

华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 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

送出日期：2014 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

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二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 2014 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 10 |
| 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..... | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 12 |
| §5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 12 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表..... | 13 |
| 6.2 利润表..... | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 15 |
| 6.4 报表附注..... | 16 |
| §7 投资组合报告 | 30 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 30 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 31 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 32 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 35 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 37 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 37 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 37 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 37 |
| 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 37 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 38 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 38 |
| §8 基金份额持有人信息 | 38 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 38 |

| | |
|--|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 39 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 39 |
| §10 重大事件揭示..... | 39 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 39 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 39 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 40 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 40 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 40 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 40 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 40 |
| 10.8 其他重大事件..... | 41 |
| §12 备查文件目录..... | 42 |
| 12.1 备查文件目录..... | 42 |
| 12.2 存放地点..... | 42 |
| 12.3 查阅方式..... | 42 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------|
| 基金名称 | 华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 华泰柏瑞量化增强股票 |
| 基金主代码 | 000172 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 8 月 2 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 | 332, 220, 202. 18 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金为指数增强型股票投资基金，在力求有效控制投资风险的前提下，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 本基金力争将对业绩比较基准的年化跟踪误差控制在 8% 以内。 |
| 投资策略 | 本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 指数。以增强指数投资收益为目的的股票投资策略如下：利用定量投资模型（如：多因子 alpha、风险估测、交易成本等模型），选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在严格控制组合预期跟踪误差的基础上，力求超越标的指数投资回报。一般情况下，本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 85%。债券投资策略：将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。同时运用金融衍生工具投资策略和融资融券和转融资转融券。 |
| 业绩比较基准 | 95%× 沪深 300 指数收益率 + 2. 5% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只指数增强型股票投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 |

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 | 王永民 |
| | 联系电话 | 021-38601777 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | cs4008880001@huatai-pb.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-0001 | 95566 |
| 传真 | | 021-38601799 | 010-66594942 |
| 注册地址 | | 上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 | 北京市复兴门内大街 1 号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 | 北京市复兴门内大街 1 号 |
| 邮政编码 | | 200135 | 100818 |
| 法定代表人 | | 齐亮 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 |
| 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 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------|------------------------------------|
| 注册登记机构 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 11,766,356.32 |
| 本期利润 | 15,691,119.05 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0612 |
| 本期加权平均净值利润率 | 5.88% |

| | |
|----------------------|-------------------------|
| 本期基金份额净值增长率 | 4.46% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 25,681,903.41 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0773 |
| 期末基金资产净值 | 357,902,105.59 |
| 期末基金份额净值 | 1.077 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 7.70% |

注：1、所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。

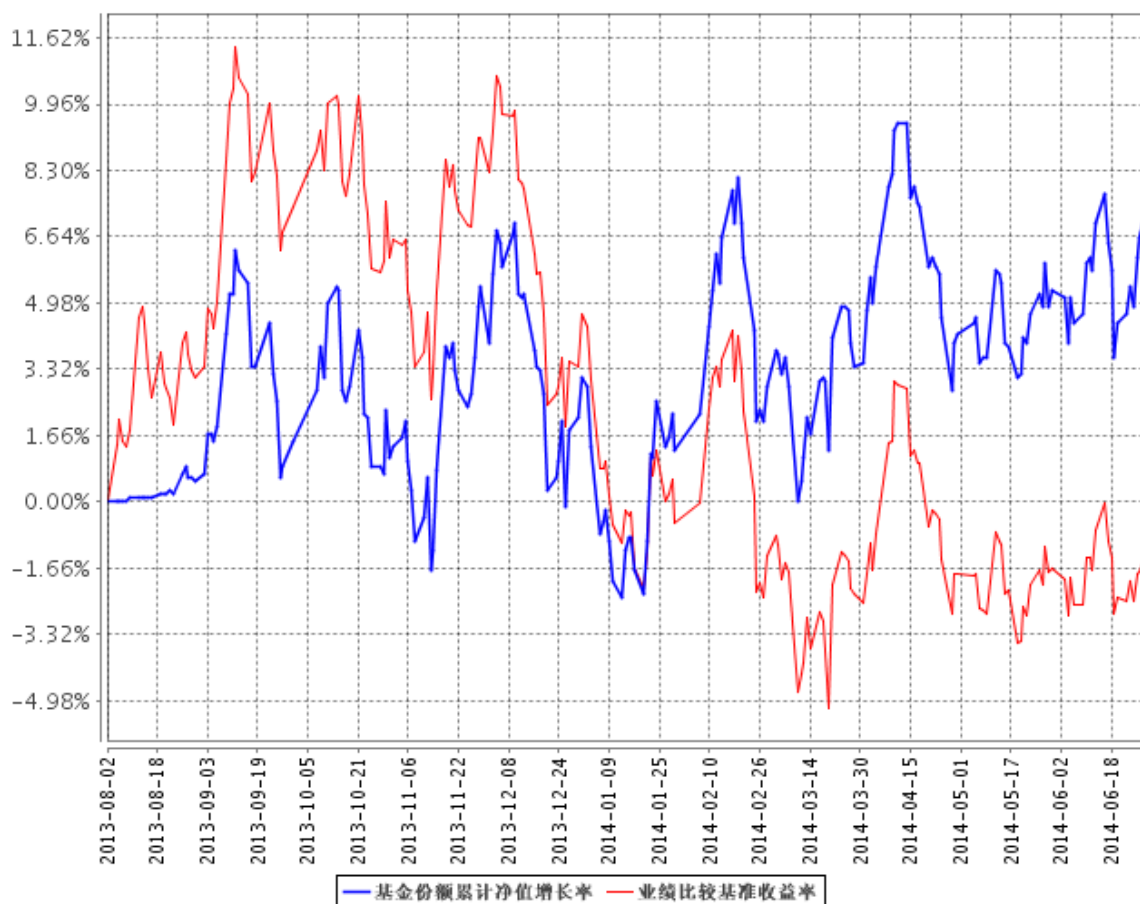
3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | 2.28% | 0.91% | 0.60% | 0.74% | 1.68% | 0.17% |
| 过去三个月 | 4.06% | 0.88% | 1.48% | 0.83% | 2.58% | 0.05% |
| 过去六个月 | 4.46% | 0.99% | -5.53% | 0.99% | 9.99% | 0.00% |
| 自合同生效日至今 | 7.70% | 0.99% | -1.08% | 1.03% | 8.78% | -0.04% |

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：图示日期为 2013 年 8 月 2 日至 2014 年 6 月 30 日。

1、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（二）投资范围的要求，基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比率不低于基金资产净值的 5%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金、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、华泰柏瑞亚洲领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、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金和华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金。截至 2014 年 6 月 30 日，公司公募基金管理规模为 405.79 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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 田汉卿 | 副总经理、本基金的基金经理 | 2013年8月2日 | - | 11 | 副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI）担任投资经理，2012年8月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013年8月起任华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金的基金经理，2013年10月起任公 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 司副总经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA 毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。 |
|--|--|--|--|--|--|

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，公司将投资管理职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，不同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”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究表明，交易价差方向没有规律性，即没有明确的利益输送方向。造成少量显著交易价差的原因来自两方面：一是报告期内股票市场的波动幅度较大，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识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，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，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，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

2014 年一季度，在经济面临转型和春节小长假双重影响下，经济增速进一步放缓。主板股票市场表现总体仍然比较低迷，在春节后出现小幅反弹行情，另外，优先股政策正式出台开启了 3 月下旬的一波反弹。但是反弹未能持续，在经济数据不佳和 IPO 重启的双重不利因素作用下，股票市场在 4 月下半月基本回吐上半月的投资回报。之后，上证综指一直在 2000 点上方一点徘徊，股票市场整体表现在二季度缺乏方向性。在这种情况下，我们首先力求投资尽可能分散化，控制投资组合对于热点概念的风险暴露，以便在不同市场情况下能够跟上基准指数，严格控制投资风险，在此基础上再追求超越比较基准指数的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金的总收益为 4.46%，相对于比较基准（95%沪深 300 价格指数收益 + 年化 2.5%）的超额收益为 9.99%，并且相对于沪深 300 总收益指数的年化跟踪误差严格控制在目标范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年二季度，政府年初开始的微刺激政策的效果开始显现，多数经济指标有所好转。后续经济的整体发展取决于政府稳增长政策的实际落实情况。从市场流动性来看，今年市场中资金的宽松程度要好于去年，同时房地产、信托等吸引资金的能力下降，未来资金有可能流向估值较低的主板股票市场。到 2014 年 8 月初，在经历了 7 月中旬以来的上涨行情之后，沪深 300 指数的市盈率约为 8.9 倍，上证综指的市盈率约为 9.6 倍，整体估值仍处于低位。总体上，我们仍坚持我们之前的观点，认为 A 股主板市场经历了长时间低迷，估值已经反映经济中的问题和增长的放缓，除非经济发生重大或系统性风险，下行空间有限。同时，在政府稳增长政策环境下，加上市场中适当的流动性和沪港通等因素的影响下，今年三季度主板市场有可能延续 7 月份以来的上涨行情。

当前，本基金还是会坚持一贯的利用基本面信息选股的策略，顺应市场的变化，在有效控制主动投资风险的前提下，力求继续获得超越市场的超额收益。

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、金融工程和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 12 次；每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 25%；基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，收益分配基准日可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。截止本报告期末，本基金可分配收益为 25,681,903.41 元。

§ 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”）在华泰柏瑞量化指数增强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：华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2014 年 6 月 30 日 | 上年度末 2013 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 19,001,935.69 | 60,663,721.97 |
| 结算备付金 | | 1,112,093.12 | 302,182.37 |
| 存出保证金 | | 217,353.48 | 72,757.00 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 332,006,373.58 | 204,703,354.85 |
| 其中：股票投资 | | 332,006,373.58 | 204,703,354.85 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 4,625.96 | 4,357.47 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 6,840,137.51 | 968,154.65 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 359,182,519.34 | 266,714,528.31 |
| 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 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 1,775.60 | 27,570,820.80 |
| 应付赎回款 | | 312,413.23 | 20,077.15 |
| 应付管理人报酬 | | 278,283.08 | 99,098.21 |
| 应付托管费 | | 69,570.78 | 24,774.55 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 513,055.30 | 310,239.21 |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 105,315.76 | 210,075.67 |
| 负债合计 | | 1,280,413.75 | 28,235,085.59 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 332,220,202.18 | 231,382,764.42 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 25,681,903.41 | 7,096,678.30 |
| 所有者权益合计 | | 357,902,105.59 | 238,479,442.72 |
| 负债和所有者权益总计 | | 359,182,519.34 | 266,714,528.31 |

注：1. 报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.077 元，基金份额总额 332,220,202.18 份。2. 上年度财务报表的实际编制期间为 2013 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化指数增强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

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 |
|-----------------------|------------|---------------------------------|
| | | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
| 一、收入 | | 19,032,369.76 |
| 1.利息收入 | | 94,503.41 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 94,503.41 |
| 债券利息收入 | | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 14,656,228.35 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 10,625,358.81 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.1 | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 4,030,869.54 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 3,924,762.73 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 356,875.27 |
| 减：二、费用 | | 3,341,250.71 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,316,450.23 |

| | | |
|----------------------------|------------|-------------------------|
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 329, 112. 54 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 1, 580, 418. 38 |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 115, 269. 56 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 15, 691, 119. 05 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 15, 691, 119. 05 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞量化指数增强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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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） | 231, 382, 764. 42 | 7, 096, 678. 30 | 238, 479, 442. 72 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 15, 691, 119. 05 | 15, 691, 119. 05 |
| 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） | 100, 837, 437. 76 | 2, 894, 106. 06 | 103, 731, 543. 82 |
| 其中：1.基金申购款 | 373, 705, 072. 38 | 15, 525, 602. 39 | 389, 230, 674. 77 |
| 2. 基金赎回款 | -272, 867, 634. 62 | -12, 631, 496. 33 | -285, 499, 130. 95 |
| 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） | 332, 220, 202. 18 | 25, 681, 903. 41 | 357, 902, 105. 59 |

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：

| | | |
|-----------|------------|-----------|
| <u>韩勇</u> | <u>房伟力</u> | <u>陈培</u> |
| 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

华泰柏瑞量化指数增强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”)证监许可[2013]610号《关于核准华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金募集的批复》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《华泰柏瑞量化指数增强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 333,108,260.81 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(2013)第 441 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 8 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 333,186,365.72 份基金份额,其中认购资金利息折合 78,104.91 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化指数增强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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(须符合中国证监会相关规定)。本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%;现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比率不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为 95%×沪深 300 指数收益率+2.5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2014 年 8 月 25 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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会

发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 1 月 1 日至 2014 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 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

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[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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,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。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 19,001,935.69 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 19,001,935.69 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 6 月 30 日 | | |
|-------------------|------------------------|----------------|--------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 326,258,241.76 | 332,006,373.58 | 5,748,131.82 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 326,258,241.76 | 332,006,373.58 | 5,748,131.82 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：无

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 4,027.59 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 500.57 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 97.80 |
| 合计 | 4,625.96 |

6.4.7.6 其他资产

注：无

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 513,055.30 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 513,055.30 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 1,177.41 |
| 预提费用 | 104,138.35 |
| 合计 | 105,315.76 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 | |
|----|---------------------------------------|------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| | | |

| | | |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末 | 231,382,764.42 | 231,382,764.42 |
| 本期申购 | 373,705,072.38 | 373,705,072.38 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -272,867,634.62 | -272,867,634.62 |
| 本期末 | 332,220,202.18 | 332,220,202.18 |

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 15,813,970.80 | -8,717,292.50 | 7,096,678.30 |
| 本期利润 | 11,766,356.32 | 3,924,762.73 | 15,691,119.05 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 12,203,789.81 | -9,309,683.75 | 2,894,106.06 |
| 其中：基金申购款 | 37,617,136.12 | -22,091,533.73 | 15,525,602.39 |
| 基金赎回款 | -25,413,346.31 | 12,781,849.98 | -12,631,496.33 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 39,784,116.93 | -14,102,213.52 | 25,681,903.41 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 74,862.71 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 10,527.89 |
| 结算备付金利息收入 | 9,112.81 |
| 其他 | - |
| 合计 | 94,503.41 |

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 481,412,230.23 |
| 减：卖出股票成本总额 | 470,786,871.42 |
| 买卖股票差价收入 | 10,625,358.81 |

6.4.7.13 债券投资收益

注：无

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：无

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无

6.4.7.15 衍生工具收益

注：无

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 4,030,869.54 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 4,030,869.54 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 3,924,762.73 |
| ——股票投资 | 3,924,762.73 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | 3,924,762.73 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 343,351.21 |

| | |
|-------|------------|
| 转换费收入 | 13,524.06 |
| 合计 | 356,875.27 |

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金财产。

2、本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用的 25% 的部分归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 1,580,418.38 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 1,580,418.38 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 74,385.57 |
| 银行划款手续费 | 10,231.21 |
| 其他费用 | 900.00 |
| 合计 | 115,269.56 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

无

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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 |

注：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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | |
|--------|----------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 |
| 华泰证券股份 | 227,760,039.44 | 21.18% |

6.4.10.1.2 权证交易

注：无

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2014年1月1日至2014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 | 207,309.91 | 21.47% | 207,309.91 | 40.41% |

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,316,450.23 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 223,837.73 |

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | |
|----|----------------------------|--|
| | 当期发生的基金应支付的托管费 | |

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无

6.4.10.4.2 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：无

6.4.10.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日 | |
|------------|----------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行股份有限公司 | 19,001,935.69 | 74,862.71 |

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金报告期末未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：无

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无

6.4.12.2 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 |
|--------|------|-----------------|------|--------|----------------|--------|-----------|--------------|--------------|----|
| 601669 | 中国电建 | 2014 年 5 月 13 日 | 重大事项 | 2.79 | - | - | 1,709,900 | 4,679,376.09 | 4,770,621.00 | - |
| 601012 | 隆基股份 | 2014 年 6 月 19 日 | 重大事项 | 15.50 | 2014 年 7 月 1 日 | 15.60 | 123,291 | 1,600,874.57 | 1,911,010.50 | - |

注：本基金截至 2014 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

6.4.13 金融工具风险及管理

-

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属主动管理的股票型证券投资基金，为证券投资基金中的较高风险较高收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资、股指期货投资以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具投资（须符合中国证监会相关规定）。本基金力求有效控制

投资风险的前提下，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括投资组合的风险、管理风险、投资合规性风险和其它风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制

控制在限定的范围之内。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。除此之外，量化投资团队还有使用量化模型来控制投资组合的风险的流程，从量化的角度把市场风险控制在目标范围内。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受

范围内。量化投资团队利用风险估测模型和适当的控制措施，加强了定量分析的方法，有效控制投资组合的预期投资风险，并力求将投资组合的实现风险（用跟踪误差衡量）控制在目标范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2014 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、存出保证金和结算备付金，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2014 年 6 月 30 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------------|---------------|--------|-------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 19,001,935.69 | - | - | - | - | - | 19,001,935.69 |
| 结算备付金 | 1,112,093.12 | - | - | - | - | - | 1,112,093.12 |
| 存出保证金 | 217,353.48 | - | - | - | - | - | 217,353.48 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 332,006,373.58 | 332,006,373.58 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 4,625.96 | 4,625.96 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 6,840,137.51 | 6,840,137.51 |
| 资产总计 | 20,331,382.29 | - | - | - | - | 338,851,137.05 | 359,182,519.34 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 1,775.60 | 1,775.60 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 312,413.23 | 312,413.23 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 278,283.08 | 278,283.08 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 69,570.78 | 69,570.78 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 513,055.30 | 513,055.30 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 105,315.76 | 105,315.76 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 1,280,413.75 | 1,280,413.75 |
| 利率敏感度缺口 | 20,331,382.29 | - | - | - | - | 337,570,723.30 | 357,902,105.59 |
| 上年度末 2013 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |

| | | | | | | |
|---------|---------------|---|---|---|-----------------|----------------|
| 银行存款 | 60,663,721.97 | - | - | - | - | 60,663,721.97 |
| 结算备付金 | 302,182.37 | - | - | - | - | 302,182.37 |
| 存出保证金 | 72,757.00 | - | - | - | - | 72,757.00 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | -204,703,354.85 | 204,703,354.85 |
| 应收利息 | - | - | - | - | 4,357.47 | 4,357.47 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 968,154.65 | 968,154.65 |
| 资产总计 | 61,038,661.34 | - | - | - | -205,675,866.97 | 266,714,528.31 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | 27,570,820.80 | 27,570,820.80 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 20,077.15 | 20,077.15 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 99,098.21 | 99,098.21 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 24,774.55 | 24,774.55 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 310,239.21 | 310,239.21 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 210,075.67 | 210,075.67 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 28,235,085.59 | 28,235,085.59 |
| 利率敏感度缺口 | 61,038,661.34 | - | - | - | -177,440,781.38 | 238,479,442.72 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，运用量化投资策略，实现增强指数收益的目标。本基金利用定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在严格控制组合预期跟踪误差的基础上，力求超越标的指数投资回报。一般情况下，本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 85%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括跟踪误差等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2013 年 12 月 31 日 | |
|---------------|------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 332,006,373.58 | 92.76 | 204,703,354.85 | 85.84 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 332,006,373.58 | 92.76 | 204,703,354.85 | 85.84 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变 | | |
|-------------|---------------------|------------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元） | |
| | | 本期末（2014 年 6 月 30 日） | 上年度末（2013 年 12 月 31 日） |
| | 业绩比较基准上升 5% | 增加约 1646 万元 | 增加约 919 万元 |
| 业绩比较基准下降 5% | 减少约 1646 万元 | 减少约 919 万元 | |

§ 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 | 332,006,373.58 | 92.43 |
| | 其中：股票 | 332,006,373.58 | 92.43 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 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 | 银行存款和结算备付金合计 | 20,114,028.81 | 5.60 |
| 7 | 其他各项资产 | 7,062,116.95 | 1.97 |
| 8 | 合计 | 359,182,519.34 | 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（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 9,274,205.08 | 2.59 |
| C | 制造业 | 131,673,998.12 | 36.79 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 22,695,610.06 | 6.34 |
| E | 建筑业 | 12,621,185.11 | 3.53 |
| F | 批发和零售业 | 26,871,501.61 | 7.51 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 7,901,688.13 | 2.21 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,994,182.00 | 1.12 |
| J | 金融业 | 101,992,270.97 | 28.50 |
| K | 房地产业 | 9,168,981.58 | 2.56 |
| L | 租赁和商务服务业 | 405,073.92 | 0.11 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,259,475.00 | 0.35 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | 4,148,202.00 | 1.16 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 332,006,373.58 | 92.76 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 936,545 | 9,590,220.80 | 2.68 |
| 2 | 000596 | 古井贡酒 | 439,158 | 8,374,743.06 | 2.34 |
| 3 | 000728 | 国元证券 | 863,282 | 8,149,382.08 | 2.28 |
| 4 | 600000 | 浦发银行 | 869,548 | 7,869,409.40 | 2.20 |
| 5 | 600897 | 厦门空港 | 493,538 | 7,185,913.28 | 2.01 |
| 6 | 600015 | 华夏银行 | 863,350 | 7,079,470.00 | 1.98 |
| 7 | 601998 | 中信银行 | 1,627,049 | 6,947,499.23 | 1.94 |
| 8 | 601336 | 新华保险 | 325,666 | 6,881,322.58 | 1.92 |
| 9 | 600027 | 华电国际 | 2,059,500 | 6,322,665.00 | 1.77 |
| 10 | 000543 | 皖能电力 | 942,227 | 6,218,698.20 | 1.74 |
| 11 | 601601 | 中国太保 | 327,130 | 5,819,642.70 | 1.63 |
| 12 | 600369 | 西南证券 | 674,070 | 5,763,298.50 | 1.61 |
| 13 | 600201 | 金宇集团 | 184,737 | 5,749,015.44 | 1.61 |
| 14 | 002535 | 林州重机 | 663,100 | 5,556,778.00 | 1.55 |
| 15 | 600327 | 大东方 | 938,300 | 5,404,608.00 | 1.51 |
| 16 | 002142 | 宁波银行 | 573,238 | 5,273,789.60 | 1.47 |
| 17 | 600741 | 华域汽车 | 522,261 | 5,107,712.58 | 1.43 |
| 18 | 601668 | 中国建筑 | 1,751,600 | 4,939,512.00 | 1.38 |
| 19 | 601318 | 中国平安 | 125,092 | 4,921,119.28 | 1.37 |
| 20 | 600030 | 中信证券 | 428,945 | 4,915,709.70 | 1.37 |
| 21 | 000789 | 江西水泥 | 558,096 | 4,877,759.04 | 1.36 |
| 22 | 603003 | 龙宇燃油 | 394,662 | 4,866,182.46 | 1.36 |
| 23 | 601288 | 农业银行 | 1,929,200 | 4,861,584.00 | 1.36 |
| 24 | 000001 | 平安银行 | 484,000 | 4,796,440.00 | 1.34 |
| 25 | 601669 | 中国电建 | 1,709,900 | 4,770,621.00 | 1.33 |
| 26 | 000600 | 建投能源 | 843,900 | 4,717,401.00 | 1.32 |
| 27 | 600109 | 国金证券 | 236,500 | 4,699,255.00 | 1.31 |
| 28 | 000501 | 鄂武商A | 382,258 | 4,472,418.60 | 1.25 |
| 29 | 600887 | 伊利股份 | 133,600 | 4,424,832.00 | 1.24 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 30 | 600177 | 雅戈尔 | 611,378 | 4,297,987.34 | 1.20 |
| 31 | 002025 | 航天电器 | 273,276 | 4,287,700.44 | 1.20 |
| 32 | 002486 | 嘉麟杰 | 1,248,400 | 4,269,528.00 | 1.19 |
| 33 | 002215 | 诺普信 | 564,098 | 4,219,453.04 | 1.18 |
| 34 | 600633 | 浙报传媒 | 312,600 | 4,148,202.00 | 1.16 |
| 35 | 000915 | 山大华特 | 150,122 | 4,011,259.84 | 1.12 |
| 36 | 601009 | 南京银行 | 486,300 | 3,890,400.00 | 1.09 |
| 37 | 601939 | 建设银行 | 931,400 | 3,846,682.00 | 1.07 |
| 38 | 000708 | 大冶特钢 | 626,445 | 3,840,107.85 | 1.07 |
| 39 | 002540 | 亚太科技 | 352,706 | 3,717,521.24 | 1.04 |
| 40 | 601808 | 中海油服 | 205,825 | 3,620,461.75 | 1.01 |
| 41 | 600761 | 安徽合力 | 365,774 | 3,599,216.16 | 1.01 |
| 42 | 300005 | 探路者 | 225,778 | 3,486,012.32 | 0.97 |
| 43 | 000028 | 国药一致 | 82,323 | 3,288,803.85 | 0.92 |
| 44 | 002392 | 北京利尔 | 351,512 | 3,230,395.28 | 0.90 |
| 45 | 600183 | 生益科技 | 521,046 | 3,209,643.36 | 0.90 |
| 46 | 000026 | 飞亚达 A | 385,215 | 3,151,058.70 | 0.88 |
| 47 | 601398 | 工商银行 | 919,450 | 3,116,935.50 | 0.87 |
| 48 | 000966 | 长源电力 | 471,262 | 3,006,651.56 | 0.84 |
| 49 | 002367 | 康力电梯 | 404,060 | 2,969,841.00 | 0.83 |
| 50 | 000418 | 小天鹅 A | 284,588 | 2,905,643.48 | 0.81 |
| 51 | 601678 | 滨化股份 | 386,746 | 2,892,860.08 | 0.81 |
| 52 | 000961 | 中南建设 | 435,287 | 2,842,424.11 | 0.79 |
| 53 | 000042 | 中洲控股 | 254,340 | 2,762,132.40 | 0.77 |
| 54 | 600376 | 首开股份 | 588,800 | 2,543,616.00 | 0.71 |
| 55 | 000338 | 潍柴动力 | 142,242 | 2,530,485.18 | 0.71 |
| 56 | 601555 | 东吴证券 | 343,600 | 2,446,432.00 | 0.68 |
| 57 | 002294 | 信立泰 | 80,991 | 2,431,349.82 | 0.68 |
| 58 | 600694 | 大商股份 | 95,000 | 2,425,350.00 | 0.68 |
| 59 | 002548 | 金新农 | 154,193 | 2,360,694.83 | 0.66 |
| 60 | 600104 | 上汽集团 | 152,600 | 2,334,780.00 | 0.65 |
| 61 | 600426 | 华鲁恒升 | 316,730 | 2,280,456.00 | 0.64 |
| 62 | 601299 | 中国北车 | 487,400 | 2,212,796.00 | 0.62 |
| 63 | 000550 | 江铃汽车 | 74,374 | 2,155,358.52 | 0.60 |
| 64 | 600823 | 世茂股份 | 236,348 | 2,018,411.92 | 0.56 |
| 65 | 300113 | 顺网科技 | 83,200 | 2,013,440.00 | 0.56 |
| 66 | 002003 | 伟星股份 | 256,452 | 1,987,503.00 | 0.56 |
| 67 | 002661 | 克明面业 | 53,851 | 1,912,787.52 | 0.53 |
| 68 | 601012 | 隆基股份 | 123,291 | 1,911,010.50 | 0.53 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 69 | 000651 | 格力电器 | 61,870 | 1,822,071.50 | 0.51 |
| 70 | 601088 | 中国神华 | 121,802 | 1,771,001.08 | 0.49 |
| 71 | 002249 | 大洋电机 | 123,801 | 1,720,833.90 | 0.48 |
| 72 | 300017 | 网宿科技 | 26,800 | 1,709,840.00 | 0.48 |
| 73 | 600971 | 恒源煤电 | 320,100 | 1,709,334.00 | 0.48 |
| 74 | 300286 | 安科瑞 | 61,000 | 1,601,250.00 | 0.45 |
| 75 | 600089 | 特变电工 | 182,700 | 1,551,123.00 | 0.43 |
| 76 | 000786 | 北新建材 | 111,200 | 1,525,664.00 | 0.43 |
| 77 | 002462 | 嘉事堂 | 80,340 | 1,495,930.80 | 0.42 |
| 78 | 600315 | 上海家化 | 37,500 | 1,374,375.00 | 0.38 |
| 79 | 000829 | 天音控股 | 162,000 | 1,370,520.00 | 0.38 |
| 80 | 002568 | 百润股份 | 75,000 | 1,350,000.00 | 0.38 |
| 81 | 600660 | 福耀玻璃 | 152,527 | 1,281,226.80 | 0.36 |
| 82 | 000540 | 中天城投 | 244,799 | 1,248,474.90 | 0.35 |
| 83 | 600011 | 华能国际 | 213,005 | 1,205,608.30 | 0.34 |
| 84 | 002500 | 山西证券 | 173,140 | 1,123,678.60 | 0.31 |
| 85 | 600801 | 华新水泥 | 167,520 | 1,117,358.40 | 0.31 |
| 86 | 600583 | 海油工程 | 145,055 | 1,069,055.35 | 0.30 |
| 87 | 300067 | 安诺其 | 122,880 | 1,012,531.20 | 0.28 |
| 88 | 300180 | 华峰超纤 | 58,128 | 1,011,427.20 | 0.28 |
| 89 | 002358 | 森源电气 | 39,721 | 987,464.06 | 0.28 |
| 90 | 600987 | 航民股份 | 173,350 | 953,425.00 | 0.27 |
| 91 | 002298 | 鑫龙电器 | 128,800 | 899,024.00 | 0.25 |
| 92 | 300292 | 吴通通讯 | 54,000 | 874,260.00 | 0.24 |
| 93 | 600461 | 洪城水业 | 107,400 | 874,236.00 | 0.24 |
| 94 | 002092 | 中泰化学 | 140,000 | 865,200.00 | 0.24 |
| 95 | 601992 | 金隅股份 | 149,200 | 838,504.00 | 0.23 |
| 96 | 000069 | 华侨城 A | 177,300 | 831,537.00 | 0.23 |
| 97 | 601006 | 大秦铁路 | 113,435 | 715,774.85 | 0.20 |
| 98 | 600197 | 伊力特 | 78,630 | 710,815.20 | 0.20 |
| 99 | 002541 | 鸿路钢构 | 50,200 | 640,050.00 | 0.18 |
| 100 | 600332 | 白云山 | 22,800 | 567,492.00 | 0.16 |
| 101 | 600318 | 巢东股份 | 64,300 | 551,051.00 | 0.15 |
| 102 | 300084 | 海默科技 | 18,100 | 430,961.00 | 0.12 |
| 103 | 300144 | 宋城演艺 | 16,100 | 427,938.00 | 0.12 |
| 104 | 000655 | 金岭矿业 | 60,300 | 414,261.00 | 0.12 |
| 105 | 000415 | 渤海租赁 | 52,744 | 405,073.92 | 0.11 |
| 106 | 600153 | 建发股份 | 72,776 | 396,629.20 | 0.11 |
| 107 | 600791 | 京能置业 | 85,068 | 384,507.36 | 0.11 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 108 | 000425 | 徐工机械 | 52,400 | 358,940.00 | 0.10 |
| 109 | 002267 | 陕天然气 | 38,500 | 350,350.00 | 0.10 |
| 110 | 600711 | 盛屯矿业 | 32,500 | 250,575.00 | 0.07 |
| 111 | 002304 | 洋河股份 | 4,600 | 233,450.00 | 0.07 |
| 112 | 002521 | 齐峰新材 | 21,300 | 215,769.00 | 0.06 |
| 113 | 000671 | 阳光城 | 24,100 | 211,839.00 | 0.06 |
| 114 | 600050 | 中国联通 | 61,200 | 197,676.00 | 0.06 |
| 115 | 000716 | 南方食品 | 9,965 | 116,989.10 | 0.03 |
| 116 | 300256 | 星星科技 | 7,200 | 105,264.00 | 0.03 |
| 117 | 300315 | 掌趣科技 | 4,100 | 73,226.00 | 0.02 |
| 118 | 002553 | 南方轴承 | 6,200 | 73,036.00 | 0.02 |
| 119 | 000726 | 鲁泰A | 8,296 | 72,921.84 | 0.02 |
| 120 | 601390 | 中国中铁 | 26,600 | 68,628.00 | 0.02 |
| 121 | 002233 | 塔牌集团 | 9,900 | 59,994.00 | 0.02 |
| 122 | 000876 | 新希望 | 3,300 | 37,257.00 | 0.01 |
| 123 | 603993 | 洛阳钼业 | 1,277 | 8,555.90 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1 | 000596 | 古井贡酒 | 8,639,075.62 | 3.62 |
| 2 | 601088 | 中国神华 | 8,620,185.58 | 3.61 |
| 3 | 601998 | 中信银行 | 7,454,795.51 | 3.13 |
| 4 | 600897 | 厦门空港 | 7,236,625.56 | 3.03 |
| 5 | 601288 | 农业银行 | 7,189,944.00 | 3.01 |
| 6 | 600109 | 国金证券 | 7,105,841.57 | 2.98 |
| 7 | 600015 | 华夏银行 | 6,872,957.35 | 2.88 |
| 8 | 002535 | 林州重机 | 6,741,007.10 | 2.83 |
| 9 | 601668 | 中国建筑 | 6,674,824.72 | 2.80 |
| 10 | 600201 | 金宇集团 | 6,621,384.49 | 2.78 |
| 11 | 000001 | 平安银行 | 6,379,287.91 | 2.67 |
| 12 | 600000 | 浦发银行 | 6,272,103.18 | 2.63 |
| 13 | 002294 | 信立泰 | 6,229,224.07 | 2.61 |
| 14 | 601601 | 中国太保 | 6,183,734.88 | 2.59 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 15 | 002462 | 嘉事堂 | 6,159,212.59 | 2.58 |
| 16 | 000789 | 江西水泥 | 6,095,489.93 | 2.56 |
| 17 | 000600 | 建投能源 | 5,779,746.90 | 2.42 |
| 18 | 600823 | 世茂股份 | 5,719,146.45 | 2.40 |
| 19 | 601336 | 新华保险 | 5,718,081.22 | 2.40 |
| 20 | 600027 | 华电国际 | 5,681,815.00 | 2.38 |
| 21 | 600519 | 贵州茅台 | 5,627,903.89 | 2.36 |
| 22 | 600036 | 招商银行 | 5,573,492.82 | 2.34 |
| 23 | 002215 | 诺普信 | 5,570,623.41 | 2.34 |
| 24 | 000860 | 顺鑫农业 | 5,461,888.08 | 2.29 |
| 25 | 000728 | 国元证券 | 5,372,477.81 | 2.25 |
| 26 | 002367 | 康力电梯 | 5,317,055.73 | 2.23 |
| 27 | 002142 | 宁波银行 | 5,299,050.18 | 2.22 |
| 28 | 600660 | 福耀玻璃 | 5,118,654.03 | 2.15 |
| 29 | 600177 | 雅戈尔 | 5,085,466.12 | 2.13 |
| 30 | 600030 | 中信证券 | 5,046,728.96 | 2.12 |
| 31 | 600327 | 大东方 | 4,940,006.39 | 2.07 |
| 32 | 601808 | 中海油服 | 4,922,939.80 | 2.06 |
| 33 | 600741 | 华域汽车 | 4,905,506.07 | 2.06 |
| 34 | 600011 | 华能国际 | 4,889,518.99 | 2.05 |
| 35 | 600369 | 西南证券 | 4,828,826.11 | 2.02 |
| 36 | 600197 | 伊力特 | 4,824,578.88 | 2.02 |
| 37 | 002001 | 新和成 | 4,805,003.43 | 2.01 |

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 601088 | 中国神华 | 8,955,525.42 | 3.76 |
| 2 | 601998 | 中信银行 | 7,936,916.98 | 3.33 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 7,922,670.16 | 3.32 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 7,183,921.72 | 3.01 |
| 5 | 002462 | 嘉事堂 | 6,779,956.80 | 2.84 |
| 6 | 601313 | 江南嘉捷 | 6,247,676.17 | 2.62 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 7 | 600720 | 祁连山 | 5,706,315.61 | 2.39 |
| 8 | 600036 | 招商银行 | 5,643,396.10 | 2.37 |
| 9 | 600396 | 金山股份 | 5,408,915.12 | 2.27 |
| 10 | 002001 | 新和成 | 5,363,873.43 | 2.25 |
| 11 | 002440 | 闰土股份 | 5,295,708.63 | 2.22 |
| 12 | 002609 | 捷顺科技 | 5,285,301.36 | 2.22 |
| 13 | 000069 | 华侨城 A | 5,259,998.99 | 2.21 |
| 14 | 000860 | 顺鑫农业 | 5,191,475.37 | 2.18 |
| 15 | 601006 | 大秦铁路 | 5,166,652.81 | 2.17 |
| 16 | 600252 | 中恒集团 | 5,160,324.81 | 2.16 |
| 17 | 600240 | 华业地产 | 5,021,595.80 | 2.11 |
| 18 | 600660 | 福耀玻璃 | 4,834,884.69 | 2.03 |
| 19 | 600028 | 中国石化 | 4,829,715.51 | 2.03 |
| 20 | 000651 | 格力电器 | 4,708,754.22 | 1.97 |

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 594,165,127.42 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 481,412,230.23 |

7.5 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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2

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情形。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 217,353.48 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,625.96 |
| 5 | 应收申购款 | 6,840,137.51 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,062,116.95 |

7.11.4 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。

7.11.5 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | |
|--------------|---------------|-------|-------|
| | | 机构投资者 | 个人投资者 |
| | | | |

| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
|-------|------------|----------------|------------|----------------|------------|
| 1,386 | 239,697.12 | 223,051,139.45 | 67.14% | 109,169,062.73 | 32.86% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2013年8月2日）基金份额总额 | 333,186,365.72 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 231,382,764.42 |
| 本报告期基金总申购份额 | 373,705,072.38 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 272,867,634.62 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 332,220,202.18 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2014年5月15日，华泰柏瑞基金管理有限公司任命高山先生为公司副总经理，高山先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试，其任命已在中国证券投资基金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告，自2014年2月13日起，陈四清先生担任本行行长。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人和托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中信证券 | 1 | 317,580,479.89 | 29.53% | 289,075.18 | 29.94% | - |
| 国信证券 | 1 | 300,656,178.41 | 27.95% | 266,056.31 | 27.55% | - |
| 方正证券 | 1 | 229,580,659.91 | 21.34% | 203,155.25 | 21.04% | - |
| 华泰证券 | 1 | 227,760,039.44 | 21.18% | 207,309.91 | 21.47% | - |

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的，并能提供基金全面的信息。

5) 具备研究实力, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务, 并能根据基金投资的特定要求, 提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：无

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|------------------|-----------------|
| 1 | 华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金 2013 年第 4 季度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2014 年 1 月 20 日 |
| 2 | 华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金更新的招募说明书 2014 年第 1 号 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2014 年 3 月 18 日 |
| 3 | 华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金更新的招募说明书 (摘要) 2014 年第 1 号 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2014 年 3 月 18 日 |
| 4 | 华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金 2013 年年度报告 摘要 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2014 年 3 月 26 日 |
| 5 | 华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金 2013 年年度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2014 年 3 月 26 日 |
| 6 | 华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金 2014 年第 1 季度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2014 年 4 月 22 日 |

§ 11 备查文件目录

11.1 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

11.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

11.3 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
2014 年 8 月 25 日