

# 华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金 2012 年年度报告 摘要

2012 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

送出日期：2013 年 3 月 28 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 2013 年 3 月 27 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 2012 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞价值增长股票
基金主代码	460005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 7 月 16 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	531,930,400.80 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于市场估值相对较低、基本面良好、能够为股东持续创造价值的公司，重点关注其中基本面有良性变化、市场认同度逐步提高的优质个股，在充分控制投资组合风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	基于对宏观经济和投资环境的分析和预测，全面评估证券市场各大类资产的中长期预期风险收益率，确定基金资产在股票、债券和现金及其他资产之间的配置比例，适度控制系统性风险。 主要通过积极主动地精选为股东持续创造价值的股票来获取超额收益。重点投资于基本面趋势良好或出现良性转折、价格相对低估、基本面趋势认同度逐步或加速提高的优质股票，辅以适度的行业配置调整来优化股票的选择和配置的权重。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%
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	010-66594855
	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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-123,327,800.14	-168,521,248.70	52,414,479.92
本期利润	-24,316,954.52	-335,779,496.88	82,090,210.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0346	-0.3718	0.2181
本期基金份额净值增长率	-1.75%	-26.20%	21.98%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3241	-0.1603	0.0297
期末基金资产净值	525,069,385.67	839,682,107.62	1,366,473,056.66
期末基金份额净值	0.9871	1.0047	1.3614

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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

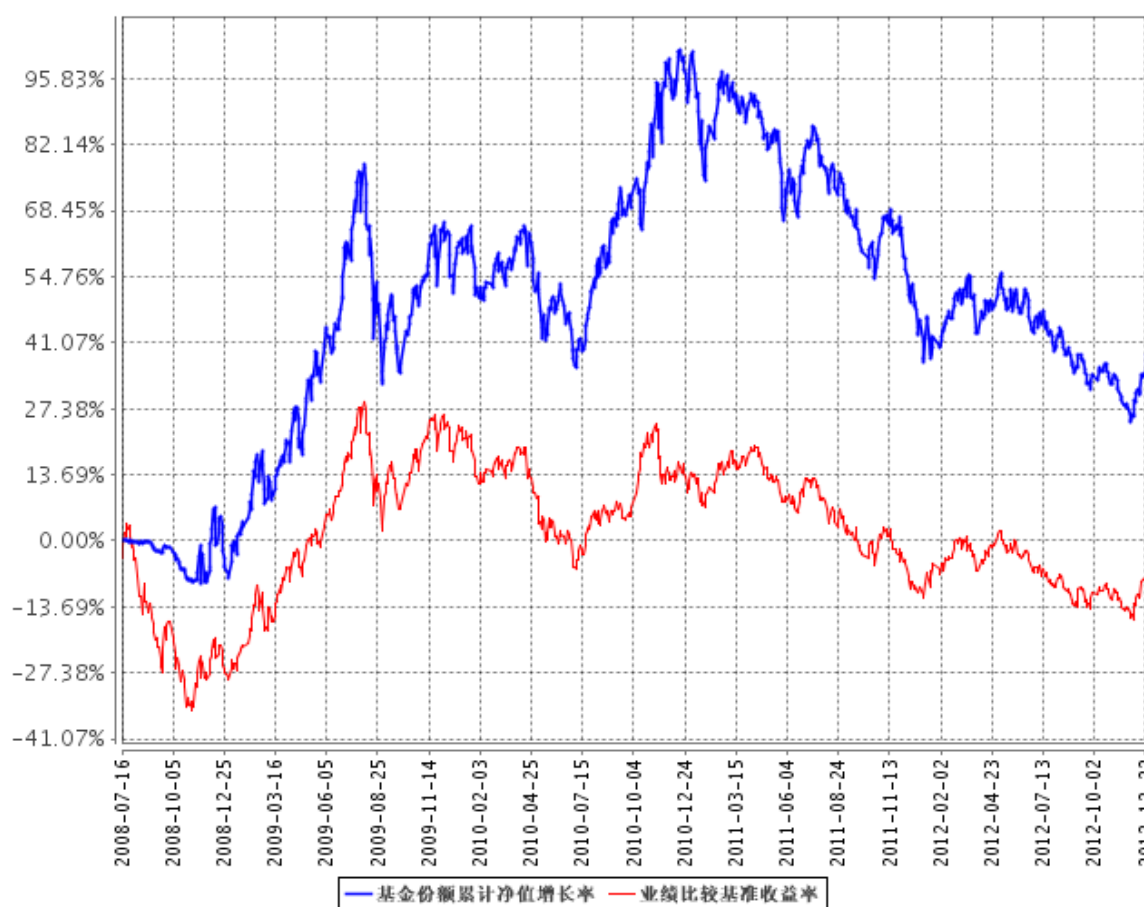
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.58%	0.88%	8.18%	1.02%	-1.60%	-0.14%
过去六个月	-1.40%	0.85%	2.46%	0.99%	-3.86%	-0.14%

过去一年	-1.75%	1.07%	7.04%	1.02%	-8.79%	0.05%
过去三年	-11.56%	1.22%	-21.86%	1.11%	10.30%	0.11%
自基金合同 生效日起至 今	43.23%	1.45%	-3.31%	1.44%	46.54%	0.01%

注：本基金的业绩基准由沪深 300 指数和上证国债指数按照 80%与 20%之比构建，并每日进行再平衡。

### 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

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

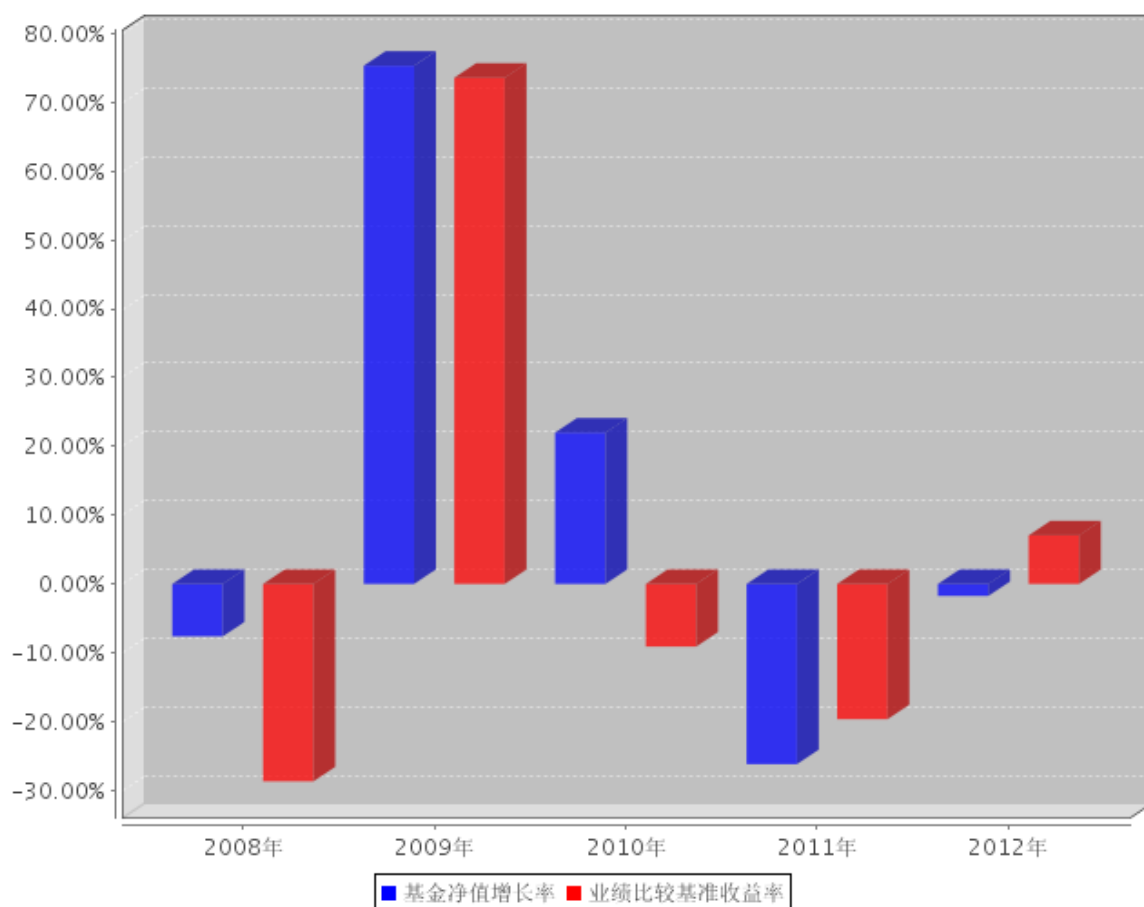


注：图示日期为 2008 年 7 月 16 日至 2012 年 12 月 31 日。

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十四条（二）投资范围、（十）之 2、基金投资组合比例限制中规定的各项比例，投资于股票的比例为基金资产的 60%-95%，现金、债券资产、权证以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 5%-40%。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效日为 2008 年 7 月 16 日，2008 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	-	-	-	-	
2011	-	-	-	-	
2010	2.0000	173,360,276.17	26,855,303.68	200,215,579.85	
合计	2.0000	173,360,276.17	26,855,303.68	200,215,579.85	

## § 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。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和华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金。截至 2012 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 387.25 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		
汪晖	本基金的基金经理、投资总监	2008 年 7 月 16 日	2013 年 2 月 22 日	18 年	18 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。
--	--	--	--	--	---

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《华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金基金合同》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 公平交易制度和控制方法

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，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生



的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3日、5日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

#### 4.3.2 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。同时潜在利益输送金额比较小（全部低于基金规模的 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。

#### 4.3.3 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

2012 年 A 股市场大幅度震荡，在经历一季度上涨后，二三季度市场震荡走低，持续低迷，上证指数一度跌破 2000 点。11 月份，特别是十八大之后，新领导人锐意改革的决心和一系列举措给市场带来信心恢复，沪深 300 指数在金融、地产、汽车等行业个股带动下大幅度上涨。全年来看，沪深 300 指数上涨约 7.55%。行业方面房地产、金融、建筑、家电等周期价值行业涨幅较大，而通信、电力设备、计算机、纺织服装和零售行业经历了景气下降，估值收缩的双杀。风格方面，低估值的周期价值风格跑赢成长风格。

本基金在资产配置方面总体把握较好，获得超额收益。但是在个股选择出现一定偏差，组合业绩总体上落后沪深 300 指数。2012 年，本基金净值增长率-1.75%，低于业绩基准 8.79 个百分点。

### 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 0.9871 元，累计净值为 1.4971 元，本报告期内基金份额净值下跌 1.75%，本基金的业绩比较基准上涨 7.04%。

## 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，本基金认为改革预期和经济企稳回升的质量和持续性是市场两大主题。在改革预期推动下，市场信心大幅度回暖带动估值水平整体回升。市场呈现估值修复特征。

在估值修复阶段完成之后，市场将进入基本面验证期。改革能否达到预期，宏观经济运行态势、货币政策调控节奏和上市公司利润增速变动趋势等因素将主导市场运行。总体来看，2013 年货币政策中性偏宽松，社会融资总量保持较高增速，经济弱复苏趋势较为明显，改革预期对市场估值和信心呈正面作用，上市公司利润增速拐点已现。相比于 2012 年，市场投资环境明显好转，估值继续下降的可能性较低。

但是，以上几个因素在 2013 年将注定不会一帆风顺，波折较大。反映了当前经济形势复杂和多变，困难较多。经济复苏的力度较弱，实体经济杠杆率较高，利润率较低，需求扩张的动力较弱。在改革方面，市场利益多元化和分歧将导致改革道路不平坦，这将对市场运行产生较大影响，市场波动率仍然较大。值得注意的是，中性偏宽松的货币条件是经济和市场回暖的驱动力，如果央行货币政策出现一定幅度调整，将会给市场带来一定的风险。

本基金将完善投资策略，在保持仓位适度灵活前提下，强化自下而上精选医药、环保和消费等成长股投资思路，紧紧把握改革预期和行业景气态势，主动精选个股，争取获得超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2012 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统事先进行合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法

合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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 80%；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-172,409,024.94 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”）在华泰柏瑞价值增长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 审计报告

普华永道会计师事务所对本基金的年度报告出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2013)第 20402 号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		54,630,838.33	54,830,378.87
结算备付金		1,054,692.31	2,985,522.77
存出保证金		1,000,000.00	766,197.86
交易性金融资产		469,479,795.41	783,731,710.15
其中：股票投资		469,479,795.41	753,980,710.15
基金投资		-	-
债券投资		-	29,751,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		2,118,539.99	5,610,297.51
应收利息		10,406.81	127,211.22
应收股利		-	-
应收申购款		37,843.74	32,906.56
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-

资产总计		528,332,116.59	848,084,224.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2012年12月31日</b>	<b>2011年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		-	4,594,651.25
应付赎回款		297,796.34	227,474.52
应付管理人报酬		621,369.32	1,115,742.70
应付托管费		103,561.54	185,957.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		544,494.91	1,010,512.01
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,695,508.81	1,267,779.75
负债合计		3,262,730.92	8,402,117.32
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		531,930,400.80	835,715,606.68
未分配利润		-6,861,015.13	3,966,500.94
所有者权益合计		525,069,385.67	839,682,107.62
负债和所有者权益总计		528,332,116.59	848,084,224.94

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9871 元，基金份额总额 531,930,400.80 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2012年1月1日至	2011年1月1日至
		2012年12月31日	2011年12月31日
<b>一、收入</b>		-5,766,853.49	-301,560,172.42
1. 利息收入		1,986,293.59	1,970,903.87
其中：存款利息收入		818,838.41	1,791,638.93
债券利息收入		1,133,043.03	179,264.94
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		34,412.15	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-107,041,747.65	-137,519,036.73
其中：股票投资收益		-112,202,310.22	-143,601,323.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-1,854,807.60	59,039.83
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		7,015,370.17	6,023,246.65
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		99,010,845.62	-167,258,248.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		277,754.95	1,246,208.62
<b>减：二、费用</b>		18,550,101.03	34,219,324.46
1. 管理人报酬		10,383,571.28	16,535,080.23
2. 托管费		1,730,595.35	2,755,846.74
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		6,009,032.69	14,471,981.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		426,901.71	456,416.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-24,316,954.52	-335,779,496.88
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-24,316,954.52	-335,779,496.88

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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）	835,715,606.68	3,966,500.94	839,682,107.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净	-	-24,316,954.52	-24,316,954.52

利润)			
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)	-303,785,205.88	13,489,438.45	-290,295,767.43
其中: 1. 基金申购款	129,215,513.33	2,543,992.16	131,759,505.49
2. 基金赎回款	-433,000,719.21	10,945,446.29	-422,055,272.92
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)	531,930,400.80	-6,861,015.13	525,069,385.67
	<b>上年度可比期间</b>		
	<b>2011年1月1日至2011年12月31日</b>		
<b>项目</b>	<b>实收基金</b>	<b>未分配利润</b>	<b>所有者权益合计</b>
一、期初所有者权益(基金净值)	1,003,762,455.55	362,710,601.11	1,366,473,056.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-335,779,496.88	-335,779,496.88
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)	-168,046,848.87	-22,964,603.29	-191,011,452.16
其中: 1. 基金申购款	676,998,037.00	190,936,662.14	867,934,699.14
2. 基金赎回款	-845,044,885.87	-213,901,265.43	-1,058,946,151.30
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)	835,715,606.68	3,966,500.94	839,682,107.62

注:

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

          韩勇          

基金管理公司负责人

          房伟力          

主管会计工作负责人

          陈培          

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况



华泰柏瑞价值增长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[2008]第 543 号《关于核准友邦华泰价值增长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《华泰柏瑞价值增长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 406,224,705.76 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(2008)第 109 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 7 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 406,303,580.25 份基金份额,其中认购资金利息折合 78,874.49 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(以下简称“中国银行”)。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“友邦华泰价值增长证券投资基金”更名为“华泰柏瑞价值增长证券投资基金”,基金简称为“华泰柏瑞价值增长股票”,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《华泰柏瑞价值增长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、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。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60% - 95%;现金、债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)、权证以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 5% - 40%,其中,基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数 $\times$ 80%+上证国债指数 $\times$ 20%。

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 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年度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 2012 年 12

月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 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。

#### 7.4.5 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》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、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，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。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税。

(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。

#### 7.4.6 关联方关系

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
柏瑞投资有限责任公司	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
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、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。

#### 7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	787,704,807.52	20.48%	2,214,619,758.47	23.23%

#### 7.4.7.1.2 权证交易

注：无。

#### 7.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31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	676,739.56	20.49%	243,244.97	44.70%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	1,823,372.09	22.93%	60,078.05	5.95%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 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等。

### 7.4.7.2 关联方报酬

#### 7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日

当期发生的基金应支付的管理费	10,383,571.28	16,535,080.23
其中：支付销售机构的客户维护费	715,509.41	961,149.80

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：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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。

#### 7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,730,595.35	2,755,846.74

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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

#### 7.4.7.2.3 销售服务费

注：无。

#### 7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2008 年 7 月 16 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	19,746,182.58	19,746,182.58
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	19,746,182.58	19,746,182.58
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.71%	2.36%

#### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.5 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		上年度可比期间	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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	54,630,838.33	793,227.32	54,830,378.87	1,723,519.85

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。

#### 7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

#### 7.4.8 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

000826	桑德环境	2012 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 9 日	配股	12.71	22.99	96,834	1,230,760.14	2,226,213.66	-
--------	------	------------------------	----------------------	----	-------	-------	--------	--------------	--------------	---

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：无。

#### 7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

##### (ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属

于第一层级的余额为 469,479,795.41 元,无属于第二层级和第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日:第一层级 747,484,057.15 元,第二层级 36,247,653.00 元,无属于第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	469,479,795.41	88.86
	其中:股票	469,479,795.41	88.86
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	55,685,530.64	10.54
6	其他各项资产	3,166,790.54	0.60
7	合计	528,332,116.59	100.00

## 8.2 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	5,607,400.70	1.07
B	采掘业	59,831,502.46	11.39
C	制造业	253,763,723.27	48.33
C0	食品、饮料	76,302,365.19	14.53
C1	纺织、服装、皮毛	9,932,836.20	1.89
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,274,242.21	2.53
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	23,649,033.37	4.50
C7	机械、设备、仪表	65,172,084.20	12.41
C8	医药、生物制品	65,433,162.10	12.46
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	33,169,918.64	6.32
E	建筑业	18,156,010.90	3.46
F	交通运输、仓储业	7,990,028.91	1.52
G	信息技术业	4,397,413.60	0.84
H	批发和零售贸易	4,279,148.18	0.81
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	45,356,817.33	8.64
K	社会服务业	34,609,541.82	6.59
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	2,318,289.60	0.44
	合计	469,479,795.41	89.41

## 8.3 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

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	600597	光明乳业	3,059,783	30,077,666.89	5.73
2	600276	恒瑞医药	835,353	25,144,125.30	4.79
3	600028	中国石化	2,999,953	20,759,674.76	3.95



4	600900	长江电力	2,999,899	20,609,306.13	3.93
5	300039	上海凯宝	874,706	20,363,155.68	3.88
6	000024	招商地产	530,022	15,842,357.58	3.02
7	600048	保利地产	1,099,960	14,959,456.00	2.85
8	000581	威孚高科	459,943	14,672,181.70	2.79
9	002244	滨江集团	1,341,475	14,555,003.75	2.77
10	601088	中国神华	566,110	14,350,888.50	2.73

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www. Huatai-pb. com 网站的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	600030	中信证券	68,089,253.23	8.11
2	600123	兰花科创	61,563,495.78	7.33
3	600837	海通证券	53,792,836.46	6.41
4	601169	北京银行	48,100,468.28	5.73
5	600900	长江电力	39,262,310.24	4.68
6	600050	中国联通	36,887,480.84	4.39
7	000783	长江证券	32,168,166.63	3.83
8	600028	中国石化	30,977,501.28	3.69
9	000568	泸州老窖	29,566,276.63	3.52
10	600276	恒瑞医药	28,068,117.38	3.34
11	600597	光明乳业	27,539,002.95	3.28
12	600616	金枫酒业	27,153,217.44	3.23
13	000562	宏源证券	26,859,204.86	3.20
14	601601	中国太保	25,592,001.69	3.05
15	000651	格力电器	23,740,808.78	2.83
16	000581	威孚高科	22,286,506.24	2.65
17	002325	洪涛股份	21,794,596.86	2.60
18	000402	金融街	20,930,704.89	2.49
19	601088	中国神华	20,905,269.76	2.49
20	601318	中国平安	20,544,475.64	2.45
21	300039	上海凯宝	20,443,510.36	2.43

22	000768	中航飞机	19,159,949.43	2.28
23	000629	攀钢钒钛	19,126,784.82	2.28
24	600585	海螺水泥	18,541,642.55	2.21
25	000776	广发证券	18,329,860.32	2.18
26	600587	新华医疗	17,844,301.21	2.13
27	000157	中联重科	17,553,599.00	2.09
28	601788	光大证券	17,446,867.89	2.08
29	601588	北辰实业	17,239,745.00	2.05

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 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	600519	贵州茅台	88,835,394.50	10.58
2	600030	中信证券	62,843,664.90	7.48
3	600123	兰花科创	58,855,306.00	7.01
4	600837	海通证券	50,240,135.86	5.98
5	600887	伊利股份	45,021,424.93	5.36
6	601169	北京银行	44,334,493.38	5.28
7	000895	双汇发展	37,183,946.14	4.43
8	600050	中国联通	36,564,124.02	4.35
9	600387	海越股份	33,997,330.94	4.05
10	601601	中国太保	33,602,585.29	4.00
11	002069	獐子岛	33,545,784.22	4.00
12	000423	东阿阿胶	31,926,013.68	3.80
13	000783	长江证券	30,641,476.79	3.65
14	000562	宏源证券	30,446,939.30	3.63
15	600422	昆明制药	29,853,206.38	3.56
16	600844	丹化科技	29,538,719.75	3.52
17	000869	张裕A	26,315,795.63	3.13
18	600436	片仔癀	25,248,036.62	3.01
19	600104	上汽集团	24,652,153.20	2.94
20	601633	长城汽车	23,837,335.14	2.84
21	600585	海螺水泥	23,464,151.91	2.79
22	600256	广汇能源	23,444,822.89	2.79
23	600763	通策医疗	22,510,441.27	2.68
24	600637	百视通	21,705,848.95	2.59

25	000402	金融街	21,042,447.26	2.51
26	600535	天士力	20,582,789.45	2.45
27	600900	长江电力	20,226,075.58	2.41
28	601788	光大证券	19,359,277.74	2.31
29	000568	泸州老窖	19,163,449.43	2.28
30	000629	攀钢钒钛	18,944,516.76	2.26
31	601336	新华保险	18,771,731.34	2.24
32	002385	大北农	18,460,001.65	2.20
33	601318	中国平安	18,358,570.89	2.19
34	000581	威孚高科	17,947,601.88	2.14
35	601588	北辰实业	17,652,984.23	2.10
36	000768	中航飞机	17,497,939.84	2.08
37	000776	广发证券	17,377,950.40	2.07
38	000024	招商地产	17,160,049.26	2.04

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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	1,788,513,337.56
卖出股票收入（成交）总额	2,059,810,547.70

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1

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。

### 8.9.2

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。

### 8.9.3 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	1,000,000.00
2	应收证券清算款	2,118,539.99
3	应收股利	-
4	应收利息	10,406.81
5	应收申购款	37,843.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,166,790.54

### 8.9.4 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。

### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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
12,274	43,337.98	284,050,024.33	53.40%	247,880,376.47	46.60%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	1,072,687.29	0.2017%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份。

该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年7月16日）基金份额总额	406,303,580.25
本报告期期初基金份额总额	835,715,606.68
本报告期基金总申购份额	129,215,513.33
减：本报告期基金总赎回份额	433,000,719.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	531,930,400.80

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

报告期内，2012年1月31日，经基金管理人股东书面决定，同意接受陈国杰先生辞任公司董事一职，同时任命 Rajeev Mittal 先生为公司董事，其任期自 2012年2月1日起。2012年10

月 12 日，经基金管理人股东书面决定，同意接受李应如女士辞任公司董事一职，同时任命 David Jiang 先生为公司董事，其任期自 2012 年 10 月 12 日起。以上事项已按规定报监管部门备案。

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。2013 年 3 月 17 日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于 2013 年 3 月 17 日公告上述事项。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 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。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 75,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 5 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
宏源证券		21,048,688,975.05	27.26%	907,200.42	27.46%	-
华泰证券	2	787,704,807.52	20.48%	676,739.56	20.49%	-
银河证券	1	591,590,775.57	15.38%	512,130.87	15.50%	-
中信建投	1	396,743,217.23	10.31%	340,216.86	10.30%	-

兴业证券	1	359,014,353.72	9.33%	305,664.13	9.25%	-
中投证券	1	339,013,973.20	8.81%	287,937.84	8.72%	-
中航证券	1	217,076,825.30	5.64%	179,690.34	5.44%	-
东海证券	1	107,241,252.89	2.79%	93,621.23	2.83%	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-

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需要，并能为基金提供全面的信息服。
- 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。

3、本报告期内，基金管理人代表基金新增租用了宏源证券股份有限公司的专用交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
宏源证券	10,630,500.00	12.25%	-	-	-	-
华泰证券	75,613,419.20	87.13%	-	-	-	-
银河证券	534,250.00	0.62%	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-

华泰柏瑞基金管理有限公司  
2013 年 3 月 28 日