华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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
报告送出日期:2013年10月24日

§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责任。

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10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞价值增长股票
交易代码	460005
前端交易代码	-
后端交易代码	-
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
报告期末基金份额总额	282,501,764.47份
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
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	39,204,656.19
2.本期利润	73,293,143.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.2302
4.期末基金资产净值	363,598,810.80
5.期末基金份额净值	1.2871

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 本报告期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	净值增长率①	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	22.28%	1.56%	7.70%	1.15%	14.58%	0.41%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注:图示日期为2008年7月16日至2013年9月30日。

1.按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(二)投资范围、(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%。

3.3 其他指标

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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总经理、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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,通过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次集中交易室对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核,在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。 本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,市场整体出现了一定程度的反弹,以大盘股为主的沪深300指数上涨约9.5%,6月底"钱荒"事件之后,央行适度放松了流动性,同时实体经济在三季度有一定程度的复苏。在此期间,消费和成长类股票的表现更为突出,中小板指数三季度上涨17.5%,创业板指数上涨更是连续第四个季度上涨,单季度涨幅达到35.2%。

本基金在投资策略上仍然坚持了成长风格,在配置上偏重于信息服务、医药生物、食品饮料、消费电子、环保等产业,投资期内取得了较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.2871元,本报告期份额净值增长率为22.28%,同期业绩比较基准增长率为7.7%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们仍然认为传统行业处在去产能、去杠杆的过程中,难以看到很大的盈利或市值增长空间。未来的投资方向仍然在消费类和新兴产业上。虽然以静态的估值来看,许多成长股已经不便宜,但长期来看,部分行业龙头仍然有市值提升的空间。而且我们认为随着经济转型的方向越来越明确,政府会有更多的鼓励经济转型的政策出台,相关上市公司也会在经营战略上做出调整,新的政策、新的商业模式、新的创新产品可能会不断出现,进而带来新的投资机会。

因此,本基金的投资方向上仍然着眼于大局,着眼于长期,不会纠结于市场风格是否会在短期发生转换,在配置上继续偏向于成长和消费,自下而上的寻找结构性机会。在成长股的整体估值水平偏高、相对估值处于历史高位的情况下,我们对标的的选择将更加审慎,并通过控制仓位来控制系统性的风险。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	275,868,285.59	75.37
	其中:股票	275,868,285.59	75.37
2	固定收益投资	19,950,000.00	5.45
	其中:债券	19,950,000.00	5.45
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	62,000,000.00	16.94
	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	5,734,780.33	1.57
6	其他资产	2,456,388.35	0.67
7	合计	366,009,454.27	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	117,021,272.28	32.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	907,000.00	0.25
F	批发和零售业	9,063,434.00	2.49
G	交通运输、仓储和邮政业	1,938,400.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,643,307.50	15.58
J	金融业	11,104,200.00	3.05
K	房地产业	7,751,600.00	2.13
L	租赁和商务服务业	15,660,300.00	4.31
M	科学研究和技术服务业	1,612,301.25	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	14,445,022.50	3.97
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,546,000.00	1.80
R	文化、体育和娱乐业	33,175,448.06	9.12
S	综合	-	-
	合计	275,868,285.59	75.87

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002241	歌尔声学	440,000	18,603,200.00	5.12
2	300315	掌趣科技	630,000	17,602,200.00	4.84
3	000049	德赛电池	300,452	17,468,279.28	4.80
4	300113	顺网科技	240,000	16,932,000.00	4.66
5	300133	华策影视	406,610	16,463,638.90	4.53
6	600887	伊利股份	360,000	16,084,800.00	4.42
7	600535	天士力	278,000	12,515,560.00	3.44
8	002400	省广股份	230,000	10,099,300.00	2.78
9	601318	中国平安	256,000	9,139,200.00	2.51
10	600600	青岛啤酒	190,000	8,141,500.00	2.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,950,000.00	5.49
	其中:政策性金融债	19,950,000.00	5.49
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	19,950,000.00	5.49

5.5 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国开01	200,000	19,950,000.00	5.49

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:无。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

-

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	326,714.32
2	应收证券清算款	1,586,710.53
3	应收股利	-
4	应收利息	487,402.18
5	应收申购款	55,561.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,456,388.35

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	352,912,585.95
报告期期间基金总申购份额	48,378,012.89
减:报告期期间基金总赎回份额	118,788,834.37
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	282,501,764.47

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》

4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问,可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线:400-888-0001(免长途费) 021-3878 4638 公司网址:www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2013年10月24日

华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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
报告送出日期:2013年10月24日

§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责任。 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10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。 本报告中的财务资料未经审计。 本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞积极成长混合
交易代码	460002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年5月29日
报告期末基金份额总额	2,915,267,221.31份
投资目标	通过严格的投资纪律约束和风险管理手段,投资于具备持续突出增长能力的优秀企业,辅以特定市场状况下的大类资产配置调整,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票类资产为主要投资工具,通过精选个股获取资产的长期增值;通过适度的大类资产配置来降低组合的系统性风险。 本基金将"自上而下"的趋势投资和"自下而上"的个股选择相结合。投资决策的重点在于寻找具有巨大发展潜力的趋势,发现并投资于有能力把握趋势并在竞争中处于优势的公司。
业绩比较基准	沪深300指数×60%+中信标普国债指数×40%
风险收益特征	较高风险、较高收益
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	45,182,082.48
2.本期利润	96,266,171.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0313
4.期末基金资产净值	2,583,484,022.48
5.期末基金份额净值	0.8862

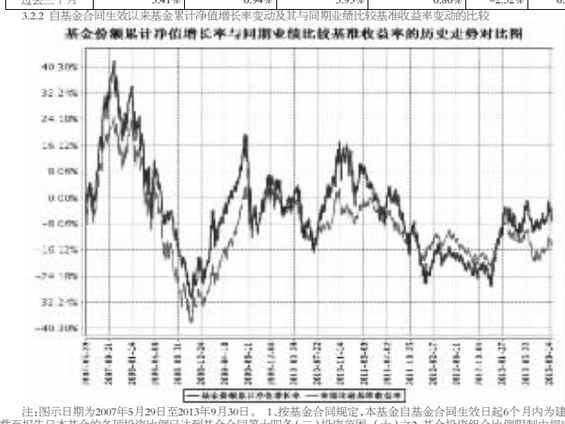
注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	3.41%	0.94%	5.93%	0.86%	-2.52%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:图示日期为2007年5月29日至2013年9月30日。 1、按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(二)投资范围、(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30%-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%-70%。

3.3 其他指标

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方伦煜	本基金的基金经理	2012年4月18日	-	12	方伦煜先生,管理学硕士,12年证券从业经历,历任广发证券股份有限公司行业研究员、招商证券有限公司投资经理、巨田基金管理有限公司研究员,广发证券股份有限公司投资经理。2008年6月至2010年2月任中国人寿资产管理有限公司投资经理,2010年2月至2012年2月任职于华安基金管理有限公司基金投资部,2012年3月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,2012年4月起担任华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,通过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次集中交易室对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核,在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。 本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初以来市场对宏观、政策的预期一波三折。先有年初政府换届后对"克强经济学"的担心,接着6月的"钱荒"令人刻骨铭心,但是随着政府关于"底线"的表态,市场心态逐步稳定下来。而7、8月份较好的经济数据重新给市场以期望。

三季度积极成长及时调高股票仓位,加大对地产、家电以及改革预期相关板块个股的配置。截至三季度末积极成长的仓位处于中性偏高水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年3季度,基金单位份额净值增长率为3.41%,同期业绩比较基准的收益率为5.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为,尽管四季度可能因为基数的原因,宏观经济的同比数据不会很好看,但是由于三季度"稳增长"措施的效果逐步显现以及库存周期的作用,四季度宏观经济数据并不会太差。

即将召开的十八届三中全会将对我国今后相当长一段时间的经济发展产生深远影响。如果在深化改革方面有实质性内容推出,中国经济仍有可能维持一个较好的发展趋势。尽管短期内经济面临产能去化导致的企业盈利下滑压力,但市场对经济发展前景的信心仍有可能对股票价格产生支撑。

展望四季度证券市场,与宏观经济密切相关的主板市场的有关行业板块,在市场对经济发展前景的担忧减弱甚至消失的情况下,将迎来估值修复行情。而对于今年以来表现异常强劲的创业板股票,其即将披露的业绩与市场预期的巨大差距将对股价形成压力。当然,如果"三中全会"的结果低于市场预期,市场大概率会回到上半年的态势。

在主题投资方面,我们看好有关改革尤其是国企改革的机会。另外,我国快速发展的经济需要强大的军事实力来保驾护航,因此,军工也是我们看好的另一个主题。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,220,060,356.03	85.47
	其中:股票	2,220,060,356.03	85.47
2	固定收益投资	277,909,000.00	10.70
	其中:债券	277,909,000.00	10.70
	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	88,250,342.56	3.40
6	其他资产	11,335,949.61	0.44
7	合计	2,597,555,648.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	28,253,789.97	1.09
C	制造业	1,012,480,497.17	39.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	45,023,265.77	1.74
F	批发和零售业	16,229,540.74	0.63
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	359,493.68	0.01
J	金融业	476,154,822.39	18.43
K	房地产业	558,676,524.38	21.62
L	租赁和商务服务业	35,768,811.68	1.38
M	科学研究和技术服务业	18,113,882.85	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	28,999,727.40	1.12
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,220,060,356.03	85.93

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600048	保利地产	18,108,303	178,910,033.64	6.93
2	000002	万 科A	16,530,963	150,927,692.19	5.84
3	600383	金地集团	21,267,317	128,029,248.34	4.96
4	002037	久联发展	9,876,669	115,458,260.61	4.47
5	600690	青岛海尔	8,481,972	112,979,867.04	4.37
6	600585	海螺水泥	6,135,711	91,667,522.34	3.55
7	600352	浙江龙盛	6,736,877	82,526,743.25	3.19
8	600000	浦发银行	7,919,656	79,909,329.04	3.09
9	600893	航空动力	4,482,993	73,252,105.62	2.84
10	600036	招商银行	6,695,814	73,118,288.88	2.83

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	178,763,000.00	6.92
	其中:政策性金融债	178,763,000.00	6.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	49,650,000.00	1.92
6	中期票据	49,496,000.00	1.92
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	277,909,000.00	10.76

5.5 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国开01	500,000	49,875,000.00	1.93
2	090205	09国开05	500,000	49,865,000.00	1.93
3	041359034	13亨通CP001	500,000	49,650,000.00	1.92
4	130410	13农发10	500,000	49,080,000.00	1.90
5	120419	12农发19	300,000	29,943,000.00	1.16

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:无。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	535,893.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,439,074.34
5	应收申购款	6,360,981.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,335,949.61

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600690	青岛海尔	112,979,867.04	4.37	临时停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,168,164,925.91
报告期期间基金总申购份额	225,878,332.13
减:报告期期间基金总赎回份额	478,776,036.73
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,915,267,221.31

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注:无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》

4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问,可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线:400-888-0001(免长途费) 021-3878 4638 公司网址:www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2013年10月24日

华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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
报告送出日期:2013年10月24日

§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责任。

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10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞盛世中国股票
交易代码	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
报告期末基金份额总额	8,171,665,355.79份
投资目标	主要通过股票选择,辅以适度的大类资产配置调整,追求管理资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票类资产为主要投资工具,通过精选个股获取资产的长期增值;以债券类资产作为降低组合风险的策略性投资工具,通过适当的大类资产配置来降低组合的系统性风险。
业绩比较基准	中信标普300指数×70%+中信国债指数×30%
风险收益特征	较高风险、较高收益
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	90,724,425.25
2.本期利润	840,310,417.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.1007
4.期末基金资产净值	5,154,514,614.07
5.期末基金份额净值	0.6308

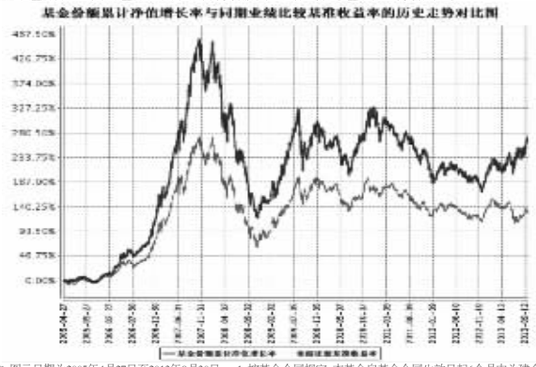
注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	19.04%	1.45%	7.65%	0.97%	11.39%	0.48%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:图示日期为2005年4月27日至2013年9月30日。 1、按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为基金净资产的0%-40%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2009年11月18日	-	19年	汪晖先生,硕士。历任华泰证券股份有限公司高级经理、华宝信托投资有限公司信托基金经理、华泰证券股份有限公司投资经理。2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金经理助理、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金经理、华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金经理。2008年7月起任华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金基金经理。2009年8月起任华泰柏瑞投资部副总监。2009年11月18日起兼任华泰柏瑞盛世基金经理。2009年12月起任华泰柏瑞投资部总监。2010年6月至2011年8月兼任华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金基金经理。2011年2月起任华泰柏瑞投资总监。
张慧	本基金的基金经理	2013年