

# 汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资 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遵规守信情况的说明.....	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>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	39
7.7 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.....	39
7.8 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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	40
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>40</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
8.3 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 .....	41
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>41</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
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 .....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	43
10.8 其他重大事件.....	45
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>47</b>
11.1 备查文件目录.....	47
11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	汇添富蓝筹稳健混合
基金主代码	519066
前端交易代码	519066
后端交易代码	519067
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 7 月 8 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	112,585,217.65 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于价值相对低估的蓝筹公司股票，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为灵活配置混合型基金，属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。

### 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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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	-6,660,126.54
本期利润	-8,092,494.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0649
本期加权平均净值利润率	-5.52%
本期基金份额净值增长率	-5.21%
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	15,824,146.48
期末可供分配基金份额利润	0.1406
期末基金资产净值	128,409,364.13
期末基金份额净值	1.141
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	55.98%

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、所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。

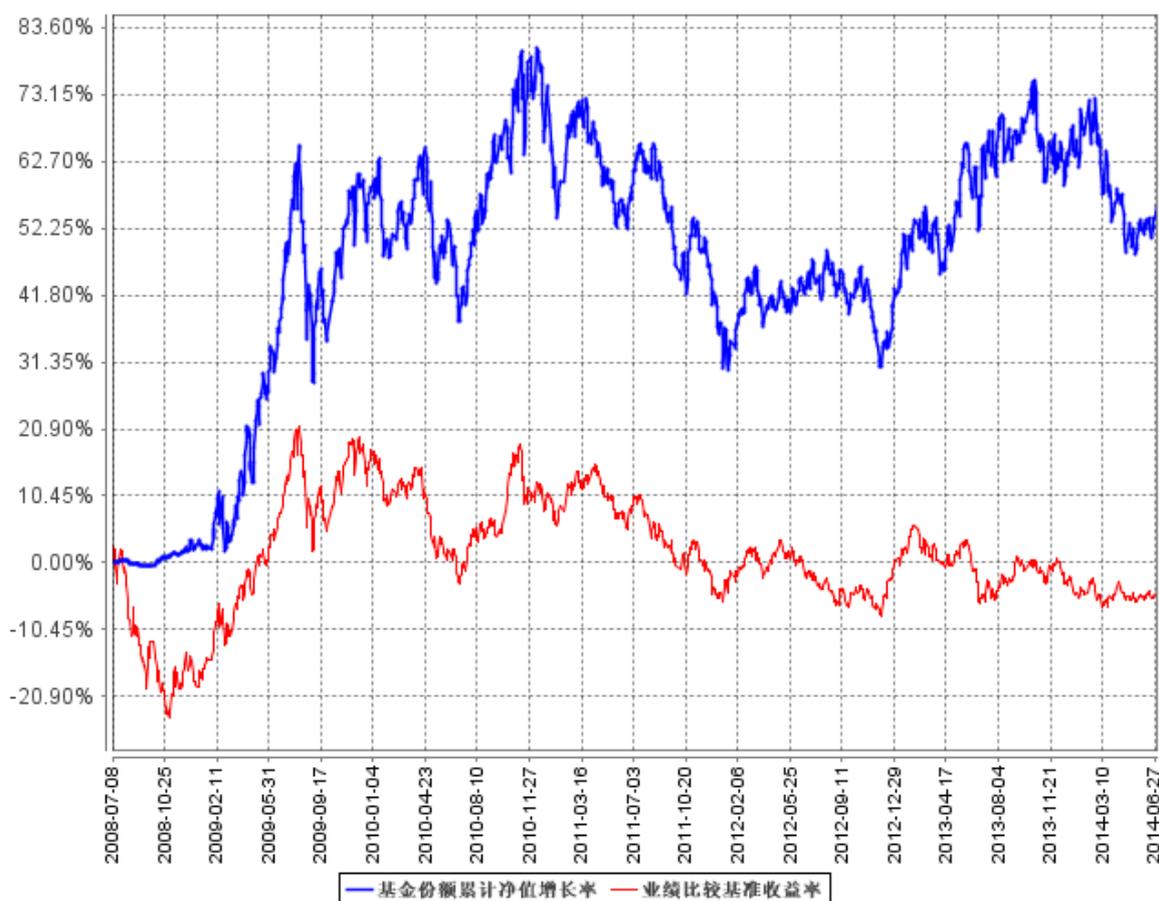
### 3.2 基金净值表现

#### 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	2.33%	0.67%	0.38%	0.47%	1.95%	0.20%
过去三个月	0.88%	0.76%	0.95%	0.52%	-0.07%	0.24%
过去六个月	-5.21%	1.06%	-3.53%	0.62%	-1.68%	0.44%
过去一年	-0.85%	1.10%	0.17%	0.70%	-1.02%	0.40%
过去三年	-1.71%	1.00%	-13.13%	0.78%	11.42%	0.22%
自基金合同生效日起至 今	55.98%	1.13%	-4.78%	1.01%	60.76%	0.12%

#### 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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2008 年 7 月 8 日）起 6 个月，建仓期结束时各项

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		
叶从飞	汇添富均衡增长股票基金、汇添富蓝筹稳健混合基金的基金经理。	2013 年 11 月 22 日	-	10 年	国籍：中国。学历：南京大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任中原证券股份有限公司资产管理部交易员、投资经理助理。2005 年 10 月加入汇添富基金管理股份有限公司任交易主管，2010 年 9 月 21 日至 2012 年 3 月 1 日任汇添富医药保健股票基金的基金经理助理，2012 年 3 月 2 日至今任汇添富均衡增长股票基金的

					基金经 理，2013 年 11 月 22 日至今 任汇添富 蓝筹稳健 混合基金 的基金经 理。
颜云飞	汇添富蓝 筹稳健混 合基金的 基金经理 助理	2013 年 11 月 22 日	-	9 年	国籍：中 国。学历： 南开大学 金融学硕 士。相关 业务资 格：证券 投资基金 从业资格。 从业 经历：曾 在中国投 资有限责 任公司、 中信证券 股份有限 公司从事 研究类工 作。2009 年 12 月加 入汇添富 基金管理 股份有限 公司，历 任行业分 析师、高 级行业分 析师， 2013 年 11 月 22 日至今 任汇添富 蓝筹稳健 混合基金 的基金经 理助理。

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

2013 年大放异彩的新兴产业在 2014 年上半年出现较大波动，在波动的市场面前，我们整体以相对较低的仓位和灵活配置重点个股来应对。上述策略整体上还算符合市场节奏，但在实际操作中仍存在较多失误。譬如仓位方面变动不够灵活，5 月底市场较低位置没有借机大幅加仓，导致在 6 月的反弹中准备不足。此外在重点个股的选择中也有遗漏，非常遗憾地错过了今年景气上升最快的新能源汽车板块。对投资策略的执行上缺乏灵活性是本季度最大反思。

中长期而言，聚焦优质成长仍是我们的投资理念的核心，在这个核心框架内，我们将加大对新兴产业中的优质成长股的研究和投资，希望能前瞻性布局新领域。三季度本基金将继续集中持仓估值具备吸引力之高成长个股。除继续配置长期看好的互联网、医药、泛环保资产外，还将坚持配置医疗、游戏等高增长行业的高成长个股，同时也考虑在部分累计跌幅较大的传统成长股中寻找逆向类投资机会。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年上半年本基金净值增长率为-5.21%，同期业绩比较基准率为-3.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前时点，我们判断经济整体运行没有大幅变化的迹象，结构调整仍在重重困难中慢慢前行。我们在以前季报中曾经表达过，中国经济两个部门已经显著脱钩，代表传统实体经济的部门持续在景气低位运行，而代表新兴产业的部门，如科技及互联网行业在创新背景下继续快速增长。

对于市场，我们认为成长股在经历近 18 个月涨后个股普遍性机会减少，但仍然有望寻找到穿越市场波动的中长期成长股，两类机会将是我们三季度的工作重点。一是能从全球科技互联网创新浪潮中创造新商业模式和客户价值的公司，他们中优势公司的崛起将是长期过程；二是在真正受益于环保标准大幅提升的公司，如部分产能受限行业及清洁能源行业；三是老龄化背景下医疗和医药领域沉淀下来真正有核心竞争力的公司。我们将紧密把握这些领域任何的变化以求抓住其中孕育的机会。

#### 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、产品创新部、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，本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务。

#### 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 12 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 25%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金于 2014 年 1 月 20 日实施利润分配，每份基金份额派发红利 0.069 元人民币。

## § 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蓝筹稳健灵活配置混合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，汇添富蓝筹稳健灵活配置混合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蓝筹稳健灵活配置混合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，汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 9,039,960.57 元。

### 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蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金 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：汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金

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	36,930,677.60	40,048,406.32
结算备付金		50,922.95	642,827.25
存出保证金		74,349.69	136,923.40
交易性金融资产	6.4.7.2	93,387,865.89	160,129,262.67
其中：股票投资		83,385,865.89	139,237,549.07
基金投资		-	-
债券投资		10,002,000.00	20,891,713.60
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	-	20,000,000.00
应收证券清算款		2,715,697.63	-
应收利息	6.4.7.5	371,845.70	228,108.29
应收股利		-	-
应收申购款		22,502.85	59,555.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		133,553,862.31	221,245,083.28
<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		4,284,658.13	16,480,624.04
应付赎回款		162,480.16	259,746.19
应付管理人报酬		156,003.73	257,101.81
应付托管费		26,000.61	42,850.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	51,786.91	214,225.40
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	463,568.64	713,293.20
负债合计		5,144,498.18	17,967,840.93
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	112,585,217.65	159,683,518.10
未分配利润	6.4.7.10	15,824,146.48	43,593,724.25
所有者权益合计		128,409,364.13	203,277,242.35
负债和所有者权益总计		133,553,862.31	221,245,083.28

注：1、报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.141 元，基金份额总额 112,585,217.65 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：汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-6,084,507.19	42,530,356.07
1.利息收入		365,557.53	1,006,723.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	128,106.01	225,043.93
债券利息收入		223,590.41	716,608.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,861.11	65,071.63
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-5,034,168.39	38,231,559.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,651,109.57	36,201,236.93

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-33,933.24	17,359.18
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	650,874.42	2,012,963.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,432,368.39	3,159,655.78
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	16,472.06	132,417.09
<b>减：二、费用</b>		2,007,987.74	4,609,512.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,093,871.33	2,477,222.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	182,311.87	412,870.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	502,380.30	1,496,514.46
5. 利息支出		6,173.19	-
其中：卖出回购金融资产支出		6,173.19	-
6. 其他费用	6.4.7.20	223,251.05	222,905.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-8,092,494.93	37,920,843.19

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金

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）	159,683,518.10	43,593,724.25	203,277,242.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,092,494.93	-8,092,494.93
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）	-47,098,300.45	-10,637,122.27	-57,735,422.72
其中：1.基金申购款	22,896,959.71	4,405,918.95	27,302,878.66
2.基金赎回款	-69,995,260.16	-15,043,041.22	-85,038,301.38
四、本期向基金份额持	-	-9,039,960.57	-9,039,960.57



管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金采用灵活积极的资产配置和股票投资策略。在资产配置中，通过以宏观经济及宏观经济政策分析为核心的情景分析法来确定投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例，并结合对市场估值、市场资金、投资主体行为和市场信心影响等因素的综合判断进行灵活调整；在股票投资中，采取“自下而上”的策略，优选价值相对低估的蓝筹公司股票构建投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得长期持续稳健的投资收益。本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

#### 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，对于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修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 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	36,930,677.60
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	36,930,677.60

注：本基金本报告期末未投资定期存款。

### 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	78,123,364.85	83,385,865.89	5,262,501.04	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	9,982,700.00	10,002,000.00	19,300.00
	合计	9,982,700.00	10,002,000.00	19,300.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	88,106,064.85	93,387,865.89	5,281,801.04	

### 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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.1 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	5,433.30
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	20.61
应收债券利息	366,361.64
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	30.15
合计	371,845.70

注：“其他”为结算保证金利息。

#### 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	51,652.51
银行间市场应付交易费用	134.40
合计	51,786.91

#### 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	250,000.00
应付赎回费	334.35
预提审计费用	44,630.98
预提信息披露费	168,603.31
合计	463,568.64

**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	159,683,518.10	159,683,518.10
本期申购	22,896,959.71	22,896,959.71
本期赎回(以“-”号填列)	-69,995,260.16	-69,995,260.16
- 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	112,585,217.65	112,585,217.65

注：本期申购中包含红利再投、转换入份额，本期赎回中包含转换出份额。

**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	57,156,464.16	-13,562,739.91	43,593,724.25
本期利润	-6,660,126.54	-1,432,368.39	-8,092,494.93
本期基金份额交易产生的变动数	-15,057,917.97	4,420,795.70	-10,637,122.27
其中：基金申购款	6,242,226.82	-1,836,307.87	4,405,918.95
基金赎回款	-21,300,144.79	6,257,103.57	-15,043,041.22
本期已分配利润	-9,039,960.57	-	-9,039,960.57
本期末	26,398,459.08	-10,574,312.60	15,824,146.48

**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
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	2,808.14
其他	1,190.54
合计	128,106.01

注：表中“其他”指直销申购款利息收入。

### 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	182,682,195.16
减：卖出股票成本总额	188,333,304.73
买卖股票差价收入	-5,651,109.57

### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,954,270.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	16,903,931.83
减：应收利息总额	84,271.41
债券投资收益	-33,933.24

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本期末未持有贵金属。

#### 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	650,874.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	650,874.42

**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	-1,432,368.39
——股票投资	-1,926,867.61
——债券投资	494,499.22
——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	-1,432,368.39

**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	16,472.06
合计	16,472.06

**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	502,380.30
银行间市场交易费用	-
合计	502,380.30

**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	44,630.98
信息披露费	168,603.31
其他费用	400.00
银行划款费用	616.76
帐户维护费	9,000.00

合计	223,251.05
----	------------

### 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，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

### 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
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
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
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

### 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		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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
东方证券股份 有限公司	42,961,227.86	13.55%	192,523,595.48	20.39%

### 6.4.10.1.2 债券交易

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		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	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 成交总额的比 例
东方证券股份 有限公司	7,301,782.00	32.48%	-	-

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	38,584.59	13.66%	6,763.34	13.09%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	173,511.04	20.47%	47,664.37	15.47%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券  
 结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包  
 括：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	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	1,093,871.33	2,477,222.61
其中：支付销售机构的客 户维护费	179,043.68	225,240.85

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内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	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	182,311.87	412,870.52

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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

份额单位：份

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
基金合同生效日（2008年7月8日）持有的基金份额	-	-

期初持有的基金份额	28,907,332.04	28,907,332.04
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	28,907,332.04	-
期末持有的基金份额	0.00	28,907,332.04
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.00%	16.46%

注：1、本公司于 2014 年 1 月 13 日赎回本基金份额 14,453,666.02 份，赎回费 0 元，符合招募说明书规定的赎回费率。

2、本公司于 2014 年 1 月 14 日赎回本基金份额 14,453,666.02 份，赎回费 0 元，符合招募说明书规定的赎回费率。

3、其中“申购/买入”含红利再投、转换入份额；“赎回/卖出”含转换出份额。

#### 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		上年度可比期间	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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	36,930,677.60	124,107.33	21,219,962.42	216,120.55

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 半年度获得的利息收入为人民币 2,808.14 元(2013 半年度：人民币 7,360.34 元)，2014 半年末结算备付金余额为人民币 50,922.95 元(2013 半年末：人民币 586,097.87 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：本基金本期和上年度可比期间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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					

1	2014年1月20日	2014年1月20日	2014年1月20日	0.690	4,883,932.13	4,156,028.44	9,039,960.57	
合计				0.690	4,883,932.13	4,156,028.44	9,039,960.57	

### 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002727	一心堂	2014年6月25日	2014年7月2日	新股流通受限	12.20	12.20	2,690	32,818.00	32,818.00	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌的股票。

#### 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在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、风险管理部门、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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本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，本年末本基金的资产均能及时变现。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、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 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	36,930,677.60	-	-	-	-	-	36,930,677.60
结算备付金	50,922.95	-	-	-	-	-	50,922.95
存出保证金	74,349.69	-	-	-	-	-	74,349.69
交易性金融资产	-	10,002,000.00	-	-	-	83,385,865.89	93,387,865.89
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,715,697.63	2,715,697.63
应收利息	-	-	-	-	-	371,845.70	371,845.70
应收申购款	9,867.20	-	-	-	-	12,635.65	22,502.85
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	37,065,817.44	10,002,000.00	-	-	-	86,486,044.87	133,553,862.31
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,284,658.13	4,284,658.13
应付赎回款	-	-	-	-	-	162,480.16	162,480.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	156,003.73	156,003.73
应付托管费	-	-	-	-	-	26,000.61	26,000.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	51,786.91	51,786.91
其他	-	-	-	-	-	463,568.64	463,568.64

负债							
负债总计	-	-	-	-	-	5,144,498.18	5,144,498.18
利率敏感 度缺口	37,065,817.44	10,002,000.00	-	-	-	81,341,546.69	128,409,364.13
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	40,048,406.32	-	-	-	-	-	40,048,406.32
结算 备付 金	642,827.25	-	-	-	-	-	642,827.25
存出 保证 金	136,923.40	-	-	-	-	-	136,923.40
交易 性金 融资 产	-	-	9,931,000.00	9,537,907.20	1,422,806.40	139,237,549.07	160,129,262.67
买入 返售 金融 资产	20,000,000.00	-	-	-	-	-	20,000,000.00
应收 利息	-	-	-	-	-	228,108.29	228,108.29
应收 申购 款	29,896.34	-	-	-	-	29,659.01	59,555.35
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	60,858,053.31	-	9,931,000.00	9,537,907.20	1,422,806.40	139,495,316.37	221,245,083.28
负债							
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	16,480,624.04	16,480,624.04

应付赎回款	-	-	-	-	-	259,746.19	259,746.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	257,101.81	257,101.81
应付托管费	-	-	-	-	-	42,850.29	42,850.29
应付交易费用	-	-	-	-	-	214,225.40	214,225.40
其他负债	-	-	-	-	-	713,293.20	713,293.20
负债总计	-	-	-	-	-	17,967,840.93	17,967,840.93
利率敏感度缺口	60,858,053.31	-9,931,000.00	9,537,907.20	1,422,806.40	121,527,475.44	203,277,242.35	

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

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	银行存款、结算备付金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响；		
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券。		
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）
	0.25%	-4,081.65	-15,807.26
	-0.25%	4,084.98	15,857.74

### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.2.1 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	83,385,865.89	64.94	139,237,549.07	68.50
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	10,002,000.00	7.79	20,891,713.60	10.28
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	93,387,865.89	72.73	160,129,262.67	78.77

注：本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 30%-80%；债券及资产支持证券为 0%-60%；权证为 0%-3%；现金和到期日在 1 年以内的政府债券不低于 5%。

#### 6.4.13.4.2.2 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，即与基金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%	3,254,466.57	5,759,860.29
-5%	-3,254,466.57	-5,759,860.29	

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	83,385,865.89	62.44
	其中：股票	83,385,865.89	62.44
2	固定收益投资	10,002,000.00	7.49
	其中：债券	10,002,000.00	7.49
	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	36,981,600.55	27.69
7	其他各项资产	3,184,395.87	2.38
8	合计	133,553,862.31	100.00

### 7.2 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	66,523,640.69	51.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	32,818.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,202,407.20	7.17
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,319,000.00	1.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,308,000.00	4.13
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	83,385,865.89	64.94

### 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

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	600352	浙江龙盛	700,042	11,305,678.30	8.80
2	002555	顺荣股份	170,010	8,004,070.80	6.23
3	002508	老板电器	225,317	6,369,711.59	4.96
4	600594	益佰制药	150,000	6,169,500.00	4.80
5	300104	乐视网	140,000	6,146,000.00	4.79
6	002440	闰土股份	329,904	6,103,224.00	4.75
7	000919	金陵药业	400,000	5,568,000.00	4.34
8	002475	立讯精密	165,200	5,415,256.00	4.22
9	600661	新南洋	200,000	5,308,000.00	4.13
10	002415	海康威视	300,000	5,082,000.00	3.96
11	300006	莱美药业	170,000	4,947,000.00	3.85
12	300113	顺网科技	120,000	2,904,000.00	2.26
13	600499	科达洁能	150,000	2,676,000.00	2.08
14	300257	开山股份	80,000	2,535,200.00	1.97
15	601058	赛轮股份	200,000	2,348,000.00	1.83
16	002183	怡亚通	300,000	2,319,000.00	1.81
17	300386	飞天诚信	2,640	152,407.20	0.12
18	002727	一心堂	2,690	32,818.00	0.03

## 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	002555	顺荣股份	13,628,373.19	6.70
2	002440	闰土股份	7,580,998.20	3.73
3	002312	三泰电子	7,200,000.00	3.54
4	002527	新时达	6,613,373.05	3.25
5	002508	老板电器	6,277,755.36	3.09
6	000919	金陵药业	5,373,764.50	2.64
7	000002	万科A	5,193,200.00	2.55
8	300006	莱美药业	5,089,064.07	2.50
9	000521	美菱电器	4,864,321.00	2.39
10	603005	晶方科技	4,845,102.00	2.38
11	601668	中国建筑	4,663,000.00	2.29
12	600661	新南洋	4,406,211.98	2.17
13	002475	立讯精密	4,365,799.96	2.15
14	600588	用友软件	3,929,090.16	1.93
15	600048	保利地产	3,890,000.00	1.91
16	300005	探路者	3,646,261.60	1.79
17	002292	奥飞动漫	3,634,846.17	1.79
18	002242	九阳股份	3,499,596.25	1.72
19	600708	海博股份	3,380,993.10	1.66
20	002456	欧菲光	3,321,383.70	1.63

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	300090	盛运股份	9,777,040.06	4.81
2	002312	三泰电子	9,662,287.00	4.75
3	002241	歌尔声学	7,841,648.02	3.86

4	002081	金螳螂	7,741,513.01	3.81
5	000651	格力电器	7,077,570.85	3.48
6	300133	华策影视	7,028,737.93	3.46
7	601633	长城汽车	6,759,755.06	3.33
8	300104	乐视网	6,716,651.94	3.30
9	000826	桑德环境	6,349,961.11	3.12
10	600535	天士力	6,326,689.34	3.11
11	000002	万科A	5,626,403.25	2.77
12	002527	新时达	5,317,691.20	2.62
13	300017	网宿科技	4,960,100.00	2.44
14	002555	顺荣股份	4,931,829.84	2.43
15	601668	中国建筑	4,545,000.00	2.24
16	600588	用友软件	4,534,024.14	2.23
17	300157	恒泰艾普	4,519,242.60	2.22
18	300228	富瑞特装	4,515,772.21	2.22
19	000400	许继电气	4,471,728.84	2.20
20	600872	中炬高新	4,279,323.67	2.11
21	603005	晶方科技	4,090,696.00	2.01

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	134,408,489.16
卖出股票收入（成交）总额	182,682,195.16

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

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	-	-
3	金融债券	10,002,000.00	7.79
	其中：政策性金融债	10,002,000.00	7.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	10,002,000.00	7.79

## 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

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	130236	13 国开 36	100,000	10,002,000.00	7.79

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 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未持有股指期货投资。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期期末未持有股指期货投资。

## 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：本基金本报告期期末未持有国债期货投资。

### 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：本基金本报告期期末未持有国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期期末未持有国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未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	74,349.69
2	应收证券清算款	2,715,697.63
3	应收股利	-
4	应收利息	371,845.70
5	应收申购款	22,502.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,184,395.87

### 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

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 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

14,807	7,603.51	838,185.20	0.74%	111,747,032.45	99.26%
--------	----------	------------	-------	----------------	--------

### 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	576,081.44	0.51%

### 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

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、基金投资和相关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（2008年7月8日）基金份额总额	741,799,533.92
本报告期期初基金份额总额	159,683,518.10
本报告期基金总申购份额	22,896,959.71
减：本报告期基金总赎回份额	69,995,260.16
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	112,585,217.65

注：表内“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

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，增聘汤从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，汤从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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	87,602,685.49	27.64%	77,576.27	27.47%	-
光大证券	1	66,533,460.78	20.99%	58,875.34	20.84%	-
广发证券	2	44,332,269.18	13.99%	39,386.43	13.94%	-
东方证券	2	42,961,227.86	13.55%	38,584.59	13.66%	-
国泰君安	2	18,629,539.99	5.88%	16,835.56	5.96%	-
中国中投	2	17,246,774.02	5.44%	15,322.96	5.43%	-
中金公司	2	15,223,147.68	4.80%	13,616.89	4.82%	-
国金证券	2	11,591,793.02	3.66%	10,553.10	3.74%	-
招商证券	2	8,766,243.34	2.77%	7,980.68	2.83%	-
国信证券	2	2,498,871.24	0.79%	2,274.95	0.81%	-
海通证券	2	1,584,390.52	0.50%	1,442.43	0.51%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	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
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	5,526,889.77	24.58%	-	-	-	-
东方证券	7,301,782.00	32.48%	-	-	-	-
国泰君安	9,652,488.00	42.94%	-	-	-	-
中国中投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-

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。

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 32 个交易单元与汇添富价值精选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、汇添富双利债券型证券投资基金共用。本基金本报告期内未新增和减少交易单元。

### 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	汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金收益分配公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 1 月 15 日
4	汇添富蓝筹稳健灵活配置型证券投资基金 2013 年第 4 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 1 月 20 日
5	汇添富蓝筹稳健灵活配置混合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 2 月 21 日
6	汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型	管理人网站	2014 年 2 月 21 日

	证券投资基金更新招募说明书 (2014 年第 1 号)		
7	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 理人网站	2014 年 2 月 25 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
9	汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型 证券投资基金 2013 年年度报告	管理人网站	2014 年 3 月 26 日
10	汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型 证券投资基金 2013 年年度报告 摘要	中国证券报, 上海证 券报, 证券时报, 管 理人网站	2014 年 3 月 26 日
11	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
12	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
13	汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型 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
14	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
15	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

## § 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蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富蓝筹稳健灵活配置混合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、报告期内汇添富蓝筹稳健灵活配置混合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