

华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金 2014 年年度报告 摘要

2014 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：2015 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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 2015 年 3 月 30 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，应阅读年报报告正文。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 2014 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	1,455,066,003.59 份

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

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 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及托管人住所

§ 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	2014 年	2013 年 8 月 2 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	189,968,127.14	4,939,162.74
本期利润	671,132,332.15	6,762,531.83
加权平均基金份额本期利润	1.2889	0.0538
本期基金份额净值增长率	70.42%	3.10%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3293	0.0307
期末基金资产净值	2,556,925,361.15	238,479,442.72
期末基金份额净值	1.757	1.031

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。

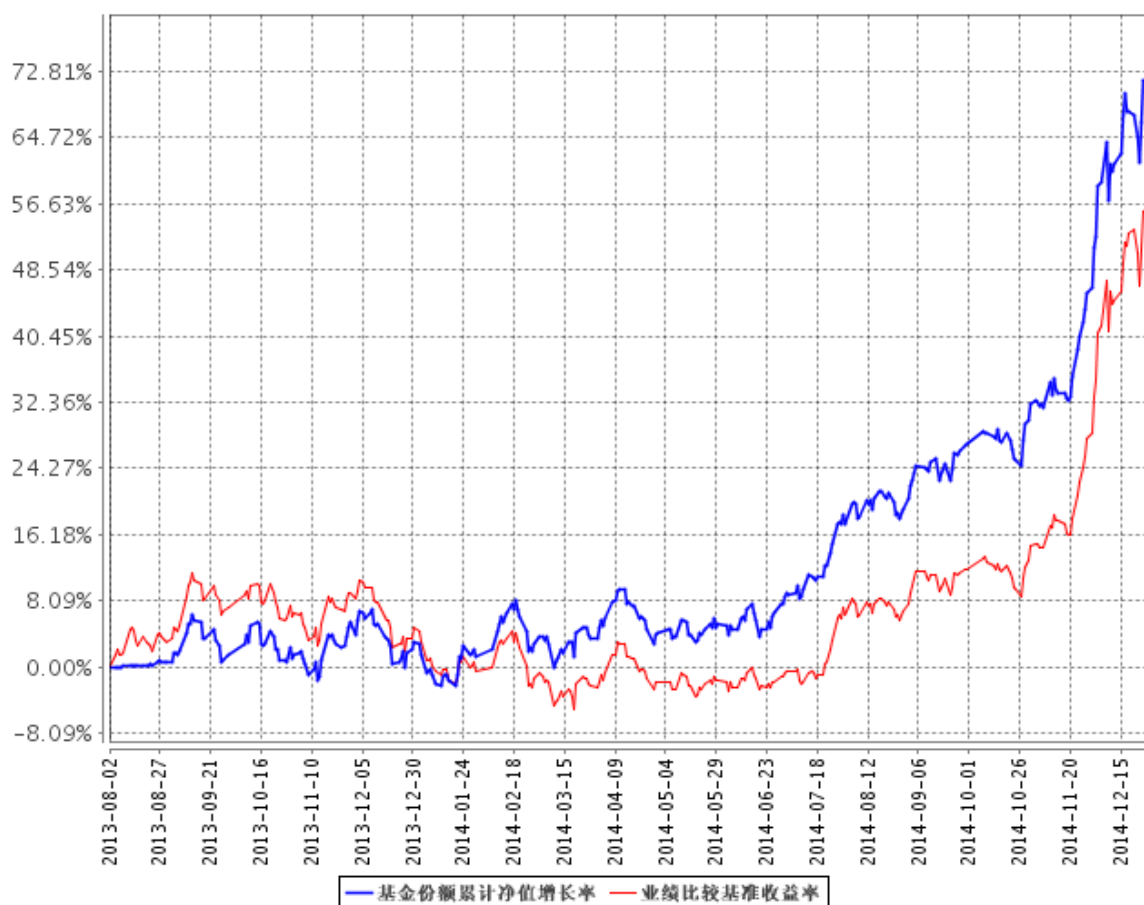
3.2 基金净值表现

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	38.13%	1.49%	42.52%	1.56%	-4.39%	-0.07%
过去六个月	63.14%	1.21%	61.39%	1.26%	1.75%	-0.05%
过去一年	70.42%	1.12%	52.47%	1.15%	17.95%	-0.03%
自基金合同生效起至今	75.70%	1.08%	59.65%	1.13%	16.05%	-0.05%

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

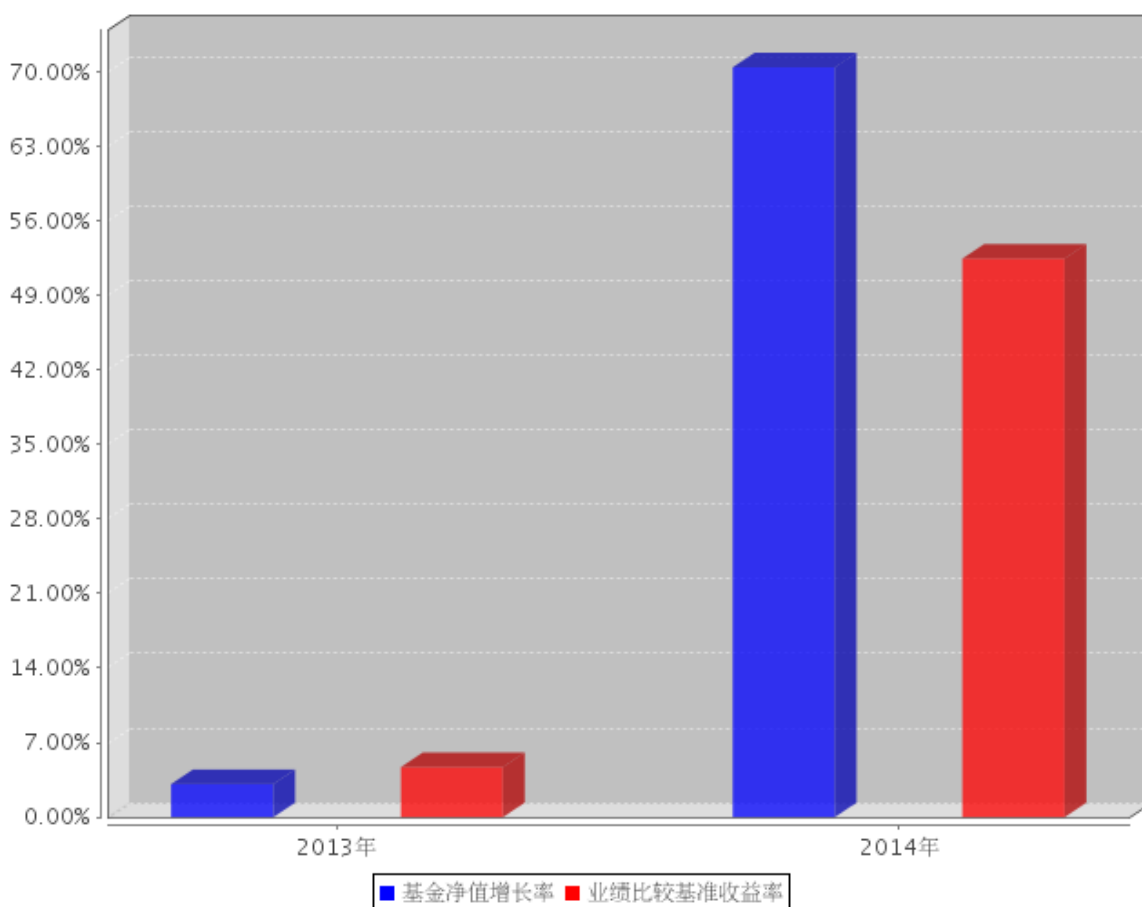


注：图示日期为 2013 年 8 月 2 日至 2014 年 12 月 31 日。

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%。

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：本基金合同于 2013 年 8 月 2 日生效，2013 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

§ 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

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、华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金、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、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金和华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金。截至 2014 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 600.75 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	副总经理兼量化投资部总监、本基金的基金经理	2013年8月2日	-	12	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。2014年12月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基

					金经理。 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《华泰柏瑞量化指数增强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，不存在不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，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

2014 年上半年，中国经济增速进一步放缓，经济数据持续下滑，股市创业板冲高回落，主板市场总体比较比较低迷。下半年随着各项改革措施逐步出台、市场对沪港通的预期升温，大盘股股价开始缓慢爬升。到了 11 月，央行降息引爆主板市场，金融、建筑、地产等板块的大盘蓝筹股急速拉升，最终大盘股表现超越中小盘。

2014 年全年，我们坚持发挥自己的量化选股优势。上半年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；下半年则在小盘积累了一定风险之后收缩了对小盘股和一些行业的暴露；全年实现了预期的超额收益和同类基金靠前的比较好的绝对收益。

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 1.757 元，本报告期内基金份额净值上涨 70.42%，同期本基金的业绩比较基准上涨 52.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票主板市场在经历了 2014 年最后两个月的大幅向上调整之后，我们目前对 2015 年的 A 股市场仍是偏向乐观的。我们认为市场在经历一轮估值修复之后，主要逻辑没有发生根本变化：从大类资产配置角度看，国内房地产市场价格见顶基本达成共识，信托投资需求下降，黄金等大宗商品震荡下行趋势确立；2015 年真实利率走势很可能下行，则银行理财产品的预期收益率也会随之下降。而在国内宏观经济增速走弱的情况下，央行的货币政策可能更加灵活，对经济注入一定的流动性；A 股市场显现赚钱效应，可能可以起到资金池的作用。因此 2015 年可能仍会有较多资金流入股市。但在 2014 年最后两个月的急涨之后，由于经济整体走弱，股票市场短期有可能在调整中上行。当前来看，2015 年的前两个月创业板和小盘股积累了一定的风险，后市我们更期待主板中盘和大盘股的表现。

本基金还是会一贯坚持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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2014 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进行事先合规性设置，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业务、交易合规、市场宣传、客户服务、信息技术安全、交易佣金分配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、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。

4.8 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 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。基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配。截止本报告期末，本基金可分配收益为 479,154,737.91 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

6.1 审计报告基本信息

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（2015）第 21325 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：华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		91,346,442.17	60,663,721.97
结算备付金		7,141,111.71	302,182.37
存出保证金		751,539.46	72,757.00
交易性金融资产		2,492,446,513.22	204,703,354.85
其中：股票投资		2,412,422,513.22	204,703,354.85
基金投资		-	-
债券投资		80,024,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		9,995,163.02	-
应收利息		2,387,825.26	4,357.47
应收股利		-	-
应收申购款		23,251,685.29	968,154.65
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,627,320,280.13	266,714,528.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,319,544.16	27,570,820.80
应付赎回款		62,144,821.69	20,077.15
应付管理人报酬		1,815,635.51	99,098.21
应付托管费		453,908.88	24,774.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,216,795.44	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		444,213.30	210,075.67
负债合计		70,394,918.98	28,235,085.59
所有者权益：			
实收基金		1,455,066,003.59	231,382,764.42
未分配利润		1,101,859,357.56	7,096,678.30
所有者权益合计		2,556,925,361.15	238,479,442.72
负债和所有者权益总计		2,627,320,280.13	266,714,528.31

注：1. 报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.757 元，基金份额总额 1,455,066,003.59 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 8 月 2 日(基 金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		688,574,141.11	8,344,268.25
1. 利息收入		582,064.45	688,122.38
其中：存款利息收入		439,404.99	146,372.70
债券利息收入		142,659.46	109.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	541,639.85
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		205,039,377.85	5,386,141.61
其中：股票投资收益		195,589,129.71	5,310,604.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益		377,303.52	23,171.37
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		9,072,944.62	52,366.18
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		481,164,205.01	1,823,369.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）		1,788,493.80	446,635.17
减：二、费用		17,441,808.96	1,581,736.42
1. 管理人报酬		6,638,597.09	510,459.41
2. 托管费		1,659,649.31	127,614.90
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		8,895,583.80	725,022.77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		247,978.76	218,639.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		671,132,332.15	6,762,531.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		671,132,332.15	6,762,531.83

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	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（本期净利润）	-	671,132,332.15	671,132,332.15
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）	1,223,683,239.17	423,630,347.11	1,647,313,586.28
其中：1. 基金申购款	2,320,363,548.01	762,563,079.55	3,082,926,627.56
2. 基金赎回款	-1,096,680,308.84	-338,932,732.44	-1,435,613,041.28
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）	1,455,066,003.59	1,101,859,357.56	2,556,925,361.15

项目	上年度可比期间 2013 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2013 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)	333,186,365.72	-	333,186,365.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	6,762,531.83	6,762,531.83
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)	-101,803,601.30	334,146.47	-101,469,454.83
其中: 1. 基金申购款	249,306,013.42	6,531,853.93	255,837,867.35
2. 基金赎回款	-351,109,614.72	-6,197,707.46	-357,307,322.18
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)	231,382,764.42	7,096,678.30	238,479,442.72

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

7.4 报表附注

7.4.1 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 2015 年 3 月 31 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 7.4.4 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。

7.4.3 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 12 月 31 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 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日止期间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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 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

注：1、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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2013年8月2日(基金合同生效日)至2013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	963,808,308.42	15.15%	266,077,061.83	49.30%

债券交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014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	877,019.00	15.35%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2013年8月2日(基金合同生效日)至2013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	242,185.14	49.83%	161,539.38	52.07%
----------------	------------	--------	------------	--------

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的净额列示。权证交易不计佣金。

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年8月2日(基金合同生效日) 至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,638,597.09	510,459.41
其中：支付销售机构的客户维护费	697,960.52	218,466.66

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年8月2日(基金合同生效日) 至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,659,649.31	127,614.90

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。

7.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期无销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间债券市场债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内未获基金管理人固有资金投资。

7.4.8.4.2 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：本基金本报告期内未获除基金管理人之外的其他关联方投资。

7.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年8月2日(基金合同生效日)至2013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	91,346,442.17	361,364.12	60,663,721.97	134,501.53

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金报告期末未持有认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.9.2 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
600580	卧龙电气	2014年12月8日	临时停牌	10.48	2015年1月14日	11.12	579,493	5,487,470.49	6,073,086.64	-
300315	掌趣科技	2014年7月14日	临时停牌	15.83	2015年2月16日	17.41	4,100	70,532.00	64,903.00	-

注：本基金截至2014年12月31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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2014 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次的余额为 2,406,284,523.58 元，属于第二层次的余额为 86,161,989.64 元，无属于第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 202,048,529.85 元，第二层次的余额为 2,654,825.00 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 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，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，本基金不会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将相关股票的公允价值列入第一层次；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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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。

(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	2,412,422,513.22	91.82
	其中：股票	2,412,422,513.22	91.82
2	固定收益投资	80,024,000.00	3.05
	其中：债券	80,024,000.00	3.05
	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	98,487,553.88	3.75
7	其他各项资产	36,386,213.03	1.38
8	合计	2,627,320,280.13	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	-	-
B	采矿业	45,195,271.72	1.77
C	制造业	925,078,935.76	36.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,097,794.31	1.88
E	建筑业	141,908,042.48	5.55
F	批发和零售业	64,649,551.85	2.53
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	3,553,865.00	0.14
J	金融业	1,002,242,314.77	39.20
K	房地产业	172,462,665.33	6.74
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	9,234,072.00	0.36
S	综合	-	-
	合计	2,412,422,513.22	94.35

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	601318	中国平安	1,514,754	113,167,271.34	4.43

2	600837	海通证券	3,257,400	78,373,044.00	3.07
3	600036	招商银行	4,093,994	67,919,360.46	2.66
4	601668	中国建筑	9,116,746	66,369,910.88	2.60
5	600999	招商证券	2,318,530	65,544,843.10	2.56
6	600015	华夏银行	4,455,754	59,974,448.84	2.35
7	000651	格力电器	1,575,637	58,487,645.44	2.29
8	601398	工商银行	11,757,014	57,256,658.18	2.24
9	601818	光大银行	11,725,400	57,219,952.00	2.24
10	600000	浦发银行	3,624,128	56,862,568.32	2.22

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	601318	中国平安	67,404,387.88	28.26
2	000651	格力电器	62,148,396.14	26.06
3	601668	中国建筑	59,181,735.50	24.82
4	000540	中天城投	57,592,610.00	24.15
5	600837	海通证券	56,130,945.28	23.54
6	601398	工商银行	55,522,596.49	23.28
7	601009	南京银行	52,183,787.56	21.88
8	000002	万科A	50,760,957.17	21.29
9	000418	小天鹅A	46,544,110.18	19.52
10	600015	华夏银行	45,340,555.43	19.01
11	600694	大商股份	44,929,575.44	18.84
12	000671	阳光城	43,980,173.22	18.44
13	000625	长安汽车	43,556,828.75	18.26
14	600036	招商银行	43,060,449.37	18.06
15	002311	海大集团	42,196,308.91	17.69
16	002521	齐峰新材	41,265,825.94	17.30
17	601377	兴业证券	41,232,258.85	17.29
18	601818	光大银行	41,124,113.00	17.24
19	600000	浦发银行	39,867,762.00	16.72

20	601336	新华保险	39,748,634.61	16.67
21	002415	海康威视	38,736,132.44	16.24
22	002392	北京利尔	38,519,844.91	16.15
23	000001	平安银行	38,143,602.95	15.99
24	000708	大冶特钢	36,805,404.00	15.43
25	002508	老板电器	34,797,397.80	14.59
26	002001	新和成	33,805,180.02	14.18
27	000550	江铃汽车	33,630,892.26	14.10
28	002567	唐人神	33,024,718.17	13.85
29	002179	中航光电	32,468,398.31	13.61
30	601801	皖新传媒	32,451,783.40	13.61
31	601088	中国神华	31,786,382.94	13.33
32	002367	康力电梯	31,562,618.62	13.23
33	600999	招商证券	30,948,577.54	12.98
34	000789	万年青	30,455,619.33	12.77
35	600887	伊利股份	30,272,330.44	12.69
36	601233	桐昆股份	29,931,593.75	12.55
37	600742	一汽富维	29,430,278.17	12.34
38	601288	农业银行	29,349,630.07	12.31
39	601555	东吴证券	29,125,612.04	12.21
40	600104	上汽集团	28,858,502.15	12.10
41	600426	华鲁恒升	28,710,030.64	12.04
42	000961	中南建设	28,548,413.82	11.97
43	600016	民生银行	27,131,125.64	11.38
44	600030	中信证券	26,374,152.31	11.06
45	000630	铜陵有色	26,280,326.90	11.02
46	002020	京新药业	25,859,973.59	10.84
47	600201	金宇集团	24,712,471.78	10.36
48	000600	建投能源	24,660,044.46	10.34
49	600376	首开股份	24,562,985.76	10.30
50	000776	广发证券	24,445,293.97	10.25
51	600660	福耀玻璃	24,199,414.94	10.15
52	600027	华电国际	23,609,810.24	9.90
53	600823	世茂股份	23,444,395.79	9.83
54	600461	洪城水业	23,093,789.60	9.68
55	601601	中国太保	23,074,458.32	9.68

56	002025	航天电器	22,667,917.91	9.51
57	601857	中国石油	22,600,711.40	9.48
58	002673	西部证券	22,472,106.03	9.42
59	601328	交通银行	22,198,678.07	9.31
60	000338	潍柴动力	21,880,374.70	9.17
61	600886	国投电力	21,830,876.03	9.15
62	601169	北京银行	21,800,600.77	9.14
63	002321	华英农业	21,555,247.34	9.04
64	601799	星宇股份	20,718,693.37	8.69
65	600987	航民股份	20,501,579.10	8.60
66	600583	海油工程	20,385,090.35	8.55
67	002142	宁波银行	20,118,042.87	8.44
68	002595	豪迈科技	19,966,229.53	8.37
69	600816	安信信托	19,251,763.42	8.07
70	600720	祁连山	19,189,558.43	8.05
71	002139	拓邦股份	19,040,697.25	7.98
72	002191	劲嘉股份	18,975,279.51	7.96
73	600801	华新水泥	18,512,391.03	7.76
74	600068	葛洲坝	18,321,000.94	7.68
75	601390	中国中铁	17,988,233.27	7.54
76	002427	尤夫股份	17,943,490.06	7.52
77	601808	中海油服	17,723,831.54	7.43
78	000596	古井贡酒	17,668,302.69	7.41
79	601998	中信银行	17,278,678.51	7.25
80	601788	光大证券	17,224,631.43	7.22
81	002554	惠博普	17,198,404.96	7.21
82	600643	爱建股份	16,674,916.64	6.99
83	002462	嘉事堂	16,262,708.96	6.82
84	000100	TCL 集团	16,223,339.00	6.80
85	002293	罗莱家纺	16,144,357.66	6.77
86	600486	扬农化工	16,097,881.28	6.75
87	600761	安徽合力	16,021,104.39	6.72
88	000728	国元证券	15,601,524.29	6.54
89	002026	山东威达	15,368,922.07	6.44
90	000333	美的集团	15,349,522.19	6.44
91	002233	塔牌集团	15,326,899.72	6.43

92	600019	宝钢股份	15,233,353.45	6.39
93	600298	安琪酵母	15,196,173.26	6.37
94	600369	西南证券	15,082,509.06	6.32
95	600580	卧龙电气	14,907,586.36	6.25
96	002540	亚太科技	14,231,255.65	5.97
97	600183	生益科技	14,030,271.86	5.88
98	002158	汉钟精机	13,794,132.18	5.78
99	002104	恒宝股份	13,685,223.45	5.74
100	600126	杭钢股份	13,421,949.35	5.63
101	002500	山西证券	13,307,033.55	5.58
102	000830	鲁西化工	12,953,474.89	5.43
103	002003	伟星股份	12,871,863.30	5.40
104	002215	诺普信	12,726,552.38	5.34
105	600011	华能国际	12,519,342.30	5.25
106	600697	欧亚集团	12,443,774.61	5.22
107	601000	唐山港	12,282,407.93	5.15
108	002008	大族激光	12,202,704.08	5.12
109	002299	圣农发展	12,162,327.36	5.10
110	600177	雅戈尔	12,155,359.31	5.10
111	600791	京能置业	12,128,313.35	5.09
112	000786	北新建材	11,920,305.56	5.00
113	002023	海特高新	11,549,877.56	4.84
114	601006	大秦铁路	11,511,184.41	4.83
115	000919	金陵药业	11,400,953.42	4.78
116	002146	荣盛发展	11,334,739.20	4.75
117	002294	信立泰	10,981,820.49	4.60
118	300175	朗源股份	10,747,943.19	4.51
119	600004	白云机场	10,694,329.80	4.48
120	601607	上海医药	10,638,203.45	4.46
121	300232	洲明科技	10,512,635.49	4.41
122	600109	国金证券	10,303,371.02	4.32
123	000916	华北高速	10,181,377.85	4.27
124	600522	中天科技	9,962,054.66	4.18
125	002042	华孚色纺	9,936,676.41	4.17
126	601939	建设银行	9,883,555.42	4.14
127	000876	新希望	9,712,219.61	4.07

128	000960	锡业股份	9,607,405.07	4.03
129	000829	天音控股	9,600,659.56	4.03
130	002553	南方轴承	9,576,164.77	4.02
131	603993	洛阳钼业	9,263,274.82	3.88
132	600997	开滦股份	9,210,821.73	3.86
133	600284	浦东建设	9,128,166.30	3.83
134	600690	青岛海尔	9,011,126.35	3.78
135	300236	上海新阳	8,956,398.99	3.76
136	000415	渤海租赁	8,926,301.49	3.74
137	002100	天康生物	8,906,128.28	3.73
138	002631	德尔家居	8,898,485.83	3.73
139	601669	中国电建	8,867,435.71	3.72
140	600971	恒源煤电	8,744,446.65	3.67
141	000686	东北证券	8,724,342.19	3.66
142	000726	鲁泰A	8,668,275.80	3.63
143	600582	天地科技	8,648,025.98	3.63
144	300113	顺网科技	8,355,174.28	3.50
145	601186	中国铁建	8,254,656.84	3.46
146	601299	中国北车	8,243,606.00	3.46
147	600496	精工钢构	8,228,611.30	3.45
148	600037	歌华有线	8,196,242.95	3.44
149	600337	美克家居	8,010,611.54	3.36
150	600231	凌钢股份	8,006,148.66	3.36
151	600315	上海家化	7,875,003.90	3.30
152	002597	金禾实业	7,792,411.49	3.27
153	002037	久联发展	7,743,873.54	3.25
154	000807	云铝股份	7,729,031.71	3.24
155	300180	华峰超纤	7,590,199.99	3.18
156	600897	厦门空港	7,505,854.60	3.15
157	000869	张裕A	7,451,330.44	3.12
158	600028	中国石化	7,405,325.90	3.11
159	300284	苏交科	7,304,962.57	3.06
160	002206	海利得	6,974,795.11	2.92
161	600858	银座股份	6,779,245.63	2.84
162	600578	京能电力	6,750,004.00	2.83
163	002535	林州重机	6,741,007.10	2.83

164	600549	厦门钨业	6,672,351.07	2.80
165	002610	爱康科技	6,559,708.01	2.75
166	002662	京威股份	6,434,974.28	2.70
167	600188	兖州煤业	6,377,680.89	2.67
168	600741	华域汽车	6,342,703.28	2.66
169	002358	森源电气	6,261,447.94	2.63
170	600271	航天信息	6,072,842.64	2.55
171	600089	特变电工	5,956,938.85	2.50
172	002329	皇氏集团	5,849,827.76	2.45
173	300248	新开普	5,824,408.47	2.44
174	600519	贵州茅台	5,627,903.89	2.36
175	000404	华意压缩	5,622,323.22	2.36
176	300286	安科瑞	5,621,149.22	2.36
177	601766	中国南车	5,603,073.31	2.35
178	000860	顺鑫农业	5,461,888.08	2.29
179	000933	神火股份	5,422,791.11	2.27
180	600219	南山铝业	5,297,554.73	2.22
181	002261	拓维信息	5,255,959.68	2.20
182	601166	兴业银行	5,233,653.89	2.19
183	000543	皖能电力	5,169,946.29	2.17
184	601003	柳钢股份	5,111,539.84	2.14
185	300298	三诺生物	5,106,843.79	2.14
186	600276	恒瑞医药	5,102,253.73	2.14
187	000516	开元投资	4,968,495.68	2.08
188	600859	王府井	4,954,283.53	2.08
189	600327	大东方	4,940,006.39	2.07
190	600889	南京化纤	4,894,745.80	2.05
191	002033	丽江旅游	4,855,376.75	2.04
192	600197	伊力特	4,824,578.88	2.02

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。

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	601009	南京银行	34,625,261.02	14.52

2	600027	华电国际	33,579,803.17	14.08
3	601233	桐昆股份	32,379,583.07	13.58
4	002367	康力电梯	27,810,113.11	11.66
5	600660	福耀玻璃	27,181,935.30	11.40
6	601998	中信银行	25,874,640.61	10.85
7	000002	万科A	25,665,124.32	10.76
8	601377	兴业证券	25,293,875.35	10.61
9	000961	中南建设	25,075,164.34	10.51
10	000728	国元证券	24,955,662.30	10.46
11	002321	华英农业	24,939,286.43	10.46
12	000338	潍柴动力	24,753,272.27	10.38
13	000600	建投能源	24,644,436.31	10.33
14	002392	北京利尔	24,491,878.95	10.27
15	002142	宁波银行	23,650,096.79	9.92
16	600583	海油工程	23,279,170.18	9.76
17	601801	皖新传媒	22,137,400.91	9.28
18	601857	中国石油	21,944,065.53	9.20
19	000540	中天城投	21,122,461.07	8.86
20	600030	中信证券	21,114,469.41	8.85
21	601555	东吴证券	20,648,186.33	8.66
22	600761	安徽合力	20,550,314.27	8.62
23	601808	中海油服	19,601,754.51	8.22
24	002462	嘉事堂	19,048,161.56	7.99
25	601601	中国太保	18,794,984.22	7.88
26	000789	万年青	18,793,848.60	7.88
27	601668	中国建筑	18,776,949.24	7.87
28	000100	TCL 集团	17,934,855.17	7.52
29	601336	新华保险	17,843,209.94	7.48
30	000625	长安汽车	17,812,408.98	7.47
31	600643	爱建股份	17,784,788.56	7.46
32	600126	杭钢股份	17,223,386.77	7.22
33	601288	农业银行	17,157,542.11	7.19
34	600486	扬农化工	16,943,585.42	7.10
35	002233	塔牌集团	16,291,299.47	6.83
36	601669	中国电建	16,247,089.01	6.81
37	601000	唐山港	16,081,416.94	6.74
38	002540	亚太科技	16,041,138.94	6.73
39	000651	格力电器	15,842,543.86	6.64

40	600177	雅戈尔	15,610,905.02	6.55
41	600104	上汽集团	15,494,900.27	6.50
42	601799	星宇股份	15,478,756.18	6.49
43	600183	生益科技	15,351,145.69	6.44
44	601006	大秦铁路	15,287,522.25	6.41
45	600201	金宇集团	15,043,021.93	6.31
46	002500	山西证券	14,876,859.75	6.24
47	600987	航民股份	14,315,579.41	6.00
48	002215	诺普信	13,717,056.56	5.75
49	002003	伟星股份	13,465,837.58	5.65
50	002026	山东威达	13,242,028.09	5.55
51	000786	北新建材	13,170,419.00	5.52
52	600376	首开股份	13,133,382.10	5.51
53	601088	中国神华	13,062,867.85	5.48
54	600580	卧龙电气	13,020,599.00	5.46
55	600791	京能置业	12,878,367.67	5.40
56	300175	朗源股份	12,555,414.15	5.26
57	600697	欧亚集团	12,531,134.94	5.25
58	600011	华能国际	12,524,486.89	5.25
59	002299	圣农发展	12,510,410.69	5.25
60	600720	祁连山	12,378,214.25	5.19
61	002146	荣盛发展	12,272,346.11	5.15
62	600109	国金证券	11,945,943.26	5.01
63	002139	拓邦股份	11,928,599.71	5.00
64	000708	大冶特钢	11,858,595.48	4.97
65	600004	白云机场	11,742,556.50	4.92
66	600742	一汽富维	11,549,903.58	4.84
67	002508	老板电器	11,237,936.04	4.71
68	002294	信立泰	11,147,794.77	4.67
69	600461	洪城水业	11,126,480.34	4.67
70	600522	中天科技	10,964,148.88	4.60
71	000916	华北高速	10,906,683.12	4.57
72	300232	洲明科技	10,731,344.61	4.50
73	000830	鲁西化工	10,630,960.74	4.46
74	000415	渤海租赁	10,394,436.14	4.36
75	002553	南方轴承	10,354,329.60	4.34
76	600426	华鲁恒升	10,276,932.76	4.31
77	600028	中国石化	10,269,850.62	4.31

78	600997	开滦股份	10,248,192.32	4.30
79	002631	德尔家居	10,218,307.55	4.28
80	601398	工商银行	10,167,312.86	4.26
81	600971	恒源煤电	10,144,577.66	4.25
82	600068	葛洲坝	9,936,024.39	4.17
83	000829	天音控股	9,765,621.92	4.09
84	600823	世茂股份	9,644,171.07	4.04
85	000686	东北证券	9,634,630.17	4.04
86	600887	伊利股份	9,585,718.42	4.02
87	603993	洛阳钼业	9,548,371.54	4.00
88	600231	凌钢股份	9,376,005.32	3.93
89	600999	招商证券	9,334,822.08	3.91
90	002415	海康威视	9,325,075.67	3.91
91	600037	歌华有线	9,277,917.27	3.89
92	002025	航天电器	9,271,911.98	3.89
93	600284	浦东建设	9,227,439.12	3.87
94	300236	上海新阳	9,058,272.84	3.80
95	601939	建设银行	9,026,975.51	3.79
96	000550	江铃汽车	9,013,560.19	3.78
97	000960	锡业股份	8,994,621.62	3.77
98	600690	青岛海尔	8,992,907.75	3.77
99	000726	鲁泰A	8,983,321.05	3.77
100	002020	京新药业	8,714,151.69	3.65
101	600252	中恒集团	8,569,772.46	3.59
102	601313	江南嘉捷	8,533,313.80	3.58
103	600897	厦门空港	8,462,571.02	3.55
104	000543	皖能电力	8,378,002.77	3.51
105	601607	上海医药	8,330,449.53	3.49
106	002037	久联发展	8,310,560.70	3.48
107	600036	招商银行	8,297,631.01	3.48
108	600337	美克家居	8,195,327.94	3.44
109	002001	新和成	8,090,660.23	3.39
110	300180	华峰超纤	8,061,159.67	3.38
111	600816	安信信托	8,021,807.48	3.36
112	002535	林州重机	8,014,897.04	3.36
113	600315	上海家化	7,990,780.79	3.35
114	600519	贵州茅台	7,922,670.16	3.32
115	002206	海利得	7,860,581.37	3.30

116	000807	云铝股份	7,844,770.67	3.29
117	300113	顺网科技	7,832,803.80	3.28
118	600741	华域汽车	7,793,914.73	3.27
119	600549	厦门钨业	7,622,699.89	3.20
120	000596	古井贡酒	7,559,888.36	3.17
121	600578	京能电力	7,407,754.50	3.11
122	000001	平安银行	7,339,676.30	3.08
123	002358	森源电气	7,279,401.11	3.05
124	300248	新开普	7,188,746.39	3.01
125	601166	兴业银行	7,183,921.72	3.01
126	000630	铜陵有色	7,157,363.54	3.00
127	002662	京威股份	7,156,450.23	3.00
128	300286	安科瑞	6,864,696.71	2.88
129	600327	大东方	6,754,310.59	2.83
130	002610	爱康科技	6,735,614.05	2.82
131	600050	中国联通	6,380,763.21	2.68
132	002329	皇氏集团	6,375,107.01	2.67
133	000069	华侨城A	6,310,278.45	2.65
134	600089	特变电工	6,308,163.22	2.65
135	002110	三钢闽光	6,266,541.38	2.63
136	002673	西部证券	6,266,079.24	2.63
137	600271	航天信息	6,024,644.65	2.53
138	600694	大商股份	5,959,629.98	2.50
139	000404	华意压缩	5,947,660.35	2.49
140	300284	苏交科	5,896,476.86	2.47
141	600369	西南证券	5,863,620.27	2.46
142	600188	兖州煤业	5,837,689.82	2.45
143	000878	云南铜业	5,659,350.95	2.37
144	603003	龙宇燃油	5,656,660.34	2.37
145	600633	浙报传媒	5,573,682.99	2.34
146	600396	金山股份	5,408,915.12	2.27
147	600298	安琪酵母	5,391,233.64	2.26
148	002427	尤夫股份	5,321,853.27	2.23
149	002440	闰土股份	5,295,708.63	2.22
150	600889	南京化纤	5,289,083.56	2.22
151	002609	捷顺科技	5,285,301.36	2.22
152	000516	开元投资	5,246,083.89	2.20
153	000860	顺鑫农业	5,191,475.37	2.18

154	002293	罗莱家纺	5,158,399.57	2.16
155	600859	王府井	5,152,820.62	2.16
156	002033	丽江旅游	5,145,138.17	2.16
157	002100	天康生物	5,100,999.10	2.14
158	600219	南山铝业	5,098,408.34	2.14
159	601003	柳钢股份	5,093,512.93	2.14
160	600000	浦发银行	5,084,652.71	2.13
161	600240	华业地产	5,021,595.80	2.11
162	002486	嘉麟杰	4,952,710.67	2.08
163	000501	鄂武商 A	4,927,456.79	2.07
164	600276	恒瑞医药	4,886,925.39	2.05
165	300298	三诺生物	4,883,310.08	2.05
166	600015	华夏银行	4,771,092.36	2.00

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。

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	3,947,049,857.05
卖出股票收入（成交）总额	2,415,959,073.40

8.5 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	80,024,000.00	3.13
	其中：政策性金融债	80,024,000.00	3.13
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	80,024,000.00	3.13

8.6 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

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	140317	14 进出 17	400,000	40,024,000.00	1.57
2	140213	14 国开 13	400,000	40,000,000.00	1.56

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)、中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)作为债务融资工具“13 浙建投 MTN001”主承销商，在获知发行人浙江省建设投资集团有限公司整合下属子公司少数股东权益事项后未及时组织召开持有人会议，违反了《银行间债券市场非金融企业债务融资工具持有人会议规程》的规定。依据相关自律规定，经自律处分会议审定，给予工商银行、中信银行勉谈话处分，并处责令改正。

8.12.3 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	751,539.46
2	应收证券清算款	9,995,163.02
3	应收股利	-
4	应收利息	2,387,825.26
5	应收申购款	23,251,685.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,386,213.03

8.12.4 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。

8.12.5 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的情况。

§ 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)	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
11,494	126,593.53	1,019,846,285.88	70.09%	435,219,717.71	29.91%

9.3 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	1,860,250.50	0.1278%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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 100 万份以上。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（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	2,320,363,548.01
减:本报告期基金总赎回份额	1,096,680,308.84
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	1,455,066,003.59

§ 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

2014 年 5 月 15 日，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。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 60000 元人民币，该事务所已向本基金提供了 2 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	
浙商证券	1	1,023,042,096.42	16.08%	905,295.18	15.84%	-
华泰证券	2	963,808,308.42	15.15%	877,019.00	15.35%	-
方正证券	1	792,076,576.39	12.45%	700,912.60	12.27%	-
中金公司	1	533,000,096.61	8.38%	485,242.27	8.49%	-
国信证券	1	425,947,113.03	6.69%	376,926.77	6.60%	-
广发证券	1	407,572,458.33	6.41%	371,051.38	6.49%	-
中原证券	1	401,298,196.78	6.31%	365,333.82	6.39%	-
海通证券	1	361,900,103.36	5.69%	320,247.78	5.60%	-
招商证券	1	360,960,195.64	5.67%	319,416.06	5.59%	-
中信证券	1	317,580,479.89	4.99%	289,075.18	5.06%	-
东方证券	1	241,119,535.01	3.79%	219,515.48	3.84%	-
申银万国	1	216,279,704.24	3.40%	196,900.01	3.45%	-
国金证券	1	121,063,771.69	1.90%	107,129.03	1.87%	-
德邦证券	1	75,350,513.07	1.18%	68,595.60	1.20%	-
西南证券	1	73,598,643.42	1.16%	67,003.75	1.17%	-
银河证券	1	48,359,998.15	0.76%	44,027.09	0.77%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	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为，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务。

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。

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
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	2,366,735.58	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

山西证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2015 年 3 月 31 日