

# 汇添富美丽 30 股票型证券投资基金 2014 年年度报告摘要

2014 年 12 月 31 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：2015 年 3 月 31 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 2015 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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 | 2,113,588,292.42 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   | 本基金的投资组合比例为：60%以上的基金资产投资于股票；其中投资于基金持仓比例最高的前 30 只股票的资产不低于非现金基金资产的 80%；其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行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。其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；基金持有单只中小企业私募债，其市值不得超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×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                 | 蒋松云                 |
|         | 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

|                     |                                  |
|---------------------|----------------------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.99fund.com                   |
| 基金年度报告备置地点          | 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 |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2014 年           | 2013 年 6 月 25 日 (基金合同生效日)–2013 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|--------------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 203,632,671.51   | 28,646,066.82                              |
| 本期利润          | 583,123,586.38   | 43,058,847.37                              |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.3685           | 0.0715                                     |
| 本期基金份额净值增长率   | 36.62%           | 6.50%                                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2014 年末          | 2013 年末                                    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1955           | 0.0619                                     |
| 期末基金资产净值      | 3,075,326,422.45 | 778,263,955.91                             |
| 期末基金份额净值      | 1.455            | 1.065                                      |

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。

4、本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 6 月 25 日，至本报告期末未满三年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日数据，特此说明。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

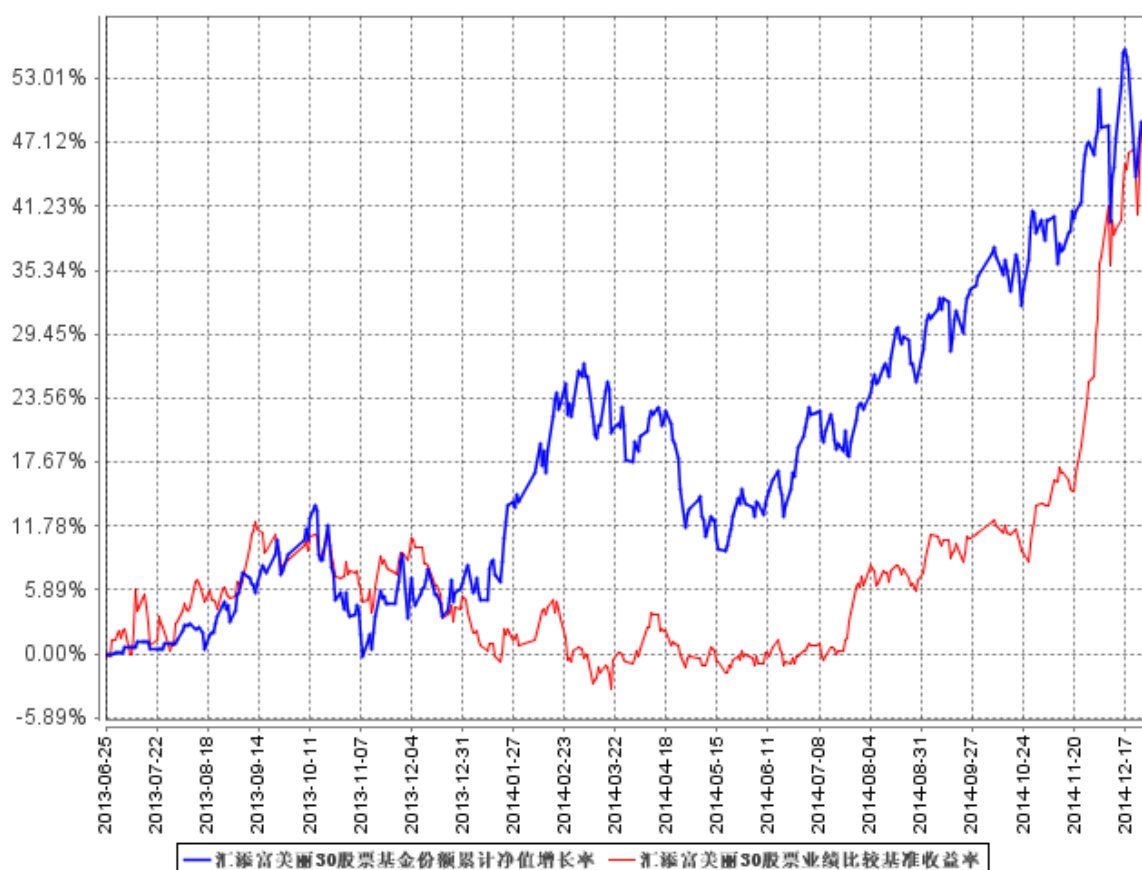
| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 8.02%    | 1.69%       | 35.99%     | 1.32%         | -27.97% | 0.37% |

|                 |        |       |        |       |         |       |
|-----------------|--------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去六个月           | 21.25% | 1.37% | 51.54% | 1.06% | -30.29% | 0.31% |
| 过去一年            | 36.62% | 1.31% | 43.49% | 0.97% | -6.87%  | 0.34% |
| 过去三年            | 0.00%  | 0.00% | 0.00%  | 0.00% | 0.00%   | 0.00% |
| 过去五年            | 0.00%  | 0.00% | 0.00%  | 0.00% | 0.00%   | 0.00% |
| 自基金合同生效日起至<br>今 | 45.50% | 1.25% | 51.76% | 0.99% | -6.26%  | 0.26% |

注：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 6 月 25 日，至本报告期末未满五年。

### 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

汇添富美丽30股票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

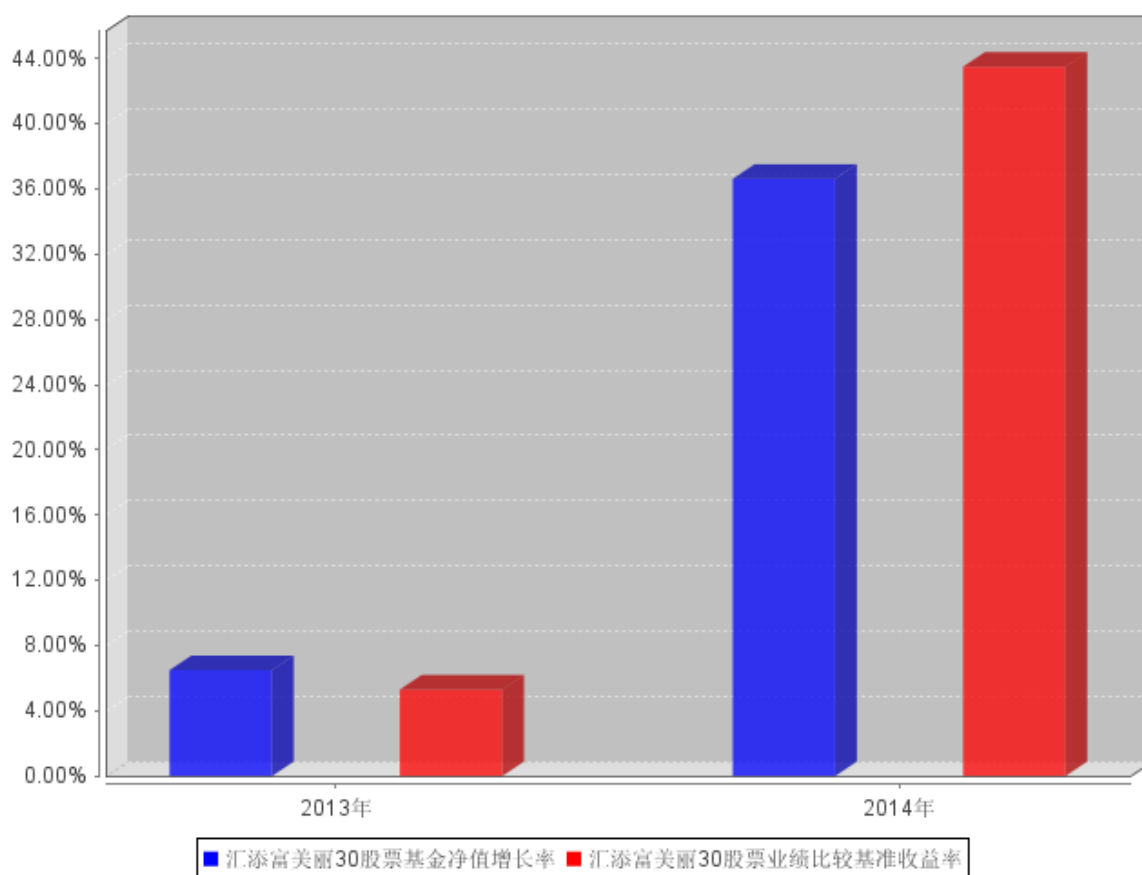


注：1. 本基金建仓期为自《基金合同》生效之日(2013 年 6 月 25 日)起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

2. 本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 6 月 25 日，至本报告期末未满五年。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富美丽30股票自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 6 月 25 日，至本报告期末未满五年。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金成立于 2013 年 6 月 25 日，2014 年度未进行利润分配。

## § 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成立于 2005 年 2 月，总部设在上海陆家嘴，公司旗下设立了北京、南方以及上海虹桥机场三个分公司，以及两个子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司(China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited)和汇添富资本管理有限公

司。

汇添富是中国第一批获得 QDII 业务资格、专户业务资格、设立海外子公司并且获得 RQFII 业务资格的基金公司，同时是全国社会保障基金投资管理人。在投资管理领域，汇添富已形成公募、专户、国际、养老金四大块业务以及股票、固定收益、被动投资、海外投资、另类投资五大块投资领域协同发展的格局。

截止 2014 年末，汇添富共管理 50 只证券投资基金，涵盖股票、指数、QDII、债券、货币市场基金等不同风险收益特征的产品。报告期内，汇添富共发行 6 只基金产品，包括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、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金。

汇添富始终坚持“以企业基本分析为立足点, 挑选高质量的证券，把握市场脉络，做中长期投资布局, 以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益”这一长期价值投资理念，并在投资研究中坚定地贯彻和执行。2014 年，汇添富取得了良好的整体投资业绩，准确把握市场节奏，精准布局产品线。旗下基金产品（除 QDII 产品）成立以来均实现正收益。其中逆向、美丽 30、价值、民营等基金位列全市场股票型基金前 1/4。

2014 年，汇添富专户业务快速发展，积极创新，推出了战略型定增专户、新股投资主题专户、海外市场 QDII 专户、企业现金管理专户等创新型产品。2014 年，公司成功获得包括国内全部大型保险公司在内的多家保险专户资格，获得多个专户组合并取得优异投资业绩。

2014 年，汇添富积极协助社保理事会研发新投资品种、参与社保产品设计和改造，并加强社保组合投资管理工作。目前公司的社保组合已经涵盖了股票、债券等品种，整体投资业绩优良。

2014 年，汇添富国际业务继续向前推进，香港子公司各项业务继续顺利推进，并成功发行添富主要消费 RQFII ETF 和医药 RQFII ETF，以及 RQFII 货币市场基金。同时加强国际机构合作，在北欧、中东都有业务推进。

2014 年，汇添富电子商务业务继续坚持“两条腿走路”，一方面加强公司官网直销能力优化客户体验，一方面继续加强跨界合作，目前汇添富电商合作伙伴已达 11 家。2014 年，“现金宝”品牌影响力进一步加强，现金宝 APP 成为下载和使用排名前十位的理财类手机应用中唯一由基金公司开发的应用。

2014 年，汇添富资本子公司发展良好，大力开展各类创新业务，推出按揭贷款收益权和供应链融资等创新业务。同时完成了大批规章制度和业务指引的修订，有力地保障公司运营合法有序。公司在 2014 年还涉足一级市场业务，积极参与了绿地集团增资扩股项目，成为第一家介入一级市

场并参与国企改革的公募基金公司。

2014 年，汇添富持续开展贴心的投资者服务与教育工作。公司围绕向“现代财富管理机构”转型的思路，从不同类型客户的切身需求出发，大力建设投顾式客户服务体系；同时，公司进一步着力开展“投资者见面会”、“添富之约”客户沙龙、投资者“走进汇添富”和“走进上市公司”等全方位的投资者服务与教育活动。

2014 年，汇添富社会责任事业进一步深入开展。“河流·孩子”助学计划启动第七季活动，公司公益基金会捐资在青海省海东地区互助县建设“添富小学”；为添富小学校长及优秀乡村教师提供国内外知名教育机构的师资培训；“河流·孩子”公益纪录片成功在全国范围公映；“添富之爱 感恩十年”公益行走遍六所添富小学，让汇添富的业务伙伴更加深入了解了汇添富的感恩文化。

2014 年，汇添富荣获了包括金牛基金奖、上海市金融创新二等奖、最佳债券公司奖、上海市五一劳动奖状、模范职工之家等多个重要奖项，行业地位进一步彰显。

展望 2015 年，是中国改革深化的关键之年，“互联网+”正式写入政府工作报告，财富管理行业也将在互联网和移动互联网的催化之下发生更加剧烈的变化。2015 年我们将继续为实现汇添富的梦想奋勇前行、为筑造中国梦添砖加瓦！

#### 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、汇添富美丽 30 股票基金的基金经理，股票投资副总监。 | 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 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司，先后任固定收益分析师和高级行业研究员，现任股票投资副总监。</p> <p>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</p> |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                         |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 日至今任<br>汇添富美<br>丽 30 股票<br>基金的基<br>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 公平交易制度和控制方法

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》，本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究环节，公司建立了统一的投研平台信息管理系统，公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时，通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。（2）在投资环节，公司针对基金、专户、社保分别设立了投资决策委员会，各委员会根据各自议事规则分别召开会议，在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略，独立制定资产配置计划和组合调整方案，并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。（3）在交易环节，公司实行集中交易，所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式，按照“时间优先、价格优先、比例分配”的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理，严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配，确保交易的公平性。（4）在交易监控环节，公司通过日

常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析方面，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。同时，投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

#### 4.3.2 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。报告期内，本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度，进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易行为监控体系由稽核监察部、集中交易室、投资研究部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的监控，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3 日、5 日）同向交易的样本，利用统计分析的方法和工具，根据对样本个数、差价率是否为 0 的 T 检验显著程度、差价率均值是否小于 1%、同向交易占优比等原因进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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%的交易次数共 8 次，其中因专户到期清盘发生 2 次、因基金流动性需要发生 3 次、因对冲策略发生 3 次，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 A 股市场整体大幅上涨，成长股在上半年延续了此前一年多的涨势，而价值股在下半年大幅上涨。宏观经济方面，国内经济在 2014 年一直比较低迷，房地产产业链的衰退以及政府基建投资的退出使得总需求持续不足。尽管本届政府坚持以结构调整为主的发展思路，但为了应对经济的衰退，货币政策自二季度开始出现了明显的转向。定向降准、抵押补充贷款（PSL）、中短期借贷便利（MLF、SLF）等新型货币政策工具被频繁使用，11 月央行直接将一年期存、贷款利率分别下调 0.25、0.4 个百分点，也意味着货币政策放松进入加速阶段。无风险利率的降低以及实体投资机会的缺乏共同驱动居民和产业资本提高在股票资产的配置，A 股市场由此收获了自 2009

年之后的最大涨幅。全年沪深 300 上涨 51.66%，中小板指数上涨 39.01%，创业板指数上涨 12.83%。分行业来看，非银金融、黑色金属、房地产、交通运输等行业涨幅居前，而医药生物、食品饮料、农林牧渔、传媒、电子等行业表现较差。

回顾 2014 年的基金运作，本基金在资产配置和行业配置上有得有失。成功之处是上半年把握住了医疗服务、新能源汽车的投资机会，下半年在互联网领域的投资也有所收获；不足之处是 11 月降息之后对价值股的配置比例不足，导致基金业绩在最后一个月大幅落后于基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年本基金的收益率为 36.62%，比业绩比较基准低 6.87%。

#### 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 2015 年，本基金的观点如下。第一，2015 年中央政府的政策目标中稳增长的重要性会明显上升，尤其是货币政策正在进入加速放松的阶段，央行在 2015 年可能会多次降息、降准，这将继续推动居民增加股票资产的配置。第二，尽管国内经济整体在 2015 年可能仍然会比较疲弱，但经过两年的结构转型之后部分行业、领域的经济效率有明显提升，新的增长亮点也在涌现。首先是互联网与传统产业的融合正在持续深入，在很多领域都会带来非常好的长期投资机遇。其次，部分传统制造业的产能在过去两年显著收缩，行业整体的定价能力增强，在上游资源价格普遍大幅下跌的背景下盈利能力有望大幅提升。最后，过去一年国企改革在部分企业已经收效明显，而在 2015 年的改革关键之年国企改革有望大范围推进，从而提升国有企业整体的经营效率。市场潜在的风险因素主要来自两个方面。首先，IPO 加速、注册制的推出以及新三板快速扩容等因素使得股票供给在 2015 年大幅增加，对部分概念大于实质的所谓成长股会有显著的负面影响。其次，过去两个季度美元指数已经上涨超过 10%，美联储加息可能会加速全球资本从新兴市场国家向美国的流动趋势，对人民币形成贬值压力，对国内整体资产价格形成负面冲击。

本基金在下一阶段重点关注以下方面的投资机会。第一，继续在互联网、医疗服务、新型消费领域寻找长期的优质成长股；第二，在传统制造业中寻找供给格局能够得到显著改善、并且受益于上游资源价格下跌的领域；第三，行业景气度能够平稳甚至向好的低估值蓝筹股；第四，国企改革。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司以维护基金份额持有人利益为宗旨，有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则，认真履行职责，通过常规稽核、专项检查 and 系统监控等方式方法积极开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，促进内

部控制和风险管理的不断改进，并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

#### （一）完善规章制度，健全内部控制体系

在本报告期内，督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估，并根据各项业务特点、业务发展实际，建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程，进一步明确了内部控制和风险管理责任，公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善，为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

#### （二）加强稽核监察，确保基金运作和公司经营合法合规

本报告期内，督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察，包括对基金投资交易行为、投资指标的监控，对投资组合的风险度量、评估和建议，对基金信息披露的审核、监督，对基金销售、营销的稽核、控制，对基金营运、技术系统的稽核、评估，切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

#### （三）强化培训教育，提高全员合规意识

本报告期内，督察长和稽核监察部门积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险意识、合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强内部控制和风险管理，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

### 4.7 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。

#### 4.8 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 2013 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 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年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师汤骏、蔺育化于 2015 年 3 月 27 日签字出具了安永华明（2015）审字第 60466941\_B28 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：汇添富美丽 30 股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产         | 本期末<br>2014 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |                         |                          |
| 银行存款        | 104,524,665.94          | 85,580,097.95            |
| 结算备付金       | 8,207,888.54            | 2,731,367.83             |
| 存出保证金       | 1,246,010.20            | 409,676.92               |
| 交易性金融资产     | 2,975,822,967.20        | 697,338,564.45           |
| 其中：股票投资     | 2,905,752,967.20        | 677,907,331.95           |
| 基金投资        | -                       | -                        |
| 债券投资        | 70,070,000.00           | 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    | -                       | 30,000,000.00            |
| 应收证券清算款     | 7,879,608.40            | 7,756,728.06             |
| 应收利息        | 1,879,937.63            | 74,171.74                |
| 应收股利        | -                       | -                        |
| 应收申购款       | 13,547,334.88           | 1,851,367.51             |

|                 |                                 |                                  |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 递延所得税资产         | -                               | -                                |
| 其他资产            | -                               | -                                |
| 资产总计            | 3,113,108,412.79                | 825,741,974.46                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2014 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>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          | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         | 19,534,161.99                   | 44,512,513.88                    |
| 应付赎回款           | 9,329,024.06                    | 1,337,287.55                     |
| 应付管理人报酬         | 3,548,227.42                    | 945,178.35                       |
| 应付托管费           | 591,371.23                      | 157,529.71                       |
| 应付销售服务费         | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 4,435,382.46                    | 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            | 343,823.18                      | 165,040.01                       |
| 负债合计            | 37,781,990.34                   | 47,478,018.55                    |
| <b>所有者权益:</b>   |                                 |                                  |
| 实收基金            | 2,113,588,292.42                | 730,668,586.86                   |
| 未分配利润           | 961,738,130.03                  | 47,595,369.05                    |
| 所有者权益合计         | 3,075,326,422.45                | 778,263,955.91                   |
| 负债和所有者权益总计      | 3,113,108,412.79                | 825,741,974.46                   |

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.269 元，基金份额总额 2,113,588,292.42 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目         | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2013 年 6 月 25 日(基金合同<br>生效日)至 2013 年 12 月 31<br>日 |
|-------------|-------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b> | 636,120,657.30                            | 51,386,056.35                                                |
| 1. 利息收入     | 3,642,209.91                              | 7,364,775.62                                                 |

|                            |                       |                      |
|----------------------------|-----------------------|----------------------|
| 其中：存款利息收入                  | 1,355,128.02          | 6,435,478.24         |
| 债券利息收入                     | 1,876,361.46          | 3,238.22             |
| 资产支持证券利息收入                 | -                     | -                    |
| 买入返售金融资产收入                 | 410,720.43            | 926,059.16           |
| 其他利息收入                     | -                     | -                    |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          | 243,734,230.31        | 28,870,528.99        |
| 其中：股票投资收益                  | 227,325,138.75        | 28,780,528.99        |
| 基金投资收益                     | -                     | -                    |
| 债券投资收益                     | 443,628.56            | -                    |
| 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                       | 15,965,463.00         | 90,000.00            |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 379,490,914.87        | 14,412,780.55        |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | -                     | -                    |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 9,253,302.21          | 737,971.19           |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>52,997,070.92</b>  | <b>8,327,208.98</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 29,684,819.98         | 4,787,152.50         |
| 2. 托管费                     | 4,947,470.05          | 797,858.73           |
| 3. 销售服务费                   | -                     | -                    |
| 4. 交易费用                    | 17,945,290.40         | 2,441,426.73         |
| 5. 利息支出                    | 2,271.99              | -                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 2,271.99              | -                    |
| 6. 其他费用                    | 417,218.50            | 300,771.02           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>583,123,586.38</b> | <b>43,058,847.37</b> |

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |                |                |
|------------------------|----------------------------------------|----------------|----------------|
|                        | 实收基金                                   | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）        | 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 | -                                      | 583,123,586.38 | 583,123,586.38 |

|                                        |                                                       |                   |                   |
|----------------------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| 润)                                     |                                                       |                   |                   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | 1,382,919,705.56                                      | 331,019,174.60    | 1,713,938,880.16  |
| 其中: 1. 基金申购款                           | 7,058,798,033.49                                      | 2,081,481,568.89  | 9,140,279,602.38  |
| 2. 基金赎回款                               | -5,675,878,327.93                                     | -1,750,462,394.29 | -7,426,340,722.22 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                                                     | -                 | -                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 2,113,588,292.42                                      | 961,738,130.03    | 3,075,326,422.45  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2013 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日 |                   |                   |
|                                        | 实收基金                                                  | 未分配利润             | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 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)               | -                                                     | 43,058,847.37     | 43,058,847.37     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | 61,614,394.27                                         | 4,536,521.68      | 66,150,915.95     |
| 其中: 1. 基金申购款                           | 616,730,042.48                                        | 39,791,973.01     | 656,522,015.49    |
| 2. 基金赎回款                               | -555,115,648.21                                       | -35,255,451.33    | -590,371,099.54   |
| 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)                        | 730,668,586.86                                        | 47,595,369.05     | 778,263,955.91    |

本报告 7.1 至 7.4 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 |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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）向社会公开发行募集，基金合同于 2013 年 6 月 25 日生效，首次设立募集规模为 669,054,192.59 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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 $\times$ 80%+中证全债指数收益率 $\times$ 20%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 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。

#### 7.4.4.1 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。

### 7.4.5 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；

#### 7.4.6 关联方关系

| 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       |

#### 7.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |                      | 上年度可比期间<br>2013 年 6 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日 |                      |
|-------|----------------------------------------|----------------------|---------------------------------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                                   | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                                                    | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |

|        |                  |        |                  |        |
|--------|------------------|--------|------------------|--------|
| 东方证券股份 | 3,540,403,928.43 | 28.46% | 1,177,609,079.01 | 64.57% |
|--------|------------------|--------|------------------|--------|

## 7.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |                      | 上年度可比期间<br>2013 年 6 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日 |                      |
|--------|----------------------------------------|----------------------|---------------------------------------------------------|----------------------|
|        | 成交金额                                   | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                                                    | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例 |
| 东方证券股份 | 19,578,630.90                          | 41.79%               | -                                                       | -                    |

## 7.4.6.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |                            | 上年度可比期间<br>2013 年 6 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日 |                            |
|--------|----------------------------------------|----------------------------|---------------------------------------------------------|----------------------------|
|        | 回购成交金额                                 | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 | 回购成交金额                                                  | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的比<br>例 |
| 东方证券股份 | -                                      | -                          | 5,005,000,000.00                                        | 75.87%                     |

## 7.4.6.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

## 7.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日                  |                |              |                  |
|--------|---------------------------------------------------------|----------------|--------------|------------------|
|        | 当期<br>佣金                                                | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额     | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 东方证券股份 | 3,146,623.15                                            | 28.32%         | 1,128,961.37 | 25.45%           |
| 关联方名称  | 上年度可比期间<br>2013 年 6 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日 |                |              |                  |
|        | 当期<br>佣金                                                | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额     | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 东方证券股份 | 1,053,651.83                                            | 64.48%         | 13,004.80    | 3.61%            |

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。

## 7.4.6.2 关联方报酬

### 7.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2013 年 6 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日 |
|-----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 29,684,819.98                          | 4,787,152.50                                            |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 11,528,275.37                          | 2,472,658.94                                            |

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，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，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、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。

### 7.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2013 年 6 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,947,470.05                           | 797,858.73                                              |

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，由基金托管人根据基金管理人的授权委

托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。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。

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.6.4.1 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及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.6.4.2 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。

#### 7.4.6.5 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<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |              | 上年度可比期间<br>2013 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日 |              |
|-------|----------------------------------------|--------------|-------------------------------------------------------|--------------|
|       | 期末余额                                   | 当期利息收入       | 期末余额                                                  | 当期利息收入       |
| 工商银行  | 104,524,665.94                         | 1,209,389.25 | 85,580,097.95                                         | 3,041,565.50 |

注：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 年度获得的利息收入为人民币 90,050.40 元(2013 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日止期间：人民币 58,489.65 元)，2014 年末结算备付金余额为人民币 8,207,888.54 元(2013 年末：人民币 2,731,367.83 元)。

#### 7.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

## 7.4.7 期末（ 2014 年 12 月 31 日 ）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.7.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

### 7.4.7.2 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 |
|--------|------|------------------|----------|--------|-----------------|--------|------------|----------------|----------------|----|
| 000906 | 物产中拓 | 2014 年 10 月 13 日 | 重大资产重组停牌 | 17.32  | 2015 年 1 月 30 日 | 16.00  | 4,600,000  | 50,738,727.19  | 79,672,000.00  | -  |
| 002009 | 天奇股份 | 2014 年 10 月 20 日 | 重大资产重组停牌 | 17.84  | 2015 年 1 月 28 日 | 17.93  | 530,083    | 8,958,427.10   | 9,456,680.72   | -  |
| 002018 | 华信国际 | 2014 年 11 月 19 日 | 重大资产重组停牌 | 14.16  | 2015 年 3 月 6 日  | 15.39  | 18,471,488 | 208,977,825.00 | 261,556,270.08 | -  |
| 300144 | 宋城演艺 | 2014 年 12 月 19 日 | 重大资产重组停牌 | 30.12  | 2015 年 3 月 18 日 | 33.13  | 3,606,704  | 88,770,464.44  | 108,633,924.48 | -  |
| 300168 | 万达信息 | 2014 年 12 月 31 日 | 重大事项停牌   | 46.20  | 2015 年 1 月 8 日  | 44.50  | 5,000,000  | 130,265,709.98 | 231,000,000.00 | -  |
| 300252 | 金信诺  | 2014 年 11 月 11 日 | 重大事项停牌   | 43.40  | 2015 年 1 月 28 日 | 46.99  | 542,843    | 17,778,441.72  | 23,559,386.20  | -  |

### 7.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.7.3.1 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。

#### 7.4.7.3.2 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。

## 7.4.8 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 7.4.8.1 公允价值

#### 7.4.8.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.8.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.8.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日, 本基金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中属于第一层次的余额为人民币 2,191,874,705.72 元, 属于第二层次的余额为人民币 783,948,261.48 元, 无第三层次余额。

##### 7.4.8.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

2014 年度, 对于以公允价值计量的金融工具, 由第一层次转入第二层次的投资的金额为人民币 56,044,365.33 元, 无由第二层次转入第一层次的投资的金额。

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

##### 7.4.8.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和上期末均不以第三层次公允价值计量。

#### 7.4.8.2 承诺事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.8.3 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。

#### 7.4.8.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2015 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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<br>(%) |
|----|--------|------------------|------------------|
| 1  | 权益投资   | 2,905,752,967.20 | 93.34            |
|    | 其中: 股票 | 2,905,752,967.20 | 93.34            |
| 2  | 固定收益投资 | 70,070,000.00    | 2.25             |
|    | 其中: 债券 | 70,070,000.00    | 2.25             |
|    | 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      | 112,732,554.48   | 3.62   |
| 7 | 其他各项资产            | 24,552,891.11    | 0.79   |
| 8 | 合计                | 3,113,108,412.79 | 100.00 |

## 8.2 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             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -                | -            |
| B  | 采矿业              | 69,200,000.00    | 2.25         |
| C  | 制造业              | 892,625,011.57   | 29.03        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -            |
| E  | 建筑业              | 66,741,969.00    | 2.17         |
| F  | 批发和零售业           | 301,508,123.64   | 9.80         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 102,316,346.52   | 3.33         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 501,105,154.36   | 16.29        |
| J  | 金融业              | 212,462,977.00   | 6.91         |
| K  | 房地产业             | 157,835,989.18   | 5.13         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 126,900,000.00   | 4.13         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 72,918,000.00    | 2.37         |
| 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               | 49,392,982.80    | 1.61         |
| Q  | 卫生和社会工作          | 66,207,602.00    | 2.15         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 239,919,477.13   | 7.80         |
| S  | 综合               | 46,619,334.00    | 1.52         |
|    | 合计               | 2,905,752,967.20 | 94.49        |

### 8.3 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  | 002018 | 华信国际 | 18,471,488 | 261,556,270.08 | 8.50         |
| 2  | 300168 | 万达信息 | 5,000,000  | 231,000,000.00 | 7.51         |
| 3  | 300059 | 东方财富 | 7,465,522  | 208,735,995.12 | 6.79         |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 1,939,100  | 144,870,161.00 | 4.71         |
| 5  | 600415 | 小商品城 | 10,000,000 | 126,900,000.00 | 4.13         |
| 6  | 300144 | 宋城演艺 | 3,606,704  | 108,633,924.48 | 3.53         |
| 7  | 000625 | 长安汽车 | 6,584,664  | 108,186,029.52 | 3.52         |
| 8  | 000024 | 招商地产 | 3,600,000  | 95,004,000.00  | 3.09         |
| 9  | 300291 | 华录百纳 | 2,743,379  | 83,261,552.65  | 2.71         |
| 10 | 002390 | 信邦制药 | 4,000,000  | 80,880,000.00  | 2.63         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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  | 002018 | 华信国际 | 225,061,129.03 | 28.92          |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 162,203,304.45 | 20.84          |
| 3  | 300168 | 万达信息 | 139,266,888.17 | 17.89          |
| 4  | 600415 | 小商品城 | 125,261,380.60 | 16.09          |
| 5  | 000625 | 长安汽车 | 123,760,592.80 | 15.90          |
| 6  | 000559 | 万向钱潮 | 123,347,504.88 | 15.85          |
| 7  | 600048 | 保利地产 | 119,929,720.21 | 15.41          |
| 8  | 300059 | 东方财富 | 119,348,734.57 | 15.34          |
| 9  | 000858 | 五粮液  | 119,201,422.81 | 15.32          |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 116,530,035.48 | 14.97          |
| 11 | 002390 | 信邦制药 | 115,950,661.86 | 14.90          |
| 12 | 300144 | 宋城演艺 | 114,201,961.46 | 14.67          |
| 13 | 600352 | 浙江龙盛 | 103,314,262.01 | 13.27          |
| 14 | 600645 | 中源协和 | 95,984,635.52  | 12.33          |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 15 | 002094 | 青岛金王 | 93,504,078.32 | 12.01 |
| 16 | 300291 | 华录百纳 | 93,454,903.35 | 12.01 |
| 17 | 300146 | 汤臣倍健 | 91,793,885.40 | 11.79 |
| 18 | 002713 | 东易日盛 | 91,432,987.81 | 11.75 |
| 19 | 002640 | 百圆裤业 | 91,199,483.97 | 11.72 |
| 20 | 000712 | 锦龙股份 | 90,986,296.81 | 11.69 |
| 21 | 002387 | 黑牛食品 | 90,078,226.74 | 11.57 |
| 22 | 002081 | 金螳螂  | 87,209,321.68 | 11.21 |
| 23 | 600867 | 通化东宝 | 86,910,315.82 | 11.17 |
| 24 | 000046 | 泛海控股 | 86,153,692.80 | 11.07 |
| 25 | 600418 | 江淮汽车 | 80,798,949.42 | 10.38 |
| 26 | 600998 | 九州通  | 80,617,030.32 | 10.36 |
| 27 | 000002 | 万科A  | 76,686,459.74 | 9.85  |
| 28 | 300006 | 莱美药业 | 75,739,741.72 | 9.73  |
| 29 | 000906 | 物产中拓 | 75,280,097.43 | 9.67  |
| 30 | 300166 | 东方国信 | 74,467,709.66 | 9.57  |
| 31 | 601898 | 中煤能源 | 73,849,113.67 | 9.49  |
| 32 | 600763 | 通策医疗 | 73,196,319.56 | 9.41  |
| 33 | 002102 | 冠福股份 | 71,400,862.57 | 9.17  |
| 34 | 002589 | 瑞康医药 | 71,087,456.92 | 9.13  |
| 35 | 000671 | 阳光城  | 70,301,825.30 | 9.03  |
| 36 | 002192 | 路翔股份 | 67,384,893.83 | 8.66  |
| 37 | 002568 | 百润股份 | 67,088,638.80 | 8.62  |
| 38 | 002170 | 芭田股份 | 66,197,169.78 | 8.51  |
| 39 | 000024 | 招商地产 | 64,375,322.00 | 8.27  |
| 40 | 600389 | 江山股份 | 61,057,635.37 | 7.85  |
| 41 | 600180 | 瑞茂通  | 60,176,181.29 | 7.73  |
| 42 | 000553 | 沙隆达A | 59,040,588.82 | 7.59  |
| 43 | 600897 | 厦门空港 | 58,651,468.64 | 7.54  |
| 44 | 000562 | 宏源证券 | 57,923,578.48 | 7.44  |
| 45 | 002242 | 九阳股份 | 56,292,380.91 | 7.23  |
| 46 | 600661 | 新南洋  | 55,693,880.05 | 7.16  |
| 47 | 002699 | 美盛文化 | 54,877,046.23 | 7.05  |
| 48 | 300131 | 英唐智控 | 54,667,132.54 | 7.02  |
| 49 | 000716 | 黑芝麻  | 53,596,387.45 | 6.89  |
| 50 | 000919 | 金陵药业 | 53,261,314.51 | 6.84  |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 51 | 601717 | 郑煤机   | 51,200,306.42 | 6.58 |
| 52 | 002594 | 比亚迪   | 51,196,010.66 | 6.58 |
| 53 | 601336 | 新华保险  | 50,944,121.71 | 6.55 |
| 54 | 300113 | 顺网科技  | 50,159,698.65 | 6.45 |
| 55 | 000547 | 闽福发 A | 49,464,961.81 | 6.36 |
| 56 | 600895 | 张江高科  | 48,550,503.14 | 6.24 |
| 57 | 300016 | 北陆药业  | 48,024,591.26 | 6.17 |
| 58 | 002285 | 世联行   | 47,314,224.82 | 6.08 |
| 59 | 002382 | 蓝帆医疗  | 46,553,806.58 | 5.98 |
| 60 | 002375 | 亚厦股份  | 44,821,107.38 | 5.76 |
| 61 | 600694 | 大商股份  | 42,983,484.61 | 5.52 |
| 62 | 002407 | 多氟多   | 42,237,582.16 | 5.43 |
| 63 | 600348 | 阳泉煤业  | 41,397,122.66 | 5.32 |
| 64 | 601519 | 大智慧   | 40,597,661.75 | 5.22 |
| 65 | 601012 | 隆基股份  | 38,749,882.79 | 4.98 |
| 66 | 002454 | 松芝股份  | 38,740,553.75 | 4.98 |
| 67 | 002555 | 顺荣股份  | 38,701,289.45 | 4.97 |
| 68 | 600184 | 光电股份  | 37,922,265.20 | 4.87 |
| 69 | 000800 | 一汽轿车  | 37,507,293.81 | 4.82 |
| 70 | 600315 | 上海家化  | 37,494,470.92 | 4.82 |
| 71 | 000572 | 海马汽车  | 37,307,542.98 | 4.79 |
| 72 | 300356 | 光一科技  | 35,740,513.52 | 4.59 |
| 73 | 600028 | 中国石化  | 35,533,927.00 | 4.57 |
| 74 | 002462 | 嘉事堂   | 33,037,095.62 | 4.24 |
| 75 | 300380 | 安硕信息  | 30,869,944.66 | 3.97 |
| 76 | 002007 | 华兰生物  | 30,281,323.50 | 3.89 |
| 77 | 000905 | 厦门港务  | 30,240,000.00 | 3.89 |
| 78 | 002005 | 德豪润达  | 30,066,736.01 | 3.86 |
| 79 | 600896 | 中海海盛  | 29,911,712.43 | 3.84 |
| 80 | 002004 | 华邦颖泰  | 29,729,737.52 | 3.82 |
| 81 | 600699 | 均胜电子  | 29,714,773.72 | 3.82 |
| 82 | 002581 | 万昌科技  | 29,132,643.05 | 3.74 |
| 83 | 600211 | 西藏药业  | 28,245,012.01 | 3.63 |
| 84 | 002488 | 金固股份  | 27,879,894.57 | 3.58 |
| 85 | 000848 | 承德露露  | 27,876,636.91 | 3.58 |
| 86 | 002385 | 大北农   | 26,773,379.53 | 3.44 |

|     |        |      |               |      |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 87  | 300072 | 三聚环保 | 26,595,983.97 | 3.42 |
| 88  | 601918 | 国投新集 | 26,475,648.40 | 3.40 |
| 89  | 600038 | 哈飞股份 | 25,765,082.89 | 3.31 |
| 90  | 600549 | 厦门钨业 | 25,629,437.42 | 3.29 |
| 91  | 601668 | 中国建筑 | 25,565,916.00 | 3.28 |
| 92  | 300096 | 易联众  | 25,456,719.47 | 3.27 |
| 93  | 000596 | 古井贡酒 | 25,141,192.62 | 3.23 |
| 94  | 300295 | 三六五网 | 24,492,047.92 | 3.15 |
| 95  | 600535 | 天士力  | 24,342,178.41 | 3.13 |
| 96  | 600594 | 益佰制药 | 23,477,939.70 | 3.02 |
| 97  | 000656 | 金科股份 | 22,996,840.02 | 2.95 |
| 98  | 002326 | 永太科技 | 22,491,771.49 | 2.89 |
| 99  | 002174 | 游族网络 | 21,905,905.10 | 2.81 |
| 100 | 600497 | 驰宏锌锗 | 21,675,166.14 | 2.79 |
| 101 | 000788 | 北大医药 | 21,400,570.81 | 2.75 |
| 102 | 300257 | 开山股份 | 20,951,163.44 | 2.69 |
| 103 | 600429 | 三元股份 | 20,426,438.26 | 2.62 |
| 104 | 300252 | 金信诺  | 20,323,164.45 | 2.61 |
| 105 | 002672 | 东江环保 | 20,070,536.20 | 2.58 |
| 106 | 600588 | 用友软件 | 19,996,840.80 | 2.57 |
| 107 | 000423 | 东阿阿胶 | 19,949,125.64 | 2.56 |
| 108 | 000980 | 金马股份 | 19,683,154.21 | 2.53 |
| 109 | 000762 | 西藏矿业 | 19,536,306.79 | 2.51 |
| 110 | 300177 | 中海达  | 19,494,544.75 | 2.50 |
| 111 | 300204 | 舒泰神  | 19,391,885.98 | 2.49 |
| 112 | 002563 | 森马服饰 | 19,195,898.02 | 2.47 |
| 113 | 600335 | 国机汽车 | 19,011,213.67 | 2.44 |
| 114 | 300005 | 探路者  | 18,929,439.29 | 2.43 |
| 115 | 600029 | 南方航空 | 18,663,729.34 | 2.40 |
| 116 | 600118 | 中国卫星 | 18,427,874.30 | 2.37 |
| 117 | 600367 | 红星发展 | 18,032,004.28 | 2.32 |
| 118 | 000768 | 中航飞机 | 17,157,658.10 | 2.20 |
| 119 | 600366 | 宁波韵升 | 17,053,225.98 | 2.19 |
| 120 | 000997 | 新大陆  | 17,048,306.04 | 2.19 |
| 121 | 300226 | 上海钢联 | 15,927,394.70 | 2.05 |
| 122 | 300077 | 国民技术 | 15,894,088.27 | 2.04 |

|     |        |      |               |      |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 123 | 600682 | 南京新百 | 15,858,708.44 | 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。

#### 8.4.2 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  | 600519 | 贵州茅台  | 162,150,361.05 | 20.83          |
| 2  | 000559 | 万向钱潮  | 144,660,931.32 | 18.59          |
| 3  | 000858 | 五 粮 液 | 125,644,743.65 | 16.14          |
| 4  | 600418 | 江淮汽车  | 125,520,349.30 | 16.13          |
| 5  | 002390 | 信邦制药  | 115,327,467.62 | 14.82          |
| 6  | 600352 | 浙江龙盛  | 113,953,718.05 | 14.64          |
| 7  | 002094 | 青岛金王  | 106,244,893.09 | 13.65          |
| 8  | 002081 | 金 螳 螂 | 102,615,509.23 | 13.19          |
| 9  | 600998 | 九州通   | 100,080,790.93 | 12.86          |
| 10 | 002387 | 黑牛食品  | 95,700,519.12  | 12.30          |
| 11 | 000046 | 泛海控股  | 87,921,294.12  | 11.30          |
| 12 | 002242 | 九阳股份  | 87,185,528.08  | 11.20          |
| 13 | 000712 | 锦龙股份  | 86,242,673.72  | 11.08          |
| 14 | 300146 | 汤臣倍健  | 85,496,336.65  | 10.99          |
| 15 | 000671 | 阳 光 城 | 81,054,901.24  | 10.41          |
| 16 | 002102 | 冠福股份  | 80,280,733.57  | 10.32          |
| 17 | 600048 | 保利地产  | 79,584,798.50  | 10.23          |
| 18 | 300006 | 莱美药业  | 78,906,782.86  | 10.14          |
| 19 | 000002 | 万 科 A | 77,667,052.10  | 9.98           |
| 20 | 600389 | 江山股份  | 73,408,319.67  | 9.43           |
| 21 | 300144 | 宋城演艺  | 72,995,235.73  | 9.38           |
| 22 | 300166 | 东方国信  | 71,940,554.81  | 9.24           |
| 23 | 002568 | 百润股份  | 70,471,733.34  | 9.05           |
| 24 | 002170 | 芭田股份  | 66,309,287.14  | 8.52           |
| 25 | 002375 | 亚厦股份  | 64,437,627.54  | 8.28           |
| 26 | 000716 | 黑芝麻   | 63,904,877.98  | 8.21           |
| 27 | 000562 | 宏源证券  | 58,769,691.02  | 7.55           |
| 28 | 000848 | 承德露露  | 57,934,516.37  | 7.44           |
| 29 | 600594 | 益佰制药  | 57,777,115.70  | 7.42           |
| 30 | 600867 | 通化东宝  | 57,269,044.27  | 7.36           |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 31 | 000553 | 沙隆达 A | 54,574,380.21 | 7.01 |
| 32 | 000919 | 金陵药业  | 52,389,043.30 | 6.73 |
| 33 | 300113 | 顺网科技  | 52,379,758.03 | 6.73 |
| 34 | 601336 | 新华保险  | 52,147,111.84 | 6.70 |
| 35 | 002382 | 蓝帆医疗  | 50,831,636.54 | 6.53 |
| 36 | 002007 | 华兰生物  | 50,675,559.30 | 6.51 |
| 37 | 002594 | 比亚迪   | 50,658,695.38 | 6.51 |
| 38 | 300090 | 盛运股份  | 47,971,197.33 | 6.16 |
| 39 | 002407 | 多氟多   | 47,863,729.49 | 6.15 |
| 40 | 002555 | 顺荣股份  | 42,594,950.45 | 5.47 |
| 41 | 600211 | 西藏药业  | 42,009,735.32 | 5.40 |
| 42 | 600348 | 阳泉煤业  | 41,293,452.26 | 5.31 |
| 43 | 300077 | 国民技术  | 39,337,037.75 | 5.05 |
| 44 | 000572 | 海马汽车  | 38,214,670.29 | 4.91 |
| 45 | 300356 | 光一科技  | 38,142,967.35 | 4.90 |
| 46 | 002454 | 松芝股份  | 37,980,673.82 | 4.88 |
| 47 | 601012 | 隆基股份  | 35,418,070.23 | 4.55 |
| 48 | 600315 | 上海家化  | 35,358,866.17 | 4.54 |
| 49 | 600028 | 中国石化  | 35,328,487.32 | 4.54 |
| 50 | 601519 | 大智慧   | 35,001,853.46 | 4.50 |
| 51 | 002018 | 华信国际  | 34,476,424.28 | 4.43 |
| 52 | 002004 | 华邦颖泰  | 32,892,942.71 | 4.23 |
| 53 | 002462 | 嘉事堂   | 32,572,105.04 | 4.19 |
| 54 | 002581 | 万昌科技  | 31,955,021.40 | 4.11 |
| 55 | 600699 | 均胜电子  | 31,868,331.21 | 4.09 |
| 56 | 000906 | 物产中拓  | 31,597,826.80 | 4.06 |
| 57 | 600661 | 新南洋   | 31,535,244.47 | 4.05 |
| 58 | 300015 | 爱尔眼科  | 31,264,512.06 | 4.02 |
| 59 | 601668 | 中国建筑  | 31,183,532.00 | 4.01 |
| 60 | 002005 | 德豪润达  | 28,732,618.69 | 3.69 |
| 61 | 601918 | 国投新集  | 28,432,146.29 | 3.65 |
| 62 | 002385 | 大北农   | 28,209,230.34 | 3.62 |
| 63 | 000596 | 古井贡酒  | 28,017,219.03 | 3.60 |
| 64 | 300072 | 三聚环保  | 27,818,577.11 | 3.57 |
| 65 | 002713 | 东易日盛  | 26,388,086.83 | 3.39 |
| 66 | 600535 | 天士力   | 25,210,887.18 | 3.24 |
| 67 | 600549 | 厦门钨业  | 24,965,231.60 | 3.21 |
| 68 | 300096 | 易联众   | 23,253,972.23 | 2.99 |

|     |        |       |               |      |
|-----|--------|-------|---------------|------|
| 69  | 002174 | 游族网络  | 22,999,353.28 | 2.96 |
| 70  | 002589 | 瑞康医药  | 22,916,074.62 | 2.94 |
| 71  | 600038 | 哈飞股份  | 22,861,635.57 | 2.94 |
| 72  | 601318 | 中国平安  | 22,308,970.53 | 2.87 |
| 73  | 002326 | 永太科技  | 21,882,162.58 | 2.81 |
| 74  | 002285 | 世联行   | 21,572,317.82 | 2.77 |
| 75  | 600497 | 驰宏锌锗  | 21,477,189.46 | 2.76 |
| 76  | 002309 | 中利科技  | 21,368,011.14 | 2.75 |
| 77  | 000980 | 金马股份  | 21,350,207.51 | 2.74 |
| 78  | 002672 | 东江环保  | 21,039,887.81 | 2.70 |
| 79  | 600645 | 中源协和  | 20,781,565.50 | 2.67 |
| 80  | 300177 | 中海达   | 20,445,772.04 | 2.63 |
| 81  | 002563 | 森马服饰  | 20,306,779.53 | 2.61 |
| 82  | 000423 | 东阿阿胶  | 20,306,022.97 | 2.61 |
| 83  | 300016 | 北陆药业  | 19,632,322.59 | 2.52 |
| 84  | 600029 | 南方航空  | 19,153,459.15 | 2.46 |
| 85  | 300204 | 舒泰神   | 19,079,801.20 | 2.45 |
| 86  | 300257 | 开山股份  | 18,545,917.69 | 2.38 |
| 87  | 000762 | 西藏矿业  | 18,516,007.98 | 2.38 |
| 88  | 300005 | 探路者   | 18,286,746.44 | 2.35 |
| 89  | 002488 | 金固股份  | 18,166,690.21 | 2.33 |
| 90  | 000768 | 中航飞机  | 18,133,056.99 | 2.33 |
| 91  | 000788 | 北大医药  | 17,566,941.11 | 2.26 |
| 92  | 600367 | 红星发展  | 17,384,030.95 | 2.23 |
| 93  | 300131 | 英唐智控  | 17,242,257.44 | 2.22 |
| 94  | 000547 | 闽福发 A | 17,234,749.74 | 2.21 |
| 95  | 000997 | 新大陆   | 17,206,000.53 | 2.21 |
| 96  | 600429 | 三元股份  | 17,156,490.18 | 2.20 |
| 97  | 300226 | 上海钢联  | 16,914,655.76 | 2.17 |
| 98  | 000656 | 金科股份  | 16,893,626.49 | 2.17 |
| 99  | 600187 | 国中水务  | 16,816,368.80 | 2.16 |
| 100 | 000418 | 小天鹅 A | 16,444,273.77 | 2.11 |
| 101 | 600335 | 国机汽车  | 16,315,690.03 | 2.10 |
| 102 | 300291 | 华录百纳  | 16,264,657.02 | 2.09 |
| 103 | 600682 | 南京新百  | 16,029,187.00 | 2.06 |

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。

### 8.4.3 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 | 7,028,994,130.04 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 5,411,897,518.71 |

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。

### 8.5 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      | 70,070,000.00 | 2.28         |
|    | 其中：政策性金融债 | 70,070,000.00 | 2.28         |
| 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        | 70,070,000.00 | 2.28         |

### 8.6 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  | 140444 | 14 农发 44 | 300,000 | 30,066,000.00 | 0.98         |
| 2  | 140204 | 14 国开 04 | 200,000 | 20,004,000.00 | 0.65         |
| 3  | 140213 | 14 国开 13 | 200,000 | 20,000,000.00 | 0.65         |

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1**

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、处罚的情形。

**8.12.2**

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。

**8.12.3 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   | 1,246,010.20  |
| 2  | 应收证券清算款 | 7,879,608.40  |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 1,879,937.63  |
| 5  | 应收申购款   | 13,547,334.88 |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 24,552,891.11 |

**8.12.4 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。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值    | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|---------------|----------|
| 1  | 300168 | 万达信息 | 231,000,000.00 | 7.51          | 重大事项停牌   |
| 2  | 300144 | 宋城演艺 | 108,633,924.48 | 3.53          | 重大资产重组停牌 |
| 3  | 002018 | 华信国际 | 261,556,270.08 | 8.50          | 重大资产重组停牌 |

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 36,556       | 57,817.82     | 639,796,206.67 | 30.27%     | 1,473,792,085.75 | 69.73%     |

### 9.2 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 | 7,393,166.83 | 0.35%    |

## § 10 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               | 7,058,798,033.49 |
| 减:本报告期基金总赎回份额             | 5,675,878,327.93 |
| 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              | 2,113,588,292.42 |

注：表内“总申购份额”含转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有举行基金份额持有人大会。

### 11.2 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，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，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，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，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，齐东超先生不再担任该基金的基金经理。

8、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。

9、基金管理人 2014 年 4 月 10 日公告，齐东超先生不再担任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理，由雷鸣先生单独管理该基金。

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、《汇添富移动互联股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 8 月 26 日正式生效，欧阳沁春先生任该基金的基金经理。

12、《汇添富环保行业股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 9 月 16 日正式生效，叶从飞先生任该基金的基金经理。

13、基金管理人 2014 年 10 月 25 日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富理财 7 天债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

14、基金管理人 2014 年 10 月 25 日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，与陆文磊先生共同管理该基金。

15、基金管理人 2014 年 11 月 27 日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富和聚宝货币市场基金的基金经理，与汤从珊女士共同管理该基金。

16、《汇添富外延增长主题股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 12 月 8 日正式生效，韩贤旺先生任该基金的基金经理。

17、《汇添富收益快钱货币市场基金基金合同》于 2014 年 12 月 23 日正式生效，陆文磊先生、徐寅喆女士共同任该基金的基金经理。

18、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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2013 年 6 月 25 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期末，应付未付的审计费用为人民币玖万元整。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 |        | 23,540,403,928.43 | 28.46%       | 3,146,623.15 | 28.32%     | -  |
| 齐鲁证券 |        | 21,086,245,841.76 | 8.73%        | 970,713.33   | 8.74%      | -  |
| 国信证券 | 1      | 928,402,984.22    | 7.46%        | 821,546.81   | 7.39%      | -  |
| 兴业证券 | 2      | 816,695,643.16    | 6.56%        | 723,816.98   | 6.51%      | -  |
| 联合证券 | 1      | 810,247,430.99    | 6.51%        | 716,988.64   | 6.45%      | -  |
| 银河证券 | 2      | 699,413,101.90    | 5.62%        | 619,051.44   | 5.57%      | -  |
| 东兴证券 | 1      | 604,463,682.58    | 4.86%        | 550,302.01   | 4.95%      | -  |

|      |   |                |       |            |       |   |
|------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 国金证券 | 2 | 526,197,369.41 | 4.23% | 466,736.96 | 4.20% | - |
| 华鑫证券 | 1 | 512,545,821.00 | 4.12% | 466,620.85 | 4.20% | - |
| 中信建投 | 1 | 491,169,792.18 | 3.95% | 447,159.56 | 4.02% | - |
| 中金公司 | 2 | 478,849,762.18 | 3.85% | 425,299.25 | 3.83% | - |
| 招商证券 | 2 | 470,191,456.17 | 3.78% | 416,072.37 | 3.74% | - |
| 财富证券 | 1 | 369,358,900.69 | 2.97% | 336,263.22 | 3.03% | - |
| 海通证券 | 1 | 249,656,941.28 | 2.01% | 227,286.62 | 2.05% | - |
| 国都证券 | 1 | 153,022,853.29 | 1.23% | 139,311.39 | 1.25% | - |
| 安信证券 | 1 | 148,562,320.96 | 1.19% | 135,250.71 | 1.22% | - |
| 国泰君安 | 2 | 134,693,001.04 | 1.08% | 119,190.44 | 1.07% | - |
| 上海证券 | 1 | 115,254,776.33 | 0.93% | 104,928.68 | 0.94% | - |
| 民族证券 | 1 | 91,461,888.58  | 0.74% | 83,266.94  | 0.75% | - |
| 长江证券 | 1 | 82,451,001.73  | 0.66% | 75,062.92  | 0.68% | - |
| 渤海证券 | 1 | 78,547,433.08  | 0.63% | 71,509.30  | 0.64% | - |
| 申银万国 | 1 | 53,055,717.79  | 0.43% | 48,301.57  | 0.43% | - |
| 广州证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 方正证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 德邦证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 中投证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 中银国际 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 北京高华 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 厦门证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 日信证券 | 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。

#### 11.7.2 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%       | -      | -              | -    | -            |

|      |               |        |                  |        |   |   |
|------|---------------|--------|------------------|--------|---|---|
| 齐鲁证券 | 13,665,327.40 | 29.17% | 1,020,000,000.00 | 72.08% |   |   |
| 国信证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 兴业证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 联合证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 银河证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 东兴证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 国金证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 华鑫证券 | 13,606,819.70 | 29.04% | 150,000,000.00   | 10.60% | - | - |
| 中信建投 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 中金公司 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 招商证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 财富证券 | -             | -      | 45,000,000.00    | 3.18%  | - | - |
| 海通证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 国都证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 安信证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 国泰君安 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 上海证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 民族证券 | -             | -      | 200,000,000.00   | 14.13% | - | - |
| 长江证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 渤海证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 申银万国 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 广州证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 方正证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 德邦证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 中投证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 中银国际 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 北京高华 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 厦门证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 日信证券 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 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 41 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，汇添富成长多因子量化策略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）。

汇添富基金管理股份有限公司  
2015 年 3 月 31 日