汇添富上证综合指数证券投资基金

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	汇添富上证综合指数
基金主代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月1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	5,134,000,783.79份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于6%,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性,主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%且年化跟踪误差小于6%的投资目标。
业绩比较基准	上证综合指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
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	-221,217,838.11	-111,074,602.48	-20,377,404.52
本期利润	-170,421,309.99	246,925,598.99	-1,048,848,625.33
加权平均基金份额本期利润	-0.0314	0.0400	-0.1641
本期基金份额净值增长率	-5.26%	5.70%	-20.11%
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	-0.2797	-0.2402	-0.2810
期末基金资产净值	3,697,986,241.78	4,550,559,670.25	4,438,404,254.07
期末基金份额净值	0.720	0.760	0.719

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。

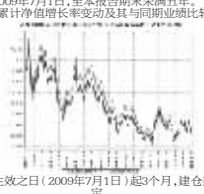
3.2 基金净值表现

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	-3.10%	0.99%	-2.56%	0.93%	-0.54%	0.06%
过去六个月	7.46%	1.08%	6.57%	1.02%	0.89%	0.06%
过去一年	-5.26%	1.15%	-6.39%	1.10%	1.13%	0.05%
过去三年	-20.00%	1.09%	-23.35%	1.08%	3.35%	0.01%
自基金合同生效日起至今	-28.00%	1.27%	-26.98%	1.26%	-1.02%	0.01%

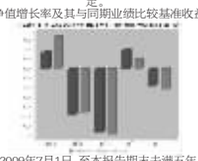
注:本基金的《基金合同》生效日为2009年7月1日,至本报告期末未满五年。

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(2009年7月1日)起3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2009年7月1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、另类投资五大块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产品获得了欧洲监考股指数——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——添富共赢沪深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瞩目夺目的亮丽风景线。

2013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,大力建设热线式客户服务体系;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。"问流?孩子"助学计划启动第六季活动,公司公益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筹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、捐助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"问流?孩子"公益助学计划荣获"2013温暖金融 陆家嘴年度金融公益榜——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混业竞争时代,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		
吴振翔	汇添富上证综合指数、汇添富深证300ETF联接、汇添富深证300ETF基金、汇添富中证主要消费ETF、中证医药卫生ETF、中证能源ETF、中证金融地产ETF、汇添富沪深300安中指数基金的基金经理,金融工程部总监助理。	2010年2月5日	-	7年	国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员,上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理、2008年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、现任金融工程部总监助理。2010年1月8日至2010年2月4日任汇添富上证综合指数基金的基金经理助理,2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理,2011年9月16日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金的基金经理,2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理,2013年8月23日至今任中证主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金的基金经理。
赖中立	汇添富上证综合指数、汇添富深证300ETF、汇添富深证300ETF联接基金的基金经理助理,汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)的基金经理。	2012年2月15日	-	6年	国籍:中国。学历:北京大学中国经济研究中心金融学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格、从业经历:曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司任金融工程部分析师。2012年2月15日至今任汇添富上证综合指数基金、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理助理,2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)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,严格按照各合约要求,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(1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。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,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,其中因股票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

回顾13年,众多对经济金融影响重大的事件纷至沓来,上证指数走势一波三折。基本面上,一季度宏观数据向好,市场反应积极,但后续宏观数据显示经济复苏乏力,部分行业产能过剩的现实和结构调整的需求导致兼投资拉动经济的老路不可持续;资金面上,利率市场化进程步步推进,资金一直处于偏紧的状态;外围市场上,渐行渐近的量宽退出给新兴市场带来了不小的压力;这些因素都导致了在过去的一年里大盘蓝筹股缺乏系统性机会,成为"虎头蛇尾"的一年。但一些转机正在酝酿之中,新一届中央不回避问题,积极改革,三中全会决议立意深远,鼓舞人心,市场因此积极响应,在11月份迎来了一波上涨,但进入12月以来,由于资金面紧张、IPO重启、美联储宣布削减QE等一系列事件,指数再次进入下跌通道。

报告期内,本基金遵循指数基金的被动投资原则,保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位报告期内基本保持在92%~96%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。本基金对抽样复制组合继续采取缩小试调整,降低了冗余的交易量。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内上证综指下跌6.75%,基准下跌6.39%,本基金在报告期内累计收益率为-5.26%,收益率超越业绩比较基准1.13%。收益率的差异因素主要来源于期间成份股分红、日常申购赎回等因素。本基金日均跟踪误差为0.0835%,这一跟踪误差水平远低于合同约定上限,在报告期达到了投资目标。

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14年,短期来看,随着利率市场化的推进和降杠杆的需求,资金面仍将偏紧,对A股上涨有一定制约;但中长期看,随着中央各项改革措施的逐步落实,一些困扰经济运行的长期问题将得到逐步解决,经济结构将得到有效调整,全要素生产力也将持续提高,A股必然会迎来估值的修复。从外围市场看,美、欧、日等三大股市目金融危机以来陆续走出熊市,发达经济体的复苏有益于我国出口的改善;OE削减虽对新兴市场资产价格有所影响,但目前市场已对此有所反映,同时我国良好的经济基础和宏观调控能力也可以抵消OE削减的负面影响。

目前大盘股估值较低,同时机构持有仓位较低,已经反应了较为悲观的预期,继续大幅下跌的空间较小。而随着改革的推进和经济数据的好转,大盘股票很可能迎来"逆袭"。上证指数作为市场标杆,可能会有较好的表现。

作为被动投资的指数型基金,汇添富上证综合指数基金将严格遵守基金合同,继续坚持既定的指数化投资策略,积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。

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、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,保持估值政策程序的一致性。

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:每年度6月和12月的最后一个交易日每份基金份额可供分配利润超过0.02元时,至少将期末可供分配利润的20%进行收益分配。本基金2013年6月30日可供分配基金份额利润为-0.3304元,2013年12月31日可供分配基金份额利润为-0.2797,未达到收益分配的基准,因此本年度本基金未进行利润分配。

§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

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,773,517.80	0.10
8	其他	-	-
9	合计	3,773,517.80	0.10

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	110024	隧道转债	18,580	1,816,380.80	0.05
2	110020	南山转债	17,400	1,585,662.00	0.04
3	113006	深燃转债	3,750	371,475.00	0.01

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.9 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投资贵金属。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无股指期货持仓。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

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	414,038.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	52,535.61
5	应收申购款	242,342.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	708,916.80

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110020	南山转债	1,585,662.00	0.04

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未进行积极投资,不存在流通受限的情况。

§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(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
98,234	52,262.97	783,918,379.63	15.27%	4,350,082,404.16	84.73%

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	128,658.55	0.00%

注:1)本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0。

2)该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为0。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年7月1日)基金份额总额	9,097,758,651.47
本报告期期初基金份额总额	5,989,415,010.04
本报告期基金总申购份额	1,340,083,982.66
减:本报告期基金总赎回份额	2,195,498,208.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,134,000,783.79

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、《汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金基金合同》于2013年1月24日正式生效,曾刚先生任该基金的基金经理。

2、基金管理人2013年2月8日公告,增聘曾刚先生担任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理,王珏池先生不再担任该基金的基金经理。

3、基金管理人2013年2月8日公告,增聘陈加荣先生担任汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理,陆文磊先生不再担任该基金的基金经理。

4、基金管理人2013年2月8日公告,增聘陈加荣先生担任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理,王珏池先生不再担任该基金的基金经理。

5、基金管理人2013年3月30日公告,增聘梁珂先生担任汇添富可转换债券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。

6、《汇添富消费行业股票型证券投资基金基金合同》于2013年5月3日正式生效,朱晓亮先生任该基金的基金经理。

7、基金管理人2013年5月11日公告,王栩先生不再担任汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理,由周睿先生单独管理该基金。

8、基金管理人2013年5月11日公告,苏竞先生不再担任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理,由王栩先生单独管理该基金。

9、《汇添富理财7天债券型证券投资基金基金合同》于2013年5月29日正式生效,曾刚先生任该基金的基金经理。

10、《汇添富实业债债券型证券投资基金基金合同》于2013年6月14日正式生效,曾刚先生任该基金的基金经理。

11、《汇添富美丽30股票型证券投资基金基金合同》于2013年6月25日正式生效,王栩先生任该基金的基金经理。

12、《汇添富高息债债券型证券投资基金基金合同》于2013年6月27日正式生效,陈加荣先生任该基金的基金经理。

13、基金管理人2013年8月1日公告,增聘涉从娜女士担任汇添富货币市场基金的基金经理,王珏池先生不再担任该基金的基金经理。

14、《中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2013年8月23日正式生效,吴振翔先生任该基金的基金经理。

15、《中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2013年8月23日正式生效,吴振翔先生任该基金的基金经理。

16、《中证能源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2013年8月23日正式生效,吴振翔先生任该基金的基金经理。

17、《中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2013年8月23日正式生效,吴振翔先生任该基金的基金经理。

18、《汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2013年9月6日正式生效,陈加荣先生任该基金的基金经理。

19、《汇添富现金宝货币市场基金基金合同》于2013年9月12日正式生效,曾刚先生任该基金的基金经理。

20、基金管理人2013年9月16日公告,增聘汪泽先生担任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,与吴振翔先生共同管理该基金。

21、基金管理人2013年9月16日公告,增聘汪泽先生担任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,与吴振翔先生共同管理该基金。

22、基金管理人2013年9月16日公告,增聘汪泽先生担任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,与吴振翔先生共同管理该基金。

23、基金管理人2013年9月16日公告,增聘汪泽先生担任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,与吴振翔先生共同管理该基金。

24、《汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金基金合同》于2013年11月6日正式生效,吴振翔先生任该基金的基金经理。

25、《汇添富互利分级债券型证券投资基金基金合同》于2013年11月6日正式生效,陆文磊先生任该基金的基金经理。

26、基金管理人2013年11月11日公告,增聘汪泽先生担任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,吴振翔先生不再担任该基金的基金经理。

27、基金管理人2013年11月11日公告,增聘汪泽先生担任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理,吴振翔先生不再担任该基金的基金经理。

28、《汇添富安心中国债券型证券投资基金基金合同》于2013年11月22日正式生效,何昊先生任该基金的基金经理。

29、基金管理人2013年11月23日公告,增聘朱晓亮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,叶从飞先生共同管理该基金,苏竞先生不再担任该基金的基金经理。

30、基金管理人2013年11月23日公告,增聘叶从飞先生担任汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,苏竞先生不再担任该基金的基金经理。

31、《汇添富双利增强债券型证券投资基金基金合同》于2013年12月3日正式生效,曾刚先生任该基金的基金经理。

32、《汇添富新收益债券型证券投资基金基金合同》于2013年12月10日正式生效,梁珂先生任该基金的基金经理。

33、《汇添富全额宝货币市场基金基金合同》于2013年12月13日正式生效,陆文磊先生、苏丛娜女士任该基金的基金经理。

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(2009年7月1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捌万元整。

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	2	1,212,841,156.52	73.73%	1,104,168.38	73.73%	-
兴业证券	1	203,478,170.57	12.37%	185,246.43	12.37%	-
东吴证券	1	96,903,693.91	5.89%	88,221.28	5.89%	-
中投证券	1	69,339,064.02	4.22%	63,125.44	4.22%	-
国海证券	2	57,354,950.44	3.49%	52,215.98	3.49%	-
长城证券	1	4,998,564.27	0.30%	4,550.80	0.30%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1)基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

(2)交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3)投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。

(4)每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5)调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。

(6)成交量分配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:报告期内,本基金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、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、深证300交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、中证医药卫生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、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金共用。本报告期新增4家证券公司的5个交易单元:信达证券证券(深交所交易单元)、恒泰证券(上交所交易单元)、联讯证券(上交所交易单元)、瑞银证券(上交所交易单元和深交所交易单元)。

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。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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