

# 华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金 2011 年年度报告

2011 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：2012 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 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 2012 年 3 月 29 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。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>          | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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             | 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             | 12        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明        | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14        |
| 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      | 14        |
| <b>§6 审计报告</b>                          | <b>14</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 14        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 15        |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | <b>16</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 16        |
| 7.2 利润表                                 | 17        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 18        |
| 7.4 报表附注                                | 19        |
| <b>§8 投资组合报告</b>                        | <b>40</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 40        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 40        |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 41        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 44        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 45        |
| 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      | 46        |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 46        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 8.8 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 ..... | 46        |
| 8.9 投资组合报告附注.....                        | 46        |
| <b>§9 基金份额持有人信息.....</b>                 | <b>47</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....               | 47        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 .....        | 47        |
| <b>§10 开放式基金份额变动.....</b>                | <b>48</b> |
| <b>§11 重大事件揭示.....</b>                   | <b>48</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 48        |
| 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 .....   | 48        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 48        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                     | 48        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 49        |
| 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 .....      | 49        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 49        |
| 11.8 其他重大事件 .....                        | 51        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>           | <b>54</b> |
| <b>§13 备查文件目录.....</b>                   | <b>54</b> |
| 13.1 备查文件目录.....                         | 54        |
| 13.2 存放地点.....                           | 55        |
| 13.3 查阅方式.....                           | 55        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金   |
| 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 | 12,598,429,846.50 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                        | 010-66594855             |
|         | 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             |
| 注册地址    |      | 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 | 北京市复兴门内大街 1 号            |
| 办公地址    |      | 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 | 北京市复兴门内大街 1 号            |
| 邮政编码    |      | 200135                              | 100818                   |

|       |    |    |
|-------|----|----|
| 法定代表人 | 齐亮 | 肖钢 |
|-------|----|----|

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                                 |
|---------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报、上海证券报、证券时报                                                |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a> |
| 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                             |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址                                |
|--------|------------------|-------------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所有限公司 | 上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼              |
| 注册登记机构 | 华泰柏瑞基金管理有限公司     | 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 | 2011 年            | 2010 年            | 2009 年            |
|---------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 本期已实现收益       | 46,723,497.09     | -278,071,756.55   | 1,664,986,841.38  |
| 本期利润          | -2,352,946,761.42 | 534,220,219.80    | 3,127,984,910.25  |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1871           | 0.0391            | 0.2305            |
| 本期加权平均净值利润率   | -30.31%           | 6.38%             | 40.05%            |
| 本期基金份额净值增长率   | -26.87%           | 6.62%             | 56.45%            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2011 年末           | 2010 年末           | 2009 年末           |
| 期末可供分配利润      | -1,455,576,489.76 | -1,575,862,520.06 | -1,432,729,869.70 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.1155           | -0.1209           | -0.1017           |
| 期末基金资产净值      | 6,458,253,240.19  | 9,132,652,495.84  | 9,265,787,473.04  |
| 期末基金份额净值      | 0.5126            | 0.7009            | 0.6574            |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2011 年末           | 2010 年末           | 2009 年末           |
| 基金份额累计净值增长率   | 203.19%           | 314.56%           | 288.83%           |

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

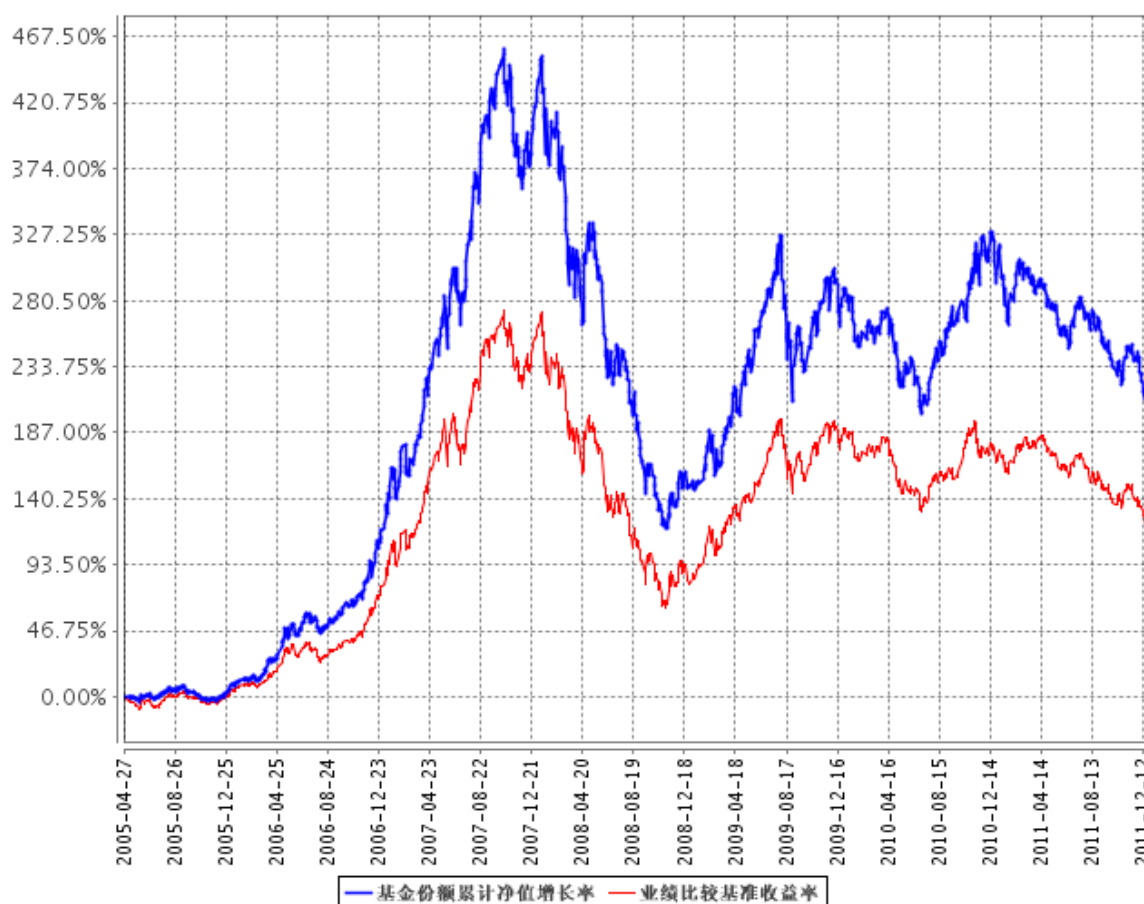
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段                  | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③    | ②－④   |
|---------------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月               | -9.27%       | 1.14%               | -5.69%             | 0.98%                 | -3.58% | 0.16% |
| 过去六个月               | -17.39%      | 1.04%               | -15.73%            | 0.95%                 | -1.66% | 0.09% |
| 过去一年                | -26.87%      | 1.08%               | -17.32%            | 0.91%                 | -9.55% | 0.17% |
| 过去三年                | 21.99%       | 1.48%               | 25.05%             | 1.16%                 | -3.06% | 0.32% |
| 过去五年                | 39.40%       | 1.72%               | 25.95%             | 1.50%                 | 13.45% | 0.22% |
| 自基金合同<br>生效日起至<br>今 | 203.19%      | 1.58%               | 124.17%            | 1.38%                 | 79.02% | 0.20% |

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

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



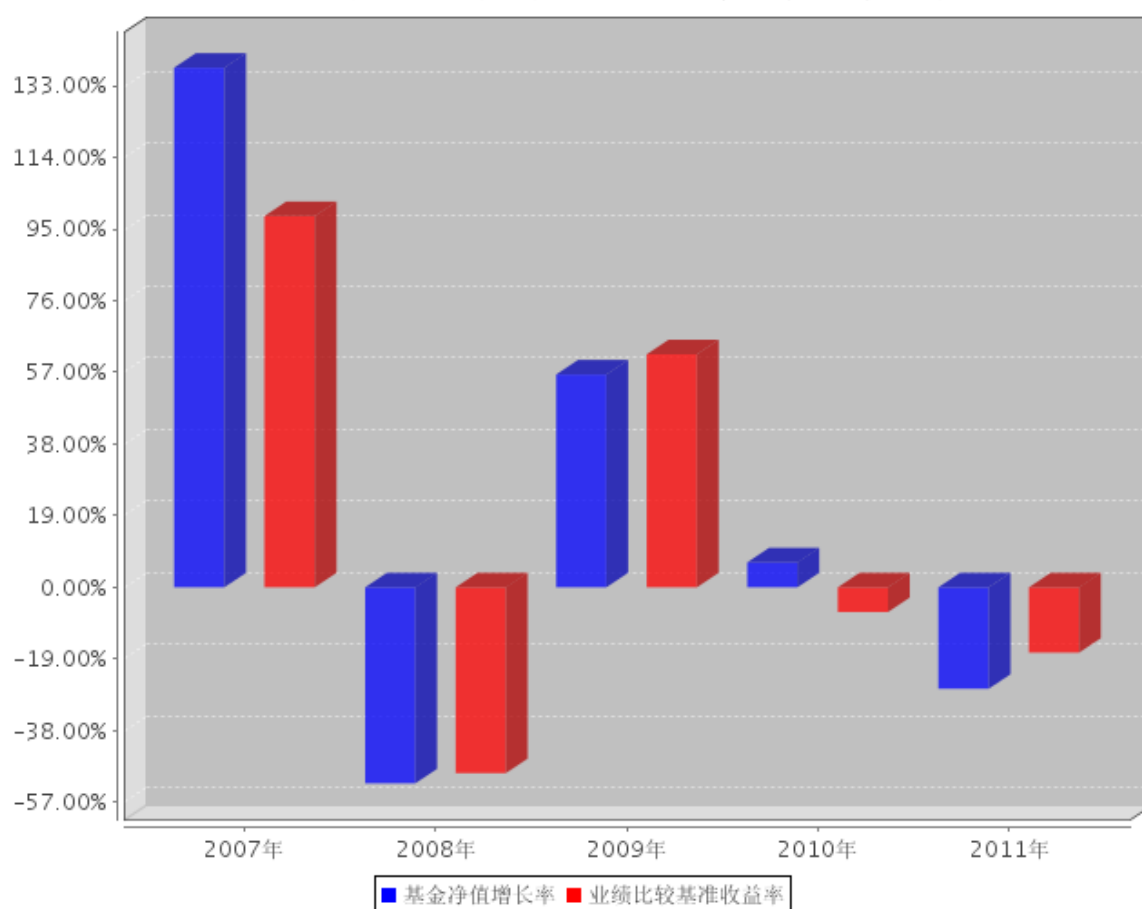
注：图示日期为 2005 年 4 月 27 日至 2011 年 12 月 31 日。

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



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对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## § 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和华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金。截至 2011 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 134.65 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 | -    | 17 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。 |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------|

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内的公平交易模块，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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

注：本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格均不相同。

### 4.3.3 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。

## 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

2011 年 A 股市场震荡走低，沪深 300 指数下跌超过 23%。行业方面食品饮料、金融和房地产行业跌幅较小，有色金属、电子元器件跌幅较大。风格方面，创业板、中小板和中证 500 所代表的中小市值股票调整幅度较大。

本基金在资产配置方面总体把握较好，但是行业和风格配置出现一定偏差，组合业绩总体上落后沪深 300 指数。2011 年，本基金净值增长率-26.87%，低于业绩基准 9.55 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 0.5126 元，本报告期份额净值增长率为-26.87%，同期业绩比较基准增长率为-17.32%。

## 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 2012 年，本基金认为市场经历了连续两年的估值压缩，系统性风险已经大体释放，估值趋于合理，股市环境将有所改善，区间震荡的格局在上半年较为明显。从基本面看，货币信贷紧缩已经进入尾声，预期将触底回升，在一定范围内震荡。政策预调微调的条件已经具备，为股市估值修复提供了条件。当然，经济将延续回落态势，表现在 PPI 走低，需求偏弱，企业利润增速降低。这些因素一方面已经反应在较低的估值中，另一方面也制约了市场启动新一轮牛市，市场全面持续走好的条件尚不具备。

本基金认为 2012 年宏观经济中仍然存在一些潜在的风险因素。美国和欧元区继续实行宽松的货币政策，以及伊朗、叙利亚等地缘政治问题可能使大宗商品和石油价格再次上涨。国内利率水平和劳动力价格继续提高。这些因素有可能在某一时间使通胀再次成为关注焦点，将对市场信心构成新一轮冲击。

本基金认为在流动性改善的预期下，低估值周期股将有很好的反弹机会。优秀的成长股将会穿越不利的经济周期，获得长期超额收益。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2011 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 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-1,455,576,489.76 元，报告期内基金未实施收益分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

### § 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

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2012)第 21312 号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题       | 审计报告                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告收件人      | 华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金全体基金份额持有人：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 引言段          | 我们审计了后附的华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞盛世中国基金”)的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 管理层对财务报表的责任段 | <p>编制和公允列报财务报表是华泰柏瑞盛世中国基金 的基金管理人 华泰柏瑞基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>                                                                                                                                                                            |
| 注册会计师的责任段    | <p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> |
| 审计意见段        | 我们认为，上述 华泰柏瑞盛世中国基金 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了 华泰柏瑞盛世中国基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度 的经营成果和基金净值变动情况。                                                                                                                                                                                                                                  |
| 注册会计师的姓名     | 薛 竞<br>王 灵                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 会计师事务所的名称    | 普华永道中天会计师事务所有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 会计师事务所的地址    | 上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 审计报告日期       | 2012 年 3 月 22 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

## § 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：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2011 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2010 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 652,303,076.09                  | 510,642,526.46                   |
| 结算备付金           |            | 22,726,845.62                   | 11,094,567.71                    |
| 存出保证金           |            | 2,921,828.36                    | 4,889,269.81                     |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 5,794,685,322.75                | 8,615,586,416.23                 |
| 其中：股票投资         |            | 5,475,143,322.75                | 8,214,326,416.23                 |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 319,542,000.00                  | 401,260,000.00                   |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 5,750,684.88                    | 13,747,223.53                    |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 47,643.39                       | 1,572,077.14                     |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 6,478,435,401.09                | 9,157,532,080.88                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2011 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2010 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                 |                                  |
| 短期借款            |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款           |            | 1,141,015.81                    | 3,486,618.36                     |
| 应付管理人报酬         |            | 8,663,608.45                    | 11,968,730.42                    |
| 应付托管费           |            | 1,443,934.74                    | 1,994,788.38                     |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 5,896,292.45                    | 4,897,781.71                     |



|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应交税费          |          | 107,000.00       | -                |
| 应付利息          |          | -                | -                |
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 2,930,309.45     | 2,531,666.17     |
| 负债合计          |          | 20,182,160.90    | 24,879,585.04    |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 5,271,231,223.24 | 5,451,607,529.00 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 1,187,022,016.95 | 3,681,044,966.84 |
| 所有者权益合计       |          | 6,458,253,240.19 | 9,132,652,495.84 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 6,478,435,401.09 | 9,157,532,080.88 |

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.5126 元，基金份额总额 12,598,429,846.50 份。

## 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至<br>2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至<br>2010 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            |            | -2,172,284,807.89                         | 722,631,791.97                                 |
| 1. 利息收入                |            | 17,717,970.06                             | 26,459,497.07                                  |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 11,107,429.75                             | 10,441,064.56                                  |
| 债券利息收入                 |            | 6,549,678.00                              | 13,813,530.06                                  |
| 资产支持证券利息收入             |            | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入             |            | 60,862.31                                 | 2,204,902.45                                   |
| 其他利息收入                 |            | -                                         | -                                              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 209,319,327.26                            | -116,511,428.63                                |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | 166,524,157.61                            | -156,374,545.73                                |
| 基金投资收益                 |            | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | -8,308,897.94                             | 6,042,279.92                                   |
| 资产支持证券投资收益             |            | -                                         | -                                              |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.14   | -                                         | -                                              |
| 股利收益                   | 7.4.7.15   | 51,104,067.59                             | 33,820,837.18                                  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16   | -2,399,670,258.51                         | 812,291,976.35                                 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                         | -                                              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17   | 348,153.30                                | 391,747.18                                     |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 180,661,953.53                            | 188,411,572.17                                 |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 116,717,757.88                            | 125,530,128.94                                 |

|                     |            |                   |                |
|---------------------|------------|-------------------|----------------|
| 2. 托管费              | 7.4.10.2.2 | 19,452,959.66     | 20,921,688.12  |
| 3. 销售服务费            | 7.4.10.2.3 | -                 | -              |
| 4. 交易费用             | 7.4.7.18   | 43,974,459.96     | 41,451,374.92  |
| 5. 利息支出             |            | -                 | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | -                 | -              |
| 6. 其他费用             | 7.4.7.19   | 516,776.03        | 508,380.19     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | -2,352,946,761.42 | 534,220,219.80 |
| 减：所得税费用             |            | -                 | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | -2,352,946,761.42 | 534,220,219.80 |

### 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：2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 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）                        | 5,451,607,529.00                            | 3,681,044,966.84  | 9,132,652,495.84  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                           | -2,352,946,761.42 | -2,352,946,761.42 |
| 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）      | -180,376,305.76                             | -141,076,188.47   | -321,452,494.23   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 500,827,868.80                              | 244,233,326.61    | 745,061,195.41    |
| 2. 基金赎回款                               | -681,204,174.56                             | -385,309,515.08   | -1,066,513,689.64 |
| 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）                        | 5,271,231,223.24                            | 1,187,022,016.95  | 6,458,253,240.19  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 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）                        | 5,896,961,609.50 | 3,368,825,863.54 | 9,265,787,473.04  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                | 534,220,219.80   | 534,220,219.80    |
| 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）      | -445,354,080.50  | -222,001,116.50  | -667,355,197.00   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 388,992,845.55   | 214,562,373.91   | 603,555,219.46    |
| 2. 基金赎回款                               | -834,346,926.05  | -436,563,490.41  | -1,270,910,416.46 |
| 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）                        | 5,451,607,529.00 | 3,681,044,966.84 | 9,132,652,495.84  |

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：

|           |            |           |
|-----------|------------|-----------|
| <u>韩勇</u> | <u>房伟力</u> | <u>陈培</u> |
| 基金管理公司负责人 | 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(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《关于同意友邦华泰华泰盛世中国股票型证券投资基金设立的批复》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有限公司普华永道中天验字(2005)第 48 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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。因基金管理人更名,经中国证监会批准,本基金名称自 2010 年 4 月 30 日起由“友邦华

泰盛世中国证券投资基金”更名为“华泰柏瑞盛世中国证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞盛世中国股票”，基金代码保持不变。

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 2.390029438，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 2012 年 3 月 30 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》、《华泰柏瑞盛世中国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 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度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

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。

额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

##### (1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

##### (2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自 2009 年 6 月 15 日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37 号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 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

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。



#### 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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》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) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。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、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(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 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2011 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2010 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 652,303,076.09          | 510,642,526.46           |
| 定期存款           | —                       | —                        |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | —                       | —                        |
| 其他存款           | —                       | —                        |
| 合计：            | 652,303,076.09          | 510,642,526.46           |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2011 年 12 月 31 日 |
|----|-------------------------|
|----|-------------------------|

|        |       | 成本                       | 公允价值             | 公允价值变动           |
|--------|-------|--------------------------|------------------|------------------|
| 股票     |       | 6,097,411,327.70         | 5,475,143,322.75 | -622,268,004.95  |
| 债券     | 交易所市场 | -                        | -                | -                |
|        | 银行间市场 | 319,922,017.78           | 319,542,000.00   | -380,017.78      |
|        | 合计    | 319,922,017.78           | 319,542,000.00   | -380,017.78      |
| 资产支持证券 |       | -                        | -                | -                |
| 基金     |       | -                        | -                | -                |
| 其他     |       | -                        | -                | -                |
| 合计     |       | 6,417,333,345.48         | 5,794,685,322.75 | -622,648,022.73  |
| 项目     |       | 上年度末<br>2010 年 12 月 31 日 |                  |                  |
|        |       | 成本                       | 公允价值             | 公允价值变动           |
| 股票     |       | 6,428,623,280.45         | 8,214,326,416.23 | 1,785,703,135.78 |
| 债券     | 交易所市场 | -                        | -                | -                |
|        | 银行间市场 | 409,940,900.00           | 401,260,000.00   | -8,680,900.00    |
|        | 合计    | 409,940,900.00           | 401,260,000.00   | -8,680,900.00    |
| 资产支持证券 |       | -                        | -                | -                |
| 基金     |       | -                        | -                | -                |
| 其他     |       | -                        | -                | -                |
| 合计     |       | 6,838,564,180.45         | 8,615,586,416.23 | 1,777,022,235.78 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2011 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2010 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 158,756.72              | 150,350.94               |
| 应收定期存款利息   | -                       | -                        |
| 应收其他存款利息   | -                       | -                        |
| 应收结算备付金利息  | 11,249.81               | 4,271.41                 |
| 应收债券利息     | 5,580,609.82            | 13,592,547.94            |
| 应收买入返售证券利息 | -                       | -                        |
| 应收申购款利息    | -                       | -                        |
| 其他         | 68.53                   | 53.24                    |

|    |              |               |
|----|--------------|---------------|
| 合计 | 5,750,684.88 | 13,747,223.53 |
|----|--------------|---------------|

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2011 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2010 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 5,894,942.45            | 4,897,781.71             |
| 银行间市场应付交易费用 | 1,350.00                | -                        |
| 合计          | 5,896,292.45            | 4,897,781.71             |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2011 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2010 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 2,250,000.00            | 1,750,000.00             |
| 应付赎回费       | 309.45                  | 666.17                   |
| 预提审计费       | 160,000.00              | 161,000.00               |
| 预提信息披露费     | 520,000.00              | 620,000.00               |
| 合计          | 2,930,309.45            | 2,531,666.17             |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|----------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额             |
| 上年度末          | 13,029,546,398.67                      | 5,451,607,529.00 |
| 本期申购          | 1,196,972,812.46                       | 500,827,868.80   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,628,089,364.63                      | -681,204,174.56  |
| 本期末           | 12,598,429,846.50                      | 5,271,231,223.24 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目   | 已实现部分             | 未实现部分            | 未分配利润合计          |
|------|-------------------|------------------|------------------|
| 上年度末 | -1,575,862,520.06 | 5,256,907,486.90 | 3,681,044,966.84 |

|                |                   |                   |                   |
|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 本期利润           | 46,723,497.09     | -2,399,670,258.51 | -2,352,946,761.42 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 73,562,533.21     | -214,638,721.68   | -141,076,188.47   |
| 其中：基金申购款       | -78,113,619.29    | 322,346,945.90    | 244,233,326.61    |
| 基金赎回款          | 151,676,152.50    | -536,985,667.58   | -385,309,515.08   |
| 本期已分配利润        | -                 | -                 | -                 |
| 本期末            | -1,455,576,489.76 | 2,642,598,506.71  | 1,187,022,016.95  |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|-----------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 10,933,750.34                          | 10,303,634.71                               |
| 定期存款利息收入  | -                                      | -                                           |
| 其他存款利息收入  | -                                      | -                                           |
| 结算备付金利息收入 | 173,679.41                             | 137,429.85                                  |
| 其他        | -                                      | -                                           |
| 合计        | 11,107,429.75                          | 10,441,064.56                               |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 14,648,364,309.23                      | 13,813,588,427.68                           |
| 减：卖出股票成本总额 | 14,481,840,151.62                      | 13,969,962,973.41                           |
| 买卖股票差价收入   | 166,524,157.61                         | -156,374,545.73                             |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|------------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 475,485,467.00                         | 481,639,698.63                              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 465,522,900.00                         | 468,927,169.50                              |

|          |               |              |
|----------|---------------|--------------|
| 减：应收利息总额 | 18,271,464.94 | 6,670,249.21 |
| 债券投资收益   | -8,308,897.94 | 6,042,279.92 |

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

注：无。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|-------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 51,104,067.59                          | 33,820,837.18                               |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                      | -                                           |
| 合计          | 51,104,067.59                          | 33,820,837.18                               |

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -2,399,670,258.51                      | 812,291,976.35                              |
| ——股票投资     | -2,407,971,140.73                      | 829,946,941.45                              |
| ——债券投资     | 8,300,882.22                           | -17,654,965.10                              |
| ——资产支持证券投资 | -                                      | -                                           |
| 2. 衍生工具    | -                                      | -                                           |
| ——权证投资     | -                                      | -                                           |
| 3. 其他      | -                                      | -                                           |
| 合计         | -2,399,670,258.51                      | 812,291,976.35                              |

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 346,049.95                             | 372,036.15                                  |
| 转换费收入   | 2,103.35                               | 8,724.67                                    |
| 其他收入    | -                                      | 10,986.36                                   |
| 合计      | 348,153.30                             | 391,747.18                                  |

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金财产。

2、本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用的 25%的部分归入基金财产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|-----------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 43,972,734.96                          | 41,449,924.92                               |
| 银行间市场交易费用 | 1,725.00                               | 1,450.00                                    |
| 合计        | 43,974,459.96                          | 41,451,374.92                               |

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|-------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 审计费用  | 160,000.00                             | 161,000.00                                  |
| 信息披露费 | 320,000.00                             | 320,000.00                                  |
| 其他费用  | 36,776.03                              | 27,380.19                                   |
| 合计    | 516,776.03                             | 508,380.19                                  |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 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、基金代销机构 |

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 |                      | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |                      |
|--------------|----------------------------------------|----------------------|---------------------------------------------|----------------------|
|              | 成交金额                                   | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                                        | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 华泰证券股份有限公司   | 1,125,535,067.88                       | 3.92%                | 3,465,896,162.23                            | 12.79%               |
| 华泰联合证券有限责任公司 | 784,087,111.11                         | 2.73%                | 1,530,562,322.66                            | 5.65%                |

##### 7.4.10.1.2 权证交易

注：无。

##### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称            | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日      |                |            |                  |
|------------------|---------------------------------------------|----------------|------------|------------------|
|                  | 当期<br>佣金                                    | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 华泰证券股份<br>有限公司   | 924,409.97                                  | 3.85%          | 463,420.43 | 7.86%            |
| 华泰联合证券<br>有限责任公司 | 666,471.62                                  | 2.77%          | 39,024.04  | 0.66%            |
| 关联方名称            | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |                |            |                  |
|                  | 当期<br>佣金                                    | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 华泰证券股份<br>有限公司   | 2,816,056.76                                | 12.43%         | 909,294.89 | 18.57%           |
| 华泰联合证券<br>有限责任公司 | 1,300,974.78                                | 5.74%          | -          | -                |

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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|-----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 116,717,757.88                         | 125,530,128.94                              |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 17,928,105.20                          | 19,918,452.07                               |

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 19,452,959.66                          | 20,921,688.12                               |

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况



#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及 2010 年度，基金管理公司未投资本基金。

#### 7.4.10.4.2 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：本报告期及 2010 年度，基金管理公司主要股东及其控制的机构未投资本基金。

#### 7.4.10.5 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<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 |               | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 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 | 652,303,076.09                         | 10,933,750.34 | 510,642,526.46                              | 10,303,634.71 |

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日      |        |      |      |           |               |
|---------------------------------------------|--------|------|------|-----------|---------------|
| 关联方名称                                       | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 |               |
|                                             |        |      |      | 数量（单位：份）  | 总金额           |
| -                                           | -      | -    | -    | -         | -             |
| 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |        |      |      |           |               |
| 关联方名称                                       | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 |               |
|                                             |        |      |      | 数量（单位：份）  | 总金额           |
| 华泰证券                                        | 601377 | 兴业证券 | 新股认购 | 2,519,157 | 25,191,570.00 |
| 华泰证券                                        | 601288 | 农业银行 | 新股认购 | 1,858,520 | 4,980,833.60  |

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：无。

#### 7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |    |    |     |      |    |      |    |    |     |    |
|----------------------|----|----|-----|------|----|------|----|----|-----|----|
| 证券                   | 证券 | 成功 | 可流通 | 流通受限 | 认购 | 期末估值 | 数量 | 期末 | 期末估 | 备注 |

| 代码     | 名称   | 认购日              | 日                | 类型     | 价格    | 单价    | (单位: 股)   | 成本总额          | 值总额           |   |
|--------|------|------------------|------------------|--------|-------|-------|-----------|---------------|---------------|---|
| 002231 | 奥维通信 | 2011 年 12 月 28 日 | 2012 年 12 月 31 日 | 非公开发行  | 12.85 | 11.80 | 2,000,000 | 25,700,000.00 | 23,600,000.00 | - |
| 601336 | 新华保险 | 2011 年 12 月 9 日  | 2012 年 3 月 16 日  | 网下新股中签 | 23.25 | 27.87 | 87,441    | 2,033,003.25  | 2,436,980.67  | - |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 7.4.12.2 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 |
|--------|------|------------------|------|--------|-----------------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 600315 | 上海家化 | 2011 年 12 月 30 日 | 股权转让 | 34.09  | 2012 年 1 月 4 日  | 34.75  | 579,022 | 20,134,578.32 | 19,738,859.98 | -  |
| 300026 | 红日药业 | 2011 年 12 月 27 日 | 资产重组 | 25.00  | 2012 年 2 月 29 日 | 27.50  | 111,566 | 3,084,823.25  | 2,789,150.00  | -  |

注：1、本基金截至 2011 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡

以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 0.16%。（2010 年 12 月 31 日：无）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。

此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为三个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2011 年 12 月 31 日  | 1 个月以内                | 1-3 个月                | 3 个月-1 年              | 1-5 年    | 5 年以上    | 不计息                     | 合计                      |
|--------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|----------|----------|-------------------------|-------------------------|
| 资产                       |                       |                       |                       |          |          |                         |                         |
| 银行存款                     | 652,303,076.09        | -                     | -                     | -        | -        | -                       | 652,303,076.09          |
| 结算备付金                    | 22,726,845.62         | -                     | -                     | -        | -        | -                       | 22,726,845.62           |
| 存出保证金                    | 138,549.12            | -                     | -                     | -        | -        | 2,783,279.24            | 2,921,828.36            |
| 交易性金融资产                  | 10,068,000.00         | 19,364,000.00         | 290,110,000.00        | -        | -        | 5,475,143,322.75        | 5,794,685,322.75        |
| 应收利息                     | -                     | -                     | -                     | -        | -        | 5,750,684.88            | 5,750,684.88            |
| 应收申购款                    | 2,176.88              | -                     | -                     | -        | -        | 45,466.51               | 47,643.39               |
| <b>资产总计</b>              | <b>685,238,647.71</b> | <b>19,364,000.00</b>  | <b>290,110,000.00</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>5,483,722,753.38</b> | <b>6,478,435,401.09</b> |
| 负债                       |                       |                       |                       |          |          |                         |                         |
| 应付赎回款                    | -                     | -                     | -                     | -        | -        | 1,141,015.81            | 1,141,015.81            |
| 应付管理人报酬                  | -                     | -                     | -                     | -        | -        | 8,663,608.45            | 8,663,608.45            |
| 应付托管费                    | -                     | -                     | -                     | -        | -        | 1,443,934.74            | 1,443,934.74            |
| 应付交易费用                   | -                     | -                     | -                     | -        | -        | 5,896,292.45            | 5,896,292.45            |
| 应交税费                     | -                     | -                     | -                     | -        | -        | 107,000.00              | 107,000.00              |
| 其他负债                     | -                     | -                     | -                     | -        | -        | 2,930,309.45            | 2,930,309.45            |
| <b>负债总计</b>              | <b>-</b>              | <b>-</b>              | <b>-</b>              | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>20,182,160.90</b>    | <b>20,182,160.90</b>    |
| <b>利率敏感度缺口</b>           | <b>685,238,647.71</b> | <b>19,364,000.00</b>  | <b>290,110,000.00</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>5,463,540,592.48</b> | <b>6,458,253,240.19</b> |
| 上年度末<br>2010 年 12 月 31 日 | 1 个月以内                | 1-3 个月                | 3 个月-1 年              | 1-5 年    | 5 年以上    | 不计息                     | 合计                      |
| 资产                       |                       |                       |                       |          |          |                         |                         |
| 银行存款                     | 510,642,526.46        | -                     | -                     | -        | -        | -                       | 510,642,526.46          |
| 结算备付金                    | 11,094,567.71         | -                     | -                     | -        | -        | -                       | 11,094,567.71           |
| 存出保证金                    | 138,549.12            | -                     | -                     | -        | -        | 4,750,720.69            | 4,889,269.81            |
| 交易性金融资产                  | -                     | 300,870,000.00        | 100,390,000.00        | -        | -        | 8,214,326,416.23        | 8,615,586,416.23        |
| 应收利息                     | -                     | -                     | -                     | -        | -        | 13,747,223.53           | 13,747,223.53           |
| 应收申购款                    | 1,498,034.54          | -                     | -                     | -        | -        | 74,042.60               | 1,572,077.14            |
| <b>资产总计</b>              | <b>523,373,677.83</b> | <b>300,870,000.00</b> | <b>100,390,000.00</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>8,232,898,403.05</b> | <b>9,157,532,080.88</b> |
| 负债                       |                       |                       |                       |          |          |                         |                         |
| 应付赎回款                    | -                     | -                     | -                     | -        | -        | 3,486,618.36            | 3,486,618.36            |

|         |                |                |                |   |                  |                  |
|---------|----------------|----------------|----------------|---|------------------|------------------|
| 应付管理人报酬 | -              | -              | -              | - | 11,968,730.42    | 11,968,730.42    |
| 应付托管费   | -              | -              | -              | - | 1,994,788.38     | 1,994,788.38     |
| 应付交易费用  | -              | -              | -              | - | 4,897,781.71     | 4,897,781.71     |
| 其他负债    | -              | -              | -              | - | 2,531,666.17     | 2,531,666.17     |
| 负债总计    | -              | -              | -              | - | 24,879,585.04    | 24,879,585.04    |
| 利率敏感度缺口 | 523,373,677.83 | 300,870,000.00 | 100,390,000.00 | - | 8,208,018,818.01 | 9,132,652,495.84 |

注：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.95%(2010 年 12 月 31 日：4.39%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2010 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金净资产的 60%-90%，债券、现金及其它短期金融工具为 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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2011 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2010 年 12 月 31 日 |                       |
|--------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|              | 公允价值                    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 5,475,143,322.75        | 84.78                    | 8,214,326,416.23         | 89.94                 |
| 交易性金融资产—基金投资 | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 交易性金融资产—债券投资 | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 衍生金融资产—权证投资  | -                       | -                        | -                        | -                     |

|    |                  |       |                  |       |
|----|------------------|-------|------------------|-------|
| 其他 | -                | -     | -                | -     |
| 合计 | 5,475,143,322.75 | 84.78 | 8,214,326,416.23 | 89.94 |

#### 7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变 |                              |                        |
|----|---------------------------|------------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动                 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币亿元） |                        |
|    |                           | 本期末（2011 年 12 月 31 日）        | 上年度末（2010 年 12 月 31 日） |
|    | 沪深 300 指数上涨 5%            | 增加 2.40                      | 增加 4.13                |
|    | 沪深 300 指数下跌 5%            | 减少 2.40                      | 减少 4.13                |

#### 7.4.14 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) 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。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 5,429,015,312.77 元，属于第二层级的余额为 365,670,009.98 元，无属于第三层级的余额（2010 年 12 月 31 日：第一层级 8,130,740,934.49 元，第二层级 484,845,481.74 元，无第三层级）。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级（2010 年度：同）。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层级列入第二层级，并于限售期满后从第二层级转入第一层级，本基金于本年度内未发生持有的非公开发行股票限售期满的情况（2010 年度：同）。

##### (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<br>(%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 5,475,143,322.75 | 84.51            |
|    | 其中：股票             | 5,475,143,322.75 | 84.51            |
| 2  | 固定收益投资            | 319,542,000.00   | 4.93             |
|    | 其中：债券             | 319,542,000.00   | 4.93             |
|    | 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      | 675,029,921.71   | 10.42            |
| 6  | 其他各项资产            | 8,720,156.63     | 0.13             |
| 7  | 合计                | 6,478,435,401.09 | 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       | 280,966,314.63   | 4.35         |
| B   | 采掘业            | 59,647,085.82    | 0.92         |
| C   | 制造业            | 3,713,801,823.60 | 57.50        |
| C0  | 食品、饮料          | 1,244,066,650.35 | 19.26        |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 86,194,386.82    | 1.33         |
| C2  | 木材、家具          | —                | —            |
| C3  | 造纸、印刷          | —                | —            |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 158,822,682.22   | 2.46         |
| C5  | 电子             | 170,587,306.04   | 2.64         |
| C6  | 金属、非金属         | 281,236,419.26   | 4.35         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 673,957,532.36   | 10.44        |
| C8  | 医药、生物制品        | 1,098,936,846.55 | 17.02        |
| C99 | 其他制造业          | —                | —            |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 42,662,079.32    | 0.66         |
| E   | 建筑业            | —                | —            |
| F   | 交通运输、仓储业       | 102,687,374.24   | 1.59         |



|   |         |                  |       |
|---|---------|------------------|-------|
| G | 信息技术业   | 342,528,335.42   | 5.30  |
| H | 批发和零售贸易 | 102,951,246.92   | 1.59  |
| I | 金融、保险业  | 74,246,382.36    | 1.15  |
| J | 房地产业    | 492,271,199.91   | 7.62  |
| K | 社会服务业   | 261,573,724.61   | 4.05  |
| L | 传播与文化产业 | 1,807,755.92     | 0.03  |
| M | 综合类     | -                | -     |
|   | 合计      | 5,475,143,322.75 | 84.78 |

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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  | 000423 | 东阿阿胶 | 8,159,239  | 350,439,315.05 | 5.43         |
| 2  | 600887 | 伊利股份 | 14,492,074 | 296,073,071.82 | 4.58         |
| 3  | 000895 | 双汇发展 | 2,961,256  | 207,139,857.20 | 3.21         |
| 4  | 600104 | 上海汽车 | 13,855,188 | 195,912,358.32 | 3.03         |
| 5  | 002063 | 远光软件 | 11,379,847 | 193,002,205.12 | 2.99         |
| 6  | 600256 | 广汇股份 | 8,519,606  | 175,333,491.48 | 2.71         |
| 7  | 600844 | 丹化科技 | 11,432,296 | 136,501,614.24 | 2.11         |
| 8  | 600585 | 海螺水泥 | 7,999,877  | 125,198,075.05 | 1.94         |
| 9  | 002069 | 獐子岛  | 5,061,046  | 124,299,289.76 | 1.92         |
| 10 | 600276 | 恒瑞医药 | 4,067,480  | 119,746,611.20 | 1.85         |
| 11 | 000581 | 威孚高科 | 3,271,994  | 117,431,864.66 | 1.82         |
| 12 | 000858 | 五粮液  | 3,460,131  | 113,492,296.80 | 1.76         |
| 13 | 000998 | 隆平高科 | 4,179,441  | 107,871,372.21 | 1.67         |
| 14 | 600387 | 海越股份 | 11,247,248 | 102,687,374.24 | 1.59         |
| 15 | 600535 | 天士力  | 2,223,736  | 93,263,487.84  | 1.44         |
| 16 | 000002 | 万科A  | 12,224,974 | 91,320,555.78  | 1.41         |
| 17 | 600048 | 保利地产 | 8,999,749  | 89,997,490.00  | 1.39         |
| 18 | 600199 | 金种子酒 | 5,795,919  | 86,359,193.10  | 1.34         |
| 19 | 600519 | 贵州茅台 | 444,458    | 85,913,731.40  | 1.33         |
| 20 | 000969 | 安泰科技 | 5,071,228  | 83,979,535.68  | 1.30         |
| 21 | 600875 | 东方电气 | 3,582,270  | 82,786,259.70  | 1.28         |
| 22 | 000538 | 云南白药 | 1,476,625  | 78,261,125.00  | 1.21         |
| 23 | 000799 | 酒鬼酒  | 3,293,336  | 77,426,329.36  | 1.20         |
| 24 | 600637 | 百视通  | 5,136,392  | 77,302,699.60  | 1.20         |
| 25 | 600085 | 同仁堂  | 5,501,483  | 77,185,806.49  | 1.20         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 26 | 600422 | 昆明制药 | 5,058,201 | 75,114,284.85 | 1.16 |
| 27 | 000869 | 张裕A  | 677,537   | 73,106,242.30 | 1.13 |
| 28 | 600312 | 平高电气 | 8,561,312 | 71,486,955.20 | 1.11 |
| 29 | 600702 | 沱牌舍得 | 4,204,064 | 69,913,584.32 | 1.08 |
| 30 | 601888 | 中国国旅 | 2,600,026 | 68,198,681.98 | 1.06 |
| 31 | 000826 | 桑德环境 | 2,654,536 | 66,894,307.20 | 1.04 |
| 32 | 002099 | 海翔药业 | 3,277,026 | 61,280,386.20 | 0.95 |
| 33 | 600406 | 国电南瑞 | 1,949,359 | 60,820,000.80 | 0.94 |
| 34 | 600809 | 山西汾酒 | 940,451   | 59,380,076.14 | 0.92 |
| 35 | 000876 | 新希望  | 3,537,523 | 59,253,510.25 | 0.92 |
| 36 | 600123 | 兰花科创 | 1,499,939 | 58,317,628.32 | 0.90 |
| 37 | 600893 | 航空动力 | 4,139,983 | 56,262,368.97 | 0.87 |
| 38 | 002297 | 博云新材 | 4,362,718 | 55,842,790.40 | 0.86 |
| 39 | 002025 | 航天电器 | 4,249,920 | 54,738,969.60 | 0.85 |
| 40 | 002603 | 以岭药业 | 1,248,165 | 47,917,054.35 | 0.74 |
| 41 | 002038 | 双鹭药业 | 1,389,154 | 45,633,708.90 | 0.71 |
| 42 | 600267 | 海正药业 | 1,371,708 | 43,579,163.16 | 0.67 |
| 43 | 000401 | 冀东水泥 | 2,599,939 | 43,340,983.13 | 0.67 |
| 44 | 600168 | 武汉控股 | 6,218,962 | 42,662,079.32 | 0.66 |
| 45 | 002007 | 华兰生物 | 1,669,037 | 41,742,615.37 | 0.65 |
| 46 | 601633 | 长城汽车 | 3,424,534 | 40,991,671.98 | 0.63 |
| 47 | 002029 | 七匹狼  | 1,156,030 | 40,807,859.00 | 0.63 |
| 48 | 002106 | 莱宝高科 | 2,299,859 | 38,545,636.84 | 0.60 |
| 49 | 600376 | 首开股份 | 3,999,900 | 38,359,041.00 | 0.59 |
| 50 | 002481 | 双塔食品 | 1,812,502 | 37,500,666.38 | 0.58 |
| 51 | 002231 | 奥维通信 | 3,080,936 | 36,355,044.80 | 0.56 |
| 52 | 000926 | 福星股份 | 4,936,708 | 34,951,892.64 | 0.54 |
| 53 | 600383 | 金地集团 | 7,019,987 | 34,748,935.65 | 0.54 |
| 54 | 601318 | 中国平安 | 999,934   | 34,437,726.96 | 0.53 |
| 55 | 002385 | 大北农  | 999,858   | 32,495,385.00 | 0.50 |
| 56 | 002086 | 东方海洋 | 2,490,991 | 32,382,883.00 | 0.50 |
| 57 | 002091 | 江苏国泰 | 2,499,617 | 31,695,143.56 | 0.49 |
| 58 | 601336 | 新华保险 | 1,087,420 | 30,306,395.40 | 0.47 |
| 59 | 002033 | 丽江旅游 | 1,560,463 | 30,272,982.20 | 0.47 |
| 60 | 002253 | 川大智胜 | 1,255,936 | 29,451,699.20 | 0.46 |
| 61 | 300099 | 尤洛卡  | 1,106,315 | 29,317,347.50 | 0.45 |
| 62 | 002327 | 富安娜  | 615,161   | 29,035,599.20 | 0.45 |
| 63 | 600993 | 马应龙  | 1,620,578 | 28,019,793.62 | 0.43 |
| 64 | 600801 | 华新水泥 | 2,199,980 | 28,005,745.40 | 0.43 |

|     |        |       |           |               |      |
|-----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| 65  | 600729 | 重庆百货  | 870,000   | 27,787,800.00 | 0.43 |
| 66  | 600298 | 安琪酵母  | 927,936   | 27,290,597.76 | 0.42 |
| 67  | 000598 | 兴蓉投资  | 3,000,000 | 24,810,000.00 | 0.38 |
| 68  | 600763 | 通策医疗  | 1,152,281 | 24,290,083.48 | 0.38 |
| 69  | 002313 | 日海通讯  | 539,491   | 21,849,385.50 | 0.34 |
| 70  | 600315 | 上海家化  | 579,022   | 19,738,859.98 | 0.31 |
| 71  | 000024 | 招商地产  | 999,999   | 17,999,982.00 | 0.28 |
| 72  | 600079 | 人福医药  | 925,762   | 17,839,433.74 | 0.28 |
| 73  | 002277 | 友阿股份  | 1,120,840 | 17,373,020.00 | 0.27 |
| 74  | 600600 | 青岛啤酒  | 499,984   | 16,739,464.32 | 0.26 |
| 75  | 000888 | 峨眉山 A | 889,156   | 16,298,229.48 | 0.25 |
| 76  | 601311 | 骆驼股份  | 836,618   | 15,368,672.66 | 0.24 |
| 77  | 002262 | 恩华药业  | 779,527   | 14,779,831.92 | 0.23 |
| 78  | 600467 | 好当家   | 1,549,890 | 14,320,983.60 | 0.22 |
| 79  | 601566 | 九牧王   | 649,806   | 13,912,346.46 | 0.22 |
| 80  | 000978 | 桂林旅游  | 1,692,717 | 13,355,537.13 | 0.21 |
| 81  | 600778 | 友好集团  | 1,073,558 | 10,392,041.44 | 0.16 |
| 82  | 300144 | 宋城股份  | 400,000   | 10,120,000.00 | 0.16 |
| 83  | 300039 | 上海凯宝  | 437,851   | 9,098,543.78  | 0.14 |
| 84  | 600533 | 栖霞建设  | 2,499,912 | 8,199,711.36  | 0.13 |
| 85  | 002186 | 全聚德   | 272,231   | 7,333,903.14  | 0.11 |
| 86  | 002390 | 信邦制药  | 400,000   | 4,156,000.00  | 0.06 |
| 87  | 601628 | 中国人寿  | 200,000   | 3,528,000.00  | 0.05 |
| 88  | 600016 | 民生银行  | 570,000   | 3,357,300.00  | 0.05 |
| 89  | 300026 | 红日药业  | 111,566   | 2,789,150.00  | 0.04 |
| 90  | 601009 | 南京银行  | 282,000   | 2,616,960.00  | 0.04 |
| 91  | 300024 | 机器人   | 139,982   | 2,481,880.86  | 0.04 |
| 92  | 600354 | 敦煌种业  | 99,942    | 2,091,786.06  | 0.03 |
| 93  | 000568 | 泸州老窖  | 53,154    | 1,982,644.20  | 0.03 |
| 94  | 002073 | 软控股份  | 123,448   | 1,867,768.24  | 0.03 |
| 95  | 601098 | 中南传媒  | 199,973   | 1,807,755.92  | 0.03 |
| 96  | 600177 | 雅戈尔   | 174,922   | 1,640,768.36  | 0.03 |
| 97  | 300006 | 莱美药业  | 85,990    | 1,487,627.00  | 0.02 |
| 98  | 600557 | 康缘药业  | 94,000    | 1,382,740.00  | 0.02 |
| 99  | 600683 | 京投银泰  | 290,000   | 1,360,100.00  | 0.02 |
| 100 | 601808 | 中海油服  | 91,750    | 1,329,457.50  | 0.02 |
| 101 | 002014 | 永新股份  | 92,000    | 1,324,800.00  | 0.02 |
| 102 | 600372 | 中航电子  | 52,429    | 1,270,878.96  | 0.02 |
| 103 | 601208 | 东材科技  | 66,600    | 1,257,408.00  | 0.02 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 104 | 600517 | 置信电气 | 83,921  | 1,234,477.91 | 0.02 |
| 105 | 002230 | 科大讯飞 | 30,000  | 1,050,000.00 | 0.02 |
| 106 | 300210 | 森远股份 | 35,950  | 991,501.00   | 0.02 |
| 107 | 600337 | 美克股份 | 107,000 | 923,410.00   | 0.01 |
| 108 | 600439 | 瑞贝卡  | 119,972 | 797,813.80   | 0.01 |
| 109 | 600549 | 厦门钨业 | 24,000  | 712,080.00   | 0.01 |
| 110 | 600038 | 哈飞股份 | 40,800  | 710,736.00   | 0.01 |

## 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 名的股票投资明细

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  | 600585 | 海螺水泥  | 406,408,658.30 | 4.45           |
| 2  | 000423 | 东阿阿胶  | 387,386,171.56 | 4.24           |
| 3  | 600887 | 伊利股份  | 334,064,495.41 | 3.66           |
| 4  | 600104 | 上海汽车  | 324,118,274.59 | 3.55           |
| 5  | 601101 | 昊华能源  | 266,327,212.29 | 2.92           |
| 6  | 600015 | 华夏银行  | 262,055,638.21 | 2.87           |
| 7  | 600123 | 兰花科创  | 249,976,505.01 | 2.74           |
| 8  | 600844 | 丹化科技  | 235,074,897.62 | 2.57           |
| 9  | 601166 | 兴业银行  | 228,155,144.39 | 2.50           |
| 10 | 000895 | 双汇发展  | 227,414,640.54 | 2.49           |
| 11 | 600256 | 广汇股份  | 219,645,722.45 | 2.41           |
| 12 | 600000 | 浦发银行  | 203,401,573.95 | 2.23           |
| 13 | 601169 | 北京银行  | 203,376,702.90 | 2.23           |
| 14 | 600362 | 江西铜业  | 200,143,351.42 | 2.19           |
| 15 | 600036 | 招商银行  | 197,529,146.83 | 2.16           |
| 16 | 601088 | 中国神华  | 174,932,047.29 | 1.92           |
| 17 | 000002 | 万科 A  | 171,955,732.24 | 1.88           |
| 18 | 600031 | 三一重工  | 156,824,274.34 | 1.72           |
| 19 | 000001 | 深发展 A | 152,732,851.01 | 1.67           |
| 20 | 000629 | 攀钢钒钛  | 152,204,337.59 | 1.67           |

注：不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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  | 601699 | 潞安环能  | 368,045,184.06 | 4.03           |
| 2  | 601101 | 昊华能源  | 332,068,557.73 | 3.64           |
| 3  | 600458 | 时代新材  | 290,779,769.00 | 3.18           |
| 4  | 000858 | 五 粮 液 | 288,224,429.78 | 3.16           |
| 5  | 600585 | 海螺水泥  | 264,066,787.82 | 2.89           |
| 6  | 600362 | 江西铜业  | 246,785,508.31 | 2.70           |
| 7  | 000423 | 东阿阿胶  | 242,625,261.09 | 2.66           |
| 8  | 600015 | 华夏银行  | 227,418,274.77 | 2.49           |
| 9  | 000969 | 安泰科技  | 215,278,500.24 | 2.36           |
| 10 | 601166 | 兴业银行  | 192,190,269.79 | 2.10           |
| 11 | 600000 | 浦发银行  | 187,260,531.36 | 2.05           |
| 12 | 600036 | 招商银行  | 179,985,895.69 | 1.97           |
| 13 | 600252 | 中恒集团  | 178,126,450.99 | 1.95           |
| 14 | 600261 | 阳光照明  | 174,733,528.79 | 1.91           |
| 15 | 601169 | 北京银行  | 165,218,181.91 | 1.81           |
| 16 | 600123 | 兰花科创  | 163,292,720.06 | 1.79           |
| 17 | 601088 | 中国神华  | 156,576,200.42 | 1.71           |
| 18 | 600707 | 彩虹股份  | 154,473,455.17 | 1.69           |
| 19 | 000039 | 中集集团  | 148,901,288.39 | 1.63           |
| 20 | 600031 | 三一重工  | 144,027,975.26 | 1.58           |

注：不考虑相关交易费用。

#### 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 | 14,150,628,198.87 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 14,648,364,309.23 |

注：不考虑相关交易费用。

#### 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      | 309,474,000.00 | 4.79         |
| 3  | 金融债券      | -              | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |

|   |         |                |      |
|---|---------|----------------|------|
| 4 | 企业债券    | 10,068,000.00  | 0.16 |
| 5 | 企业短期融资券 | -              | -    |
| 6 | 中期票据    | -              | -    |
| 7 | 可转债     | -              | -    |
| 8 | 其他      | -              | -    |
| 9 | 合计      | 319,542,000.00 | 4.95 |

## 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

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  | 1101024 | 11 央票 24      | 1,000,000 | 96,740,000.00 | 1.50         |
| 2  | 1101020 | 11 央票 20      | 1,000,000 | 96,740,000.00 | 1.50         |
| 3  | 1101088 | 11 央票 88      | 1,000,000 | 96,630,000.00 | 1.50         |
| 4  | 1101018 | 11 央行票据<br>18 | 200,000   | 19,364,000.00 | 0.30         |
| 5  | 1080082 | 10 杨浦投债<br>02 | 100,000   | 10,068,000.00 | 0.16         |

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 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。

## 8.9 投资组合报告附注

**8.9.1** 2011 年 5 月 28 日，宜宾五粮液股份有限公司（下称：五粮液，股票代码：000858）公告关于中国证监会《行政处罚决定书》。公告称，公司对有关事项进行了认真整改，整改取得明显实效，公司没有受到任何经济损失。公司按照整改方案中“切实解决关联交易”的承诺，已采取积极措施，使关联交易大幅减少。公司 2010 年的生产、销售同步大幅增长，利润大幅增加；2011 年的生产经营发展势头良好。

本基金投资于“五粮液”股票是基于深入的基本面分析及投资价值判断，投资决策流程合法合规，并符合公司投资管理制度的相关规定。同时，本基金管理人的投研团队对五粮液受处罚事件进行了及时评估和跟踪研究，并认为该事项对该公司股票的投资价值未产生实质性影响。

除前述事项外，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。

**8.9.2** 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。

### 8.9.3 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   | 2,921,828.36 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 5,750,684.88 |
| 5  | 应收申购款   | 47,643.39    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 8,720,156.63 |

### 8.9.4 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。

### 8.9.5 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情况。

### 8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：无。

## § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 569,540      | 22,120.36     | 3,250,257,347.40 | 25.80%     | 9,348,172,499.10 | 74.20%     |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目                   | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例 |
|----------------------|--------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 1,155,116.27 | 0.0092%  |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                  |                       |
|----------------------------------|-----------------------|
| 基金合同生效日（ 2005 年 4 月 27 日 ）基金份额总额 | 900, 519, 775. 77     |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 13, 029, 546, 398. 67 |
| 本报告期基金总申购份额                      | 1, 196, 972, 812. 46  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                    | 1, 628, 089, 364. 63  |
| 本报告期基金拆分变动份额                     | —                     |
| 本报告期期末基金份额总额                     | 12, 598, 429, 846. 50 |

## § 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

报告期内，基金管理人副总经理刘宏友因个人原因提出辞职，基金管理人董事会 2011 年第二次会议审议通过刘宏友辞去副总经理的申请，免去其副总经理职务；董事 Soo Kok Beng Peter (苏国明) 先生因即将退休，基金管理人的股东书面一致决定由李应如女士担任公司第三届董事会董事，Soo Kok Beng Peter (苏国明) 先生不再担任基金管理人的董事；总经理陈国杰因任期届满，基金管理人第三届董事会 2011 年第六次会议审议并通过，陈国杰先生不再担任公司总经理职务，任命韩勇先生为公司总经理，此任命经中国证券监督管理委员会证监许可文【2011】2086 号核准批复。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。有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理。因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理，刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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 160,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 7 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 |    |
| 申银万国 | 1      | 3,182,274,954.06 | 11.08%       | 2,704,924.17 | 11.26%     | -  |
| 齐鲁证券 | 2      | 3,120,251,071.40 | 10.87%       | 2,652,205.69 | 11.04%     | -  |
| 光大证券 | 1      | 2,527,936,568.15 | 8.81%        | 2,053,964.27 | 8.55%      | -  |
| 长江证券 | 1      | 2,480,480,809.76 | 8.64%        | 2,108,398.37 | 8.77%      | -  |
| 兴业证券 | 1      | 2,452,199,908.21 | 8.54%        | 1,992,431.00 | 8.29%      | -  |
| 国泰君安 | 1      | 1,817,683,704.17 | 6.33%        | 1,545,027.62 | 6.43%      | -  |
| 广发证券 | 1      | 1,813,724,064.00 | 6.32%        | 1,541,658.71 | 6.42%      | -  |
| 中金公司 | 2      | 1,710,870,514.10 | 5.96%        | 1,417,204.72 | 5.90%      | -  |
| 中信建投 | 3      | 1,367,849,864.98 | 4.76%        | 1,136,130.84 | 4.73%      | -  |
| 中银国际 | 1      | 1,270,811,504.17 | 4.43%        | 1,080,187.94 | 4.49%      | -  |
| 国信证券 | 2      | 1,190,690,102.08 | 4.15%        | 1,012,083.73 | 4.21%      | -  |
| 华泰证券 | 2      | 1,125,535,067.88 | 3.92%        | 924,409.97   | 3.85%      | -  |
| 北京高华 | 1      | 1,051,028,377.60 | 3.66%        | 893,367.54   | 3.72%      | -  |

|      |   |                |       |            |       |   |
|------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 中信证券 | 1 | 911,557,697.30 | 3.18% | 740,646.98 | 3.08% | - |
| 中投证券 | 1 | 812,029,429.65 | 2.83% | 659,778.96 | 2.75% | - |
| 华泰联合 | 2 | 784,087,111.11 | 2.73% | 666,471.62 | 2.77% | - |
| 东方证券 | 1 | 655,753,881.64 | 2.28% | 532,804.34 | 2.22% | - |
| 国金证券 | 1 | 340,434,206.20 | 1.19% | 289,367.86 | 1.20% | - |
| 安信证券 | 1 | 94,175,929.20  | 0.33% | 80,047.70  | 0.33% | - |
| 方正证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 财富证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 西部证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 银河证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 西南证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 渤海证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 招商证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |

### 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 |
| 申银万国 | 30,511,746.30 | 53.30%       | -      | -              | -    | -            |
| 齐鲁证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 光大证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长江证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 兴业证券 | 430,039.45    | 0.75%        | -      | -              | -    | -            |
| 国泰君安 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 广发证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中金公司 | 6,392,774.00  | 11.17%       | -      | -              | -    | -            |
| 中信建投 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中银国际 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国信证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华泰证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 北京高华 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中投证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华泰联合 | 6,111,380.10  | 10.68%       | -      | -              | -    | -            |

|      |               |        |   |   |   |   |
|------|---------------|--------|---|---|---|---|
| 东方证券 | 13,799,527.15 | 24.11% | - | - | - | - |
| 国金证券 | -             | -      | - | - | - | - |
| 安信证券 | -             | -      | - | - | - | - |
| 方正证券 | -             | -      | - | - | - | - |
| 财富证券 | -             | -      | - | - | - | - |
| 西部证券 | -             | -      | - | - | - | - |
| 银河证券 | -             | -      | - | - | - | - |
| 西南证券 | -             | -      | - | - | - | - |
| 渤海证券 | -             | -      | - | - | - | - |
| 招商证券 | -             | -      | - | - | - | - |

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。

3、本报告期内，基金管理人代表基金未新增租用专用交易单元。

## 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                         | 法定披露方式           | 法定披露日期           |
|----|------------------------------|------------------|------------------|
| 1  | 华泰柏瑞基金管理有限公司继续参加华夏银行网上银行基金申购 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 12 月 31 日 |

|    |                                                       |                  |                  |
|----|-------------------------------------------------------|------------------|------------------|
|    | 费率和基金定投申购费率优惠活动的公告                                    |                  |                  |
| 2  | 华泰柏瑞基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 12 月 28 日 |
| 3  | 华泰柏瑞基金管理有限公司继续参加深圳发展银行基金网上、电话银行日常申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 12 月 28 日 |
| 4  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更直销银行账户信息的公告                           | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 12 月 9 日  |
| 5  | 华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金 2011 年第 3 季度报告                      | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 10 月 24 日 |
| 6  | 华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金参加华宝证券费率优惠活动的公告                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 9 月 21 日  |
| 7  | 华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金 2011 年半年度报告                         | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 8 月 24 日  |
| 8  | 华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金 2011 年半年度报告摘要                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 8 月 24 日  |
| 9  | 华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金 2011 年第 2 季度报告                      | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 7 月 20 日  |
| 10 | 华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金参加浙商证券网上交易、电话委托等基金申购费率优惠活动的公告       | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 6 月 30 日  |
| 11 | 华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告        | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 6 月 29 日  |

|    |                                                                                                   |                  |                 |
|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-----------------|
| 12 | 华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金更新的招募说明书(摘要)<br>2011 年第 1 号                                                      | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 6 月 9 日  |
| 13 | 华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金更新的招募说明书 2011 年第 1 号                                                             | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 6 月 9 日  |
| 14 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告                                                         | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 6 月 8 日  |
| 15 | 华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金增加中信证券股份有限公司及天相投资顾问有限公司为定期定额申购业务办理机构的公告                                         | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 5 月 28 日 |
| 16 | 华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金 2011 年第 1 季度报告                                                                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 4 月 25 日 |
| 17 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于网上直销平台开通汇付天下“天天盈”模式的公告                                                              | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 4 月 18 日 |
| 18 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加中信证券股份有限公司为华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金、华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金代销机构及华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金转换业务办理机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 4 月 9 日  |
| 19 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加“华夏银行·盈基金 2011”网上银行基金申购最低 4 折优惠                                                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 4 月 1 日  |

|    |                                         |                  |                 |
|----|-----------------------------------------|------------------|-----------------|
|    | 活动的公告                                   |                  |                 |
| 20 | 华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金 2010 年年度报告摘要          | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 3 月 30 日 |
| 21 | 华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金 2010 年年度报告            | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 3 月 30 日 |
| 22 | 华泰柏瑞基金管理有限公司参加海通证券股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 2 月 23 日 |
| 23 | 华泰柏瑞基金管理有限公司高级管理人员离任公告                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 2 月 12 日 |
| 24 | 华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金 2010 年第 4 季度报告        | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 1 月 22 日 |
| 25 | 华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理增聘公告                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 1 月 21 日 |
| 26 | 华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理增聘公告                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 1 月 21 日 |
| 27 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于董事变更的公告                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2011 年 1 月 15 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### **13.2 存放地点**

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

### **13.3 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司  
2012 年 3 月 30 日