汇添富社会责任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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	汇添富社会责任股票
基金主代码	470028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月29日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,410,809,383.74份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	精选积极履行社会责任,并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司,谋求基金资产的稳健增值。
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积极履行社会责任的优质上市公司,以谋求基金资产稳健增值。
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	李芳菲
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-63201816

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3月29日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益	504,183,086.83	-510,377,550.93	-205,794,322.68
本期利润	425,436,656.50	68,363,786.90	-585,594,544.34
加权平均基金份额本期利润	0.1871	0.0197	-0.1286
本期基金份额净值增长率	16.13%	2.13%	-15.60%
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	0.0008	-0.2000	-0.1561
期末基金资产净值	1,411,871,923.03	2,757,280,944.16	3,152,567,203.28
期末基金份额净值	1.001	0.862	0.844

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2011年3月29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2013年12月31日数据,特此说明。

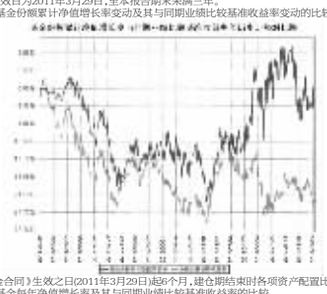
3.2 基金净值表现

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	-6.80%	1.53%	-3.03%	0.90%	-3.77%	0.63%
过去六个月	5.15%	1.63%	4.12%	1.03%	1.03%	0.60%
过去一年	16.13%	1.63%	-6.02%	1.12%	22.15%	0.51%
自基金合同生效日起至今	0.10%	1.23%	-22.19%	1.06%	22.29%	0.17%

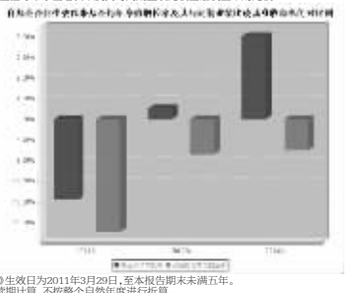
注:本基金的《基金合同》生效日为2011年3月29日,至本报告期末未满三年。

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(2011年3月29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:1.本基金的《基金合同》生效日为2011年3月29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2011年3月29日,2011年度、2012年度和2013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、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、中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证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——欧洲STOXX 50指数(EURO STOXX 50 Index)的独家授权。2013年7月,在第二只RQFII产品——汇添共享沪深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,电商客户及资产保有量节节上升。汇添富在2013年不仅升华优化了已为投资者所熟悉的现金宝账户的收益及功能,更连续推出两只互联网客户专属的纯电商货币基金产品——汇添富"现金宝"和"全额宝"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夺目的亮丽风景线。

2013年,汇添富持续开展缺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。

2013年,汇添富社会责任事业进一步深入开展。"河南7孩子"助学计划启动第六季活动,公司总基金会捐资在湖北省恩施州利川市忠路镇建设"添富小学";为优秀乡村教师赴提供国内外知名教育机构的师资培训;在北京和上海举行"添富乐跑,爱的力量"系列公益跑活动,为添富小学贫困学生等款捐赠冬日保暖套装。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长期坚持和突出贡献,2013年11月,汇添富基金"河流7孩子"公益助学计划荣获"2013温暖金融 陆家嘴年度金融公益杯——年度温暖奖"。

展望2014年,行业转型发展的大变革将进一步深化,整个财富管理行业进入大规业竞争时代,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、锐意进取,积极把握机会,切实以"客户至上,做好优质服务"为己任,推动各项业务战略布局有效落实,为中国基金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		
欧阳沁春	汇添富社会责任股票基金的基金经理。	2011年3月29日	-	12年	国籍:中国。学历:卫生部武汉生物制品研究所医学硕士,中欧国际工商学院工商管理硕士,上海交通大学财经法律专业硕士。曾任上海证券交易所法律部高级经理,中国网络安全产业联盟秘书长,中国网络安全产业联盟法律专家委员会主任委员,中国网络信息安全技术专家委员会委员。2006年9月加入汇添富基金管理股份有限公司任高级行业分析师,2007年3月至2007年6月担任汇添富均衡增长股票基金的基金经理助理,2007年6月18日至2012年3月2日任汇添富均衡增长股票基金的基金经理,2011年3月29日至今任汇添富社会责任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"分别按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《证券从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、投资交易监控周报、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、场外交易价差、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,当发生风格相似或同一投资经理管理的投资组合之间业绩夹现差异超过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集中交易室、投资研究部、稽核监察部和金融工程部组成,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即败盈率差异、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,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,公司各组合间买卖价差不显著,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14次,其中因指数基金建仓及成份股调整发生8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A股市场是个结构性的牛市:上证指数下跌4.41%,创业板指数上涨83.22%。市场表现分化十分严重:信息服务、信息技术和电子元器件等TMT表现显前,而以银行和地产为代表的大盘蓝筹股表现落后。

2013年一季度我们投资组合一直兼顾成长与价值股的投资,导致本基金一季度业绩落后,二季度以后,我们投资组合一直处于高仓位状态,持续进行成长股的投资,我们在增长潜力比较大的消费品行业进行了中长期的布局,我们也进行了中盘成长股的投资,主要集中在电子行业、传媒和天然气产业链,我们根据行业产业政策的变化,调整了医药行业的配置比例。比较遗憾的是,我们在表现最好的传媒行业研究与投资力度不足,整体而言,本基金本期表现差强人意。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年本基金年收益率16.13%,同期业绩比较基准收益率-6.02%。

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2014年,我们持谨慎的态度:面对中国经济增速逐步放缓的情势,新一届政府采取了经济结构调整和转型升级的执政思路,而且随着对地方政府投融资平台的规范、政府消费行为的限制、银行表外融资的规范,我们认为消费、基建投资等行业短期趋于悲观,股市缺乏向上整体实业基础;实业资本的大幅度减持和IPO大量发行也会压制市场的估值。整体A股市场未来一段时间可能表现不会太理想,但是结构性牛市的基础依然存在,经济在转型过程中依然会催生不少盈利大幅增长的股票。市场依然会以板块的阶段性表现和个股分化为其主要特征。我们在行业配置方面会重点关注移动互联网、消费类电子和大健康产业中的投资机会,聚焦确定性强、能够穿越周期的真正具备成长性的个股进行中长期投资。

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签订了《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,每份基金份额每次分配比例不得低于该次收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)每份基金份额可供分配利润的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

在托管汇添富社会责任股票型证券投资基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《汇添富社会责任股票型证券投资基金基金合同》、《汇添富社会责任股票型证券投资基金托管协议》的约定,对汇添富社会责任股票型证券投资基金管理人一汇添富基金管理股份有限公司 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,汇添富基金管理股份有限公司在汇添富社会责任股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务会信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的汇添富社会责任股票型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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(普通特殊合伙人)审计,注册会计师陈露、汤骏于2014年3月24日签字出具了安永华明(2014)审字第60466941_B15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:汇添富社会责任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	28,872,318.55	399,293,467.23
结算备付金	5,088,726.94	4,977,120.80
存出保证金	1,166,231.35	3,000,000.00
交易性金融资产	1,362,750,670.96	2,388,395,077.69
其中:股票投资	1,313,160,670.96	2,285,439,780.89
基金投资	-	-
债券投资	49,590,000.00	102,955,296.80
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	-	-
应收证券清算款	51,854,826.51	-
应收利息	907,805.21	2,449,114.40
应收股利	-	-
应收申购款	169,303.22	27,018.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,450,809,882.74	2,798,141,798.13
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	32,680,819.91	28,871,752.30
应付赎回款	939,413.59	2,739,238.11
应付管理人报酬	1,816,502.95	3,311,271.03
应付托管费	302,750.49	551,878.53
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,987,567.79	2,171,172.12
应交税费	-	-
应付利息	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,210,904.98	3,215,541.88
负债合计	38,937,959.71	40,860,853.97
所有者权益:		
实收基金	1,410,809,383.74	3,198,148,074.76
未分配利润	1,062,539.29	-440,867,130.60
所有者权益合计	1,411,871,923.03	2,757,280,944.16
负债和所有者权益总计	1,450,809,882.74	2,798,141,798.13

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.001元,基金份额总额1,410,809,383.74份。

7.2 利润表

会计主体:汇添富社会责任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	494,051,635.12	138,685,256.05
1.利息收入	3,173,158.09	10,770,992.24
其中:存款利息收入	1,039,726.74	3,381,101.31
债券利息收入	1,967,773.86	1,733,879.63
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	165,657.49	5,656,011.30
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	568,980,627.72	-451,208,788.03
其中:股票投资收益	557,124,127.12	-478,404,570.12
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,500,624.54	-
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	9,355,876.06	27,195,782.09
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-78,746,430.33	578,741,337.82
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	644,279.64	381,714.02
减:二、费用	68,614,978.62	70,321,469.15
1.管理人报酬	32,748,623.48	44,763,707.18
2.托管费	5,458,104.06	7,460,617.80
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	29,923,556.36	17,610,708.54
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	484,694.72	486,435.63
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	425,436,656.50	68,363,786.90

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富社会责任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)	3,198,148,074.76	-440,867,130.60	2,757,280,944.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	425,436,656.50	425,436,656.50
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)	-1,787,338,691.02	16,493,013.39	-1,770,845,677.63
其中:1.基金申购款	241,280,678.27	3,531,784.48	244,812,462.75
2.基金赎回款	-2,028,619,369.29	12,961,228.91	-2,015,658,140.38
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)	1,410,809,383.74	1,062,539.29	1,411,871,923.03

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)	3,735,497,479.45	-582,930,276.17	3,152,567,203.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	68,363,786.90	68,363,786.90
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)	-537,349,404.69	73,699,358.67	-463,650,046.02
其中:1.基金申购款	43,481,171.99	-5,978,804.41	37,502,367.58
2.基金赎回款	-580,830,576.68	79,678,163.08	-501,152,413.60
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)	3,198,148,074.76	-440,867,130.60	2,757,280,944.16

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

汇添富社会责任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]1887号文(关于核准汇添富社会责任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股份有限公司(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2011年3月29日正式生效,首次设立募集规模为5,622,650,211.18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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金精选积极履行社会责任,并具有良好的公司治理结构,诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司,谋求基金资产的稳健增值。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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表表External格式中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定以下合称"企业会计准则")编制,同时,在具体会计核算科目及披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁发的《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。

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间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]132号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金有关税收问题的通知》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税税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应税税所得额;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、基金销售机构、基金注册登记机构
中国农业银行股份有限公司	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
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

7.4.8 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 2012年1月1日至2012年12月31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	6,534,551,230.57	33.78%	3,447,929,358.91	29.85%

7.4.8.1.2 债券交易

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 2012年1月1日至2012年12月31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	53,467,549.40	48.92%	-	-

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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	
	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	100,000,000.00	41.95%	100,000,000.00	4.03%

7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

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			
	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	5,843,144.56	33.73%	38,910.35	1.96%

关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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	2,939,165.09	29.65%	584,607.57	27.00%

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于:交易手续、证券结算风险基金和上海证券交易所实(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费