

华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金 2013 年半年度报告 摘要

2013 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：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 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 | 352,912,585.95 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 | 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 | 44,251,343.38 |
| 本期利润 | 33,369,117.94 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0805 |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.64% |
| 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 | -0.2144 |
| 期末基金资产净值 | 371,475,154.27 |
| 期末基金份额净值 | 1.0526 |

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 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

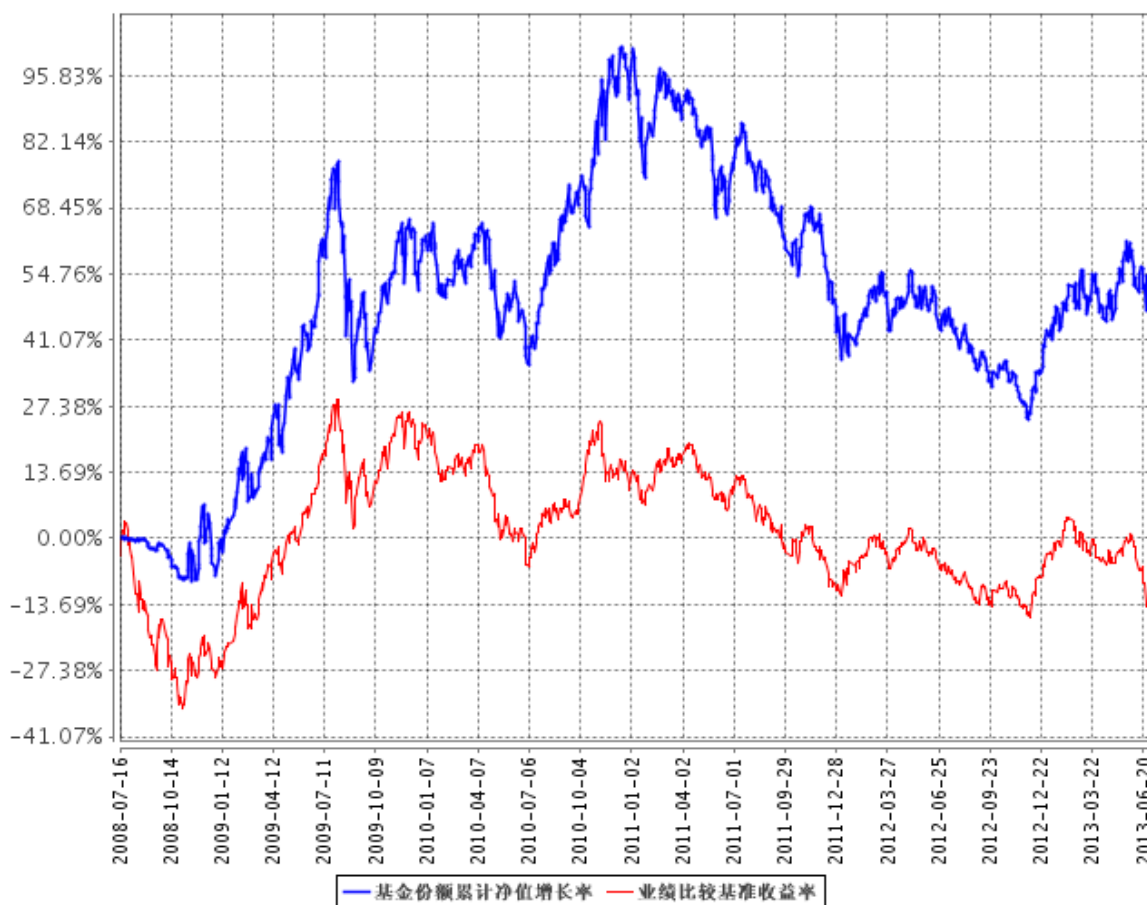
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -3.64% | 1.73% | -12.55% | 1.49% | 8.91% | 0.24% |
| 过去三个月 | 1.21% | 1.45% | -9.32% | 1.16% | 10.53% | 0.29% |
| 过去六个月 | 6.64% | 1.41% | -9.86% | 1.20% | 16.50% | 0.21% |
| 过去一年 | 5.14% | 1.15% | -7.65% | 1.09% | 12.79% | 0.06% |

| | | | | | | |
|-------------|--------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去三年 | 9.38% | 1.24% | -8.79% | 1.10% | 18.17% | 0.14% |
| 自基金合同生效日起至今 | 52.73% | 1.45% | -12.84% | 1.42% | 65.57% | 0.03% |

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 2013 年 6 月 30 日。1、本基金基金合同生效日为 2008 年 7 月 16 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%。

§ 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和华泰柏瑞稳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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|-----------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 沈雪峰 | 本基金的基金经理、投资部副总监 | 2013年2月7日 | - | 20 | 经济学硕士。历任：安徽省国际信托投资公司投资银行部、股票自营部投资经理；华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员；亚洲证券资产管理总部副总经理兼固定收益证券管理总部副经理、 |

| | | | | | |
|----|---------------|-----------------|-----------------|------|--|
| | | | | | 研究所副所长；华富基金管理公司资深研究员、基金经理、投研部副总监。后重新加入华安基金管理公司，任基金经理。2012 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013 年 2 月起任华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金的基金经理。 |
| 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 | 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。 |
|--|--|--|--|--|---|

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。

4.3.2 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

2013 年上半年，宏观经济表现平平，一季度在经济复苏的预期下周期性行业持续反弹行情，

但随后二季度的经济数据表明经济仍然疲弱，但经济刺激政策一直未有出现，加之政府加强了对地产及影子银行中潜在风险的控制，在 6 月底一度出现银行间市场“钱荒”的特殊状况，导致股市债市双双大挫，上证综指创出 2008 年以来的新低。上半年沪深 300 指数下跌约 11.3%，采掘、有色、钢铁、建筑建材、银行等周期性行业跌幅居前。但与此同时，政府积极推动经济结构调整，鼓励内需和新兴产业发展，由此造成市场结构性机会明显，市场风格严重分化。上半年中小板指数上涨 21%，创业板指数大涨 66.7%，其中信息服务、医药生物、电子和信息设备、无线互联网、传媒等行业涨幅居前。

本基金上半年一直坚守成长股的投资风格，配置上偏重于医药、TMT、环保、食品饮料等行业，上半年投资绩效良好。

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 1.0526 元，累计净值为 1.5626 元，本报告期内基金份额净值增长率为 6.64%，同期业绩比较基准增长率为-9.86%。

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，本基金认为经济的增长仍然面临诸多挑战。首先，传统产业产能过剩、杠杆过高的问题仍然存在，增长空间十分有限；其次，新一届政府对宏观经济增速下滑的容忍度也有所提高，在政策上使用刺激性政策较为谨慎；海外市场方面，外需起色不大，而美国量化宽松政策退出的预期在加强，导致国内流动性可能受到负面影响。因此，预计股票市场难有大的趋势性投资机会。

但是经济经过上半年持续探底后可能在下半年出现补库存短周期，7 月份宏观经济数据出现了良好的企稳现象，与此同时，经济保增长和就业的底线需求在增加，房地产调控更趋市场化，四季度将召开的三中全会也将强化市场对政策的预期，短期经济筑底将给跌跌不休的周期性板块带来喘息反弹的机会，而成长股也将借机休整，我们判断上证综指阶段性筑底，股市存在较多的投资机会。我们不会过多纠结于市场风格是否转换，长期看好医药、食品饮料、电子等消费类产业，以及环保、智慧城市、电子信息、新媒体、军工等战略性新兴产业，在周期性板块出现反弹的同时注重把握对成长股更好的买入机会。

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 6 次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 10%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。报告期内基金未实施收益分配。截至本报告期末，本基金可分配收益为 -75,665,780.62 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：华泰柏瑞价值增长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 | | 941,787.73 | 54,630,838.33 |
| 结算备付金 | | 3,638,930.11 | 1,054,692.31 |
| 存出保证金 | | 501,349.35 | 1,000,000.00 |
| 交易性金融资产 | | 307,490,222.40 | 469,479,795.41 |
| 其中：股票投资 | | 287,500,222.40 | 469,479,795.41 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 19,990,000.00 | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | 36,400,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | | 38,988,164.96 | 2,118,539.99 |
| 应收利息 | | 629,002.28 | 10,406.81 |
| 应收股利 | | 45,030.00 | - |
| 应收申购款 | | 22,411.00 | 37,843.74 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 388,656,897.83 | 528,332,116.59 |
| 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 | | 15,283,937.93 | - |

| | | | |
|---------------|--|----------------|----------------|
| 应付赎回款 | | 97,189.68 | 297,796.34 |
| 应付管理人报酬 | | 431,428.07 | 621,369.32 |
| 应付托管费 | | 71,904.69 | 103,561.54 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 911,069.70 | 544,494.91 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 386,213.49 | 1,695,508.81 |
| 负债合计 | | 17,181,743.56 | 3,262,730.92 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 352,912,585.95 | 531,930,400.80 |
| 未分配利润 | | 18,562,568.32 | -6,861,015.13 |
| 所有者权益合计 | | 371,475,154.27 | 525,069,385.67 |
| 负债和所有者权益总计 | | 388,656,897.83 | 528,332,116.59 |

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0526 元，基金份额总额 352,912,585.95 份。

6.2 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：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 | | 40,740,465.62 | 9,038,849.97 |
| 1.利息收入 | | 904,723.74 | 513,161.44 |
| 其中：存款利息收入 | | 119,054.48 | 392,304.30 |
| 债券利息收入 | | 236,005.48 | 120,857.14 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 549,663.78 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 50,626,383.26 | -38,713,311.39 |
| 其中：股票投资收益 | | 48,965,511.38 | -42,526,453.90 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | - | 2,760.00 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 1,660,871.88 | 3,810,382.51 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | -10,882,225.44 | 47,108,623.18 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|--|----------------------|----------------------|
| 列) | | | |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | | 91,584.06 | 130,376.74 |
| 减:二、费用 | | 7,371,347.68 | 10,432,616.50 |
| 1. 管理人报酬 | | 3,185,866.31 | 5,795,660.25 |
| 2. 托管费 | | 530,977.73 | 965,943.44 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | | 3,453,281.85 | 3,448,408.87 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中: 卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | | 201,221.79 | 222,603.94 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 33,369,117.94 | -1,393,766.53 |
| 减: 所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 33,369,117.94 | -1,393,766.53 |

6.3 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: 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) | 531,930,400.80 | -6,861,015.13 | 525,069,385.67 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 33,369,117.94 | 33,369,117.94 |
| 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) | -179,017,814.85 | -7,945,534.49 | -186,963,349.34 |
| 其中: 1.基金申购款 | 65,354,569.81 | 2,542,312.09 | 67,896,881.90 |
| 2. 基金赎回款 | -244,372,384.66 | -10,487,846.58 | -254,860,231.24 |
| 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 | 352,912,585.95 | 18,562,568.32 | 371,475,154.27 |

| 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 |
| | 金净值) | | |
| 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(本期净利润) | - | -1,393,766.53 | -1,393,766.53 |
| 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) | -99,377,854.91 | -1,745,963.64 | -101,123,818.55 |
| 其中：1.基金申购款 | 74,599,874.37 | 2,047,580.53 | 76,647,454.90 |
| 2.基金赎回款 | -173,977,729.28 | -3,793,544.17 | -177,771,273.45 |
| 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) | 736,337,751.77 | 826,770.77 | 737,164,522.54 |

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
基金管理人负责人

 房伟力
主管会计工作负责人

 陈培
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金(原“友邦华泰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”)。

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×80%+上证国债指数×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 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。

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) 对基金取得的股票的股息、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 |

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。

6.4.8 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 | 455,134,792.46 | 20.54% | 342,971,606.78 | 15.44% |

债券回购交易

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 | |
|----------------|---------------------------------------|----------------------------|--|----------------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的 比例 | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的比 例 |
| 华泰证券股份 有限公司 | 243,100,000.00 | 14.86% | - | - |

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 | 406,435.56 | 20.48% | 136,705.43 | 15.01% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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 | 279,560.54 | 14.97% | 137,225.83 | 13.25% |

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。

3. 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 | 上年度可比期间 |
|-----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | 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 | 3,185,866.31 | 5,795,660.25 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 323,129.56 | 388,597.83 |

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | 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 | 530,977.73 | 965,943.44 |

注：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。

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：无。

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

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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 | 5.60% | 2.68% |

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：无。

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 | | 上年度可比期间 | |
|------------|---------------------------------|-----------|---------------------------------|------------|
| | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | | 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 | 941,787.73 | 94,144.40 | 78,518,278.05 | 377,346.34 |

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

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 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 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 | 470,000 | 12,711,284.25 | 13,418,500.00 | - |
| 600436 | 片仔癀 | 2013年6月21日 | 重大事项 | 136.82 | 2013年7月1日 | 118.73 | 60,000 | 8,021,521.04 | 8,209,200.00 | - |

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 | 287,500,222.40 | 73.97 |
| | 其中：股票 | 287,500,222.40 | 73.97 |
| 2 | 固定收益投资 | 19,990,000.00 | 5.14 |
| | 其中：债券 | 19,990,000.00 | 5.14 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 36,400,000.00 | 9.37 |
| | 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 | 4,580,717.84 | 1.18 |
| 6 | 其他各项资产 | 40,185,957.59 | 10.34 |
| 7 | 合计 | 388,656,897.83 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 171,208,510.97 | 46.09 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,422,000.00 | 1.73 |
| E | 建筑业 | 3,829,000.00 | 1.03 |
| F | 批发和零售业 | 17,195,650.00 | 4.63 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 29,350,143.00 | 7.90 |
| J | 金融业 | 2,708,120.00 | 0.73 |
| K | 房地产业 | 1,807,400.00 | 0.49 |
| L | 租赁和商务服务业 | 500,400.00 | 0.13 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 10,150,100.00 | 2.73 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 24,080,898.43 | 6.48 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,359,500.00 | 0.37 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 16,944,500.00 | 4.56 |
| S | 综合 | 1,944,000.00 | 0.52 |
| | 合计 | 287,500,222.40 | 77.39 |

7.3 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 | 000538 | 云南白药 | 302,500 | 25,413,025.00 | 6.84 |
| 2 | 000049 | 德赛电池 | 380,000 | 22,800,000.00 | 6.14 |
| 3 | 002241 | 歌尔声学 | 610,409 | 22,151,742.61 | 5.96 |
| 4 | 002038 | 双鹭药业 | 350,000 | 20,510,000.00 | 5.52 |
| 5 | 300027 | 华谊兄弟 | 470,000 | 13,418,500.00 | 3.61 |
| 6 | 300315 | 掌趣科技 | 350,000 | 11,543,000.00 | 3.11 |
| 7 | 002573 | 国电清新 | 600,000 | 9,768,000.00 | 2.63 |
| 8 | 300070 | 碧水源 | 250,000 | 9,420,000.00 | 2.54 |
| 9 | 300113 | 顺网科技 | 220,000 | 9,361,000.00 | 2.52 |
| 10 | 600436 | 片仔癀 | 60,000 | 8,209,200.00 | 2.21 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读载于基金管理人网站（www.huatai-pb.com）的半年度报告正文。

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 | 000001 | 平安银行 | 40,647,244.92 | 7.74 |
| 2 | 000538 | 云南白药 | 34,065,614.16 | 6.49 |
| 3 | 000024 | 招商地产 | 31,164,907.69 | 5.94 |
| 4 | 000963 | 华东医药 | 30,589,466.47 | 5.83 |
| 5 | 000049 | 德赛电池 | 26,244,603.33 | 5.00 |
| 6 | 002038 | 双鹭药业 | 24,011,741.43 | 4.57 |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 22,570,794.94 | 4.30 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 22,131,472.34 | 4.21 |
| 9 | 000002 | 万科A | 21,427,472.31 | 4.08 |
| 10 | 002241 | 歌尔声学 | 21,048,559.69 | 4.01 |
| 11 | 600535 | 天士力 | 19,657,302.43 | 3.74 |
| 12 | 002570 | 贝因美 | 19,299,446.38 | 3.68 |
| 13 | 002573 | 国电清新 | 18,829,862.93 | 3.59 |
| 14 | 000423 | 东阿阿胶 | 18,203,733.32 | 3.47 |
| 15 | 600436 | 片仔癀 | 17,106,793.14 | 3.26 |
| 16 | 600292 | 九龙电力 | 16,811,339.35 | 3.20 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 17 | 002415 | 海康威视 | 16,665,374.51 | 3.17 |
| 18 | 002273 | 水晶光电 | 15,915,969.40 | 3.03 |
| 19 | 300027 | 华谊兄弟 | 15,441,195.55 | 2.94 |
| 20 | 300026 | 红日药业 | 15,291,795.61 | 2.91 |
| 21 | 601601 | 中国太保 | 13,557,733.55 | 2.58 |
| 22 | 601699 | 潞安环能 | 13,348,822.69 | 2.54 |
| 23 | 300315 | 掌趣科技 | 13,060,038.70 | 2.49 |
| 24 | 300070 | 碧水源 | 12,603,049.20 | 2.40 |
| 25 | 300347 | 泰格医药 | 12,590,773.74 | 2.40 |
| 26 | 300113 | 顺网科技 | 12,572,888.43 | 2.39 |
| 27 | 600085 | 同仁堂 | 11,503,706.03 | 2.19 |

注：不考虑相关交易费用。

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 | 000024 | 招商地产 | 43,599,464.14 | 8.30 |
| 2 | 000001 | 平安银行 | 39,273,335.64 | 7.48 |
| 3 | 600597 | 光明乳业 | 38,909,899.26 | 7.41 |
| 4 | 600048 | 保利地产 | 34,494,704.10 | 6.57 |
| 5 | 000581 | 威孚高科 | 28,128,116.18 | 5.36 |
| 6 | 600276 | 恒瑞医药 | 26,623,986.20 | 5.07 |
| 7 | 000963 | 华东医药 | 25,740,696.97 | 4.90 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 22,541,384.41 | 4.29 |
| 9 | 300039 | 上海凯宝 | 22,017,404.00 | 4.19 |
| 10 | 600900 | 长江电力 | 21,503,823.33 | 4.10 |
| 11 | 000002 | 万科A | 21,367,310.48 | 4.07 |
| 12 | 600028 | 中国石化 | 20,692,684.22 | 3.94 |
| 13 | 600535 | 天士力 | 19,106,316.54 | 3.64 |
| 14 | 000423 | 东阿阿胶 | 18,557,526.78 | 3.53 |
| 15 | 002273 | 水晶光电 | 17,901,838.76 | 3.41 |
| 16 | 600085 | 同仁堂 | 17,191,503.28 | 3.27 |
| 17 | 300026 | 红日药业 | 16,907,773.94 | 3.22 |
| 18 | 000651 | 格力电器 | 16,181,716.66 | 3.08 |
| 19 | 601088 | 中国神华 | 13,772,313.34 | 2.62 |
| 20 | 000538 | 云南白药 | 13,334,871.73 | 2.54 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 21 | 002244 | 滨江集团 | 13,298,545.19 | 2.53 |
| 22 | 600292 | 九龙电力 | 13,292,996.94 | 2.53 |
| 23 | 002570 | 贝因美 | 13,229,897.90 | 2.52 |
| 24 | 000826 | 桑德环境 | 13,159,246.52 | 2.51 |
| 25 | 601601 | 中国太保 | 12,986,232.83 | 2.47 |
| 26 | 300347 | 泰格医药 | 12,870,430.80 | 2.45 |
| 27 | 002573 | 国电清新 | 12,490,815.55 | 2.38 |
| 28 | 000338 | 潍柴动力 | 12,119,563.36 | 2.31 |
| 29 | 002415 | 海康威视 | 11,708,008.55 | 2.23 |
| 30 | 600066 | 宇通客车 | 11,255,610.34 | 2.14 |
| 31 | 600499 | 科达机电 | 10,967,797.69 | 2.09 |
| 32 | 601699 | 潞安环能 | 10,882,073.85 | 2.07 |
| 33 | 600422 | 昆明制药 | 10,503,028.61 | 2.00 |

注：不考虑相关交易费用。

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 | 997,958,005.76 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,218,000,744.71 |

注：不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 19,990,000.00 | 5.38 |
| | 其中：政策性金融债 | 19,990,000.00 | 5.38 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 19,990,000.00 | 5.38 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 120228 | 12 国开 28 | 200,000 | 19,990,000.00 | 5.38 |

7.7 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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：无。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

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。

7.10.2

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。

7.10.3 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 | 501,349.35 |
| 2 | 应收证券清算款 | 38,988,164.96 |
| 3 | 应收股利 | 45,030.00 |
| 4 | 应收利息 | 629,002.28 |
| 5 | 应收申购款 | 22,411.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 40,185,957.59 |

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|---------------|----------|
| 1 | 300027 | 华谊兄弟 | 13,418,500.00 | 3.61 | 重大事项 |
| 2 | 600436 | 片仔癀 | 8,209,200.00 | 2.21 | 重大事项 |

7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：无。

§ 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 |
| 10,591 | 33,321.93 | 145,313,090.15 | 41.18% | 207,599,495.80 | 58.82% |

8.3 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 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 897,160.96 | 0.2542% |

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 50 万份至 100 万份（含）。

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。

§ 9 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 | 531,930,400.80 |
| 本报告期基金总申购份额 | 65,354,569.81 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 244,372,384.66 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 352,912,585.95 |

§ 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

报告期内，基金管理人通过股东会决议，任命韩勇先生为公司董事、杨科先生为公司独立董事。上述人员的变更已报中国证券监督管理委员会及上海监管局备案。

报告期内，基金管理人通过员工民主选举并经股东会决议，任命陈培先生为公司监事。

报告期内基金经理变动情况如下：

沈雪峰任华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金的基金经理，原基金经理汪晖不再管理该基金。

上述基金经理的变更已报中国证券投资基金业协会及上海监管局备案。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

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。

2013 年 6 月 1 日，中国银行股份有限公司发布公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

10.3 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。

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

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。

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 | |
| 宏源证券 | 2 | 706,835,934.53 | 31.90% | 632,585.22 | 31.88% | - |
| 中投证券 | 1 | 551,079,091.74 | 24.87% | 487,649.19 | 24.57% | - |
| 华泰证券 | 3 | 455,134,792.46 | 20.54% | 406,435.56 | 20.48% | - |
| 兴业证券 | 1 | 321,557,510.67 | 14.51% | 292,746.73 | 14.75% | - |
| 银河证券 | 1 | 181,351,421.07 | 8.18% | 165,102.44 | 8.32% | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 爱建证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 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，本基金未新增专用交易单元。

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

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 | - | - | 192,500,000.00 | 11.77% | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | 243,100,000.00 | 14.86% | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|----------------|--------|---|---|
| 兴业证券 | - | - | 491,400,000.00 | 30.03% | - | - |
| 银河证券 | - | - | 709,100,000.00 | 43.34% | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 爱建证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | - | - | - | - | - | - |

华泰柏瑞基金管理有限公司
2013 年 8 月 26 日