汇添富民营活力股票型证券投资基金

【2013】年度报告摘要

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3月26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2014年3月24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2013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	汇添富民营活力股票
基金主代码	470009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月5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	2,640,019,056.91份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用自下而上的方法,精选与中国经济发展密切相关的优秀民营企业上市公司股票进行投资布局,在科学严格管理风险的前提下,力求基金资产的中长期增值。
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成长性较高且估值有吸引力的优秀民营企业上市公司以获取超额收益。本基金通过投资于具有良好的公司治理结构、灵活的用人和分配机制、独特的核心竞争优势等突出特征的优秀民营企业,以分享优秀民营企业成长所带来的资本增值。
业绩比较基准	中证民营企业综合指数×80%+上证国债指数×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

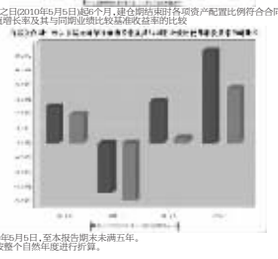
3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	259,751,353.89	-26,728,180.69	-94,575,849.26
本期利润	187,210,838.03	79,785,242.69	-164,729,882.78
加权平均基金份额本期利润	0.1458	0.1487	-0.2372
本期基金份额净值增长率	38.17%	17.45%	-20.78%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.0322	-0.0365	-0.0890
期末基金资产净值	3,250,525,334.90	543,304,015.89	536,403,969.44
期末基金份额净值	1.231	1.070	0.911

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.79%	1.46%	-1.45%	1.09%	-5.34%	0.37%
过去六个月	11.32%	1.45%	14.69%	1.11%	-3.37%	0.34%
过去一年	38.17%	1.39%	22.50%	1.16%	15.67%	0.23%
过去三年	28.56%	1.17%	-6.25%	1.16%	34.81%	0.01%
自基金合同生效日起至今	47.84%	1.19%	4.48%	1.22%	43.36%	-0.03%

注:本基金合同(《基金合同》)生效日为2010年5月5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

注:本基金建仓期为本(《基金合同》)生效之日(2010年5月5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。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金的《基金合同》生效日为2010年5月5日,至本报告期末未满五年。
2.合同生效当年按照实际存续期计算,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

单位:人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2013	2.500	335,436,116.01	286,412,554.03	621,848,670.04	
合计	2.500	335,436,116.01	286,412,554.03	621,848,670.04	

注:本基金2011年度和2012年度均未进行利润分配。

§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、南方两个分公司,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)与汇添富资本管理有限公司。
汇添富是中国第一批获取QDII业务资格、专户业务资格、设立海外子公司并且获得ROPII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,汇添富已形成分募、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、另类投资五大投资领域协同发展的格局。
截止2013年末,汇添富共管理45只证券投资基金,涵盖股票、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18只基金产品,包括汇添富理财21天、7天债券基金,汇添富消费行业股票型证券投资基金、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、中证主要消费50指数增强型证券投资基金、中证医药卫生50指数增强型证券投资基金、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、汇添富中证医药指数证券投资基金、汇添富中证能源指数证券投资基金、汇添富中证金融地产指数证券投资基金、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、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富全球现代制造股票证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深300指数证券投资基金、汇添富新兴产业股票证券投资基金、汇添富全球石油股票证券投资基金、汇添富双动力股票证券投资基金、汇添富核心价值股票证券投资基金、汇添富全球医疗保健股票证券投资基金、汇添富民营活力股票证券投资基金、汇添富全球互联股票证券投资基金、汇添富宝货币市场基金。
汇添富始终坚持"长期业绩本位主义"的投资理念,以研究为立足点,挖掘高质量的证券,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有效地贯彻和执行。2013年,汇添富取得了良好的整体投资业绩,在市场震荡起伏的背景下,公司旗下主动型基金基本上都获得正收益,切实为投资者赢得财富增长。
2013年,汇添富专户业务快速发展,在传统专户产品稳健扩容的基础上,还积极创新,不仅开发出基本面对冲、量化对冲等新型专户产品,并且实现了对冲策略的多元化。在2013年结构分化的复杂市场行情下,汇添富对冲系列专户产品依然为客户赢得了较好的正收益。
2013年,汇添富国际业务取得突破进展。2013年2月,汇添富与全球著名指数公司STOXX签署合作协议,宣布在中国发行的汇添富基金ETF产品获得了欧洲蓝筹股指数——2013年7月,汇添富STOXX 50指数(EURO STOXXX 50 Index)的跟踪指数,在第二只ROPII产品——汇添富沪深300指数ETF成功上市之际,汇添富资产管理(香港)有限公司还同步推出了其ETF系列产品的品牌——C-Shares。
2013年,汇添富电子商务业务实现跨越式发展,公司成立了电子金融总部,电商新力发展产保有量节节上升。汇添富在2013年不仅开华伟化了已投资者所熟悉的民营宝理财产品的收益及功能,更连续推出两只互联网客户专属的货币基金产品——"添富"现金宝"和"金添富"货币基金,并以开创基金电商直销新纪录和持续优异的投资业绩,成为互联网金融新时代一道靓丽亮目的资源风景线。
2013年,汇添富持续开展帮助个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。
2013年,汇添富社会责任事业进一步深入开展。"阳光7张子"助学计划启动第六季活动,公司公益基金会资金资助在湖北省恩施州利川市忠路镇建设"添富小学";为优秀乡村教师赴美国国内外知名教育机构参观学习进行奖励,爱的力量"系列公益教育活动,为贫困小学获赠学生等差拼图多日保暖套装。同时,汇添富还着力开展医疗救助、结对帮扶,国防拥军等社会公益活动,凭借慈善公益事业上的积极参与和突出贡献,2013年11月,汇添富基金"同成7张子"公益助学计划荣获"2013福建金融 陈家唯年度金融公益奖"。
展望2014年,行业转型发展的大变革将进一步深化,整个资管管理行业进入大政策竞争时代,互联网金融的崛起既是机遇更是挑战。汇添富基金将始终保持积极的心态,大力创新、脱意进取,积极把握机会,切实以"客户至上,做优优质资产"为己任,推动各项业务战略布局有效落实,为中国基金业的繁荣发展做出积极贡献。
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		
亦东超	汇添富成长焦点股票基金、汇添富民营活力股票基金的基金经理,股票投资副总监。	2010年5月5日	-	9年	硕士,中国、华历,清华大学工学硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾任海通证券研究所证券分析师,2005年4月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任行业分析师、研究总监助理、现任股票投资副总监。2009年2月2日至2009年7月27日任汇添富成长焦点股票基金的基金经理助理,2009年7月28日至今任汇添富成长焦点股票基金的基金经理,2010年5月5日至今任汇添富民营活力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聘任日期和解聘日期;
2.非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别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遵规守信情况的说明
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,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,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;贯穿了投权、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、投资研究氣候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。投资组合经理在投权范围内根据投资策略,独立制定投资决策,各投资组合经理决策时,公司要求投资决策委员会制定投资方案,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,所有交易执行在集中交易室实施,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。所有场外交易执行方由集中交易室处理,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、投资交易监控规则、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、场外交易价差、场外交易比例、投资交易指令的发出、执行、成交、分配、结算、估值、风控、绩效评估、投资组合经理、督察长、总经理审核等重要环节,当发生风格相似或同一投资管理下的投资组合之间业绩表现差异超过5%等情形时,将进行专项分析。同时,投资组合的定期报告还将对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集中交易室、稽核监察部和业绩上线部组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后全程核大式的监控,确保公平交易制度的执行情况。
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、5日、15日)同向交易的样本,对其进行了95%的置信区间,假设差价率为0的分布检验以及差价率均值的分析。分析结果表明,不同时间窗口下,公司各组合间实际差价率显著,差价率均值小于1%。
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。
4.3.3 异常交易行为的专项说明
本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内本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超过该证券当日总成交量5%的交易次数共14次,其中因指数基金建仓及成份股调整发生4次,因专户到期清盘发生4次,因基金流动性需要发生1次,因专户现金分红需要发生1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
2013年宏观经济情况回顾:1季度开始延续到3季度,经济稳定在"七上八下"的平台里,增长动力较弱,灾其期间,过去通过大量资本投入进行扩张拉动经济增长的旧模式已经出现瓶颈,环保、通胀的约束越发明显,积累的融资风险不断提高。为了和谐旧模式的转型,所以,金融风险积累,央行3季度开放宽松生面要变化,从中性转向中性偏紧,将对未来宏观经济走势产生显著的影响。央行分别于6月和年末两次向商业银行传递了中长期维持资金偏紧的信号,促使银行调整行为,引发流动性紧张的现象,导致市场利率大幅上升,社会融资成本高企,对实体经济形成较大压力。
从历史的角度,全面的深远影响本主要体现在制度变革和体制创新上(关于金融深化改革有了一些基本面和理论问题上取得了新的突破,必将持续推动中国发展转型。
与经济的发展趋势相对应,2013年的A股投资市场风格分化演绎到极致,周期、成长、消费不同风格的股票充分展示冰火两重天。全年创业板涨幅82.73%,而上证指数下跌6.75%。信息服务板块上涨70.45%,信息设备板块上涨51.66%,电子板块上涨42.78%;对比周期板块,采掘下跌31.18%,有色下跌29.64%,黑色金属板块下跌27.7%,房地产板块下跌11.94%。成长股一路高歌的背后是中国经济转型方向的持续支持,周期股持续低迷的背后也同样和传统经济增长模式无法持续相匹配。
我们在去年年报提出把聚焦高成长公司,对13年市场相对乐观的判断,基本契合的全年的市场走势,13年取得了较好的投资成绩。一季度,本基金集中在高成长板,以医药、消费为主;二季度增加互联网、油气服务等新兴产业高成长股票配置;三季度加大泛互联网领域的投资,四季度我们主意到无风险利率大幅上升,显著下降了股权投资,较好的规避了市场风险,但是集中持股的部分公司跌幅较大,组合净值的损失比较明显。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
本基金2013年度实现收益率为38.17%,战胜业绩基准15.67个百分点。本年度,持有人结构依然稳定,在此感谢基金持有人持续的肯定与支持。下半年规模扩张了近4倍,对基金操作风格产生一定压力。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
2014年货币政策仍会维持偏紧态势,中期来看无风险利率保持在较高水平,将推高社会融资成本。一季度末到二季度初可能有阶段性的流动性改善,但是整体货币环境是趋紧格局的背景,再叠加实际GDP增速的预期抬升,资金价格回落的幅度不会很大。当资金价格再度冲高时,经济潜在的风险点,如信托、融资平台等,随时可能爆发。基于以上因素,我们对2014年的股市,经济增速区间在7%-7.5%的下区间运行,并有信用风险爆发的风险。
但是也不必过于悲观。十八大拥有划时代的意义,国家领导人改革决心坚定,必将有更多强有力的改革政策推出;正在身边发生的科技革命浮胥着大量投资机遇。
展望未来,我们会在较长一段时间里维持短空长多的判断。
对于14年市场,有几点工作是我们要面对。第一,最大的机会仍是移动互联网的应用,正在快速改变我们的生活,冲击传统商业模式,重点关注和移动互联网结合的金融、移动支付和O2o、彩票、智能家居、游戏、影视、教育、医疗等;第二,随集中爆发出的行为共振和消费偏好,关注重磅电子产品watch、新能源汽车、LED等的机会;第三,计算机硬件国产化和软件投入加大的趋势刚刚开始;第四,环保治理背景下的产能收缩对部分原材料行业的价格冲击可能是新的投资方向。
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《证券投资基金会计核算业务指引》、《证券投资基金会计核算业务指引1》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》、《有值证券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历,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,可以提议调算某一投资品种的估值调整影响,并有权决定关议案但仅有一票表决权,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6次,每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日可供分配利润的10%,若(《基金合同》)生效不满3个月可不进行收益分配。
本基金于2013年11月4日实施利润分配,每份基金份额派发红利0.25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民营活力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,汇添富民营活力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民营活力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,不存在任何违规或合同违约行为。在本报告期内,公司在严格控制基金合同的规定进行。本报告期内,汇添富民营活力股票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621,848,670.04元。
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民营活力股票型证券投资基金2013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,认上内容真实、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,注册会计师陈 离、汤骏于2014年3月24日签字出具了安永华明(2014)审字第60469941_B11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:汇添富民营活力股票型证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产:		
银行存款	183,803,102.98	55,430,538.23
结算备付金	20,952,494.96	392,873.52
存出保证金	2,206,572.39	1,285,372.70
交易性金融资产	2,651,011,368.82	490,338,059.53
其中:股票投资	2,398,721,394.82	490,338,059.53
基金投资	-	-
债券投资	252,289,974.00	-
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	546,300,494.45	-
应收证券清算款	-	1,519,043.91
应收利息	3,465,067.08	9,467.53
应收股利	-	-
应收申购款	5,050,874.18	118,613.55
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,412,789,974.83	549,093,968.97

负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	144,960,120.31	2,967,646.22
应付赎回款	8,379,280.66	1,216,525.01
应付管理人报酬	4,131,142.52	646,695.11
应付托管费	688,523.78	107,782.51
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,864,097.81	639,095.93
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	241,474.85	212,208.30
负债合计	162,264,639.93	5,789,953.08
所有者权益:		
实收基金	2,640,019,056.91	507,538,447.03
未分配利润	610,506,277.99	35,765,568.86
所有者权益合计	3,250,525,334.90	543,304,015.89
负债和所有者权益总计	3,412,789,974.83	549,093,968.97

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.231元,基金份额总额2,640,019,056.91份。

7.2 利润表
会计主体:汇添富民营活力股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	237,768,304.55	94,059,111.30
1.利息收入	5,748,752.25	901,920.59
其中:存款利息收入	1,490,305.15	901,920.59
债券利息收入	1,561,015.06	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,697,432.04	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	301,288,913.13	-13,523,430.06
其中:股票投资收益	288,616,833.23	-17,345,614.97
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,635,302.32	-
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	11,036,777.58	3,822,184.91
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-72,540,515.86	106,513,423.38
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	3,271,155.03	167,197.39
减:二、费用	50,557,466.52	14,273,868.61
1.管理人报酬	25,682,270.26	7,926,471.24
2.托管费	4,280,378.38	1,321,078.46
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	20,141,940.38	4,577,705.91
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	452,877.50	448,613.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	187,210,838.03	79,785,242.69

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:汇添富民营活力股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	507,538,447.03	35,765,568.86	543,304,015.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	187,210,838.03	187,210,838.03
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)	2,132,480,609.88	1,009,378,541.14	3,141,859,151.02
其中:1.基金申购款	4,130,081,687.84	1,882,356,517.45	6,012,438,205.29
2.基金赎回款	-1,997,601,077.96	-872,977,976.31	-2,870,579,054.27
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)	-	-621,848,670.04	-621,848,670.04
五、期末所有者权益(基金净值)	2,640,019,056.91	610,506,277.99	3,250,525,334.90

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	588,807,373.20	-52,403,403.76	536,403,969.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	79,785,242.69	79,785,242.69
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)	-81,268,926.17	8,383,729.93	-72,885,196.24
其中:1.基金申购款	150,045,885.45	2,274,721.98	152,320,607.43
2.基金赎回款	-231,314,811.62	6,109,007.95	-225,205,803.67
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)	507,538,447.03	35,765,568.86	543,304,015.89

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 王小炼
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
汇添富民营活力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[2010]308号文《关于核准汇添富民营活力股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人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2010年5月5日正式生效,首次设立募集规模为1,407,531,401.76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。
本基金采用自下而上的方法,精选与中国经济发展密切相关的优秀民营企业上市公司股票进行投资布局,在科学严格管理风险的前提下,力求基金资产的中长期增值。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、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。本基金以民营企业上市公司为股票主要投资对象,投资于民营企业上市公司股票的资产占股票资产的比例不低于80%。本基金的业绩比较基准为:中证民营企业综合指数×80%+上证国债指数×20%。
7.4.2 会计报表的编制基础
本财务报表系按照中国财政部颁布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XBRL分类标准第3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)与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。
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2013年12月31日的财务状况以及2013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。
7.4.5 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。
7.4.6 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(管理人运用基金实类股票、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,暂不纳收企业所得税。
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。
7.4.7 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、基金注册登记机构、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
东航金戎控股有限责任公司	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、托管人及其高级管理人员
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

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31日 | | 上年度可比期间