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:2014年3月26日

华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013年12月31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2014年3月26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2013年1月1日起至2013年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞盛世中国股票
基金主代码	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
报告期末基金份额总额	8,554,432,820.79份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

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	fcsd@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	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	321,245,028.10	-755,089,604.43	46,723,497.09
本期利润	872,707,432.95	-10,345,645.30	-2,352,946,761.42
加权平均基金份额本期利润	0.1009	-0.0009	-0.1871
本期基金份额净值增长率	18.53%	0.21%	-26.87%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1403	-0.1794	-0.1155
期末基金资产净值	5,208,691,873.89	5,512,812,049.11	6,458,253,240.19
期末基金份额净值	0.6089	0.5137	0.5126

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。

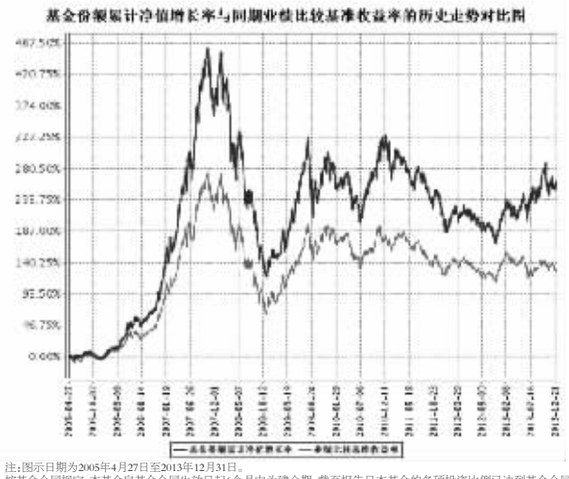
3.2 基金净值表现

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	-3.47%	1.34%	-2.56%	0.80%	-0.91%	0.54%
过去六个月	14.91%	1.40%	4.90%	0.89%	10.01%	0.51%
过去一年	18.53%	1.36%	-3.12%	0.96%	21.65%	0.40%
过去三年	-13.13%	1.17%	-14.71%	0.91%	1.58%	0.26%
过去五年	44.91%	1.38%	28.99%	1.07%	15.92%	0.31%
自基金合同生效日起至今	260.15%	1.50%	131.25%	1.29%	128.90%	0.21%

注:本基金的业绩基准由中信标普300指数和中信国债指数按照70%与30%之比构建,并每日进行再平衡。

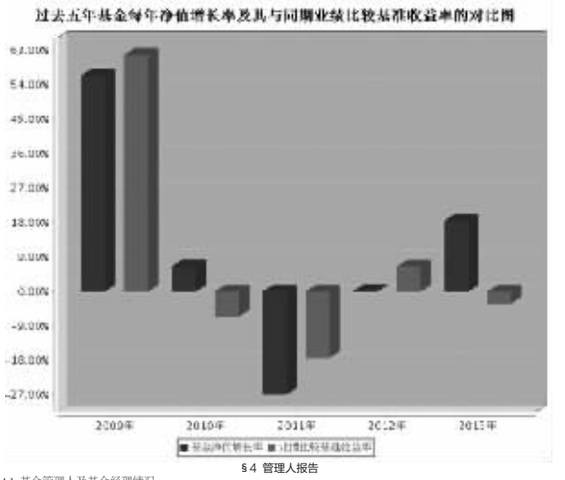
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:图示日期为2005年4月27日至2013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十三条中“(二)投资范围”以及“(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%。

3.2.3 过去五年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



§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、华泰柏瑞金子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、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和华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金。截至2013年12月31日,公司基金管理规模为363.09亿元。

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	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、华安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、华泰柏瑞金子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9月16日	-	6	经济学硕士,6年证券从业经历。2007年7月至2010年6月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010年6月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员、基金经理助理,2013年9月起任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金的基金经理。
张语	本基金的基金经理	2012年6月29日	2013年4月16日	8	张语先生,8年证券(基金)从业经验,经济学硕士,曾任职于中银万国证券股份有限公司、上海中银万国证券研究所有限公司、德勤咨询(上海)有限公司。2007年5月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员及基金经理助理。2012年6月起任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金经理。

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遵规守信情况的说明

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、法规的规定以及本基金的《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复核,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,不同业务类型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。造成少量显著交易价差的原因来自两方面:一是投资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投资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

2013年A股市场两极分化明显,一方面创业板指上涨82.73%,另一方面沪深300却下跌7.65%。分行业来看,以TMT、医药、食品、家电等新兴成长、稳定消费行业,代表了创新和转型升级的方向,全年大幅上涨。而金融、地产产业链、资源品等行业,受经济增速放缓和前景不明影响,自2月开始不断走强,全年跌幅居前。

对于成长性行业而言,13年上涨的驱动力既来自企业业绩的快速成长,也来自流动性推动的估值提升,甚至在下半年的行情中,后者起到了更大的作用。在经济缺乏亮点的背景下,主题投资亦热点纷呈,去IOE、特一级资质、金改、土地流转、自贸区、二胎、O2O、国企改革等主题板块此起彼伏。

本基金在资产配置方面总体把握较好,自2季度开始,坚持成长风格,投资处于成长期的行业和公司,重点配置了传媒、食品、医药等行业。在4季度,基于对宏观经济走势、上市公司盈利增长和估值水平的判断,本基金对持仓品种中盈利可能低于预期或估值脱离基本面支撑的个股进行了减持,并在波动中对优质品种进行了增持。对于主题投资,本基金在控制风险的前提下适度进行了参与,但其脉冲式行情的特点使得在实际操作中难度较大。

2013年,本基金净值增长率18.53%,超过业绩基准21.65个百分点。

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0.6089元,本报告期份额净值增长率为18.53%,同期业绩比较基准增长率为-3.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

就近期公布的宏观数据来看,低迷的2月上旬用电数据、表现偏弱的2月汇丰PMI预览值均暗示2013年12月中下旬以来的弱势格局仍在延续。考虑到基数的原因,2014年年初宏观数据更不容乐观。针对当前的经济形势,预计未来政策取向“稳增长”的考虑会多一投。

从近期央行的报告表述以及实际操作来看,2014年流动性可能相对宽松,尤其考虑到实体经济的平淡、房价谨慎风气的蔓延,流动性可能更加显得充裕。在市场普遍对实体经济有充分一致预期的前提下,流动性可能成为影响2014年证券市场的重要因素之一。

2014年的证券市场存在很大的不确定性。IPO何去何从,宏观政策是否出现较大调整以及对证券市场违法违规行为查处力度的加大等等都会对证券市场产生直接影响。展望2014年的股票市场,在市场总体平淡的情况下,不排除不同风格子板块会有所表现。在宏观经济前景不乐观的预期下,以创业板为代表的主题投资仍然可能表现活跃。不过此时参与颇有大中取聚的味道。蓝筹股毕竟估值极具吸引力,不排除因为政策的原因、或者市场风格转换的原因而出现某种程度的反弹行情。

2014年的关键词大概率是“改革”,因此,股票市场的热点也将围绕改革而展开。预计“国企改革”、城镇化、环保、军工以及民生相关等行业板块会有较多的投资机会。但是改革不是一蹴而就的,需要一定的过程,在这期间,传统的稳增长手段将继续发挥应有的作用。在市场热情专注于“新经济”的时候,传统的一些周期股也在酝酿着机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2013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,要求相关部门跟踪整改,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-1,199,855,422.17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(2014)第20551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:华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		179,187,835.58	243,412,854.17
结算备付金		7,576,883.69	6,648,437.98
存出保证金		1,830,924.97	4,250,000.00
交易性金融资产		4,111,457,376.57	5,081,264,899.28
其中:股票投资		3,911,787,376.57	4,928,479,899.28
基金投资		-	-
债券投资		199,670,000.00	152,785,000.00
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		591,720,510.18	169,970,687.46
应收证券清算款		141,269,121.77	25,469,867.65
应收利息		6,443,154.85	2,459,642.85
应收股利		-	-
应收申购款		200,052,381.77	15,292.85
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		5,239,538,189.38	5,533,491,682.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31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		14,524,393.22	-
应付赎回款		4,183,325.38	2,255,308.27
应付管理人报酬		6,123,872.10	6,570,579.99
应付托管费		1,020,645.34	1,095,096.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,530,002.25	4,939,573.66
应交税费		214,950.00	214,950.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		2,249,127.20	5,604,124.54
负债合计		30,846,315.49	20,679,633.13
所有者权益:			
实收基金		3,579,166,380.73	4,490,113,893.98
未分配利润		1,629,525,493.16	1,022,698,155.13
所有者权益合计		5,208,691,873.89	5,512,812,049.11
负债和所有者权益总计		5,239,538,189.38	5,533,491,682.24

7.2 利润表

会计主体:华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		990,742,119.65	130,917,384.83
1.利息收入		16,620,689.52	19,225,521.95
其中:存款利息收入		3,469,720.99	8,510,805.00
债券利息收入		10,905,944.22	7,583,783.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,245,024.31	3,130,933.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		421,948,391.93	-633,223,424.95
其中:股票投资收益		407,030,497.85	-693,764,971.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-9,105,724.66	-341,715.50
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		24,023,618.74	60,883,262.07
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		551,462,404.85	744,743,959.13
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		710,633.35	171,328.70
减:二、费用		118,034,686.70	141,263,030.13
1.管理人报酬		73,463,083.54	92,483,068.52
2.托管费		12,243,847.20	15,413,844.75
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		31,812,543.34	32,869,380.08
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		515,212.62	496,736.78
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		872,707,432.95	-10,345,645.30
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		872,707,432.95	-10,345,645.30

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1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)	4,490,113,893.98	1,022,698,155.13	5,512,812,049.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	872,707,432.95	872,707,432.95
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)	-910,947,513.25	-265,880,094.92	-1,176,827,608.17
其中:1.基金申购款	303,155,210.09	129,033,163.93	432,188,374.02
2.基金赎回款	-1,214,102,723.34	-394,913,258.85	-1,609,015,982.19
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)	3,579,166,380.73	1,629,525,493.16	5,208,691,873.89
项目	上年度可比期间 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)	5,271,231,223.24	1,187,022,016.95	6,458,253,240.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-10,345,645.30	-10,345,645.30
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)	-781,117,329.26	-153,978,216.52	-935,095,545.78
其中:1.基金申购款	47,476,312.12	13,147,979.52	60,624,291.64
2.基金赎回款	-828,593,641.38	-167,126,196.04	-995,719,837.42
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)	4,490,113,893.98	1,022,698,155.13	5,512,812,049.11

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、房伟力、陈培

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金(原名为友邦华泰盛世中国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”)证监基金字[2005]第19号《关于同意友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金设立的批复》核准,由友邦华泰基金管理有限公司(已自2010年4月30日起更名为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《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》(现更名为《华泰柏瑞盛世中国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900,348,752.84元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2005)第48号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》(现更名为《华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金合同》)于2005年4月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为900,519,775.77份基金份额,其中认购资金利息折合171,022.93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《华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金招募说明书》和《友邦华泰基金管理有限公司关于友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定,本基金于2007年9月3日进行了基金份额拆分,拆分比例为2.39029438,并于2007年9月4日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞盛世中国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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金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%。此外,本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的资产比例合计不低于基金净资产的5%。本基金的业绩比较基准为:中信标普300指数×70%+中信国债指数×30%。

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2014年3月26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》、《华泰柏瑞盛世中国股票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2013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2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4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的说明

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[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。

7.4.6 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

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。

7.4.7 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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	616,192,296.29	3.02%	435,619,687.33	2.04%
华泰联合证券	-	-	163,865,739.28	0.77%

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 2013年1月1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	546,538.89	2.99%	111,755.43	4.43%
关联方名称	上年度可比期间 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	364,583.75	1.98%	100,788.37	2.04%
华泰联合证券有限责任公司	139,286.58	0.76%	-	-

注:上述佣金按股票交易量的千分之一计算,以扣除证管费和经手费后的净额列示。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。 关联方的佣金比率和计算方式与非关联方一致。

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	73,463,083.54	92,483,068.52
其中:支付销售机构的客户维护费	14,251,787.66	13,852,660.54

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 × 1.50% ÷ 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