

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
基金合同生效日期：2013年3月26日

1.1 重要提示
基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司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法律责任。本报告所载内容已经三分之二以上独立董事审议通过，并由董事长签发。本基金管理人遵循基金份额持有人利益优先原则，恪尽职守，勤勉尽责，确保基金资产的安全与完整，实现基金份额持有人的合法权益。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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。基金管理人不对投资收益做出任何承诺，也不对投资收益做出任何担保。投资者应仔细阅读基金合同、基金招募说明书及更新。

本年度报告摘要内容已经过注册会计师签字，注册会计师不会因本报告所载内容对基金管理人出具了无保留意见的审计报告。本年度报告摘要自年度报告正文披露之日起，投资者了解相关内容，应以年度报告正文为准。本年度报告正文于2013年3月26日起在本公司网站披露。

1.2 基金简介

基金简称	华泰柏瑞盛世中国股票
基金代码	460001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年4月27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
期末基金份额总额	10,731,559,579.38份
基金资产净值	不定期

2.2 基金产品说明

本基金通过跟踪业绩基准，辅以适度的大类资产配置调整，追求长期资产价值的稳定增值。

2.3 基金管理人及基金托管人

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
法定代表人	张晖	陶礼明
联系电话	021-38601777	010-66594855
电子邮箱	ca00088001@huatai-pb.com	tzq@bank-of-china.com
客户服务电话	400-888-0001	95566
传真	021-38601799	010-66594942

3.1 主要会计数据和财务指标

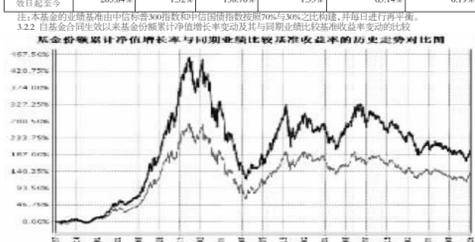
项目	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-755,089,044.43	46,273,907.09	-278,071,756.55
本期利润	-10,345,645.30	-2,352,946,761.42	334,201,643.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0009	-0.1871	0.0391
期末基金份额净值	0.2124	-26.8784	6.6274

3.2 主要财务指标

项目	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1794	-0.1155	-0.1209
期末基金资产净值	5,512,821,049.11	6,458,253,495.84	9,132,652,495.84
期末基金份额净值	0.5137	0.5126	0.7009

3.3 主要财务指标

项目	2012年	2011年	2010年
本期基金份额净值增长率	-40.62%	-27.25%	-27.25%
基金份额净值增长率标准差	1.06%	1.06%	1.06%
同期业绩比较基准收益率	-26.88%	-26.88%	-26.88%
基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的绝对偏差	-13.74%	-0.63%	-0.63%



3.4 基金管理人及基金托管人

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
法定代表人	张晖	陶礼明
联系电话	021-38601777	010-66594855
电子邮箱	ca00088001@huatai-pb.com	tzq@bank-of-china.com
客户服务电话	400-888-0001	95566
传真	021-38601799	010-66594942

3.5 主要财务指标

项目	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-755,089,044.43	46,273,907.09	-278,071,756.55
本期利润	-10,345,645.30	-2,352,946,761.42	334,201,643.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0009	-0.1871	0.0391
期末基金份额净值	0.2124	-26.8784	6.6274

3.6 基金管理人及基金托管人

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
法定代表人	张晖	陶礼明
联系电话	021-38601777	010-66594855
电子邮箱	ca00088001@huatai-pb.com	tzq@bank-of-china.com
客户服务电话	400-888-0001	95566
传真	021-38601799	010-66594942

3.7 主要财务指标

项目	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-755,089,044.43	46,273,907.09	-278,071,756.55
本期利润	-10,345,645.30	-2,352,946,761.42	334,201,643.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0009	-0.1871	0.0391
期末基金份额净值	0.2124	-26.8784	6.6274

3.8 基金管理人及基金托管人

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
法定代表人	张晖	陶礼明
联系电话	021-38601777	010-66594855
电子邮箱	ca00088001@huatai-pb.com	tzq@bank-of-china.com
客户服务电话	400-888-0001	95566
传真	021-38601799	010-66594942

3.9 主要财务指标

项目	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-755,089,044.43	46,273,907.09	-278,071,756.55
本期利润	-10,345,645.30	-2,352,946,761.42	334,201,643.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0009	-0.1871	0.0391
期末基金份额净值	0.2124	-26.8784	6.6274

3.10 基金管理人及基金托管人

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
法定代表人	张晖	陶礼明
联系电话	021-38601777	010-66594855
电子邮箱	ca00088001@huatai-pb.com	tzq@bank-of-china.com
客户服务电话	400-888-0001	95566
传真	021-38601799	010-66594942

3.11 主要财务指标

项目	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-755,089,044.43	46,273,907.09	-278,071,756.55
本期利润	-10,345,645.30	-2,352,946,761.42	334,201,643.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0009	-0.1871	0.0391
期末基金份额净值	0.2124	-26.8784	6.6274

华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

2012 年度报告摘要

2012年12月31日

4.9 管理人及会计师事务所是否出具非标准审计报告相矛盾的说明
无。

5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规情况
本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞盛世中国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，完全忠实履行托管人职责。

4.8 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.8.1 关联方名称		
4.8.2 基金托管费		

4.7.1 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.1.1 关联方名称		
4.7.1.2 基金托管费		

4.7.2 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.2.1 关联方名称		
4.7.2.2 基金托管费		

4.7.3 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.3.1 关联方名称		
4.7.3.2 基金托管费		

4.7.4 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.4.1 关联方名称		
4.7.4.2 基金托管费		

4.7.5 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.5.1 关联方名称		
4.7.5.2 基金托管费		

4.7.6 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.6.1 关联方名称		
4.7.6.2 基金托管费		

4.7.7 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.7.1 关联方名称		
4.7.7.2 基金托管费		

4.7.8 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.8.1 关联方名称		
4.7.8.2 基金托管费		

4.7.9 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.9.1 关联方名称		
4.7.9.2 基金托管费		

4.7.10 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.10.1 关联方名称		
4.7.10.2 基金托管费		

4.7.11 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.11.1 关联方名称		
4.7.11.2 基金托管费		

4.7.12 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.12.1 关联方名称		
4.7.12.2 基金托管费		

4.7.13 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.13.1 关联方名称		
4.7.13.2 基金托管费		

4.7.14 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.14.1 关联方名称		
4.7.14.2 基金托管费		

4.7.15 关联方名称

项目	本期	上期
当期发生的基金支付托管费	15,413,844.75	19,425,959.66
4.7.15.1 关联方名称		
4.7.15.2 基金托管费		

注：不涉及关联交易费用。
8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本(成交总额)	10,410,261,288.83
卖出股票收入(成交总额)	11,009,815,382.13

8.5 期末按债券品种和分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	102,900,000.00	1.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,885,000.00	0.90
4	其中：政策性金融债	49,885,000.00	0.90
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	152,785,000.00	2.77

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

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	110019	11附息国债	1,000,000	102,900,000.00	1.87
2	120218	12附息国债	500,000	49,885,000.00	0.90

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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	-	4,250,000.00	-
2	应收证券清算款	-	-	25,469,867.65	-
3	应收利息	-	-	2,459,642.85	-
4	应收股利	-	-	113,292.85	-
5	其他应收款	-	-	-	-
6	其他流动资产	-	-	-	-
7	预付款项	-	-	-	-
8	其他	-	-	-	-
9	合计	-	-	32,194,803.35	-

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

序号	权证代码	股票名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	102,210,330.08	1.85	重大资产重组
2	000826	鲁商置业	23,233,778.02	0.46	转股

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内本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，也没有在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。

8.9.2 本基金投资的前十名证券中，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

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,250,000.00
2	应收证券清算款	25,469,867.65
3	应收利息	2,459,642.85
4	应收股利	113,292.85
5	其他应收款	-
6	其他流动资产	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	32,194,803.35

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	股票名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	102,210,330.08	1.85	重大资产重组
2	000826	鲁商置业	23,233,778.02	0.46	转股

8.9.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

9 基金份额持有人

序号	基金份额持有人名称	持有基金份额(份)	占基金份额比例
1	11,155,116.27	0.0108%	

10 开放式基金份额变动

项目	持有基金份额(份)	占基金份额比例
基金合同生效以来基金份额持有人持有基金份额	1,155,116.27	0.0108%

11 基金持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会。

12 基金管理人及基金托管人

项目	持有基金份额(份)	占基金份额比例
基金管理人	1,155,116.27	0.0108%

13 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼。

14 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

15 基金管理人及基金托管人

项目	持有基金份额(份)	占基金份额比例
基金管理人	1,155,116.27	0.0108%

16 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼。

17 基金管理人及基金托管人

项目	持有基金份额(份)	占基金份额比例
基金管理人	1,155,116.27	0.0108%

18 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼。

19 基金管理人及基金托管人

项目	持有基金份额(份)	占基金份额比例
基金管理人	1,155,1	