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8月25日

# 汇添富民营活力股票型证券投资基金

## 【2014】半年度报告摘要

§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2014年8月21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2014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 | 1,718,689,043.83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层汇添富基金管理股份有限公司 |

§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(2014年1月1日 - 2014年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 250,809,831.39 |
| 本期利润 | 431,469,545.90 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2132 |
| 本期基金份额净值增长率 | 14.95% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1484 |
| 期末基金资产净值 | 2,431,964,914.89 |
| 期末基金份额净值 | 1.415 |

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 | 7.93% | 0.94% | 3.40% | 0.80% | 4.53% | 0.14% |
| 过去三个月 | 8.93% | 1.11% | 3.62% | 0.84% | 5.31% | 0.27% |
| 过去六个月 | 14.95% | 1.29% | 4.09% | 1.00% | 10.86% | 0.29% |
| 过去一年 | 27.96% | 1.37% | 19.45% | 1.06% | 8.51% | 0.31% |
| 过去三年 | 59.71% | 1.20% | 4.06% | 1.15% | 55.65% | 0.05% |
| 自基金合同生效日起至今 | 69.94% | 1.20% | 8.71% | 1.20% | 61.23% | 0.00% |

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

汇添富基金管理股份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、东航金控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2014年6月30日,公司管理证券投资基金规模约981.54亿元,权益类产品管理规模在行业内名列前茅,公司管理4只上证公式证券投资基金,形成了覆差价、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、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、汇添富香港优势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、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任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、汇添富价值股票型证券投资基金、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、汇添富信用债券型证券投资基金、汇添富高息债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富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、汇添富红利分级债券型证券投资基金、汇添富交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、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金。

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 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、汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富双利债券基金、汇添富可转换债券基金的基金经理助理。 | 2014年4月8日 | - | 7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31日至今任汇添富消费行业股票基金的基金经理。2013年4月11日至今任汇添富双利债券基金、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。2014年4月8日至今任汇添富民营活力股票基金的基金经理。 |
| 齐东超 | 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、投资经理副总监。 | 2010年5月5日 | 2014年4月8日 | 10年 | 国籍:中国。学历: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。2008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、投资经理副总监。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2014年4月8日任汇添富成长焦点股票基金的基金经理。2010年5月5日至2014年4月8日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码日期;

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,并贯穿分工授权、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,包括投资指令下达、交易执行、结果反馈、事中交易分析、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4次,其中3次是由于对冲专户采取指数化策略投资导致,1次是由于投资流动性的需求导致。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

14年上半年在经济转型、政府换届调整的大背景下,市场整体比较平稳,6月底随着流动性的改善,市场出现了一波明显的反弹。从结构上看,代表传统经济的周期股继续疲软,而代表经济转型方向的互联网、医疗服务、信息安全、新能源汽车等行业大幅反弹。

我们的投资依然聚焦在高成长公司,对移动互联网、金融软件、医疗服务、大环保的投资取得了比较好的收益,净值上涨14.95%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年上半年,本基金净值上涨14.95%,跑赢业绩基准10.86%。同期沪深300下跌7.08%,中小板下跌3.72%,创业板上涨7.69%。

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年下半年,我们认为在政府的底线思维支撑下,流动性环境的改善可以持续,所以对市场判断相对积极一些。但整体的经济状况依然难以出现大的转折,转型的背景下,国内经济去杠杆、去产能的进程不会改变,整体经济增长将即刻到一个更加合理的水平,大部分产能过剩的制造业和周期性行业缺乏系统性机会。

中国的时代特征已经从由出口和投资拉动的发展,转向更有质量的增长,而我们判断互联网、医疗服务和环保就成为支撑未来新经济的基础产业,具体机会如下:

1、互联网的垂直应用,这正在快速改变我们的生活,冲击传统商业模式,重点关注和互联网以及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、装饰等;

2.能集中爆发出的行为共振和消费偏好的重磅电子产品,如iwatch、新能源汽车、LED等的机会;

3.计算机硬件国产化和软件投入;

4.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。

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终账对同时进行。

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

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,汇添富民营活力股票型证券投资基金未进行利润分配。

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2014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:汇添富民营活力股票型证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 102,711,603.03 | 183,803,102.98 |
| 结算备付金 | 1,323,686.13 | 20,952,494.96 |
| 存出保证金 | 1,584,533.44 | 2,206,572.39 |
| 交易性金融资产 | 2,230,829,694.46 | 2,651,011,368.82 |
| 其中:股票投资 | 2,120,770,694.46 | 2,398,721,394.82 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 110,059,000.00 | 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 | 119,294,487.86 | - |
| 应收利息 | 3,831,380.34 | 3,465,067.05 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 5,279,571.09 | 5,050,874.18 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 2,464,854,956.35 | 3,412,789,974.83 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 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 | 3,878,197.76 | 144,960,120.31 |
| 应付赎回款 | 23,424,277.10 | 8,379,280.66 |
| 应付管理人报酬 | 2,889,312.14 | 4,131,142.52 |
| 应付托管费 | 481,551.99 | 688,523.78 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 1,916,351.15 | 3,864,097.81 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 300,351.32 | 241,474.85 |
| 负债合计 | 32,890,041.46 | 162,264,639.93 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 1,718,689,043.83 | 2,640,019,056.91 |
| 未分配利润 | 713,275,871.06 | 610,506,277.99 |
| 所有者权益合计 | 2,431,964,914.89 | 3,250,525,334.90 |
| 负债和所有者权益总计 | 2,464,854,956.35 | 3,412,789,974.83 |

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.415元,基金份额总额1,718,689,043.83份。

6.2 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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 467,959,828.33 | 158,465,031.16 |
| 1.利息收入 | 5,434,713.96 | 579,551.73 |
| 其中:存款利息收入 | 735,861.16 | 386,313.93 |
| 债券利息收入 | 2,576,749.42 | 10,773.13 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 2,122,103.38 | 182,464.67 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 279,358,854.81 | 125,293,041.63 |
| 其中:股票投资收益 | 266,864,174.11 | 116,755,925.54 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -220,795.36 | 1,362,637.17 |
| 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 | 12,715,476.06 | 7,174,478.92 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 180,659,714.51 | 32,184,810.15 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 2,506,545.05 | 407,627.65 |
| 减:二、费用 | 36,490,282.43 | 13,353,356.78 |
| 1.管理人报酬 | 19,944,366.86 | 6,240,033.20 |
| 2.托管费 | 3,324,061.03 | 1,040,005.54 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 12,196,603.76 | 5,849,673.25 |
| 5.利息支出 | 800,338.99 | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 800,338.99 | - |
| 6.其他费用 | 224,911.79 | 223,644.79 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 431,469,545.90 | 145,111,674.38 |

6.3 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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014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) | 2,640,019,056.91 | 610,506,277.99 | 3,250,525,334.90 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 431,469,545.90 | 431,469,545.90 |
| 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) | -921,330,013.08 | -328,699,952.83 | -1,250,029,965.91 |
| 其中:1.基金申购款 | 664,348,512.58 | 224,262,685.90 | 888,611,198.48 |
| 2.基金赎回款 | -1,585,678,525.66 | -552,962,638.73 | -2,138,641,164.39 |
| 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) | 1,718,689,043.83 | 713,275,871.06 | 2,431,964,914.89 |
| 项目 | 上年度可比期间 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) | 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) | - | 145,111,674.38 | 145,111,674.38 |
| 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) | 497,021,563.20 | 148,527,725.44 | 645,549,288.64 |
| 其中:1.基金申购款 | 909,098,228.91 | 249,642,607.19 | 1,158,740,836.10 |
| 2.基金赎回款 | -412,076,665.71 | -101,114,881.75 | -513,191,547.46 |
| 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) | 1,004,560,010.23 | 329,404,968.68 | 1,333,964,978.91 |

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

6.4 报表附注

6.4.1 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1,407,531,401.75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%。

6.4.2 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。

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2014年6月30日的财务状况以及2014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、证券投资公司债券型证券投资基金、证券投资公司债券型证券投资基金、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、国家税务总局财税字[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《关于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[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。

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

| 项目 | 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 |

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 2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013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 | 2,258,410,005.19 | 28.85% | 1,094,788,135.72 | 27.19% |

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013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 | 8,663,815.40 | 6.71% | 38,857,567.60 | 77.69% |

6.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2014年1月1日至2014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 | 2,013,227.79 | 28.79% | 171,306.76 | 8.94% |
| | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013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 | 984,425.36 | 27.26% | 531,952.31 | 24.86% |

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 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 19,944,366.86 | 6,240,033.20 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 4,742,425.99 | 993,081.42 |

注: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款指令,基金托管人复核后于次月前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、公休日等,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 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,324,061.03 | 1,040,005.54 |

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款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,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:本基金与关联方本期和上年度可比期间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 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2010年5月5日)持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 25,022,187.50 | 50,044,375.00 |
| 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 | 25,022,187.50 | - |
| 期末持有的基金份额 | 0.00 | 50,044,375.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 4.98% |

注:本公司于2014年1月13日,2014年1月14日和2014年1月15日分别赎回本基金份额8,340,729.5份、8,340,729份和8,340,729份(含募集期利息结转的份额),赎回费0元,符合招募说明书规定的赎回费率。

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

份额单位:份

| 关联方名称 | 本期末 2014年6月30日 | | 上年度末 2013年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 上海汇添富公益基金会 | 1,984,126.98 | 0.12% | 1,984,126.98 | 0.08% |

注:上海汇添富公益基金会于2010年4月30日运用2,000,000.00元认购本基金份额1,984,126.98份(含募集期利息结转的份额),认购费用15,873.02元,符合招募说明书规定的认购费率。

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 2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013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 | 102,711,603.03 | 641,400.07 | 142,561,398.78 | 335,185.68 |

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,2014年半年末获得的利息收入为人民币74,346