

# 汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券 投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。本半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 8 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现</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
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	49
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	49
7.8 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.....	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>51</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	51
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
10.2 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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>57</b>
11.1 备查文件目录 .....	57
11.2 存放地点 .....	58
11.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金
基金简称	汇添富沪深 300 安中指数
基金主代码	000368
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 6 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
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	166,750,579.81 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪沪深 300 安中动态策略指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。
投资策略	主要采取完全复制法。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	沪深 300 安中动态策略指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型指数基金，在证券投资基金中属于较高预期风险、较高预期收益的品种，本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 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		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	赵会军
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200120	100140
法定代表人	林利军	姜建清

## 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》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层汇添富基金管理股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-7,153,195.67
本期利润	-9,451,613.70
加权平均基金份额本期利润	-0.0599
本期加权平均净值利润率	-6.63%
本期基金份额净值增长率	-6.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-16,852,889.50
期末可供分配基金份额利润	-0.1011
期末基金资产净值	149,897,690.31
期末基金份额净值	0.8989
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-10.11%

注：1、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。

2、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(例如：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

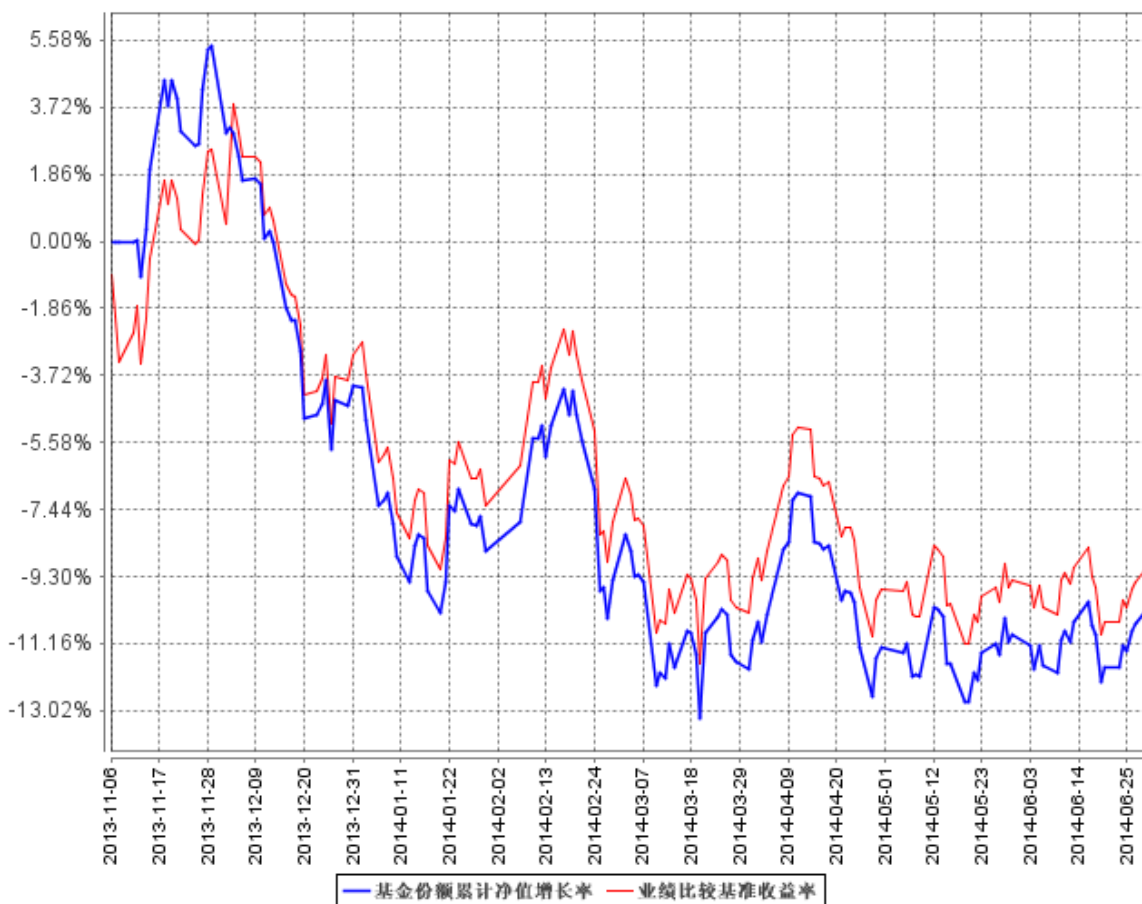
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.91%	0.64%	0.51%	0.64%	0.40%	0.00%
过去三个月	1.96%	0.82%	1.49%	0.82%	0.47%	0.00%
过去六个月	-6.35%	1.00%	-6.02%	1.01%	-0.33%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今	-10.11%	1.00%	-8.95%	1.04%	-1.16%	-0.04%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 11 月 06 日，至本报告期末未满 1 年。

#### 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：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 11 月 6 日，截至本报告期末，基金成立未满 1 年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013 年 11 月 6 日）起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立，注册资本为 1 亿元人民币。截止到 2014 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 981.54 亿元，有效客户数约 290 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 47 只开放式证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长股票型证券投资基金、汇添富成长焦点股票型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富香港优势股票型证券投资基金、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富理财 28 天债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金、汇添富消费行业股票型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽 30 股票型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富互利分级债券型证券投资基金、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富新收益债券型证券投资基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金。



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		
吴振翔	汇添富上证综合指数、汇添富中证主要消费 ETF、汇添富中证医药卫生 ETF、汇添富中证能源 ETF、汇添富中证金融地产 ETF、汇添富沪深 300 安中指数基金的基金经理，金融工程部总监助理。	2013 年 11 月 6 日	-	8 年	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师，现任金融工程部总监助理。2010 年 1 月 8 日至 2010 年 2 月 4 日任汇添富上

				<p>证综合指数基金的基金经理助理，2010 年 2 月 5 日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富中证 300ETF 基金的基金经理，2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富中证 300ETF 基金联接基金的基金经理，2013 年 8 月 23 日至今任中证主要消费 ETF 基金、中证医药卫生 ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金的基金经理，2013 年 11 月 6 日至今任汇添</p>
--	--	--	--	---

					富 沪 深 300 安 中 指 数 基 金 的 基 金 经 理。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 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

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合，交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了同日反向交易控制的规则，同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组

合同间的同向交易分析。本报告期内基金管理人管理的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总成交量 5%的交易次数为 4 次，其中 3 次是由于对冲专户采取指数化策略投资导致，1 次是由于投资流动性的需求导致。经检查和分析未发现异常情况。

#### 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

回顾上半年，市场在经济复苏并不明朗的担忧下震荡整理，近几个月以来的波动幅度已经趋于历史最低水平。经济基本上，二季度多地方已出现房地产行业景气下滑的相关印证，而地方政府也对此情况表现较为紧张。若作为经济增长支柱之一的房地产行业出现大规模衰退，经济增长的目标恐难达成。而决策层显然也将此种担忧考虑在内，在二季度出台了一系列“微刺激”政策。在政策面的维稳之下，相关经济指标有所好转，市场也在近期迎来了一波反弹，修复了一部分市场情绪。资金面上，二季度货币政策和信贷条件仍相对宽松，但 IPO 重启对流动性仍有较大的影响。整体来看，上半年市场表现窄幅震荡先抑后扬。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位报告期内基本保持在 92%~95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内安中沪深 300 指数基准下跌-6.02%，本基金在报告期内累计收益率为-6.35%，收益率落后业绩比较基准 0.33%。收益率的差异因素主要来源于期间成份股分红、日常申购赎回等因素。本基金日均跟踪误差为 0.0282%，这一跟踪误差水平远低于合同约定上限，在报告期达到了投资目标。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济增速下滑依然是决策层的主要矛盾，在房地产活动持续下行的压力下，“微刺激”政策的继续拓展是可以期待的。而流动性方面的定向宽松也为市场的短期底部提供了支撑。综合来看，在多空双向的基本面因素作用下，第三季度的市场或将在近期反弹的基础上再做文章，而近期市场情绪逐渐回暖也为反弹的延续提供了基础。从外围市场的角度来看，美欧市场的情况甚为乐观：近期就业数据确认了美国经济的全面复苏，欧洲的宽松政策也将推升市场走势。在外部市场的乐观情绪影响下，只要经济基本面继续向好，A 股市场投资价值的改善将是可期待的。

目前市场整体估值较低，已经反应了较为悲观的预期，机构对周期性板块的配置比例很低，继续下跌的空间小。随着近期基本面的改善及市场情绪的好转，权益类资产的配置价值将逐渐提

高。安中动态指数成份股源于沪深 300，较有可能受益于蓝筹股的估值修复行情，同时，动态调整的指数编制方法也有可能帮助投资者更好地参与主题性的投资机会。

作为被动投资的指数型基金，汇添富沪深 300 安中动态策略指数基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的指数化投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。我们非常期望汇添富沪深 300 安中动态策略指数基金能继续与投资者一起分享中国经济的美好未来。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《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》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富沪深 300 安中动态策略指数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，汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富沪深 300 安中动态策略指数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，汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金 2014 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	9,058,414.98	6,370,056.42
结算备付金		203,789.50	609,104.02
存出保证金		75,919.03	46,244.37
交易性金融资产	6.4.7.2	139,780,445.37	117,827,319.12
其中：股票投资		139,780,445.37	117,827,319.12
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	5,234,031.43
应收利息	6.4.7.5	1,714.69	1,653.43
应收股利		-	-
应收申购款		1,319,409.84	57,929.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		150,439,693.41	130,146,337.82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年6月30日</b>	<b>上年度末 2013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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,696,577.86
应付赎回款		36,625.80	1,101.72
应付管理人报酬		60,348.87	50,515.17
应付托管费		12,069.80	10,103.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	172,056.26	81,457.16
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	260,902.37	50,438.93
负债合计		542,003.10	2,890,193.89
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	166,750,579.81	132,588,165.36
未分配利润	6.4.7.10	-16,852,889.50	-5,332,021.43
所有者权益合计		149,897,690.31	127,256,143.93
负债和所有者权益总计		150,439,693.41	130,146,337.82

注：1、报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8989 元，基金份额总额 166,750,579.81 份。

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-8,189,826.24
1.利息收入		36,034.80
其中：存款利息收入	6.4.7.11	36,034.80
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-5,931,177.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-7,612,910.66
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,681,733.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,298,418.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,734.04
<b>减：二、费用</b>		1,261,787.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	351,646.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	70,329.30
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	578,514.94
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	261,296.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-9,451,613.70

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、本基金合同于 2013 年 11 月 6 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示本期数据，特此说明。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元



项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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）	132,588,165.36	-5,332,021.43	127,256,143.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,451,613.70	-9,451,613.70
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）	34,162,414.45	-2,069,254.37	32,093,160.08
其中：1.基金申购款	37,445,173.80	-2,365,047.61	35,080,126.19
2.基金赎回款	-3,282,759.35	295,793.24	-2,986,966.11
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）	166,750,579.81	-16,852,889.50	149,897,690.31

注：本基金于 2013 年 11 月 6 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益（基金净值）变动表只列示本期数据，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>林利军</u>	<u>陈灿辉</u>	<u>王小练</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2013]1209 号文《关于核准汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的批复》的核准，由汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）作为发起人于 2013 年 10 月 18 日至 2013 年 11 月 4 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2013）验字第 60466941\_B49 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 11 月 6 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 274,987,595.90 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 7,149.29 元，以上实收基

金（本息）合计为人民币 274,994,745.19 元，折合 274,994,745.19 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资于沪深 300 安中动态策略指数的成份股的组合比例不低于基金资产的 90%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪沪深 300 安中动态策略指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。本基金的业绩比较基准是沪深 300 安中动态策略指数收益率 $\times$ 95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后） $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和债券投资；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入

方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

##### 1) 股票投资

###### (1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

###### (2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

###### C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

##### 2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日

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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的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，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

### 3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

### 4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

### 5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入

账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；



- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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；

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	9,058,414.98
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,058,414.98

注：本基金本期末未投资于定期存款。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	146,962,147.33	139,780,445.37	-7,181,701.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	-	-	-
交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	146,962,147.33	139,780,445.37	-7,181,701.96

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	1,601.38
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	82.53
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	30.78
合计	1,714.69

注：“其他”指应收结算保证金利息。

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
----	-------------------

交易所市场应付交易费用	172,056.26
银行间市场应付交易费用	-
合计	172,056.26

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	234.16
预提费用	203,315.49
指数使用费	57,352.72
合计	260,902.37

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	132,588,165.36	132,588,165.36
本期申购	37,445,173.80	37,445,173.80
本期赎回(以“-”号填列)	-3,282,759.35	-3,282,759.35
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	166,750,579.81	166,750,579.81

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

#### 6.4.7.10 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	4,024,482.38	-9,356,503.81	-5,332,021.43
本期利润	-7,153,195.67	-2,298,418.03	-9,451,613.70
本期基金份额交易产生的变动数	189,674.47	-2,258,928.84	-2,069,254.37
其中：基金申购款	183,635.96	-2,548,683.57	-2,365,047.61
基金赎回款	6,038.51	289,754.73	295,793.24
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-2,939,038.82	-13,913,850.68	-16,852,889.50
-----	---------------	----------------	----------------

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	29,765.60
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	4,770.65
其他	1,498.55
合计	36,034.80

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	178,730,815.88
减：卖出股票成本总额	186,343,726.54
买卖股票差价收入	-7,612,910.66

#### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期末未有债券投资收益。

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末未有资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期末持有贵金属投资。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本期未投资衍生工具。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,681,733.61
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,681,733.61

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,298,418.03
——股票投资	-2,298,418.03
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-2,298,418.03

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,734.04
合计	3,734.04

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	578,514.94
银行间市场交易费用	-
合计	578,514.94

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	168,603.31
其他	500.00
银行费用	128.50
指数使用费	57,352.72
合计	261,296.71

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控控股有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资本管理有限公司	基金管理人施加重大影响的联营企业
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例

东方证券股份有限公司	310,831,415.22	79.85%
------------	----------------	--------

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30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
东方证券股份 有限公司	280,061.65	79.76%	-	-

注：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证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	3,883.98

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，



于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的托管费	70,329.30

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金的基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

### 6.4.10.5 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	9,058,414.98	29,765.60

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止期间获得的利息收入为人民

币 4,770.65 元，2014 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 203,789.5 元。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金在本期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 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
600498	烽火通信	2014年6月30日	重大事项停牌	11.91	2014年7月7日	12.10	79,750	993,964.77	949,822.50	-
600637	百视通	2014年5月29日	重组停牌	32.03	-	-	13,851	519,944.04	443,647.53	-
600832	东方明珠	2014年5月29日	重组停牌	10.98	-	-	36,551	374,027.50	401,329.98	-
000009	中国宝安	2014年5月28日	重大事项停牌	10.21	2014年8月15日	9.33	24,649	249,448.30	251,666.29	-
002570	贝因美	2014年6月19日	重大事项停牌	14.36	-	-	16,564	313,319.14	237,859.04	-
601669	中国电建	2014年5月13日	重大事项停牌	2.79	-	-	71,335	215,423.73	199,024.65	-
000960	锡业股份	2014年5月6日	重大事项停牌	12.44	2014年8月5日	13.68	15,044	177,429.73	187,147.36	-
000536	华映科技	2014年5月23日	重大事项	23.10	2014年8月20日	25.41	7,655	184,229.86	176,830.50	-

		日	停牌		日					
000878	云南铜业	2014年4月17日	重大事项停牌	7.61	2014年7月17日	7.50	18,239	152,093.95	138,798.79	-
600582	天地科技	2014年6月26日	重组停牌	7.97	-	-	7,164	64,298.57	57,097.08	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

#### 6.4.13.2 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约责任，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行，另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 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。

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，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、存出保证金、部分交易性金融资产及部分应收申购款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 6 月 30 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	9,058,414.98	-	-	-	-	-	9,058,414.98
结算备付金	203,789.50	-	-	-	-	-	203,789.50
存出保证金	75,919.03	-	-	-	-	-	75,919.03
交易性金融资产	-	-	-	-	-	139,780,445.37	139,780,445.37
应收利息	-	-	-	-	-	1,714.69	1,714.69
应收申购款	1,319,113.40	-	-	-	-	296.44	1,319,409.84
资产总计	10,657,236.91	-	-	-	-	139,782,456.50	150,439,693.41
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	36,625.80	36,625.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	60,348.87	60,348.87
应付托管费	-	-	-	-	-	12,069.80	12,069.80
应付交易费用	-	-	-	-	-	172,056.26	172,056.26
其他负债	-	-	-	-	-	260,902.37	260,902.37
负债总计	-	-	-	-	-	542,003.10	542,003.10

利率敏感度缺口	10,657,236.91	-	-	-	-	-139,240,453.40	149,897,690.31
上年度末 2013 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	6,370,056.42	-	-	-	-	-	6,370,056.42
结算备付金	609,104.02	-	-	-	-	-	609,104.02
存出保证金	46,244.37	-	-	-	-	-	46,244.37
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-117,827,319.12	117,827,319.12
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,234,031.43	5,234,031.43
应收利息	-	-	-	-	-	1,653.43	1,653.43
应收申购款	22,067.59	-	-	-	-	35,861.44	57,929.03
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,047,472.40	-	-	-	-	-123,098,865.42	130,146,337.82
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,696,577.86	2,696,577.86
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,101.72	1,101.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	50,515.17	50,515.17
应付托管费	-	-	-	-	-	10,103.05	10,103.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	81,457.16	81,457.16
其他负债	-	-	-	-	-	50,438.93	50,438.93
负债总计	-	-	-	-	-	2,890,193.89	2,890,193.89
利率敏感度缺口	7,047,472.40	-	-	-	-	-120,208,671.53	127,256,143.93

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期期末计息资产仅包括银行存款及应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本期期末未持有其他资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	139,780,445.37	93.25	117,827,319.12	92.59
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	139,780,445.37	93.25	117,827,319.12	92.59

注：本基金投资于沪深 300 安中动态策略指数的成份股的组合比例不低于基金资产的 90%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与所投资证券的贝塔系数紧密相关；		
	对于上市时间不足一年的股票，使用申银万国行业指数替代股票价格计算其贝塔系数；		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	5%	6,275,766.88	5,832,716.03
	-5%	-6,275,766.88	-5,832,716.03

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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 (%)
1	权益投资	139,780,445.37	92.91
	其中：股票	139,780,445.37	92.91
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,262,204.48	6.16
7	其他各项资产	1,397,043.56	0.93
8	合计	150,439,693.41	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	780,049.44	0.52
B	采矿业	26,199,632.77	17.48
C	制造业	51,303,723.86	34.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,780,559.04	20.53
E	建筑业	2,353,822.26	1.57
F	批发和零售业	2,849,206.67	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	1,798,080.37	1.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,817,861.14	5.88
J	金融业	8,551,986.52	5.71
K	房地产业	1,229,697.66	0.82
L	租赁和商务服务业	667,264.44	0.45
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	880,942.00	0.59

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	510,886.27	0.34
S	综合	3,056,732.93	2.04
	合计	139,780,445.37	93.25

## 7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

## 7.3 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

### 7.3.1 期末指数投资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	601088	中国神华	413,675	6,014,834.50	4.01
2	600900	长江电力	948,966	5,902,568.52	3.94
3	600050	中国联通	1,453,379	4,694,414.17	3.13
4	600011	华能国际	816,188	4,619,624.08	3.08
5	000063	中兴通讯	316,836	4,156,888.32	2.77
6	600028	中国石化	697,971	3,678,307.17	2.45
7	600795	国电电力	1,658,960	3,599,943.20	2.40
8	601857	中国石油	440,512	3,321,460.48	2.22
9	600886	国投电力	630,315	3,214,606.50	2.14
10	600256	广汇能源	388,321	2,726,013.42	1.82
11	600674	川投能源	185,480	2,177,535.20	1.45
12	601991	大唐发电	582,999	2,075,476.44	1.38
13	002353	杰瑞股份	48,088	1,935,542.00	1.29
14	600642	申能股份	436,690	1,886,500.80	1.26
15	600519	贵州茅台	12,229	1,736,273.42	1.16
16	000598	兴蓉投资	350,218	1,670,539.86	1.11
17	600583	海油工程	220,609	1,625,888.33	1.08
18	600027	华电国际	461,033	1,415,371.31	0.94
19	600863	内蒙华电	366,553	1,381,904.81	0.92
20	600008	首创股份	215,486	1,331,703.48	0.89
21	600887	伊利股份	39,227	1,299,198.24	0.87
22	601808	中海油服	73,033	1,284,650.47	0.86
23	000651	格力电器	42,476	1,250,918.20	0.83



24	000983	西山煤电	199,467	1,051,191.09	0.70
25	601158	重庆水务	196,660	971,500.40	0.65
26	601318	中国平安	24,531	965,049.54	0.64
27	600498	烽火通信	79,750	949,822.50	0.63
28	000538	云南白药	18,093	944,454.60	0.63
29	601898	中煤能源	233,187	939,743.61	0.63
30	002241	歌尔声学	34,920	930,967.20	0.62
31	002415	海康威视	54,906	930,107.64	0.62
32	600104	上汽集团	60,619	927,470.70	0.62
33	601699	潞安环能	119,427	906,450.93	0.60
34	002065	东华软件	44,776	900,893.12	0.60
35	000858	五粮液	49,929	895,226.97	0.60
36	600688	上海石化	269,058	885,200.82	0.59
37	600016	民生银行	140,540	872,753.40	0.58
38	600535	天士力	22,350	866,509.50	0.58
39	600036	招商银行	84,043	860,600.32	0.57
40	600276	恒瑞医药	25,606	849,094.96	0.57
41	600348	阳泉煤业	150,343	847,934.52	0.57
42	000725	京东方 A	382,040	829,026.80	0.55
43	600585	海螺水泥	52,216	820,835.52	0.55
44	600518	康美药业	52,184	780,150.80	0.52
45	600196	复星医药	38,323	773,741.37	0.52
46	600111	包钢稀土	38,162	749,883.30	0.50
47	002236	大华股份	27,354	737,190.30	0.49
48	600703	三安光电	31,419	736,147.17	0.49
49	600804	鹏博士	47,116	680,355.04	0.45
50	600100	同方股份	74,397	662,877.27	0.44
51	000895	双汇发展	18,354	656,889.66	0.44
52	600123	兰花科创	85,020	639,350.40	0.43
53	002230	科大讯飞	23,428	623,184.80	0.42
54	601668	中国建筑	217,492	613,327.44	0.41
55	000333	美的集团	30,922	597,413.04	0.40
56	601666	平煤股份	146,842	593,241.68	0.40
57	601166	兴业银行	58,749	589,252.47	0.39
58	000423	东阿阿胶	17,632	587,498.24	0.39
59	601006	大秦铁路	87,518	552,238.58	0.37
60	601139	深圳燃气	79,833	533,284.44	0.36
61	002024	苏宁云商	80,006	524,839.36	0.35
62	600000	浦发银行	57,873	523,750.65	0.35

63	600019	XD 宝钢股	126,443	518,416.30	0.35
64	600352	浙江龙盛	32,100	518,415.00	0.35
65	000937	冀中能源	87,822	512,002.26	0.34
66	600315	上海家化	13,896	509,288.40	0.34
67	600188	兖州煤业	73,098	505,838.16	0.34
68	600271	航天信息	23,575	492,010.25	0.33
69	601001	大同煤业	85,623	468,357.81	0.31
70	600718	东软集团	34,333	463,152.17	0.31
71	601899	紫金矿业	206,513	450,198.34	0.30
72	000970	中科三环	37,470	445,143.60	0.30
73	002450	康得新	19,504	443,716.00	0.30
74	600637	百视通	13,851	443,647.53	0.30
75	600332	白云山	17,659	439,532.51	0.29
76	601989	XD 中国重	89,011	429,033.02	0.29
77	600079	人福医药	14,250	425,362.50	0.28
78	002304	洋河股份	8,354	423,965.50	0.28
79	600690	青岛海尔	28,664	423,080.64	0.28
80	600395	盘江股份	65,281	415,839.97	0.28
81	000625	长安汽车	33,742	415,364.02	0.28
82	600309	万华化学	27,336	414,413.76	0.28
83	000002	万科 A	49,804	411,879.08	0.27
84	002038	双鹭药业	9,186	409,420.02	0.27
85	600030	中信证券	35,158	402,910.68	0.27
86	600832	东方明珠	36,551	401,329.98	0.27
87	600085	同仁堂	22,437	391,076.91	0.26
88	600837	海通证券	41,868	383,092.20	0.26
89	600600	青岛啤酒	9,528	381,691.68	0.25
90	000623	吉林敖东	24,292	377,011.84	0.25
91	000963	华东医药	6,895	372,330.00	0.25
92	601988	中国银行	143,849	366,814.95	0.24
93	000100	TCL 集团	160,476	365,885.28	0.24
94	002594	比亚迪	7,691	365,245.59	0.24
95	002456	欧菲光	16,830	360,666.90	0.24
96	601918	国投新集	129,060	360,077.40	0.24
97	600252	中恒集团	29,596	347,161.08	0.23
98	600997	开滦股份	77,698	338,763.28	0.23
99	601288	农业银行	134,128	338,002.56	0.23
100	601607	上海医药	26,554	330,066.22	0.22
101	600588	用友软件	22,771	320,387.97	0.21

102	600089	特变电工	37,610	319,308.90	0.21
103	601328	交通银行	81,084	314,605.92	0.21
104	000069	华侨城 A	66,643	312,555.67	0.21
105	000568	泸州老窖	19,000	311,220.00	0.21
106	601766	中国南车	68,919	310,135.50	0.21
107	002422	科伦药业	7,688	306,366.80	0.20
108	600739	辽宁成大	20,033	305,102.59	0.20
109	600010	包钢股份	83,495	302,251.90	0.20
110	002129	中环股份	15,849	302,240.43	0.20
111	600018	上港集团	67,874	302,039.30	0.20
112	000581	威孚高科	10,886	293,595.42	0.20
113	600489	中金黄金	38,595	293,322.00	0.20
114	600547	山东黄金	18,812	291,209.76	0.19
115	600406	国电南瑞	21,572	287,554.76	0.19
116	601601	中国太保	16,006	284,746.74	0.19
117	000157	中联重科	64,203	284,419.29	0.19
118	600597	光明乳业	17,544	281,405.76	0.19
119	603000	人民网	7,042	275,975.98	0.18
120	601299	中国北车	60,503	274,683.62	0.18
121	000338	潍柴动力	15,338	272,863.02	0.18
122	000831	五矿稀土	12,853	269,655.94	0.18
123	601168	西部矿业	48,865	267,291.55	0.18
124	600362	江西铜业	21,409	262,688.43	0.18
125	000061	农产品	27,696	255,634.08	0.17
126	601231	环旭电子	8,282	255,416.88	0.17
127	000060	中金岭南	37,389	254,245.20	0.17
128	002007	华兰生物	9,723	253,770.30	0.17
129	600267	海正药业	17,091	253,459.53	0.17
130	000009	中国宝安	24,649	251,666.29	0.17
131	000729	燕京啤酒	38,712	251,628.00	0.17
132	000001	平安银行	25,121	248,949.11	0.17
133	600066	宇通客车	15,365	247,991.10	0.17
134	000792	盐湖股份	16,294	245,550.58	0.16
135	002385	大北农	21,457	243,751.52	0.16
136	000012	南玻 A	35,373	241,597.59	0.16
137	002570	贝因美	16,564	237,859.04	0.16
138	002001	新和成	19,164	237,441.96	0.16
139	000629	攀钢钒钛	113,856	236,820.48	0.16
140	600108	亚盛集团	42,342	234,151.26	0.16

141	600827	友谊股份	21,127	231,974.46	0.15
142	000999	华润三九	12,497	229,819.83	0.15
143	601600	中国铝业	74,648	226,929.92	0.15
144	600031	三一重工	44,872	226,154.88	0.15
145	600660	福耀玻璃	26,604	223,473.60	0.15
146	601933	永辉超市	35,063	221,598.16	0.15
147	600177	雅戈尔	31,201	219,343.03	0.15
148	601169	北京银行	26,768	215,750.08	0.14
149	600516	方大炭素	22,408	214,892.72	0.14
150	601818	光大银行	83,945	213,220.30	0.14
151	000778	新兴铸管	57,031	211,585.01	0.14
152	600436	片仔癀	2,724	211,191.72	0.14
153	000709	河北钢铁	113,018	210,213.48	0.14
154	000793	华闻传媒	17,801	209,161.75	0.14
155	601186	中国铁建	45,242	208,565.62	0.14
156	002106	莱宝高科	18,422	208,168.60	0.14
157	000876	新希望	18,347	207,137.63	0.14
158	600216	浙江医药	22,587	206,671.05	0.14
159	002294	信立泰	6,865	206,087.30	0.14
160	600893	航空动力	7,968	205,335.36	0.14
161	600383	金地集团	23,019	204,638.91	0.14
162	601939	建设银行	49,379	203,935.27	0.14
163	600839	四川长虹	65,175	200,739.00	0.13
164	600664	哈药股份	32,079	199,531.38	0.13
165	601669	中国电建	71,335	199,024.65	0.13
166	600157	永泰能源	83,958	198,980.46	0.13
167	002202	金风科技	20,947	198,787.03	0.13
168	600497	驰宏锌锗	21,571	198,668.91	0.13
169	000768	中航飞机	18,756	197,500.68	0.13
170	601390	中国中铁	75,015	193,538.70	0.13
171	600062	华润双鹤	11,163	191,891.97	0.13
172	600015	华夏银行	23,249	190,641.80	0.13
173	601633	长城汽车	7,480	189,244.00	0.13
174	000960	锡业股份	15,044	187,147.36	0.12
175	600741	华域汽车	19,009	185,908.02	0.12
176	600009	上海机场	14,198	183,154.20	0.12
177	601992	金隅股份	32,247	181,228.14	0.12
178	601888	中国国旅	5,473	180,827.92	0.12
179	601958	金铂股份	25,585	180,630.10	0.12

180	600143	金发科技	40,893	180,338.13	0.12
181	600705	中航投资	11,158	179,309.06	0.12
182	600549	厦门钨业	7,025	178,435.00	0.12
183	002081	金螳螂	12,546	177,651.36	0.12
184	000536	华映科技	7,655	176,830.50	0.12
185	600150	中国船舶	8,026	169,027.56	0.11
186	000039	中集集团	12,460	167,711.60	0.11
187	000826	桑德环境	7,311	167,056.35	0.11
188	000400	许继电气	8,323	166,876.15	0.11
189	000630	铜陵有色	18,337	164,299.52	0.11
190	600048	保利地产	32,710	162,241.60	0.11
191	600118	中国卫星	8,678	160,369.44	0.11
192	601101	昊华能源	28,341	159,559.83	0.11
193	600971	恒源煤电	29,572	157,914.48	0.11
194	600166	福田汽车	30,800	157,080.00	0.10
195	600219	南山铝业	30,734	154,284.68	0.10
196	600403	大有能源	28,785	152,272.65	0.10
197	000758	中色股份	15,299	152,072.06	0.10
198	002399	海普瑞	8,138	152,017.84	0.10
199	601117	中国化学	28,577	148,886.17	0.10
200	000776	广发证券	15,126	148,234.80	0.10
201	600221	海南航空	86,769	144,904.23	0.10
202	000800	一汽轿车	14,984	143,846.40	0.10
203	601098	中南传媒	9,842	142,118.48	0.09
204	002299	圣农发展	12,130	140,586.70	0.09
205	002653	海思科	7,247	139,142.40	0.09
206	002069	獐子岛	9,944	139,017.12	0.09
207	000878	云南铜业	18,239	138,798.79	0.09
208	600060	海信电器	14,368	138,651.20	0.09
209	600694	大商股份	5,429	138,602.37	0.09
210	002155	辰州矿业	18,300	136,884.00	0.09
211	601118	海南橡胶	22,023	135,221.22	0.09
212	600655	豫园商城	18,330	134,908.80	0.09
213	600598	*ST 大荒	19,534	131,073.14	0.09
214	600873	梅花生物	25,431	130,461.03	0.09
215	601800	中国交建	34,415	129,400.40	0.09
216	601018	宁波港	56,762	128,849.74	0.09
217	000839	中信国安	16,881	128,295.60	0.09
218	600811	东方集团	24,677	128,073.63	0.09

219	601928	凤凰传媒	13,724	127,358.72	0.08
220	600415	小商品城	25,301	127,264.03	0.08
221	601333	广深铁路	49,503	125,737.62	0.08
222	000425	徐工机械	18,133	124,211.05	0.08
223	600259	广晟有色	3,219	123,062.37	0.08
224	601618	中国中冶	71,216	121,779.36	0.08
225	600029	南方航空	51,738	119,514.78	0.08
226	600999	招商证券	11,809	119,388.99	0.08
227	600160	巨化股份	24,436	118,270.24	0.08
228	601238	广汽集团	15,653	117,867.09	0.08
229	600372	中航电子	5,146	116,659.82	0.08
230	002603	以岭药业	3,944	116,032.48	0.08
231	600875	东方电气	9,717	115,340.79	0.08
232	600153	建发股份	21,122	115,114.90	0.08
233	000401	冀东水泥	14,130	114,876.90	0.08
234	600068	葛洲坝	30,441	112,936.11	0.08
235	601688	华泰证券	14,414	108,393.28	0.07
236	600316	洪都航空	6,241	106,658.69	0.07
237	601628	中国人寿	7,654	104,170.94	0.07
238	002344	海宁皮城	8,303	103,538.41	0.07
239	601901	方正证券	19,032	103,343.76	0.07
240	000933	神火股份	29,576	102,332.96	0.07
241	002375	亚厦股份	4,479	101,046.24	0.07
242	600648	外高桥	3,671	97,795.44	0.07
243	002310	东方园林	5,797	95,708.47	0.06
244	600809	山西汾酒	7,038	93,464.64	0.06
245	601336	新华保险	4,194	88,619.22	0.06
246	000869	张裕 A	3,643	87,832.73	0.06
247	601009	南京银行	10,718	85,744.00	0.06
248	600115	东方航空	37,029	85,536.99	0.06
249	600096	云天化	12,033	84,591.99	0.06
250	601111	中国国航	25,031	82,351.99	0.05
251	000783	长江证券	8,403	80,668.80	0.05
252	601106	中国一重	38,413	73,752.96	0.05
253	601866	中海集运	34,954	73,752.94	0.05
254	002142	宁波银行	7,526	69,239.20	0.05
255	000402	金融街	12,631	68,838.95	0.05
256	601377	兴业证券	7,975	68,744.50	0.05
257	600170	上海建工	15,917	68,283.93	0.05

258	000528	柳工	11,654	67,826.28	0.05
259	600859	王府井	4,282	67,655.60	0.05
260	601998	中信银行	15,499	66,180.73	0.04
261	600340	华夏幸福	2,602	65,492.34	0.04
262	600058	五矿发展	6,143	64,808.65	0.04
263	601258	庞大集团	14,679	64,440.81	0.04
264	000703	恒逸石化	9,277	61,135.43	0.04
265	000596	古井贡酒	3,145	59,975.15	0.04
266	601717	郑煤机	12,101	58,810.86	0.04
267	601369	陕鼓动力	10,272	57,625.92	0.04
268	600582	天地科技	7,164	57,097.08	0.04
269	002051	中工国际	3,305	53,541.00	0.04
270	000024	招商地产	5,076	52,891.92	0.04
271	600783	鲁信创投	3,281	52,692.86	0.04
272	600546	山煤国际	14,496	51,895.68	0.03
273	600369	西南证券	6,064	51,847.20	0.03
274	600109	国金证券	2,564	50,946.68	0.03
275	600528	中铁二局	10,727	49,666.01	0.03
276	600649	城投控股	7,789	49,070.70	0.03
277	000728	国元证券	5,076	47,917.44	0.03
278	002431	棕榈园林	2,679	47,686.20	0.03
279	601555	东吴证券	6,219	44,279.28	0.03
280	600970	中材国际	6,450	43,989.00	0.03
281	600208	新湖中宝	13,208	38,567.36	0.03
282	601099	太平洋	5,836	37,175.32	0.02
283	000686	东北证券	5,050	36,208.50	0.02
284	002146	荣盛发展	3,775	35,749.25	0.02
285	603993	洛阳钼业	5,310	35,577.00	0.02
286	002500	山西证券	5,177	33,598.73	0.02
287	000750	国海证券	3,554	33,585.30	0.02
288	600663	陆家嘴	2,082	32,978.88	0.02
289	000961	中南建设	5,020	32,780.60	0.02
290	000156	华数传媒	1,148	32,247.32	0.02
291	000046	泛海控股	6,898	30,834.06	0.02
292	002269	美邦服饰	3,692	30,680.52	0.02
293	600895	张江高科	4,043	26,360.36	0.02
294	600376	首开股份	5,915	25,552.80	0.02
295	600266	北京城建	2,791	20,848.77	0.01
296	002673	西部证券	1,881	20,314.80	0.01

297	000718	苏宁环球	4,034	18,193.34	0.01
298	000656	金科股份	1,730	11,919.70	0.01

### 7.3.2 期末积极投资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

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	600050	中国联通	9,192,601.00	7.22
2	000063	中兴通讯	9,089,333.22	7.14
3	600900	长江电力	5,136,203.60	4.04
4	600498	烽火通信	4,942,978.59	3.88
5	601088	中国神华	4,878,242.03	3.83
6	600519	贵州茅台	4,224,557.66	3.32
7	600011	华能国际	4,057,495.00	3.19
8	600795	国电电力	3,433,252.00	2.70
9	600887	伊利股份	3,115,883.00	2.45
10	000651	格力电器	3,110,968.68	2.44
11	600886	国投电力	2,827,274.97	2.22
12	600028	中国石化	2,815,873.95	2.21
13	002415	海康威视	2,772,745.17	2.18
14	601857	中国石油	2,753,035.28	2.16
15	002241	歌尔声学	2,691,049.10	2.11
16	600256	广汇能源	2,307,146.95	1.81
17	601318	中国平安	2,239,718.80	1.76
18	600703	三安光电	2,199,606.60	1.73
19	000538	云南白药	2,158,767.28	1.70
20	600016	民生银行	2,084,523.48	1.64

注：买入金额按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 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	600498	烽火通信	5,913,447.10	4.65
2	000063	中兴通讯	5,448,673.96	4.28
3	600036	招商银行	5,305,877.45	4.17
4	600050	中国联通	5,238,463.15	4.12
5	600016	民生银行	5,172,956.30	4.06
6	600519	贵州茅台	4,139,790.33	3.25
7	601166	兴业银行	3,475,431.09	2.73
8	600000	浦发银行	3,245,373.44	2.55
9	600887	伊利股份	3,042,475.91	2.39
10	600837	海通证券	2,623,870.93	2.06
11	000651	格力电器	2,602,387.46	2.04
12	600030	中信证券	2,570,297.56	2.02
13	601988	中国银行	2,537,385.01	1.99
14	000002	万科A	2,403,100.65	1.89
15	002415	海康威视	2,384,373.24	1.87
16	601318	中国平安	2,243,185.90	1.76
17	601288	农业银行	1,954,173.33	1.54
18	002241	歌尔声学	1,929,386.10	1.52
19	000858	五粮液	1,881,288.21	1.48
20	601328	交通银行	1,833,455.54	1.44

注：卖出金额按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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	210,525,771.65
卖出股票收入（成交）总额	178,730,815.88

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.8 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。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期期末无股指期货持仓。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无国债期货持仓。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内本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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 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	75,919.03
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	1,714.69
5	应收申购款	1,319,409.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,397,043.56

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未进行积极投资，不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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 (户)	户均持有的 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 额比例	持有份额	占总份 额比例
377	442,309.23	154,184,079.99	92.46%	12,566,499.82	7.54%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

注：本基金的基金管理人从业人员本报告期末未持有本基金。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 11 月 6 日）基金份额总额	274,994,745.19
本报告期期初基金份额总额	132,588,165.36
本报告期基金总申购份额	37,445,173.80
减：本报告期基金总赎回份额	3,282,759.35
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	166,750,579.81

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 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

1、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘汤丛珊女士担任汇添富理财 30 天债券型证券投资基金的基金经理。同时，曾刚先生不再担任该基金的基金经理。

2、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘汤丛珊女士担任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理。同时，曾刚先生不再担任该基金的基金经理。

3、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘陆文磊先生担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理。同时，陈加荣先生不再担任该基金的基金经理。

4、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘何旻先生担任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。

5、《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》于 2014 年 3 月 6 日正式生效，赖中立先生任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2014 年 3 月 28 日公告，增聘雷鸣先生担任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理，与齐东超先生共同管理该基金。

7、基金管理人 2014 年 4 月 10 日公告，汇添富成长焦点股票型证券投资基金由雷鸣先生单独管理，齐东超先生不再管理该基金。

8、基金管理人 2014 年 4 月 10 日公告，增聘朱晓亮先生担任汇添富民营活力股票型证券投资基金的基金经理。同时，齐东超先生不再担任该基金的基金经理。

9、基金管理人 2014 年 4 月 10 日公告，增聘顾耀强先生担任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，与韩贤旺先生、叶从飞先生、朱晓亮先生共同管理该基金。

10、《汇添富和聚宝货币市场基金基金合同》于 2014 年 5 月 28 日正式生效，汤丛珊女士任该基金的基金经理。

11、本报告期内，因基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
东方证券	2	310,831,415.22	79.85%	280,061.65	79.76%	-
民族证券	2	78,425,180.52	20.15%	71,058.20	20.24%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

### 10.7.2 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
东方证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

(1) 基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

(2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

## 2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

此 38 个交易单元与汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金共用。本报告期新增 1 家证券公司的 2 个交易单元：民族证券（上交所交易单元和深交所交易单元）。本报告期退租 1 家证券公司的 1 个交易单元：湘财证券（上交所交易单元）。

## 10.8 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	汇添富基金管理股份有限公司关于调整现金宝快速取现业务规则的公告	管理人网站	2014 年 1 月 1 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2013 年年度资产净值的公告	管理人网站	2014 年 1 月 2 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加鑫鼎盛为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 2 月 14 日
4	汇添富现金宝理财服务澄清公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管	2014 年 2 月 25 日



		理人网站	
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加太平洋证券为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 3 月 7 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与中金公司开展的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, 管理人网站	2014 年 4 月 4 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于客服中心变更办公地址的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 4 月 10 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加钱景财富为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 4 月 11 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于变更直销中心银行账户信息的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 4 月 21 日
10	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 4 月 22 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 6 月 10 日
12	汇添富基金汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大同证券为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 6 月 11 日
13	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金更新招募说明书摘要 (2014 年第 1 号)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 6 月 19 日
14	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金更新招募说明书 (2014 年第 1 号)	管理人网站	2014 年 6 月 19 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公

告；

6、中国证监会要求的其他文件。

### **11.2 存放地点**

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理股份有限公司

### **11.3 查阅方式**

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司  
2014 年 8 月 25 日