

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  
送出报告日期:2014年3月26日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员在履行职责时,不得损害基金份额持有人的利益。基金管理人、基金托管人及其工作人员不得利用职务之便,谋取不正当利益,损害基金份额持有人的利益。基金管理人、基金托管人及其工作人员不得泄露因任职期间知悉的基金投资、运作等有关信息,不得利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用其名下的资产,但不保证基金一定盈利。

基金年度报告经审计的,评价报告应当披露审计报告结论,并附载于报告中。基金年度报告应当披露基金组合报告等信息,对基金份额净值进行复核,并由基金托管人出具书面报告。

本年度报告摘要节选自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

本报告期自2013年8月2日起至2013年12月31日止。

## § 2 基金简介

|                            |
|----------------------------|
| 2.1 基金基本情况                 |
| 基金名称 华泰柏瑞量化增强股票            |
| 基金代码 000172                |
| 基金运作方式 约定期开放式              |
| 基金合同生效日 2013年8月2日          |
| 基金管理人 华泰柏瑞基金管理有限公司         |
| 基金托管人 中国银行股份有限公司           |
| 报告期末基金份额总额 231,382,764.42份 |
| 基金净值 0.9974                |
| 基金存续期间 不定期                 |

|   |
|---|
| 2.2 基金产品说明  |
| 本基金为量化股票型基金,在力求有效控制投资风险的前提下,力争超越业绩比较基准的收益,追求基金份额长期增值。   |
| 本基金将力争对基金份额净值增长率的贡献度在8%以上。  |
| 本基金的股票投资比例不低于基金资产的80%,并保持不低于总资产的5%的现金或现金等价物(或到期日在一年以内的政府债券)。本基金投资于债券的比例不超过基金资产的20%。本基金投资于权证、股指期货、国债期货等金融衍生工具的比例不得超过基金资产净值的10%。本基金投资于股票型基金、债券型基金、货币市场基金的比例不得超过基金资产净值的5%。 |
| 本基金在2014年8月2日至2013年12月31日的主要风险点,并坚持一贯的利用基本面信息选股的策略,力求继续获得超越业绩比较基准的超额收益。   |

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年的股票市场在年中出现两次较大的调整,上证综指在高位一度调整到年内低点附近,我们仍认为股票市场的调整是合理的,股票市场的估值水平在一定程度上反映了经济基本面的实际情况。

本基金将根据对宏观经济、证券市场及行业走势的判断,利用风险控制和消除、防范产业链的波幅,信用风险的抑制和消除、防范产业链的波幅,一些传统行业产能过剩持续,以及股票市场的个别板块估值的调整等等,这些因素的影响,股票市场的估值可能具有阶段性波动,但总体市场较长的持续的趋势,基本上反映了市场对这些风险的预期,风暴的肆虐和放任之下伴随着随着底部的形成和新的上涨机会。

另外,在经济复苏和结构调整的过程中,总有受益的行业和公司,股票表现的分化会较大,这给基本面选股提供了良好的机会。

本基金在2014年8月2日至2013年12月31日的主要风险点,并坚持一贯的利用基本面信息选股的策略,力求继续获得超越业绩比较基准的超额收益。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年底,本基金管理人在基本面持稳的情况下,利用风险管理的独立性、公平性和合规操作。

本基金在2014年8月2日至2013年12月31日的主要风险点,并坚持一贯的利用基本面信息选股的策略,力求继续获得超越业绩比较基准的超额收益。

4.7 基金管理人内部监察稽核工作情况

(1)健全开展基金运作合规稽核工作,确保基金投资决策的独立性、公平性和合规操作。

本基金在2014年8月2日至2013年12月31日的主要风险点,并坚持一贯的利用基本面信息选股的策略,力求继续获得超越业绩比较基准的超额收益。

(2)健全定期和临时监察稽核工作,确保各项制度的合规操作。

本基金在2014年8月2日至2013年12月31日的主要风险点,并坚持一贯的利用基本面信息选股的策略,力求继续获得超越业绩比较基准的超额收益。

(3)健全公司各项内部控制制度的完善

本基金在2014年8月2日至2013年12月31日的主要风险点,并坚持一贯的利用基本面信息选股的策略,力求继续获得超越业绩比较基准的超额收益。

(4)健全公司监察稽核部,并坚持对公司的员工进行入职培训,对全体人员开展行为规范培训,对基金经理管理人员进行专项技能培训,对员工进行反洗钱培训等及时发出合规提示函,要求相关部门根据整改意见,针对问题进行排查,促进各项工作后续顺利检查,确保各方面开展合作。

(5)健全公司监察稽核部,并坚持对公司的员工进行入职培训,对全体员工开展行为规范培训,对基金经理管理人员进行专项技能培训,对员工进行反洗钱培训等及时发出合规提示函,要求相关部门根据整改意见,针对问题进行排查,促进各方面开展合作。

(6)健全公司监察稽核部,并坚持对公司的员工进行入职培训,对全体员工开展行为规范培训,对基金经理管理人员进行专项技能培训,对员工进行反洗钱培训等及时发出合规提示函,要求相关部门根据整改意见,针对问题进行排查,促进各方面开展合作。

(7)健全公司监察稽核部,并坚持对公司的员工进行入职培训,对全体员工开展行为规范培训,对基金经理管理人员进行专项技能培训,对员工进行反洗钱培训等及时发出合规提示函,要求相关部门根据整改意见,针对问题进行排查,促进各方面开展合作。

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,本基金管理人将继续加强合规管理,完善内部控制制度和运作机制,不损害基金份额持有人的利益,努力防范各种风险,为基金份额持有人谋取最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金运作合规情况的说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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尽职义务。

4.8 管理人对报告期内基金投资运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内,基金管理人严格遵守《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规定,对本基金的投资运作进行了必要的监督,对基金经理持有的基金份额净值的计算以及基金费用的支取等方面进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.9 管理人对报告期内基金投资组合偏离度的说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合偏离度的计算以及基金费用的支取等方面进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.10 管理人对报告期内基金投资组合的跟踪情况的说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的跟踪情况进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.11 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险的说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.12 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.13 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.14 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.15 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.16 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.17 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.18 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.19 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.20 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.21 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.22 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.23 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.24 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.25 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.26 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.27 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.28 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.29 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.30 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.31 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.32 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.33 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.34 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.35 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.36 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.37 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.38 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.39 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.40 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.41 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.42 管理人对报告期内基金投资组合的流动性风险管理的专项说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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,对本基金的投资组合的流动性风险管理进行了认真复核,未发现本基金基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。