

汇添富美丽 30 股票型证券投资基金 2014 年半年度报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富美丽 30 股票
基金主代码	000173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 6 月 25 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	1,942,731,321.64 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选个股和集中投资，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金为股票型基金。股票投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘拥有优秀管理层、盈利能力高于行业平均水平、增长可持续且估值水平相对合理的优质上市公司，辅以严格的风险管理，以获得中长期的较高投资收益。投资策略的重点是个股精选策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 $\times$ 80% + 中证全债指数收益率 $\times$ 20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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

2.4 信息披露方式

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

§ 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	-3,681,978.57
本期利润	78,125,747.74
加权平均基金份额本期利润	0.0599
本期基金份额净值增长率	12.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.0779
期末基金资产净值	2,331,409,506.65
期末基金份额净值	1.200

- 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

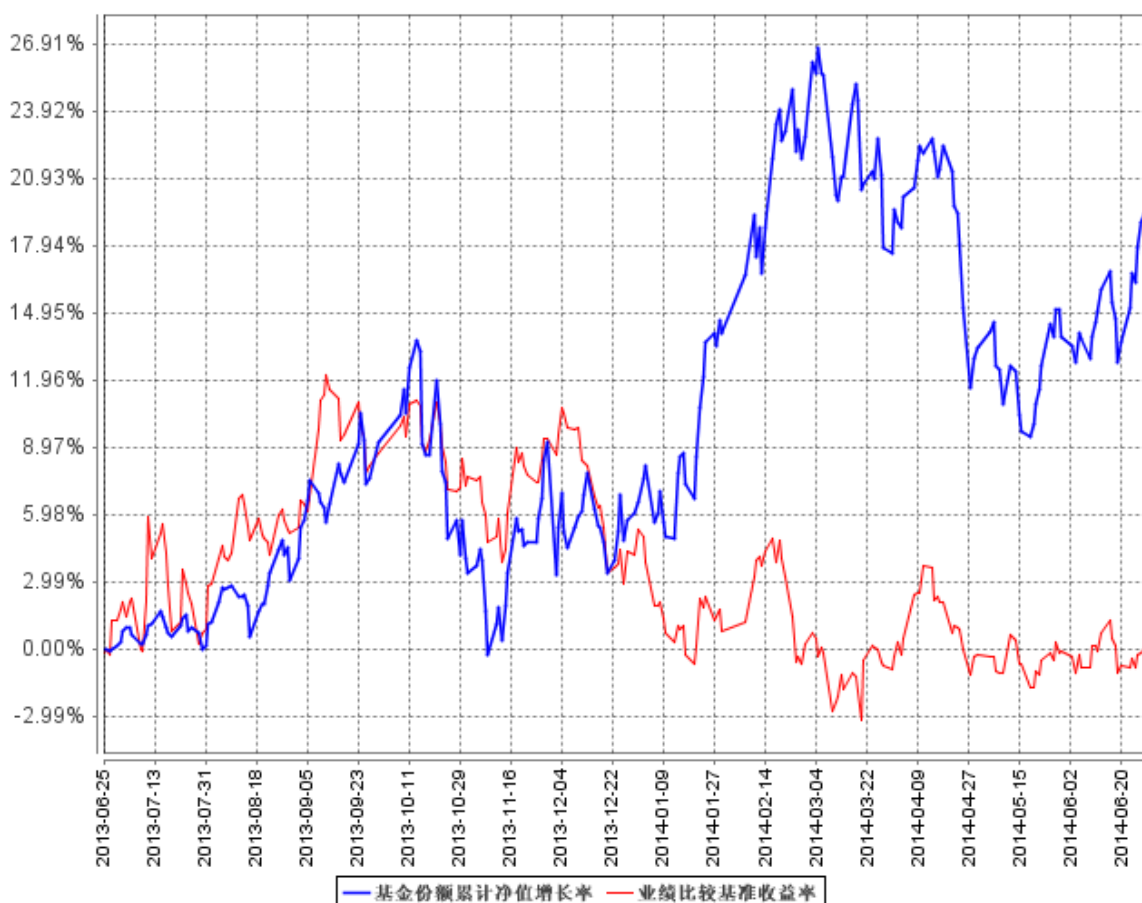
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.36%	0.93%	0.48%	0.62%	4.88%	0.31%
过去三个月	2.04%	1.04%	1.29%	0.69%	0.75%	0.35%
过去六个月	12.68%	1.25%	-4.53%	0.83%	17.21%	0.42%
过去一年	19.88%	1.20%	-0.88%	0.94%	20.76%	0.26%
自基金合同	20.00%	1.19%	0.33%	0.93%	19.67%	0.26%

生效日起至 今						
------------	--	--	--	--	--	--

注：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 06 月 25 日，至本报告期末未满 3 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：本基金建仓期为自《基金合同》生效之日(2013 年 6 月 25 日)起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 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		
王栩	汇添富优势精选混合基金、 汇添富理财 14 天债券基金、	2013 年 6 月 25 日	-	12 年	国籍：中国。学历：同济大学管理学硕士。相关业务资

	汇添富美丽 30 股票基金的基金经理。				格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任上海永嘉投资管理有限公司研究员。2004 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司任高级行业研究员，2009 年 11 月 30 日至 2010 年 2 月 4 日任汇添富优势精选混合基金的基金经理助理，2010 年 2 月 5 日至今任汇添富优势精选混合基金的基金经理，2010 年 9 月 21 日至 2013 年 5 月 10 日任汇添富医药保健股票基金的基金经理，2012 年 7 月 10 日至今任汇添富理
--	---------------------	--	--	--	---

					财 14 天债券基金的基金经理，2013 年 6 月 25 日至今任汇添富美丽 30 股票基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2014 年上半年国内经济总体处于下滑态势，以房地产产业链为代表的内需低迷是经济下滑的主因。面对经济持续下滑以及债务违约事件频发，政府陆续出台了一系列微刺激政策。货币政策方面，央行一季度即开始着力维护货币市场的稳定，市场利率水平相对于去年四季度明显下降；二季度央行两次定向下调存款准备金率。财政政策方面，部分地方政府获准试点自行发债，二季度基建投资也明显加速。行业政策方面，政府对房地产行业由打压转为适度支持。这些政策措施虽然减轻了投资者对于宏观不确定性的担忧，但追逐新兴行业回避传统行业依然是市场的主流。上半年 A 股市场整体大幅下跌，风格资产差异显著。沪深 300 下跌 7.08%，中小板指数上涨 2.50%，创业板指数上涨 7.69%。分行业来看，计算机、通信、电子、休闲服务、综合等行业涨幅居前，而采掘、农林牧渔、非银金融、建筑装饰、食品饮料等行业则大幅下跌。

本基金在上半年根据经济和市场环境的变化对资产配置结构做出调整。股票资产比例较年初略有下降，从 87.1%下降至 83.4%。行业配置方面，主要增持了食品饮料、交运设备、建筑建材、传媒等行业，主要减持了公用事业、家电、餐饮旅游等行业。个股投资上重点增持了传统行业中竞争力突出并积极探索新商业模式的优质个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年上半年本基金的收益率为 12.68%，比同期业绩比较基准率高 17.21 个百分点。

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，本基金的观点如下。第一，房地产产业链的衰退以及重大债务违约事件的发生依然是经济向下的最大风险因素，但同时可预期的是中央政府在宏观政策上会延续相对宽松的态

度，尤其是货币政策方面具有比较大的放松空间。因此宏观经济的进一步下滑不会对股票市场构成重大的负面影响。第二，尽管经济整体景气度不佳，但政府自上而下推动经济结构转型的努力以及互联网对传统产业自下而上的改造已经在相当多行业初露端倪，产业结构的深度变革为资本市场的发展提供了新的动力。第三，A 股市场的潜在重大风险来自于两个方面。一是，如果国内经济继续加速下滑人民币贬值预期会有所增强，资本外流会对人民币计价的资产价值造成冲击。二是，尽管年内 IPO 规模受到控制，但小市值公司整体性的高估值仍会受到产业资本减持、创业板融资大规模启动等因素的冲击。

本基金在下半年重点关注以下方面的投资机会。第一，传统的医药、医疗服务行业在新技术、互联网、行业政策的综合作用下正在发生剧变，相当多新领域具有广阔的发展空间。第二，互联网对传统产业的改造在部分行业已经初显成效。第三，新能源汽车行业性的高增长期正在来临，产业链中具有核心竞争力的公司有望给投资者带来丰厚的回报。第四，大多数的传统行业目前处于非常低的估值水平，可以择机对其中的优质公司做逆向投资，尤其是可能受益于沪港通、具有消费属性的优质个股。

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 12 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美丽 30 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，汇添富美丽 30 股票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美丽 30 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，汇添富美丽 30 股票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美丽 30 股票型证券投资基金 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：汇添富美丽 30 股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
-----	------------------------	--------------------------

资 产:		
银行存款	80,483,975.23	85,580,097.95
结算备付金	5,019,914.54	2,731,367.83
存出保证金	873,754.47	409,676.92
交易性金融资产	2,044,221,477.90	697,338,564.45
其中: 股票投资	1,944,075,477.90	677,907,331.95
基金投资	-	-
债券投资	100,146,000.00	19,431,232.50
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	50,000,000.00	30,000,000.00
应收证券清算款	80,050,723.87	7,756,728.06
应收利息	3,465,604.36	74,171.74
应收股利	-	-
应收申购款	114,967,278.27	1,851,367.51
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,379,082,728.64	825,741,974.46
负债和所有者权益	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 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	15,409,417.25	44,512,513.88
应付赎回款	27,135,147.48	1,337,287.55
应付管理人报酬	2,645,174.90	945,178.35
应付托管费	440,862.49	157,529.71
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,727,359.08	360,469.05
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	315,260.79	165,040.01
负债合计	47,673,221.99	47,478,018.55
所有者权益:		
实收基金	1,942,731,321.64	730,668,586.86
未分配利润	388,678,185.01	47,595,369.05
所有者权益合计	2,331,409,506.65	778,263,955.91
负债和所有者权益总计	2,379,082,728.64	825,741,974.46

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.200 元，基金份额总额 1,942,731,321.64 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富美丽 30 股票型证券投资基金

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	上年度可比期间 2013 年 6 月 25 日(基 金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日
一、收入	96,833,565.87	574,479.18
1.利息收入	1,197,323.50	1,139,182.41
其中：存款利息收入	832,464.35	1,021,340.18
债券利息收入	14,755.99	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	350,103.16	117,842.23
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	11,439,415.93	-
其中：股票投资收益	-1,935,019.73	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	502,428.56	-
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	12,872,007.10	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	81,807,726.31	-564,703.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,389,100.13	-
减：二、费用	18,707,818.13	217,281.30
1. 管理人报酬	11,111,335.10	137,470.67
2. 托管费	1,851,889.28	22,911.77
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	5,529,789.46	46,904.22
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	214,804.29	9,994.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	78,125,747.74	357,197.88

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富美丽 30 股票型证券投资基金

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）	730,668,586.86	47,595,369.05	778,263,955.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	78,125,747.74	78,125,747.74
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）	1,212,062,734.78	262,957,068.22	1,475,019,803.00
其中：1.基金申购款	2,824,214,512.92	562,607,544.90	3,386,822,057.82
2.基金赎回款	-1,612,151,778.14	-299,650,476.68	-1,911,802,254.82
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）	1,942,731,321.64	388,678,185.01	2,331,409,506.65
项目	上年度可比期间 2013 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2013 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）	669,054,192.59	-	669,054,192.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	357,197.88	357,197.88
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）	-	-	0.00
其中：1.基金申购款	-	-	0.00
2.基金赎回款	-	-	-
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）	669,054,192.59	357,197.88	669,411,390.47

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：

林利军	陈灿辉	王小练
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

汇添富美丽 30 股票型证券投资基金(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]611 号文《关于核准汇添富美丽 30 股票型证券投资基金募集的批复》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 5 月 27 日至 2013 年 6 月 21 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(2013)验字第 60466941_B24 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 6 月 25 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 668,747,398.36 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 306,794.23 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 669,054,192.59 元，折合 669,054,192.59 份基金份额。本基金的基金管理人、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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、债券回购等)、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款(包括定期存款及协议存款)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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

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 关联方关系

6.4.7.1 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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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6月25日(基金合同生效日)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	1,275,058,250.10	31.40%	46,229,466.85	100.00%

6.4.8.1.2 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6月25日(基金合同生效日)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	19,578,630.90	41.79%	-	-

6.4.8.1.3 债券回购交易

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6月25日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例

东方证券股份 有限公司	-	-	370,000,000.00	100.00%
----------------	---	---	----------------	---------

6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本期末未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 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	1,135,903.73	31.33%	372,626.36	21.58%
关联方名称	上年度可比期间 2013年6月25日(基金合同生效日)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	41,849.32	100.00%	41,849.32	100.00%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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6月25日(基金合同生效日) 至2013年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	11,111,335.10	137,470.67
其中：支付销售机构的客 户维护费	5,461,179.46	72,991.49

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，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首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.8.2.2 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6月25日(基金合同生效 日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,851,889.28	22,911.77

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，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首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期末未与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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末未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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		上年度可比期间 2013 年 6 月 25 日(基金合同生效日)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	80,483,975.23	48,998.01	21,340.18	21,340.18

股份有限公司				
--------	--	--	--	--

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 41,373.93 元，2013 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日止期间的无利息收入，2014 半年末结算备付金余额为 5,019,914.54 元，2013 半年末无结算备付金余额。

6.4.8.6 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。

6.4.9 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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
300090	盛运股份	2013 年 9 月 25 日	2014 年 9 月 26 日	非公开发行流通受限	32.41	15.75	916,384	16,499,995.82	14,433,048.00	-
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	15,245	185,989.00	185,989.00	-

6.4.9.2 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
600418	江淮汽车	2014 年 4 月 15 日	重大重组停牌	10.20	2014 年 7 月 11 日	11.22	5,000,000	45,839,265.37	51,000,000.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

购金融资产款余额

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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	1,944,075,477.90	81.72
	其中：股票	1,944,075,477.90	81.72
2	固定收益投资	100,146,000.00	4.21
	其中：债券	100,146,000.00	4.21
	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	50,000,000.00	2.10
	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	85,503,889.77	3.59
7	其他各项资产	199,357,360.97	8.38
8	合计	2,379,082,728.64	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	18,419,972.37	0.79
C	制造业	1,297,119,654.63	55.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	114,082,453.68	4.89
F	批发和零售业	186,660,467.90	8.01

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	15,287,877.33	0.66
J	金融业	29,079,310.30	1.25
K	房地产业	44,147,685.74	1.89
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	128,027,035.44	5.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	31,848,000.00	1.37
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	79,403,020.51	3.41
S	综合	-	-
	合计	1,944,075,477.90	83.39

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002390	信邦制药	6,556,697	139,460,945.19	5.98
2	300144	宋城演艺	4,816,668	128,027,035.44	5.49
3	600867	通化东宝	7,066,054	92,070,683.62	3.95
4	000906	物产中拓	5,866,205	84,942,648.40	3.64
5	600352	浙江龙盛	5,129,593	82,842,926.95	3.55
6	300291	华录百纳	2,262,839	79,403,020.51	3.41
7	002094	青岛金王	6,538,789	74,542,194.60	3.20
8	000858	五粮液	4,000,000	71,720,000.00	3.08
9	002242	九阳股份	7,142,407	70,566,981.16	3.03
10	600998	九州通	5,255,489	70,370,997.71	3.02

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.99fund.com 网站的半年度报告正文。

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	000858	五 粮 液	119,201,422.81	15.32
2	002390	信邦制药	96,402,322.68	12.39
3	000559	万向钱潮	95,822,366.20	12.31
4	300146	汤臣倍健	89,251,787.70	11.47
5	300144	宋城演艺	84,402,269.50	10.84
6	600519	贵州茅台	82,607,731.87	10.61
7	002094	青岛金王	81,846,799.32	10.52
8	600998	九州通	79,111,055.32	10.17
9	600867	通化东宝	76,070,940.82	9.77
10	000906	物产中拓	72,320,320.41	9.29
11	002081	金 螳 螂	71,948,477.12	9.24
12	300291	华录百纳	64,541,452.82	8.29
13	600389	江山股份	61,057,635.37	7.85
14	000553	沙隆达 A	59,040,588.82	7.59
15	000671	阳 光 城	57,970,295.84	7.45
16	002242	九阳股份	56,292,380.91	7.23
17	000716	南方食品	53,596,387.45	6.89
18	000919	金陵药业	53,261,314.51	6.84
19	002382	蓝帆股份	46,553,806.58	5.98
20	002375	亚厦股份	44,821,107.38	5.76
21	600418	江淮汽车	43,016,383.54	5.53
22	601519	大智慧	40,597,661.75	5.22
23	002555	顺荣股份	38,701,289.45	4.97
24	600315	上海家化	37,494,470.92	4.82
25	600028	中国石化	35,533,927.00	4.57
26	002387	黑牛食品	34,339,620.64	4.41
27	002462	嘉事堂	33,037,095.62	4.24
28	300006	莱美药业	32,156,784.52	4.13
29	600352	浙江龙盛	31,703,693.23	4.07
30	002007	华兰生物	30,281,323.50	3.89
31	002005	德豪润达	30,066,736.01	3.86

32	600699	均胜电子	29,714,773.72	3.82
33	002192	路翔股份	29,597,734.46	3.80
34	000712	锦龙股份	28,063,997.85	3.61
35	000848	承德露露	27,876,636.91	3.58
36	002004	华邦颖泰	26,621,527.52	3.42
37	600549	厦门钨业	25,629,437.42	3.29
38	002713	东易日盛	25,104,727.76	3.23
39	000002	万 科 A	24,796,861.12	3.19
40	300072	三聚环保	23,689,480.07	3.04
41	000656	金科股份	22,996,840.02	2.95
42	002326	永太科技	22,491,771.49	2.89
43	002174	游族网络	21,905,905.10	2.81
44	300257	开山股份	20,951,163.44	2.69
45	600535	天士力	20,486,180.41	2.63
46	600429	三元股份	20,426,438.26	2.62
47	600588	用友软件	19,996,840.80	2.57
48	600594	益佰制药	19,691,939.70	2.53
49	300177	中海达	19,494,544.75	2.50
50	002563	森马服饰	19,195,898.02	2.47
51	600497	驰宏锌锗	19,037,543.14	2.45
52	600335	国机汽车	19,011,213.67	2.44
53	300005	探路者	18,929,439.29	2.43
54	000547	闽福发 A	17,398,286.23	2.24
55	600366	宁波韵升	17,053,225.98	2.19
56	002018	华星化工	16,083,304.03	2.07
57	300077	国民技术	15,894,088.27	2.04

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，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	000559	万向钱潮	75,201,258.62	9.66
2	000919	金陵药业	52,389,043.30	6.73
3	000858	五 粮 液	48,572,318.81	6.24
4	000671	阳 光 城	41,726,825.15	5.36
5	300077	国民技术	39,337,037.75	5.05

6	600315	上海家化	35,358,866.17	4.54
7	600028	中国石化	35,328,487.32	4.54
8	601519	大智慧	35,001,853.46	4.50
9	002390	信邦制药	33,705,727.48	4.33
10	002382	蓝帆股份	32,745,456.27	4.21
11	600519	贵州茅台	32,233,485.73	4.14
12	600699	均胜电子	31,868,331.21	4.09
13	300015	爱尔眼科	31,264,512.06	4.02
14	002005	德豪润达	28,732,618.69	3.69
15	600418	江淮汽车	27,168,706.34	3.49
16	002081	金螳螂	26,494,589.04	3.40
17	000848	承德露露	25,674,571.37	3.30
18	600549	厦门钨业	24,965,231.60	3.21
19	600389	江山股份	24,908,898.21	3.20
20	002375	亚厦股份	23,528,172.98	3.02
21	002174	游族网络	22,999,353.28	2.96
22	002309	中利科技	21,368,011.14	2.75
23	000712	锦龙股份	20,686,872.14	2.66
24	300177	中海达	20,445,772.04	2.63
25	300090	盛运股份	20,311,821.85	2.61
26	002563	森马服饰	20,306,779.53	2.61
27	300005	探路者	18,286,746.44	2.35
28	600352	浙江龙盛	17,793,620.67	2.29
29	002007	华兰生物	17,518,190.82	2.25
30	000547	闽福发 A	17,234,749.74	2.21
31	600429	三元股份	17,156,490.18	2.20
32	000656	金科股份	16,893,626.49	2.17
33	600594	益佰制药	16,666,587.22	2.14
34	300144	宋城演艺	16,468,301.74	2.12
35	000418	小天鹅 A	16,444,273.77	2.11
36	600335	国机汽车	16,315,690.03	2.10
37	002462	嘉事堂	15,587,475.22	2.00

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，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	2,625,305,516.60
卖出股票收入（成交）总额	1,439,368,390.33

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	100,146,000.00	4.30
	其中：政策性金融债	100,146,000.00	4.30
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	100,146,000.00	4.30

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	130322	13 进出 22	800,000	80,056,000.00	3.43
2	140204	14 国开 04	200,000	20,090,000.00	0.86

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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	873,754.47
2	应收证券清算款	80,050,723.87
3	应收股利	-
4	应收利息	3,465,604.36
5	应收申购款	114,967,278.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	199,357,360.97

7.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§ 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
24,200	80,278.15	328,183,300.48	16.89%	1,614,548,021.16	83.11%

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	1,816,086.60	0.09%

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	>=100
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6月25日）基金份额总额	669,054,192.59
本报告期期初基金份额总额	730,668,586.86
本报告期基金总申购份额	2,824,214,512.92
减：本报告期基金总赎回份额	1,612,151,778.14
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	1,942,731,321.64

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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	1,275,058,250.10	31.40%	1,135,903.73	31.33%	-
国金证券	2	392,553,257.33	9.67%	347,370.42	9.58%	-
联合证券	1	366,956,433.73	9.04%	324,720.40	8.96%	-
兴业证券	2	356,098,786.04	8.77%	315,111.23	8.69%	-
国信证券	1	311,901,296.76	7.68%	276,002.69	7.61%	-
华鑫证券	1	258,101,884.63	6.36%	234,975.31	6.48%	-
中信建投	1	203,881,712.67	5.02%	185,613.60	5.12%	-
齐鲁证券	2	182,421,745.46	4.49%	166,076.44	4.58%	-
中金公司	2	180,093,046.62	4.43%	159,364.94	4.40%	-
国都证券	1	153,022,853.29	3.77%	139,311.39	3.84%	-
招商证券	2	139,979,847.90	3.45%	123,868.31	3.42%	-
银河证券	2	95,829,833.25	2.36%	84,800.10	2.34%	-
民族证券	1	73,307,999.31	1.81%	66,739.73	1.84%	-
上海证券	1	57,398,234.63	1.41%	52,255.88	1.44%	-
东兴证券	1	11,156,481.81	0.27%	10,156.77	0.28%	-

安信证券	1	3,578,552.61	0.09%	3,257.93	0.09%	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	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	19,578,630.90	41.79%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	13,606,819.70	29.04%	150,000,000.00	13.04%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	13,665,327.40	29.17%	800,000,000.00	69.57%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	200,000,000.00	17.39%	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
厦门证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

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 40 个交易单元与汇添富成长焦点股票型证券投资基金、汇添富策略回报股票型证券投资基金共用。本报告期新增 1 家证券公司的 1 个交易单元:齐鲁证券(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:日信证券(上交所交易单元)。

汇添富基金管理股份有限公司
2014 年 8 月 25 日