汇添富消费行业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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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5月3日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富消费行业股票
基金主代码	000083
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月3日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	513,344,397.04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投资方法,以基本面分析为立足点,精选消费行业的优质上市公司,结合市场脉络,做中长期布局,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期稳健增值。
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消费行业中商业模式独特、竞争优势明显,具有长期持续增长模式、估值水平相对合理的优质上市公司。
业绩比较基准	中证主要消费行业指数×40%+中证可选消费行业指数×40%+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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	田青
	联系电话	021-28932888	010-67595096
	电子邮箱	service@99fund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-9918	010-67595096
传真		021-28932998	010-66275853

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5月3日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	39,316,973.45
本期利润	58,243,343.43
加权平均基金份额本期利润	0.1110
本期基金份额净值增长率	13.90%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.0896
期末基金资产净值	584,797,004.95
期末基金份额净值	1.139

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5月3日,至本报告期末未满一年,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。

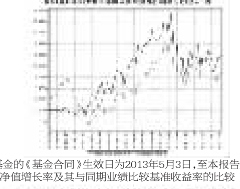
3.2 基金净值表现

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	-2.90%	1.42%	-1.63%	1.15%	-1.27%	0.27%
过去六个月	12.11%	1.24%	13.46%	1.06%	-1.35%	0.18%
自基金合同生效日起至今	13.90%	1.10%	10.09%	1.08%	3.81%	0.02%

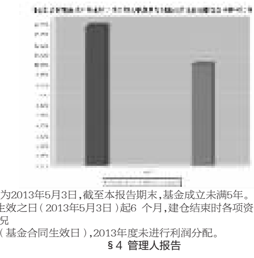
注:本基金的《基金合同》生效日为2013年5月3日,至本报告期末未满一年。

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:本基金的《基金合同》生效日为2013年5月3日,至本报告期末未满一年。

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



注:本基金的《基金合同》生效日为2013年5月3日,截至本报告期末,基金成立未满5年。

本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年5月3日)起6 个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金成立于2013年5月3日(基金合同生效日),2013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——添富共享沪深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耀眼夺目的亮丽风景线。

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、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?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		
朱晓亮	汇添富消费行业股票基金、汇添富均衡增长股票基金的基金经理,汇添富保本混合基金、汇添富可转换债券基金的基金经理助理。	2013年5月3日	-	6年	国籍:中国。学历:上海财经大学金融学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2007年5月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任行业分析师、高级行业分析师,2013年5月3日至今任汇添富消费行业股票基金的基金经理,2013年8月1日至今任汇添富保本混合基金、汇添富可转换债券基金的基金经理助理,2013年11月22日至今任汇添富均衡增长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

今年以来结构性行情是市场的主节奏,代表传统经济的银行、地产以及投资产业链相关股票持续下跌,而代表经济转型和新经济的环保、消费、传媒、互联网等各类行业则是大幅上涨,牛股频出。

本基金在操作上坚持自下而上的投资方法,围绕消费升级和新消费这一核心趋势进行布局,主要投资集中在了日化、旅游、中药、乳业、传媒、环保等相关行业,同时对家电和汽车等传统行业的优势公司进行了布局,表现略高于业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

从2013年5月成立以来,本基金净值上涨13.90%,跑赢业绩基准3.81%。同期沪深300下跌4.88%,中小板上涨10.58%。

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,我们维持之前的判断,在转型的背景下,投资机会依然集中在转型相关的产业。经济增长回归到一个更加合理的水平,流动性相对平稳,市场整体看机会不大,大部分产能过剩的制造业和周期性行业缺乏系统性机会,而代表消费升级、新消费以及经济结构调整的相关行业依然会是最重要的投资主题。

从消费基金的投资范围出发,在消费升级和移动互联网兴起的大背景下,我们继续看好会受益消费结构变化的日化、旅游、中药、乳业、传媒、互联网消费等行业,具体如下:

1、传统消费品行业中看好三类投资机会:

(1)受益消费结构变化的行业,如度假休闲游、乳业;

(2)有中国文化特色的消费品公司,如中药消费品;

(3)互联网时代的品牌逆袭,强产品力企业迎来互联网浪潮;

2、看好移动互联网普及带来的新消费行业,视频、游戏、教育以及产业链中的支付环节;

3、价值股中,看好汽车、家电中市场份额能够持续提升的优势公司;

4、非消费行业看好医药以及环保相关行业:包括医院、医药流通、环保以及环保导致产能收缩的行业。

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12次,每次收益分配比例不得低于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5月3日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间未进行利润分配。

§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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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,注册会计师陈露、汤俊于2014年3月24日签字出具了安永华明(2014)审字第60466941_B30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:汇添富消费行业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
资 产:	
银行存款	26,528,214.92
结算备付金	2,527,887.73
存出保证金	283,785.99
交易性金融资产	497,848,938.82
其中:股票投资	475,941,338.82
基金投资	-
债券投资	21,907,600.00
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	50,000,000.00
应收证券清算款	8,127,561.99
应收利息	392,965.48
应收股利	-
应收申购款	845,854.90
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	586,555,209.83
负债和所有者权益	本期末 2013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	-
应付赎回款	480,006.04
应付管理人报酬	722,787.81
应付托管费	120,464.62
应付销售服务费	-
应付交易费用	273,137.36
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	161,809.05
负债合计	1,758,204.88
所有者权益:	
实收基金	513,344,397.04
未分配利润	71,452,607.91
所有者权益合计	584,797,004.95
负债和所有者权益总计	586,555,209.83

注:1、本基金于2013年5月3日成立,无比较式的上年度可比期间,因此资产负债表只列示2013年12月31日数据,特此说明。

2、报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.139元,基金份额总额513,344,397.04份。

7.2 利润表

会计主体:汇添富消费行业股票型证券投资基金

本报告期:2013年5月3日(基金合同生效日)至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年5月3日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入	67,762,306.04
1.利息收入	4,508,460.12
其中:存款利息收入	2,081,912.20
债券利息收入	203,778.03
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	2,222,769.89
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	43,083,190.77
其中:股票投资收益	39,798,862.07
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	3,284,328.70
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	18,926,369.98
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,244,285.17
减:二、费用	9,518,962.61
1.管理人报酬	5,524,166.91
2.托管费	920,694.52
3.销售服务费	-
4.交易费用	2,744,098.13
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	330,003.05
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	58,243,343.43

注:本基金于2013年5月3日成立,无比较式的上年度可比期间,因此利润表只列示从基金合同生效日至2013年12月31日数据,特此说明。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富消费行业股票型证券投资基金

本报告期:2013年5月3日(基金合同生效日)至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年5月3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)	846,413,696.44	-	846,413,696.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	58,243,343.43	58,243,343.43
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)	-333,069,299.40	13,209,264.48	-319,860,034.92
其中:1.基金申购款	590,645,351.49	84,915,522.09	675,560,873.58
2.基金赎回款	-923,714,650.89	-71,706,257.61	-995,420,908.50
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)	513,344,397.04	71,452,607.91	584,797,004.95

注:本基金于2013年5月3日成立,无比较式的上年度可比期间,因此所有者权益(基金净值)变动表只列示从基金合同生效日至2013年12月31日数据,特此说明。

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

汇添富消费行业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]237号文《关于核准汇添富消费行业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)于2013年4月8日至2013年4月26日向社会公开发行募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2013)验字第60466941_B17号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2013年5月3日正式生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币846,217,932.89元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币195,763.55元,以上实收基金(本息)合计为人民币846,413,696.44元,折合846,413,696.44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和注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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。本基金采用自下而上的投资方法,以基本面分析为立足点,精选消费行业的优质上市公司,结合市场脉络,做中长期布局,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为中证主要消费行业指数×40%+中证可选消费行业指数×40%+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5月3日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2013年5月3日(基金合同生效日)起至2013年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前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主要包括股票投资和债券投资;

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认,即从本基金账户和资产负债表内予以转销;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

金融资产转移,是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方);本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(5)回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次,第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的,以该报价为依据确定公允价值;第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价,或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的,以该报价为依据做必要调整确定公允价值;第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的,以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下:

1)股票投资

(1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

B. 首次公开发行的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按其成本价计算;

首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

C.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值:

a.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时,采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值;

b.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时,按中国证监会相关规定处理;

2)债券投资

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日债券收盘净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(3)未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行后续计量;

(4)全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值;

3)权证投资

(1)上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)未上市流通的权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本计量;

(3)因持有股票而享有的配股权证,采用估值技术确定公允价值进行估值;

4)分离交易可转债

分离交易可转债,上市日前,采用估值技术分别对债券和权证进行估值;自上市日起,上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值;

5)其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(2)如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4) 买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(9) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提;

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提;

(3)卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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,每次收益分配比例不得低于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;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;选择红利再投资的,基金份额的现金红利将按红利发放日基金份额净值转成相应的基金份额,红利再投资的份额免收申购费;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.7 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
中国建设银行股份有限公司	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	基金管理人施加重大影响的联营企业

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期的关联方交易

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5月3日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	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	1,332,911,503.08	68.08%

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5月3日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	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	36,989,000.00	100.00%

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5月3日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券股份有限公司	5,920,000,000.00	88.62%

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年5月3日(基金合同生效日)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
本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。	1,198,335.05	68.08%	1,060.10	0.39%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年5月3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	5,524,166.91
其中:支付销售机构的客户维护费	2,195,857.89

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×1.50%÷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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年5月3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	920,694.52

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×0.25%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金的基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末均未投资本基金。

7.4.8.5 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5月3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
中国建设银行股份有限公司	26,528,214.92	467,663.00

注:除上表列示的金额外,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,2013年5月3日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间获得的利息收入为人民币58,897.00元,2013年末结算备付金余额为人民币2,527,887.73元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金2013年5月3日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间在承销期内未参与关联方承销证券。

7.4.9 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本期末未持有暂时停牌股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§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(%)
1	权益投资	475,941,338.82	81.14
	其中:股票	475,941,338.82	81.14
2	固定收益投资	21,907,600.00	3.73
	其中:债券	21,907,600.00	3.73
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,000.00	8.52
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	29,056,102.65	4.95
7	其他各项资产	9,650,168.36	1.65
8	合计	586,555,209.83	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	-	-
C	制造业	310,796,167.86	53.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,111,047.42	5.83
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	57,926,123.54	9.91
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	53,844,000.00	9.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	19,264,000.00	3.29
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	475,941,338.82	81.39

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	300144	宋城股份	2,800,000	53,844,000.00	9.21
2	600352	浙江龙盛	4,000,000	52,880,000.00	9.04
3	600887	伊利股份	1,330,000	51,976,400.00	8.89
4	600315	上海家化	850,000	35,895,500.00	6.14
5	600138	中青旅	1,999,937	35,238,889.94	6.03
6	000651	格力电器	900,000	29,394,000.00	5.03
7	300104	乐视网	650,000	26,520,000.00	4.53
8	300090	盛运股份	720,010	24,977,146.90	4.27
9	601888	中国国旅	650,064	22,687,233.60	3.88
10	601633	长城汽车	500,085	20,588,499.45	3.52

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600315	上海家化	121,896,540.74	20.84
2	600352	浙江龙盛	73,550,308.06	12.58
3	600887	伊利股份	68,719,690.49	11.75
4	300144	宋城股份	66,317,465.79	11.34
5	000651	格力电器	61,499,859.08	10.52
6	600519	贵州茅台	50,392,880.27	8.62
7	601888	中国国旅	47,344,646.47	8.10
8	600637	百视通	42,713,612.59	7.30
9	600138	中青旅	40,811,881.21	6.98
10	600612	老凤祥	32,601,403.12	5.57
11	600418	江淮汽车	29,455,212.35	5.04
12	600661	新南洋	28,881,577.68	4.94
13	300104	乐视网	28,085,306.77	4.80
14	000418	小天鹅A	27,633,679.73	4.73
15	000625	长安汽车	26,500,631.00	4.53
16	000538	云南白药	26,121,000.30	4.47
17	300090	盛运股份	25,685,774.93	4.39
18	300015	爱尔眼科	25,503,339.97	4.36
19	000527	美的电器	25,229,710.24	4.31
20	601633	长城汽车	22,803,853.92	3.90
21	002604	龙力生物	22,022,822.16	3.77
22	002505	大康牧业	21,063,370.84	3.60
23	600337	美克股份	18,916,574.53	3.23
24	002148	北纬通信	18,820,667.32	3.22
25	000848	承德露露	18,051,681.74	3.09
26	300059	东方财富	17,116,607.51	2.93
27	002344	海宁皮城	17,030,647.79	2.91
28	300005	探路者	16,967,120.12	2.90
29	002174	梅花伞	16,556,303.79	2.83
30	600597	光明乳业	14,578,728.72	2.49
31	600559	老白干酒	12,852,829.54	2.20

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600315	上海家化	93,362,920.98	15.97
2	600637	百视通	51,091,350.64	8.74
3	600519	贵州茅台	40,742,508.46	6.97
4	600612	老凤祥	40,196,139.03	6.87
5	000651	格力电器	38,419,280.16	6.57
6	600352	浙江龙盛	33,436,469.50	5.72
7	601888	中国国旅	29,928,031.74	5.12
8	000625	长安汽车	26,597,885.86	4.55
9	300015	爱尔眼科	25,713,194.02	4.40
10	000527	美的电器	24,989,604.59	4.27
11	002148	北纬通信	21,811,395.47	3.73
12	002604	龙力生物	20,901,139.91	3.57
13	002505	大康牧业	20,646,087.99	3.53
14	002174	梅花伞	20,383,857.81	3.49
15	600597	光明乳业	20,282,602.66	3.47
16	300144	宋城股份	20,010,963.89	3.42
17	600887	伊利股份	19,529,447.93	3.34
18	000848	承德露露	17,981,525.08	3.07
19	002344	海宁皮城	16,739,502.99	2.86
20	300005	探路者	15,375,110.11	2.63
21	000538	云南白药	13,380,935.66	2.29
22	600880	博瑞传播	11,898,500.41	2.03

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	1,187,544,063.34
卖出股票收入(成交)总额	770,409,356.57

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	21,907,600.00	3.75
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	-	-
8	其他	-	-
9	合计	21,907,600.00	3.75

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	019314	13国债14	220,000	21,907,600.00	3.75

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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投资。

8.9 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。

8.10 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:报告期末本基金无股指期货持仓。

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

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

上海家化联合股份有限公司("上海家化")于2013年11月21日发布《关于收到中国证监会<调查通知书>的公告》,称公司于2013年11月20日公司收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(编号:沪调查通字2013-1-64号),因公司涉嫌未按规定披露信息,中国证券监督管理委员会决定对上海家化立案稽查。同日,上海家化发布《关于收到上海证监局<行政监管措施决定书>的公告》,称因为公司未按规定披露关联交易信息,上海证监局责令公司予以整改,并要求上海家化提交书面报告以便上海证监局组织检查验收。2013年12月18日,上海家化董事会发布《关于上海证监局行政监管措施决定书相关问题的整改报告》,陈述公司整改所采取的具体措施。

本基金投资上海家化的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。本基金管理人的投研团队对上海家化受调查事件进行了及时分析和跟踪研究,认为该事件对该公司投资价值未产生实质性影响。

报告期内本基金投资的其他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、处罚的情况。

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	283,785.99
2	应收证券清算款	8,127,561.99
3	应收股利	-
4	应收利息	392,965.48
5	应收申购款	845,854.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,650,168.36

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

注:本基金本报告期末前十名股票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
6,011	85,400.83	279,863,872.56	54.52%	233,480,524.48	45.48%

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	1,925,871.15	0.38%

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100万份以上。

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(2013年5月3日)基金份额总额	846,413,696.44
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	590,645,351.49
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	923,714,650.89
本报告期期末基金份额总额	513,344,397.04

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,增聘汤丛珊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,增聘汪洋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,增聘汪洋先生担任中证医药卫生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,增聘汪洋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,增聘汪洋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,增聘汪洋先生担任深证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,增聘汪洋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,何旻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、汤丛珊女士任该基金的基金经理。

34、基金托管人2013年12月5日发布任免通知,聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

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(2013年5月3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	1,332,911,503.08	68.08%	1,198,335.05	68.08%	-
申银万国	2	385,319,871.75	19.68%	345,392.63	19.62%	-
中信证券	2	239,722,045.08	12.24%	216,552.13	12.30%	-

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	36,989,000.00	100%	5,920,000,000.00	88.62%	-	-
申银万国	-	-	580,000,000.00	8.68%	-	-
中信证券	-	-	180,000,000.00	2.69%	-	-

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6个交易单元与汇添富理财60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、汇添富实业债债券型证券投资基金和汇添富安心中国债券型证券投资基金共用,且均为本基金新增席位。

汇添富基金管理股份有限公司
2014年3月26日