基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2014年3月26日

华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金

【2013】年度报告摘要

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞行业领先股票
基金主代码	460007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年8月3日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,100,352,026.86份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过采取自上而下和自下而上相结合和方法,从定量和定性的角度把握不同时期所蕴含的行业和个股投资机会,在充分控制风险的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	大类资产配置不作为本基金的核心策略。考虑到中国大陆A股市场现阶段仍存在较大的系统性风险,本基金将仅在股票资产整体出现较大程度高估或低估时进行适度的大类资产配置调整,一般情况下本基金将保持大类资产配置的基本稳定。本基金在股票投资中注重自上而下的行业配置,即以行业估值为基础,以行业基本面趋势变化为契机,结合国家产业政策的导向,在不同备选之间合理配置基金资产。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×15%+同业存款利率×5%
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	赵会军
	联系电话	021-38601777	010-66105799
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	010-66105798

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	145,064,246.84	-128,063,500.01	-331,040,470.93
本期利润	186,274,981.67	47,508,316.35	-602,293,119.57
加权平均基金份额本期利润	0.1770	0.0388	-0.2998
本期基金份额净值增长率	25.92%	6.39%	-31.77%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2977	-0.4368	-0.3585
期末基金资产净值	945,924,353.00	753,985,231.05	1,246,011,603.73
期末基金份额净值	0.860	0.683	0.642

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不定期。

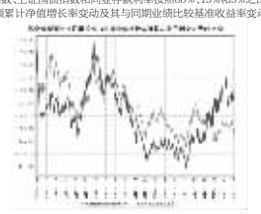
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.33%	1.52%	-2.47%	0.90%	-4.86%	0.62%
过去六个月	16.69%	1.73%	5.03%	1.03%	11.66%	0.70%
过去一年	25.92%	1.66%	-5.39%	1.11%	31.31%	0.55%
过去三年	-8.61%	1.40%	-18.89%	1.06%	10.28%	0.34%
基金合同生效日至今	-14.00%	1.43%	-26.97%	1.19%	12.97%	0.24%

注:本基金的业绩基准由沪深300指数、上证国债指数和同业存款利率按照80%、15%和5%之比构建,并每日进行再平衡。

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

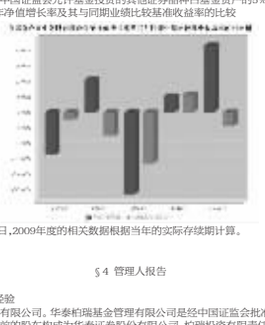


注:

1、图示日期为2009年8月3日至2013年12月31日。

2、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十一条(二)投资范围、(八)2.2、基金投资组合比例限制中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金资产的60%-95%,债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注:基金合同生效日为2009年8月3日,2009年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

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、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金和华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金。截至2013年12月31日,公司基金管理规模为363.09亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吕慧建	本基金基金经理	2009年11月18日	-	15年	吕慧建先生,硕士学位,先后在深圳发展银行、中信集团中大投资管理有限责任公司、中信基金管理有限公司工作,2007年6月加入我公司,担任高级研究员,2007年11月起任基金经理助理,自2009年11月起担任本基金的基金经理。

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定,在严格控制风险的基础上,忠实履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内,本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,建立了科学完善的公平交易管理制度,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核,对于场内交易启用投资管理系统中的公平交易模块;对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对投售内的交易进行日常监控和分析评估,同时对投资组合的交易价差在不同时间窗(如日内、3日、5日)下进行分析,综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能,确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离,实行集中交易制度,由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务,为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况,不同业务类别的投资经理之间互不干扰,独立做出投资决策。公司机构投资合理,公平交易的相关管理制度健全,投资决策流程完善,各项制度执行情况良好。 交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待,不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现,报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平,只在少数情况下“存在显著的倾向性”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究表明,交易价差方向没有规律性,即没有明确的利益输送方向。造成少量显著交易价差的原因来自两方面:一是报告期内股票市场的波动幅度较大,为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件;二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异,对证券买卖时点的把握也不同,导致股票买卖存在价差。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人制定了《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理,该制度规定投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查,交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制,风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内,该制度执行情况良好,无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中,均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年中国经济整体保持稳定运行,GDP增速达到7.7%。但是,在这个过程中,地方债、房价泡沫、QE退出等因素均对市场情绪形成压制,担心中国经济失速下滑者不乏其人。

2013年是中国新一届国家领导人展示执政理念和政策导向的第一年。新一届政府政策导向明确,提高经济增速下行的容忍度,激活体制活力,推动经济结构调整,治理环境污染的力度不断加大。但在过去的一年中,市场对于政策导向的预期有很大的波动,6月底引发短期利率大幅上涨和A股市场下跌,而三季度自贸区、沪港深准政策发布则引发了相关板块大幅上涨。

所以,总的来说,2013年的经济基本面、政策面基本稳定,美国稳步复苏,欧洲底部企稳,而日本则在推行大幅度经济刺激政策,中国经济在固定资产投资、消费、出口等方面相对稳定,而增速有一定幅度下滑。

2013年的A股走势波幅较大,分化严重。上证指数在年初延续12年底的大幅上涨走势,在2月初2444点创出年内高点后,随后下跌,在6月底创出2009年以来的新低1849点,下半年呈区间震荡走势,全年下跌6.7%。但是,创业板全年呈震荡上行走势,年度涨幅达到83.7%。全年来看,传媒、食品等行业都有很好的上涨,题材股走势活跃,走出了结构性牛市行情。

本基金在2013年整体上保持了投资策略的稳定性,重点寻找结构性行情机会,在传媒、电子元器件、医药、食品等板块重点配置,取得了较好的投资绩效,基金净值增长25.92%。

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0.860元,本报告期份额净值增长率为25.92%,同期业绩比较基准增长率为-5.39%。

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2014年,我们的对宏观经济环境的判断和2013年相近。2014年的国际经济环境较13年可能有所改善,另一方面,政策导向上,14年致力于结构调整的力度进一步加大,经济增速可能会进一步放缓,宏观经济整体上亮点有限。

我们仍然认为,中国是一个大国经济,地域广阔、经济结构丰富,在经济整体增速放缓的同时,结构性增长仍将持续。在上市公司层面,消费板块盈利增长稳定,创新活动持续活跃,一些公司继续保持良好的盈利增长。

我们仍然认为A股市场会延续分化走势,其根本原因在于行业盈利分化的基本格局没有改变。努力抓住结构性行情机会仍然是2014年的主要策略方向。

但是,和2013年相比,2014年的A股投资存在更大的挑战和风险。经济增速下行,中国经济崩溃的担心可能再次引发,导致市场短期波动;目前A股市场银行等传统产业和TMT为代表的新兴产业、消费品行业估值撕裂严重,市场风格转换的市场预期可能反复出现,引发市场波动;创业板为代表的部分成长股、医药为代表的消费股经过2013年的大幅上涨,估值处在较高水平,如果盈利增幅不大预期,股价修正的压力同样存在。

2014年,个股挖掘是我们主要的投资策略。就全年策略角度看,消费品板块仍然是主要的配置方向,而对于成长股的投资,需要进一步跟踪行业和上市公司经营情况,密切关注创新方向,提高风险意识,提高操作策略的灵活性。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2013年度,本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时,始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求,继续致力于内控机制的完善,加强内部风险的控制与防范,确保各项法规和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序,通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法,独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核,发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改,同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内,基金管理人内部监察稽核主要工作如下:

(1)全面开展基金运作合规监察工作,确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有:严格执行集中交易制度,各基金相互独立,交易指令由中央交易室统一执行完成;对基金投资交易系统进行事先合规性设置,并由风险控制部门进行实时监控,杜绝出现违规行为;严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序;通过以上措施,保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程,保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定,确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2)开展定期和专项监察稽核工作,确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱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4次;每次分配比例不低于基金期末可分配利润的10%;基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。报告期内基金未实施收益分配。截至本报告期末,本基金可分配收益为负。

§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,本基金托管人在对华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金2013年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

普华永道会计师事务所对本基金的年度报告出具了“无保留意见的审计报告”(普华永道中天审字(2014)第20581号),投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		53,942,315.37	46,657,444.26
结算备付金		1,911,434.37	1,867,488.42
存出保证金		324,130.66	1,136,910.72
交易性金融资产		887,917,330.56	708,034,523.79
其中:股票投资		887,917,330.56	708,034,523.79
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资			
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		5,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		13,872.82	11,737.27
应收股利		-	-
应收申购款		150,350.66	79,173.82
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		949,259,434.44	757,787,278.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		882,576.79	544,337.31
应付管理人报酬		1,192,898.69	877,416.90
应付托管费		198,816.45	146,236.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		482,711.64	650,589.69
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		578,077.87	1,583,467.19
负债合计		3,335,081.44	3,802,047.23
所有者权益:			
实收基金		1,100,352,026.86	1,104,533,606.38
未分配利润		-154,427,673.86	-350,548,375.33
所有者权益合计		945,924,353.00	753,985,231.05
负债和所有者权益总计		949,259,434.44	757,787,278.28

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.860,基金份额总额1,100,352,026.86份。

7.2 利润表

会计主体:华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		207,571,694.84	67,403,848.09
1.利息收入		440,875.29	1,237,243.80
其中:存款利息收入		420,636.83	628,578.16
债券利息收入		1,392.29	545,045.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		18,846.17	63,620.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		165,835,165.46	-109,763,648.42
其中:股票投资收益		159,762,236.19	-120,028,873.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益		201,197.71	928,317.65
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益			
衍生工具收益		-	-
股利收益		5,871,731.56	9,336,907.85
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		41,210,734.83	175,571,816.36
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		84,919.26	358,436.35
减:二、费用		21,296,713.17	19,895,531.74
1.管理人报酬		12,240,171.30	12,011,261.95
2.托管费		2,040,028.56	2,001,876.97
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		6,618,761.80	5,477,071.19
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		397,751.51	405,321.63
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		186,274,981.67	47,508,316.35
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		186,274,981.67	47,508,316.35

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,104,533,606.38	-350,548,375.33	753,985,231.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	186,274,981.67	186,274,981.67
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)	-4,181,579.52	9,845,719.80	5,664,140.28
其中:1.基金申购款	221,991,774.48	-34,180,811.69	187,810,962.79
2.基金赎回款	-226,173,354.00	44,026,531.49	-182,146,822.51
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)	1,100,352,026.86	-154,427,673.86	945,924,353.00
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,942,291,887.82	-696,280,284.09	1,246,011,603.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	47,508,316.35	47,508,316.35
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)	-837,758,281.44	298,223,592.41	-539,534,689.03
其中:1.基金申购款	7,377,438.28	-2,620,521.09	4,756,917.19
2.基金赎回款	-845,135,719.72	300,844,113.50	-544,291,606.22
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)	1,104,533,606.38	-350,548,375.33	753,985,231.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

_____韩勇_____ _____房伟力_____ _____陈培_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金(原名为友邦华泰行业领先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”)证监许可[2009]482号《关于核准友邦华泰行业领先股票型证券投资基金募集的批复》核准,由友邦华泰基金管理有限公司(现更名为华泰柏瑞基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同》(现更名为《华泰柏瑞行业领先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2,249,392,302.39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(2009)第132号验资报告。经向中国证监会备案,《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同》于2009年8月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,249,632,307.10份基金份额,其中认购资金利息折合240,004.71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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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“友邦华泰行业领先股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金”,基金简称为“华泰柏瑞行业领先股票”,基金代码保持不变。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞行业领先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发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资的比例范围为基金资产的60%-95%;债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%。其中,现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300 指数X80%+上证国债指数X15%+同业存款利率X5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2014年3月26日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金出售股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金直销机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
柏瑞投资有限责任公司	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	366,330,379.96	8.35%	319,790,683.52	9.17%

7.4.7.1.2 权证交易

注:无。

7.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券股份有限公司	328,223.37	8.37%	14,785.27	3.06%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
华泰证券股份有限公司	282,669.42	9.50%	205,312.57	31.56%

注:1. 上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 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等。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,240,171.30	12,011,261.95
其中:支付销售机构的客户维护费	3,792,949.95	3,576,639.26

注:支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,040,028.56	2,001,876.97

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.7.2.3 销售服务费

注:无。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	53,413,496.99	-	-	-	-

注:2013年无发生额。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:无。

7.4.7.4.2 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:本报告期内,除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.7.5 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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	53,942,315.37	381,597.52	46,657,444.26	603,734.93

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况注:无。

7.4.7.7 其他关联