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:2015年3月31日

汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金

【2014】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2015年3月27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2014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	汇添富沪深300安中指数
基金主代码	000368
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月6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	186,796,311.78份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资。紧密跟踪沪深300安中动态策略指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,以便为投资者带来长期收益。
投资策略	主要采取完全复制法。在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	沪深300安中动态策略指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型指数基金,在证券投资基金中属于较高预期风险、较高预期收益的品种。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	蒋松云
	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	2014年	2013年11月6日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	8,179,860.48	-2,835,261.10
本期利润	63,161,846.19	-7,718,545.03
加权平均基金份额本期利润	0.3872	-0.0644
本期基金份额净值增长率	37.53%	-4.02%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.0699	-0.0402
期末基金资产净值	246,566,187.23	127,256,143.93
期末基金份额净值	1.3200	0.9598

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11月6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2014年12月31日数据,特此说明。

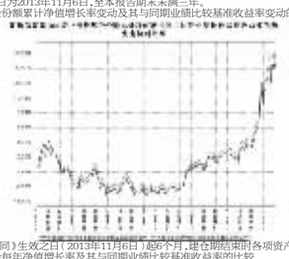
3.2 基金净值表现

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	30.64%	1.40%	31.97%	1.43%	-1.33%	-0.03%
过去六个月	46.85%	1.14%	48.97%	1.16%	-2.12%	-0.02%
过去一年	37.53%	1.09%	39.84%	1.10%	-2.31%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	32.00%	1.08%	35.39%	1.11%	-3.39%	-0.03%

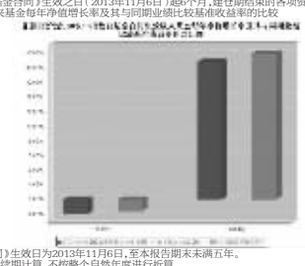
注:本基金的《基金合同》生效日为2013年11月6日,至本报告期末未满三年。

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(2013年11月6日)起六个月,建仓期期末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2013年11月6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2013年11月6日,2013年度和2014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、南方以及上海虹桥机场三个分公司,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)和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ROFII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2014年末,汇添富其管理50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6只基金产品,包括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、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金。

汇添富始终坚持"以企业基本分析为立足点,挑选质量的证券,担忧市场脉络,做中长期投资有益"的理念,同时,地产销售并去大量下滑,部分降低了市场对经济下滑的担忧。这些因素均导致了市场风格的切换,前期被受冷落了蓝筹板块迎来了"逆袭",引发了大盘蓝筹指数大幅上涨。在这些因素共同影响下,安中动态在2014年全年上涨了37.53%。

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%-95%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跟踪成本最小化的方式进行调整,降低了冗余的交易量。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内安中沪深300指数基准上涨39.84%,本基金在报告期内累计收益率为37.53%,收益率落后业绩比较基准2.31%。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0.0295%,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

展望明年,14年未推动市场上涨的主要逻辑仍然成立。预计2015年改革仍将持续,国企改革、财税体制改革、户籍制度改革、土地改革、金融改革等将继续推进,从而改善收入分配、提升效率和增长质量,改善经济结构,增强增长可持续性。这些改革措施将继续降低中国市场风险溢价,使经济增长模式顺利进入"新常态"。同时,市场利率仍有下行空间,有望引导资金逐步提高风险偏好,推动居民大量资产配置逐步转入权益类资产,从而引领权益类资产估值回升。资金面角度,沪港通之后,深港通进入视野,同时MSCI指数可能将A股纳入其指数体系,这些变化均可能使得2015年股市整体的流动性环境较为有利。"注册制"的推出可能是一个潜在的风险因素,但初期仍可能有过渡性安排使得切换过程相对平稳,从而是最减少对市场的冲击。外围市场,最大的不确定性在于美国可能在2015年加息,同时油价的过度下跌可能对中东及其他主要产油国的经济政治造成负面影响,但相信中国仍将有足够的政策空间来应对这些不确定性。

在值得度,海外资金流入预期升温,在中国资本市场的国际化过程中,A股的估值体系有可能被重新定义。随着配置型资金比例的增加,A股市场定价的有效性将逐步提高,估值的合理性将得到市场更多的重视,目前大盘蓝筹的估值水平仍较为合理,安中指数在沪深300分股中动态调整行业比例,大盘风格明显,仍有可能有较好的表现。

作为被动投资的指数型基金,汇添富沪深300安中动态策略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。我们非常期望汇添富沪深300安中动态策略指数基金能继续与投资者一起分享中国经济的美好未来。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,公司以维护基金份额持人利益为宗旨,有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则,认真履行职责,通过常规稽核、专项检查和系统监控等方式方法积极开展工作,强化对基金运作和公司运营的合规性监察,促进内部控制和风险管理的不断改进,并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内,本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面:

(一)完善规章制度,健全内部控制体系

在本报告期内,督察长和稽核监察部门系极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估,并根据各项业务特点、业务发展实际,建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程,进一步明确了内部控制和风险管理责任,公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善,为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

(二)加强稽核监察,确保基金运作和公司经营合法合规

本报告期内,督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据,按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察,包括对基金投资交易行为、投资指标的监控,对投资组合的风险度量、评估和建议,对基金信息披露的审核、监督,对基金销售、营销的稽核、控制,对基金营运、技术系统的稽核、评估,切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

(三)强化培训教育,提高全员合规意识

本报告期内,督察长和稽核监察部门系极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训,公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流,提升了员工的风险意识、合规意识,提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平,公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作,本报告期内,本基金管理人所管理的基金运作合法合规,充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,继续加强内部控制和风险管理,进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性,充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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、基金运营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,并有权表决以决定是否采用某一票表决权,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致性。

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。

4.8 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4次,每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额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2014年未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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

报告期内,本基金托管人在对汇添富沪深300安中动态策略指数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,汇添富沪深300安中动态策略指数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沪深300安中动态策略指数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,汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金未进行利润分配。

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沪深300安中动态策略指数型证券投资基金2014年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 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,注册会计师徐艳、阚育化于2015年3月27日签字出具了安永华明(2015)审字第60466941_B41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:汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	15,294,591.51	6,370,056.42
结算备付金	349,156.87	609,104.02
存出保证金	37,379.26	46,244.37
交易性金融资产	233,306,404.58	117,827,319.12
其中:股票投资	233,241,092.49	117,827,319.12
基金投资	-	-
债券投资	65,312.09	-
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	2,150,190.64	5,234,031.43
应收利息	3,105.53	1,653.43
应收股利	-	-
应收申购款	1,206,189.00	57,929.03
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	252,347,017.39	130,146,337.82
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31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	2,509,693.55	2,696,577.86
应付赎回款	2,610,165.92	1,101.72
应付管理人报酬	93,407.74	50,515.17
应付托管费	18,681.54	10,103.03
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	199,280.94	81,457.16
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	349,600.47	50,438.93
负债合计	5,780,830.16	2,890,193.89
所有者权益:		
实收基金	186,796,311.78	132,588,165.36
未分配利润	59,769,875.45	-5,332,021.43
所有者权益合计	246,566,187.23	127,256,143.93
负债和所有者权益合计	252,347,017.39	130,146,337.82

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.3200元,基金份额总额186,796,311.78份。

7.2 利润表

会计主体:汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年11月6日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一.收入	66,113,382.41	-7,093,578.35
1.利息收入	78,047.44	54,159.81
其中:存款利息收入	78,024.22	54,159.81
债券利息收入	23.22	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	11,007,959.26	-2,602,263.20
其中:股票投资收益	7,839,860.08	-2,602,368.95
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,305.27	-
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	3,162,793.91	105.75
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	54,981,985.71	-4,883,283.93
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	45,390.00	337,808.97
减:二.费用	2,951,536.22	624,966.68
1.管理人报酬	786,387.77	86,177.77
2.托管费	157,277.57	17,235.57
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,427,104.88	431,091.06
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	580,766.00	90,462.28
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	63,161,846.19	-7,718,545.03

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	132,588,165.36	-5,332,021.43	127,256,143.93
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	63,161,846.19	63,161,846.19
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)	54,208,146.42	1,940,050.69	56,148,197.11
其中:1.基金申购款	87,129,680.24	5,929,346.41	93,059,026.65
2.基金赎回款	-32,921,533.82	-3,989,295.72	-36,910,829.54
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)	186,796,311.78	59,769,875.45	246,566,187.23

项目	上年度可比期间 2013年11月6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)	274,994,745.19	-	274,994,745.19
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,718,545.03	-7,718,545.03
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)	-142,406,579.83	2,386,523.60	-140,020,056.23
其中:1.基金申购款	126,403,989.12	3,764,714.10	130,168,703.22
2.基金赎回款	-268,808,568.95	-1,378,190.50	-270,246,759.45
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)	-	-	-
五.期末所有者权益(基金净值)	132,588,165.36	-5,332,021.43	127,256,143.93

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

汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金(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]209号文《关于核准汇添富沪深300安心动态策略指数型证券投资基金的批复》的核准,由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司作为发起人于2013年10月18日至2013年11月4日向社会公开募集,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_B49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11月6日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币274,987,595.90元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币7,149.29元,以上实收基金(本息)合计人民币274,994,745.19元,按基金面值1.00元折合274,994,745.19份基金份额。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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围以沪深300安中动态策略指数的成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金业绩比较基准:沪深300安中动态策略指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

财政部颁发的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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并发布的《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》,修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

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2014年12月31日的财务状况以及2014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

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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
东航金控有限责任公司	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

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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年11月6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	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	310,831,415.22	32.65%	283,658,627.14	87.79%

7.4.8.1.2 债券交易

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交易。

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。

7.4.8.1.3 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	280,061.64	32.59%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2013年11月6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
东方证券股份有限公司	256,321.00	87.95%	52,909.00	64.95%

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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年11月6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	786,387.77	86,177.77
其中:支付销售机构的客户维护费	9,239.85	3,325.80

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.5%÷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,由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月前5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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年11月6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	157,277.57	17,235.57

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.1%÷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,由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月前5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、公休日等,支付日期顺延。

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:本基金本报告期及上年度可比期间均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及上年度可比期间均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:本基金的其他关联方本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年11月6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	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	15,294,591.51	67,540.96	6,370,056.42	50,735.75

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年度获得的利息收入为人民币8,260.53元(2013年11月6日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间:人民币767.47元),2014年末结算备付金余额为人民币349,156.87元(2013年末:人民币609,104.02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:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9 期末(2014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:本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000883	湖北能源	2014年11月18日	重大事项停牌	6.43	-	-	104,088	403,614.21	669,285.84	-
000009	中国宝安	2014年12月29日	重大资产重组停牌	12.95	2015年1月7日	13.88	49,847	590,363.96	645,518.65	-
000562	宏源证券	2014年12月10日	重大资产重组停牌	30.50	2015年1月26日	17.77	17,887	265,945.55	545,553.50	-
600332	白云山	2014年12月4日	重大事项停牌	27.11	2015年1月13日	29.82	19,900	539,873.99	539,489.00	-
600664	哈药股份	2014年12月31日	重大事项停牌	8.68	2015年2月17日	9.45	37,111	272,566.39	322,123.48	-
000413	东旭光电	2014年11月25日	重大事项停牌	7.67	2015年1月28日	8.44	23,417	185,284.41	179,608.39	-
601216	内蒙君正	2014年12月1日	重大资产重组停牌	10.44	2015年1月7日	11.10	15,150	110,050.90	158,166.00	-
600649	城投控股	2014年11月3日	重大资产重组停牌	7.23	-	-	7,731	51,414.51	55,895.13	-

注:申银万国证券股份有限公司以2049倍的比例同所有宏源证券股份有限公司(以下简称"宏源证券")股东发行A股的方式吸收合并宏源证券,并更名为申万宏源集团股份有限公司(以下简称"申万宏源"),2015年1月26日申万宏源在深交所挂牌(交易代码:000166),同日宏源证券股票摘牌。换股完成后,本基金持有申万宏源36,657股。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

截至本报告期末2014年12月31日止,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

截至本报告期末2014年12月31日止,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