汇添富价值精选股票型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2013年8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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富价值精选股票
基金主代码	519069
前端交易代码	519069
后端交易代码	519070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年1月23日
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
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	4,018,966,863.46份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选价值相对低估的优质公司股票,在有效管理风险的前提下,追求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×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风险较高收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	赵会军
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半年度报告备置地点	上海市富城路99号震旦国际大楼21层汇添富基金管理有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	475,357,700.76
本期利润	219,173,090.98
加权平均基金份额本期利润	0.0627
本期基金份额净值增长率	8.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1806
期末基金资产净值	5,103,257,845.92
期末基金份额净值	1.270

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。

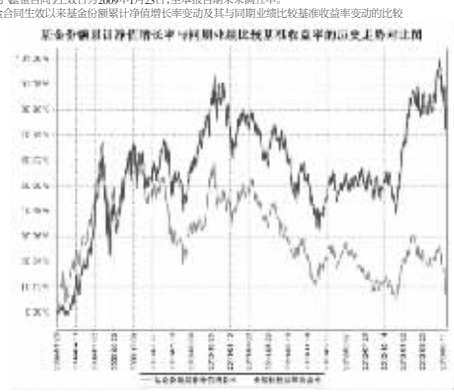
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-8.63%	1.97%	-12.39%	1.49%	3.76%	0.48%
过去三个月	-0.24%	1.41%	-9.27%	1.16%	9.03%	0.25%
过去六个月	8.31%	1.43%	-9.88%	1.20%	18.19%	0.23%
过去一年	19.09%	1.24%	-7.83%	1.09%	26.92%	0.15%
过去三年	25.91%	1.22%	-9.33%	1.10%	35.24%	0.12%
自基金合同生效日起至今	81.79%	1.35%	8.99%	1.25%	72.80%	0.10%

注:本基金的《基金合同》生效日为2009年1月23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》生效之日起2009年1月23日6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金戎控股有限责任公司共同发起设立,经中国证监会证监基金字[2005]5号文批准,于2005年2月3日正式成立,注册资本金为1亿元人民币。截止到2013年6月30日,公司管理证券投资基金规模逾650亿元,基金份额持有人户数近200万,资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理33只开放式证券投资基金,形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征,较为完善、有效的产品线,包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金(A级、B级)、汇添富均衡增长股票型证券投资基金、汇添富成长焦点股票型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富保本混合型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、汇添富可转换债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)、深证300交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财30天债券型证券投资基金、汇添富理财60天债券型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富理财28天债券型证券投资基金、汇添富收益线线货币市场基金、汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金、汇添富消费行业股票型证券投资基金、汇添富理财7天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽30股票型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈晓翔	汇添富价值精选股票型证券投资基金的基金经理,股票投资副总监。	2009年1月23日	-	12年	国籍:中国。学历:南京理工大学产业经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任宁波中粮国际仓储运输有限公司业务员、华泰证券有限责任公司行业研究员、上海申银万国研究所有限责任公司行业研究员、建信基金管理有限公司行业研究员。2007年4月加入汇添富基金管理有限公司任行业研究员,现任股票投资副总监。2009年1月23日至今任汇添富价值精选股票型证券投资基金的基金经理,2010年1月8日至2012年3月2日任汇添富均衡增长股票型基证券投基金的基金经理。

注:1.基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期;

2.非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合,交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿公了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为2次,分别是由于基金流动性需要、专户组合到期清算卖出证券所致。

本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

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

上半年,全球货币市场跌宕起伏,1-5月在美国和日本两大市场大幅上涨的带动下,全球股市总体表现强劲。然而进入六月后,市场风云突变,在美联储暗示将考虑合适时机逐步退出QE,及投资者对安倍经济学质疑声音越来越大的背景下,美日股市都出现显著的调整,并引发恐慌情绪导致大量资金撤离新兴市场。A股市场,一二月份沪深两市延续了去年底的反弹走势,然而此后影子银行、货币空转等现象引发越来越多的担忧,出口疲软、产能过剩等问题导致工业企业利润增长乏力,在国内新一届政府显示了去杠杆、控风险的坚定决心、央行强硬表态要盘活货币存量回收过剩流动性的影响下,沪深股市出现先扬后抑的走势,尤其在六月份上证指数连续击穿2300-1900的连续5个整数位,创出2009年来的新低。不过,在市场整体下跌的过程中,成长股与价值股两极分化愈演愈烈,以医药、TMT为代表的新兴产业和消费行业出现了明显的结构性行情。

上半年沪深300指数跌幅达12.8%,与此相对应,创业板大幅上涨41.7%。分行业看,信息服务、电子元器件、医药、信息设备等行业逆势大涨15%以上居涨幅榜前列,而表现最差的采掘、有色金属、黑色金属等蓝筹周期性行业跌幅超过20%。

谨富价值在上半年延续了以自下而上选股为主的投资策略,在继续保持估值处于历史低位的金融、地产等价值型股票的较高配置比例的同时,通过寻找估值合理、具有持续成长能力的优质成长股的投资机会,使投资组合相对比较基准获得了一定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年上半年,谨富价值收益8.31%,同期业绩比较基准收益率为-9.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们认为国内外经济形势总体仍较为乐观。海外各大经济体中,除美国经济基本摆脱衰退困扰出现较强的复苏信号外,日本、欧洲目前还看不到摆脱困境的明显迹象。而国内经济处于转型调结构的关键时期,去杠杆、去产能是今后一两年的主旋律,因此以重化工业为代表的周期性行业还处在下行周期短期难言见底。但是我们认为目前中央政府采取的去杠杆、控风险、促转型的宏观经济政策是正确的选择,对中国经济长期可持续发展是有利的。从市场估值角度看,虽然目前很多中小市值公司估值偏高,但以银行、地产为代表的大盘蓝筹股估值处于历史低位,有一批蓝筹股的分红收益率已经具备较大的吸引力,这在A股历史上是较为罕见的。蓝筹股的估值低反应了部分国内外投资者对中国长期经济前景过于悲观的心态。因此,我们认为下半年A股市场仍存在结构性投资机会。我们将继续保持积极的心态和充分的耐心,通过自下而上深入研究寻找具有良好盈利模式、优秀管理团队、合理估值水平的公司,重点关注"基本面良好而估值较低的蓝筹股"以及"估值合理且具备持续成长能力的优质成长股"两个方向来构建组合,力争通过中长期持股来获取长期较好的回报。

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出具本基金管理人对外公告。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由投资研究部、产品创新部、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会,负责研究、指导基金估值业务,估值委员会成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,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,可以提议调整某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的15%,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1月23日实施利润分配,每份基金份额派发红利0.01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

2013年上半年,本基金托管人在对汇添富价值精选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

2013年上半年,汇添富价值精选股票型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富价值精选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,汇添富价值精选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27,929,922.76元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理有限公司编制和披露的汇添富价值精选股票型证券投资基金2013年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:汇添富价值精选股票型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	404,429,961.34	204,965,529.81
结算备付金	9,712,351.74	12,119,066.11
存出保证金	1,965,453.77	2,043,262.82
交易性金融资产	4,923,958,759.02	2,864,540,488.26
其中:股票投资	4,667,814,009.02	2,813,715,744.26
基金投资	-	-
债券投资	256,144,750.00	50,824,744.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	40,696,220.10	361,870.10
应收利息	2,639,492.49	499,189.51
应收股利	10,977,250.00	-
应收申购款	17,006,203.26	11,787,639.77
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,411,385,691.72	3,096,317,046.38
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30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	-	1,637,225.65
应付赎回款	296,330,910.11	40,450,570.29
应付管理人报酬	6,429,580.77	3,515,896.58
应付托管费	1,071,596.79	585,982.76
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,557,535.75	2,486,602.50
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	738,222.38	212,758.26
负债合计	308,127,845.80	48,889,036.04
所有者权益:		
实收基金	4,018,966,863.46	2,578,508,161.26
未分配利润	1,084,290,982.46	468,919,849.08
所有者权益合计	5,103,257,845.92	3,047,428,010.34
负债和所有者权益总计	5,411,385,691.72	3,096,317,046.38

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.270元,基金份额总额4,018,966,863.46份。

6.2 利润表

会计主体:汇添富价值精选股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	272,742,512.94	238,932,823.57
1.利息收入	2,283,310.28	1,733,710.84
其中:存款利息收入	1,025,715.58	666,508.29
债券利息收入	965,882.44	1,044,763.76
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	291,712.26	22,438.79
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	524,234,864.36	-94,803,167.30
其中:股票投资收益	459,688,295.91	-121,746,060.62
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6,173,937.02	2,338,059.54
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	58,372,631.43	24,604,833.78
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-256,184,609.78	331,156,635.21
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,408,948.08	845,644.82
减:二、费用	53,569,421.96	34,194,627.74
1.管理人报酬	33,390,626.75	20,190,586.84
2.托管费	5,565,104.40	3,365,097.75
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	14,360,522.35	10,415,144.63
5.利息支出	27,548.83	-
其中:卖出回购金融资产支出	27,548.83	-
6.其他费用	225,619.63	223,798.52
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	219,173,090.98	204,738,195.83

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富价值精选股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,578,508,161.26	468,919,849.08	3,047,428,010.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	219,173,090.98	219,173,090.98
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)	1,440,458,702.20	424,127,965.16	1,864,586,667.36
其中:1.基金申购款	3,351,072,881.38	991,578,565.43	4,342,651,446.81
2.基金赎回款	-1,910,614,179.18	-567,450,600.27	-2,478,064,779.45
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)	-	-27,929,922.76	-27,929,922.76
五、期末所有者权益(基金净值)	4,018,966,863.46	1,084,290,982.46	5,103,257,845.92
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,763,595,253.57	-14,393,861.57	2,749,201,392.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	204,738,195.83	204,738,195.83
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)	-461,075,980.51	-17,623,667.62	-478,699,648.13
其中:1.基金申购款	421,299,707.45	17,962,621.90	439,262,329.35
2.基金赎回款	-882,375,687.96	-35,586,289.52	-917,961,977.48
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)	2,302,519,273.06	172,720,666.64	2,475,239,939.70

注:报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

林利军 陈如桐 王小练

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富价值精选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")证监基金字[2008]1317号文《关于同意汇添富价值精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由汇添富基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2009年1月23日生效,首次设立募集规模为1,512,522,680.68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为汇添富基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金坚持长期价值投资的理念,采用深入的"自下而上"的公司基本面分析方法,精选价值相对低估的优质公司进行投资布局,通过科学的组合管理,实现投资目标。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的公开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。谨富价值精选基金采用灵活积极的资产配置和股票投资策略。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称《企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会公告的《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XBRL模板第3号《年度报告和半年度报告》》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2013年6月30日的财务状况以及2013年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券《股票》交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整出出让方按证券《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、开放式证券投资基、上市交易的股票、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、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、证券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

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、证监会财税[2012]85号《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,对证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得,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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金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	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东方证券股份有限公司	2,211,104,495.79	22.16%	2,328,818,041.84	34.84%

6.4.8.1.2 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6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东方证券股份有限公司	-	-	50,250,423.28	19.34%

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券股份有限公司	-	-	60,000,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 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6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	1,996,590.60	22.22%	368,018.80	10.35%
	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日			
关联方名称	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	1,961,526.64	34.99%	1,152,458.24	40.37%

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

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	33,390,626.75	20,190,586.84
其中:支付销售机构的客户维护费	2,252,263.90	649,136.95

注:1.基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:H=E×1.50%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,565,104.40	3,365,097.75

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金与关联方于本报告期及上年度可比期间均未通过银行间同业市场进行债券(回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
基金合同生效日(2009年1月23日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	0.00	47,480,912.67
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	0.00	47,480,912.67
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	2.06%

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金的主要股东及其控制的机构本报告期末及上年度可比期末均未持有本基金份额。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	404,429,961.34	885,900.61	162,113,067.13	610,497.64

注:由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入包含了关联方保管的银行存款期末余额、除了最低备付金以外的结算备付金期末余额及当期产生的利息收入。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本期及上年度可比期间均未参与在承销期内关联方承销证券。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002004	华邦颖泰	2013年2月7日	2014年2月8日	非公开发行流通受限	14.03	14.05	4,000,000	56,120,000.00	56,200,000.00	-

6.4.9.2