）投资范围中基金投资组合比例限制中规定的各项比例，股票占基金资产的比例不低于 60%；债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例不高于 40%，其中，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金不低于 80%的权益类资产将投资于亚洲领导企业。

§ 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 | | |
| 李文杰 | 本基金的基金经理、海外投资部总 | 2010 年 12 月 2 日 | - | 12 | 李文杰先生, 香港中文大学工商管理学士, 特许金融分析师 (CFA)。1998 年-1999 年, 任香港大福证券有限公 |

| | | | | | |
|-----|-------------------|-----------------|---|----|---|
| | 监 | | | | 司客户经理；1999 年-2004 年于香港 AIGGIC, 历任交易员、资深投资分析员等职位；2004 年加入本公司, 2004 年-2007 年, 任华泰柏瑞（原友邦华泰）盛世中国股票基金基金经理。2007 年-2009 年任阿拉伯联合酋长国阿布扎比投资局组合经理。2009 年 9 月再次加入本公司, 任海外投资部总监。2010 年 12 月起任华泰柏瑞亚洲领导企业股票基金基金经理。 |
| 黄明仁 | 本基金的基金经理、海外投资部副总监 | 2010 年 12 月 2 日 | - | 12 | 黄明仁先生, 美国西雅图华盛顿大学财务金融专业管理学硕士, 具有 11 年以上境外证券投资管理经验。2004-2006 年, 任台湾建弘投资信托股份有限公司, 建弘泛太平洋基金基金经理；2006-2008 年中, 加入英国保诚投资信托股份有限公司, 任保诚印度基金基金经理。2008 年加入本公司, 现任海外投资部副总监。2010 年 12 月起任华泰柏瑞亚洲领导企业股票基金基金经理。 |

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金不聘请境外投资顾问，华泰柏瑞基金管理有限公司对全部资产进行自行管理。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

4.4.1 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。

首先海外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资指令的合规性、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内的公平交易模块，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。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

亚洲市场回顾

亚太股市经历了3季度的大幅度调整后，10月份开始了强劲反弹的态势。MSCI 亚太指数 (MXAPJ) 从3季度的最低点354反弹到10月底437水平，随后重新进入调整，MXAPJ波动在2011年结束前震荡上下，波幅逐渐收窄，在整个四季度，MXAPJ涨幅为3.96%，相对3季度21%的下跌，4季度市场呈现企稳的迹象，全年MXAPJ下跌17.98%。

市场关注的重点还是欧洲债务问题。10月初的时候，希腊债务救助方案和欧洲稳定机制 (EFSF) 的方案还处于不确定的状态，尽管市场不断有不同版本的传言和消息，但由于前期下跌幅度已经过大，市场对坏消息已经有所免疫，和9月份不同的是，外资撤出亚洲市场的压力在4季度大幅减缓，10月份开始看到有外资进入亚洲市场迹象，所以也对市场稳定也带来一定的支持。10月底，法德两国和其他欧盟国家达成共识对私营部门希腊国债的减计初步目标、扩大EFSF计划的敲定和对欧洲银行融资的计划，这一程度化解市场的疑虑；

从11月份开始，市场关注点从希腊转移到意大利，意大利的国债收益率突破了7%，而7%的收益率也是市场认为主权债务是否将会出现违约的警戒线，因为发债国家在大幅上升的市场利率情况下将大大提高他们未来的融资成本，而大幅上升的融资成本将令到这些国家更加难以从衰退中走出，形成恶性循环。为了要通过经济改革的方案，意大利总理贝卢斯科尼也从这次事件中下台，市场一般认为新任总理蒙蒂将是更佳的人选应对当前的危机，虽然市场信心短期有所恢复但消息过后还是继续走弱。

欧洲央行于 2011 年 12 月 9 日欧盟峰会后提出两个三年期的“长期再融资计划”（LTRO）。市场认为欧洲央行的 LTRO 计划类似于欧洲版 QE（欧洲版量化宽松），将一定程度化解当前欧洲银行间的流动性问题和压低主权债务国的债券市场利率。LTRO 计划总量涉及 523 家欧洲银行，4890 亿欧元贷款。贷款利息只有 1%。欧洲央行为了更多的欧洲银行能够参与本次借贷，首先将贷款利息从 2%降至 1%，其次降低了抵押物标准，除了可以抵押欧元区国家主权债务，也可以抵押对中小企业的贷款。欧洲央行出台 LTRO 的目的主要是希望欧洲银行获得 1%低息长期贷款后可以拿去购买高息的债务国国债，比如西班牙、意大利的国债（近期利率分别在 5%、6%左右），通过套利利息差（4%、5%左右）一来补充欧洲银行业的流动性，二来可以提高市场对于主权债务国国债的认购率，从而降低欧洲央行直接购买债务国国债的现金压力。意大利随后两轮的国债拍卖反应中规中矩，短期债券中标利率有大幅度的下跌，但 12 月 30 日的国债拍卖却未能达到预期规模只拍卖了 70 亿欧元，虽然 3 年期国债中标价格相对 11 月 29 日的利率从 7.89%下降到 5.62%，但长期国债（7 年、10 年）的拍卖中标利率还是徘徊在 7%警戒线水平。

欧洲各国还是继续寻找解决债务问题的方案，在 12 月 9 日的峰会结束后，各国已初步达成在财政方面需要有纪律性的约束，但具体实施细则可能还需要各国稍后公布。欧债问题短期应该不可能有彻底解决的方法，因为问题的核心还是各问题国家的偿付能力问题，要彻底挽回市场信心还是需要欧洲央行能发债购买欧洲国家的债券，在此议题上，目前德国总理是明确表明不会妥协，欧债问题还是处于不明朗状态，进入 2012 年还可能会继续困扰市场，带来一定市场波动。

香港市场

香港市场从 10 月份开始大幅反弹。恒生指数 10 月份反弹幅度将近 4000 点，和其他亚太股市一样，香港市场波幅在 2011 年结束前趋于收窄，进入 12 月份市场交投气氛明显清淡，机构投资人都提前休假，希望动荡的 2011 年快点结束，迎接 2012 年新的开始。

4 季度围绕中国经济的核心问题还是宏观调控，媒体大幅度负面报道温州等地区出现企业主跑路事件和中小企业资金链断裂问题。此前市场已经非常担心银行坏账问题，中小企业资金链断裂问题只是验证了市场早前的其中一些担忧，市场越来越担心中国经济会出现硬着陆的风险。从乐观角度看，实体经济由于流动性和信贷紧缩已出现了一系列的负面的迹象，证明宏观调控已经

达到初步的成果，物价已经开始见顶回落，CPI 已从高点 6.5%水平下降到 11 月的 4.2%。另外房地产价格上涨也已经受到控制，政府进一步收紧经济已显得没有必要。11 月份，温总理公开讲话提到宏观经济政策应该有一定的前瞻性，在适当时候进行微调，尤其是当前欧债危机令到国际形势比较复杂。市场开始演绎政府下一步可能开始出台放松政策，而随后国家也出台一系列针对中小型企业政策和增值税改革等措施，以缓解企业经营压力。人民银行 12 月初公布了银行准备金率下调，是 08 年底以来的首次下调，也可能意味着本轮宏观政策拐点已经出现，虽然政府还会因应物价上行风险避免过分放松，但未来流动性和贷款情况将有所改善。

12 月，铁道部公布了 2012 年铁路投资的计划，其中基本建设 4000 亿元。该数据比市场预期 2012 年铁路投资计划要低。相关消息引起香港铁路相关公司的股价调整。总的而言，投资方面除了保障房外，其他领域在十二五期间的成长性可能并没有超出市场预期的空间。国家为了维持经济的平稳增长，更多的手段可能还是放在刺激消费和改善收入方面。2012 年的投资方向还是继续顺着政策指引，从中国经济结构调整过程中寻找机会。

韩国、台湾市场

4 季度中国台湾股市下跌超过 2%，相对韩国股市 KOSPI 指数上涨 3.17%，台股表现相对疲弱。四季度台股受到外资持续卖出股票拖累，外资在台股 2011 年累计卖超 3000 亿元台币，再加上散户投资人皆套牢观望，进场买股意愿不高，使得大盘破底不断测试十年线 6700 点位置；此外，中国台湾的进出口贸易额在 11~12 月份急速下跌，表示实体经济正逐步放缓。韩国方面虽然金正日的突然逝世造成韩国股市下跌，但韩国股市在亚洲区表现相对抗跌，主要是韩国前几大龙头企业如三星电子、现代汽车等在全球的出口市场持续增加市场份额，尤其在中国、俄罗斯等新兴市场的份额不断上升，带动业绩提升而使得股价有支撑；另外韩国的低失业率 3.1%也表示实体经济受到欧美增衰退的冲击较小。在南亚的印度方面，印度 SENSEX 指数在四季度下跌超过 5.53%，在亚洲股市表现最差，主要是印度政府对开放国内批发零售业的政策反复，让外资对印度市场失去信心，造成外资流出，推升印度卢比对美元在四季度贬值超过 7%，也抑制了黄金等大宗商品的需求。展望后市，一季度是希腊、意大利、西班牙等欧元区国家的还债高峰，负面消息仍将影响亚洲股市的走向，建议在一季度采取保守的策略因应。

东南亚市场

2011 第 4 季，除新加坡，东南亚主要股市以高姿态挂收。其中 MSCI 印尼和马来西亚指数环

比上涨 12.3%。泰国和菲律宾分别取得 9%和 7.2%收益。新加坡则下跌 4.1%。值得一提的是所有东南亚市场在第 4 季扭转上季度负收益，显示投资人风险偏好有所上升。东南亚市场在第 3 季环比取得-6.8% 至 -14.9% 收益。

印尼第 4 季度乃至 2011 年全年表现冠绝东南亚，分别取得 12.3%和 4.7%收益。印尼国会通过土地收购法令及 Fitch 上调印尼信用评级成为该国股市上涨催化剂。作为一个防御性高的市场，马来西亚指数罕有上涨 12.3%。企业并购消息和传言全国大选将在 2012 年上旬举行是这一波涨潮主要推手。4 季度泰国也意外取得 9%收益。出乎市场意料的是，该国 70 年来最严重洪灾并未对股市造成很大的影响，投资人可能更早已经消化洪灾对企业的负面影响。但我们认为洪灾的影响最早会在 2012 第一季才反映在企业财报，市场可能过度乐观。意识到经济发展需要和政治考虑，菲律宾政府在第 4 季开始发放基建项目工程招标，市场对菲政府举动的正面回应反映在菲律宾股市。新加坡股市第 4 季度乃至 2011 年都跑输其他市场。这归咎于新加坡经济和世界经济关联度相对其他国家较高，第 4 季度新加坡取得-4.1%收益，2011 全年收益为-20.7%。

4.5.2 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 0.751 元，本报告期份额净值增长率为 1.49%，同期业绩比较基准增长率为 3.96%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年，欧洲债务问题将可能继续困扰市场，1 季度是欧洲国家债务到期高峰期，欧洲国家能否顺利展期到期债务将成为市场关注重点。而另一方面，中国已经开始放松调控政策，但未来经济的增长点还是不能肯定，中国经济处于结构调整的阶段，这并不是短期可以完成的任务的，房地产市场的周期下行带来的风险也是有待关注。尽管 2012 年有一系列风险因素，但我们判断 2012 年是充满机会的一年，主要原因是经历 2011 年的下调，很多股份已经显得非常有吸引力，亚洲国家的通胀已经受控，未来货币政策将会趋于放松，美国经济也出现初步复苏的迹象，也可能带动世界经济重新进入上升轨道。2012 年尽管充满挑战，但我们还是偏向乐观。

§ 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（人民币元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|--------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 52,459,233.23 | 73.34 |
| | 其中：普通股 | 49,337,202.31 | 68.98 |
| | 优先股 | - | - |
| | 存托凭证 | 3,122,030.92 | 4.36 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|---------|
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 944, 141. 22 | 1. 32 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 15, 927, 511. 74 | 22. 27 |
| 8 | 其他资产 | 2, 197, 081. 80 | 3. 07 |
| 9 | 合计 | 71, 527, 967. 99 | 100. 00 |

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 国家（地区） | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|------------------|--------------|
| 新加坡交易所 | 3, 395, 127. 3 | 4. 83 |
| 台湾亚交易所 | 6, 189, 624 | 8. 80 |
| 马来西亚交易所 | 3, 509, 325. 96 | 4. 99 |
| 香港交易所 | 21, 755, 028. 31 | 30. 92 |
| 菲律宾交易所 | 1, 940, 509. 48 | 2. 76 |
| 泰国交易所 | 949, 137. 61 | 1. 35 |
| 印尼交易所 | 4, 915, 234. 42 | 6. 99 |
| 韩国交易所 | 6, 683, 215. 23 | 9. 50 |
| 美国交易所 | 3, 122, 030. 92 | 4. 44 |
| 合计 | 52, 459, 233. 23 | 74. 56 |

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|-------------|------------------|--------------|
| 10 能源 | 1, 745, 972. 16 | 2. 48 |
| 20 工业 | 1, 663, 481. 05 | 2. 36 |
| 25 非日常生活消费品 | 17, 758, 143. 66 | 25. 24 |
| 30 日常消费品 | 6, 258, 566. 86 | 8. 90 |
| 35 医疗保健 | 5, 650, 692. 65 | 8. 03 |
| 40 金融 | 5, 107, 625. 05 | 7. 26 |
| 45 信息技术 | 8, 144, 200. 30 | 11. 58 |

| | | |
|---------|------------------|--------|
| 50 电信业务 | 1, 718, 478. 89 | 2. 44 |
| 55 公用事业 | 4, 412, 072. 61 | 6. 27 |
| 合计 | 52, 459, 233. 23 | 74. 56 |

注：本公司采用的行业分类标准为全球行业分类标准 GICS。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

| 序号 | 公司名称 (英文) | 公司名称 (中文) | 证券代 码 | 所在证券 市场 | 所属国家 (地区) | 数量 (股) | 公允价 值(人 民币 元) | 占基金 资产净 值比例 (%) |
|----|--|---------------|--------------|-------------|--------------|-----------------|------------------------|--------------------------|
| 1 | TOWNGAS CHINA CO LTD | 港华燃气 | 1083 HK | 香港交易 所 | 中国 | 776, 000 | 2, 642, 233. 44 | 3. 76 |
| 2 | CHINA SHINEWAY PHARMACEU TICA | 中国神威 药业 | 2877 HK | 香港交易 所 | 中国 | 262, 000 | 2, 340, 685. 47 | 3. 33 |
| 3 | MINDRAY MEDICAL INTL LTD-ADR | 迈瑞公司 | MR US | 美国交易 所 | 美国 | 14, 313 | 2, 312, 337. 80 | 3. 29 |
| 4 | PHOENIX SATELLITE TELEVISIO N | 凤凰卫视 | 2008 HK | 香港交易 所 | 中国 | 1, 306, 0 00 | 2, 075, 197. 43 | 2. 95 |
| 5 | I. T LTD | I. T 服饰 | 999 HK | 香港交易 所 | 中国 | 598, 000 | 2, 074, 938. 01 | 2. 95 |
| 6 | GUDANG GARAM TBK PT | 盐仓集团 | GGRM IJ | 印尼交易 所 | 印尼 | 47, 500 | 2, 048, 096. 86 | 2. 91 |
| 7 | GLOBAL & YUASA BATTERY CO | YUASA 电 池 | 004490 KS | 韩国交易 所 | 韩国 | 8, 460 | 2, 017, 369. 36 | 2. 87 |
| 8 | JOLLIBEE FOODS CORPORATI ON | 快乐蜂快 餐连锁 | JFC PM | 菲律宾交 易所 | 菲律宾 | 149, 220 | 1, 940, 509. 48 | 2. 76 |
| 9 | INTIME DEPARTMEN T STORE | 银泰百货 | 1833 HK | 香港交易 所 | 中国 | 296, 500 | 1, 910, 961. 77 | 2. 72 |
| 10 | GENTING PLANTATIO NS BHD | GENTING 农业 | GENP MK | 马来西亚 交易所 | 马来西亚 | 104, 700 | 1, 790, 847. 07 | 2. 55 |

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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 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金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------------------|------|--------|---------------|------------|--------------|
| 1 | ISHARES BSE SENSEX INDIA IND | 股票型 | 交易型开放式 | 贝莱德资产管理北亚有限公司 | 944,141.22 | 1.34 |

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（人民币元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,482,964.86 |
| 3 | 应收股利 | 36,967.92 |
| 4 | 应收利息 | 1,559.09 |
| 5 | 应收申购款 | 888.63 |
| 6 | 其他应收款 | 674,701.30 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,197,081.80 |

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 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 | 98,915,110.82 |
| 本报告期基金总申购份额 | 68,638.12 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 5,306,333.80 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 93,677,415.14 |

§ 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
2012 年 1 月 20 日