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:2015年3月31日

汇添富环保行业股票型证券投资基金

【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。

基金托管人中国建设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9月16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	汇添富环保行业股票
基金主代码	000696
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月16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	1,860,933,367.47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策略,以基本面分析为立足点,主要投资于环保行业的优质上市公司,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
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具有核心竞争优势和持续增长潜力且估值水平相对合理的环保行业优质上市公司,辅以严格的风险管理,以获得中长期的较高投资收益。投资策略的重点是个股精选策略。
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率80%+中证全债指数收益率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预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险、预期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	010-66278853

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9月16日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	33,487,842.48
本期利润	50,111,570.74
本期加权平均净值利润率	2.48%
本期基金份额净值增长率	2.20%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0189
期末基金资产净值	1,902,517,680.03
期末基金份额净值	1.022

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 2014 年 9月 16 日,至本报告期末未满6个月,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。

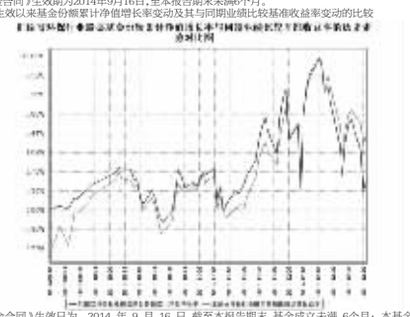
3.2 基金净值表现

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	0.39%	1.49%	4.63%	1.26%	-4.24%	0.23%
自基金合同生效日起至今	2.20%	1.37%	5.78%	1.25%	-3.58%	0.12%

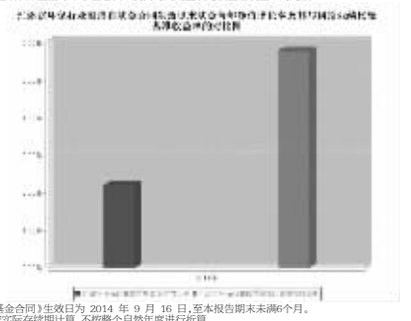
注:本基金的《基金合同》生效期为2014年9月16日,至本报告期末未满6个月。

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 2014 年 9 月 16 日,截至本报告期末,基金成立未满 6个月;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2014 年 9 月 16 日)起 6 个月,截止本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

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 2014 年 9 月 16 日,至本报告期末未满6个月。
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2014年9月16日,自合同生效日至本报告期末未进行利润分配。

§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、另类投资五大投资领域协同发展的格局。

截止2014年末,汇添富共管理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、汇添富收益快钱货币市场基金。

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。2014年,汇添富取得了良好的整体投资业绩,准确把握市场节奏,精准布局产品线。旗下基金产品(除QDII产品)成立以来均实现正收益。其中逆向、美丽30、价值、民营等基金位列全市场股票型基金前1/4。

2014年,汇添富专户业务快速发展,积极创新,推出了战略型定增专户、新股投资主题专户、海外市场QDII专户、企业现金管理专户等创新型产品。2014年,公司成功获得包括国内全部大型保险公司在内的多家保险专户资格,获得多个专户组合并取得优异投资业绩。

2014年,汇添富积极协助社保理事会研发新投资品种、参与社保产品设计和改造,并加强社保组合投资管理工作。目前公司的社保组合已经涵盖了股票、债券等品种,整体投资业绩优良。

2014年,汇添富国际业务继续向前推进,香港子公司各项业务继续顺利推进,并成功发行添富主要消费ROFII ETF和医药ROFII ETF,以及ROFII货币市场基金。同时加强国际机构合作,在北欧、中东都有业务推进。

2014年,汇添富电子商务业务继续坚持"两条腿走路",一方面加强公司官网直销能力优化客户体验,一方面继续加强跨界合作,目前汇添富电商合作伙伴已达11家。2014年,"现金宝"品牌影响力进一步加强,现金宝AP平成为下载和使用排名前十位的理财类手机应用中唯一由基金公司开发的应用。

2014年,汇添富资本子公司发展良好,大力开展各类创新业务,推出投顾贷款收益权和供应链融资等创新业务。同时完成了大批规章制度和业务指引的修订,有力地保障公司运营合法有序。公司在2014年还涉足一级市场业务,积极参与了绿地集团增资扩股项目,成为第一家介入一级市场开参与国内改革的公募基金公司。

2014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。

2014年,汇添富社会责任事业进一步深入开展。"河流?孩子"助学计划启动第七季活动,公司公益基金会捐资在青海省海东地区互助县建设"添富小学";为添富小学校长及优秀乡村教师提供国内外知名教育机构的师资培训;"河流?孩子"公益纪录片成功在全国范围公映;"添富之爱 感恩十年"公益行走遍六所添富小学,让汇添富的业务伙伴更加深入了解了汇添富的感恩文化。

2014年,汇添富荣获了包括金牛基金奖、上海市金融创新二等奖、最佳债券公司奖、上海市五一劳动奖状、模范职工之家等多个重要奖项,行业地位进一步彰显。

展望2015年,是中国改革深化的关键之年,"互联网+"正式写入政府工作报告,财富管理行业也将在互联网和移动互联网的催化之下发生更加剧烈的变化。2015年我们将继续为实现汇添富的梦想奋勇前行,为筑造中国梦添砖加瓦!

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		
叶从飞	汇添富均衡增长股票基金、汇添富蓝筹精选混合基金、汇添富环保行业股票的基金经理。	2014年9月16日	-	10年	国籍:中国。学历:南京大学经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾任中原证券股份有限公司资产管理部交易员、投资经理助理。2005年10月加入汇添富基金管理股份有限公司任交易主管,2010年9月21日至2012年3月1日任汇添富医药保健股票基金的基金经理助理,2012年3月2日至今任汇添富均衡增长股票基金的基金经理,2014年9月16日至今任汇添富环保行业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。本基金无违法违规、违约行为,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;贯穿了投权、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,公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、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、场内报价公允性等等。(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。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稽核监察部、集中交易室、投资研究部组成,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,利用统计分析的方法和工具,根据对样本个数、差价率是否为0的T检验显著程度、差价率均值是否小于1%、同向交易占比等原因进行综合分析,未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

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8次,其中因专户到期清盘发生2次、因基金流动性需要发生3次、因对冲策略发生3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

2014年A股市场先抑后扬,指数在大盘蓝筹股的带动下走出了一轮牛市行情。虽然宏观经济继续下行,但是改革预期和宽松的流动性成为牛市行情的双重驱动力。从行业表现看,非银金融、建筑装饰和钢铁等周期性板块涨幅居前,而医药生物、食品饮料和农林牧渔等成长性行业跌幅居前。本基金9月中旬成立以来,坚持自下而上的策略,严格按照基金契约在环保、节能和新能源领域中积极寻找优质品种构建组合,基本完成建仓任务。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年本基金净值上涨2.20%,同期业绩比较基准上涨5.78%。

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2015年度,我们对A股市场持乐观的观点。虽然宏观经济仍将延续下行趋势,但总体风险可控。货币政策会更加积极灵活,流动性宽松局面将会持续,无风险利率仍有下降空间。同时随着全面深化改革的不断推进,市场风险偏好也将继续提升,股指仍有上涨空间。

我们认为2015年环保行业会有不错的表现。首先,环保政策密集出台,有助于提升环保需求,推动环保行业快速发展;其次,作为"十二五"收官之年,2015年环保行业投资有望进一步加大,上市公司基本面或将明显改善。再次,环保行业的估值已经回落到历史均值水平以下,而行业增长速度仍将维持较高水平,环保行业的投资价值显著。

同时我们也看好新能源板块2015年的表现,首先从国家战略的角度看,发展新能源是解决国家能源安全和环保问题的唯一出路;其次从国家能源规划看,光伏、风电以及生物质发电等行业的空间巨大,成长性良好;最后,油价大幅下跌对行业的负面影响已经基本反应,我们认为2015年在配额制出台、装机大幅提升等正面因素的刺激下,新能源板块有望获得较好的表现。

综上所述,在政策面和基本面双轮驱动下,我们看好2015年泛环保行业的表现。本基金将坚持稳健的投资策略,积极把握泛环保业的投资机会,重点关注污水处理、废物处置、环境监测和再生资源等环保细分子行业,同时在新能源领域挑选具备核心竞争力的优质公司,并积极寻找变益环保绿色行业供给收益的投资机会。

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积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根据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。

4.8 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12 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9月16日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未进行利润分配。

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

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,注册会计师徐艳、阚育化 2015 年 3 月 27 日签字出具了安永华明(2015)审字第 60466941_B50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:汇添富环保行业股票型证券投资基金

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
资 产:	
银行存款	84,576,240.00
结算备付金	7,788,378.12
存出保证金	488,456.99
交易性金融资产	1,784,934,121.63
其中:股票投资	1,764,920,121.63
基金投资	-
债券投资	20,014,000.00
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	-
应收证券清算款	-
应收利息	436,617.26
应收股利	-
应收申购款	49,943,337.51
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,928,167,151.51
负债和所有者权益	本期末 2014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	13,142,435.99
应付赎回款	7,627,336.60
应付管理人报酬	2,326,757.16
应付托管费	387,792.87
应付销售服务费	-
应付交易费用	2,002,668.80
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	162,480.06
负债合计	25,649,471.48
所有者权益:	
实收基金	1,860,933,367.47
未分配利润	41,584,312.56
所有者权益合计	1,902,517,680.03
负债和所有者权益总计	1,928,167,151.51

注:1、报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.022元,基金份额总额1,860,933,367.47份。

7.2 利润表

会计主体:汇添富环保行业股票型证券投资基金

本报告期:2014年9月16日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年9月16日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	64,573,370.93
1.利息收入	5,052,984.33
其中:存款利息收入	977,013.27
债券利息收入	69,306.20
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	4,006,664.86
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	37,865,105.15
其中:股票投资收益	36,200,818.95
基金投资收益	-
债券投资收益	951,810.43
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	712,475.77
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	16,623,728.26
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	5,031,553.19
减:二、费用	14,461,800.19
1.管理人报酬	8,834,646.01
2.托管费	1,472,440.98
3.销售服务费	-
4.交易费用	3,910,044.69
5.利息支出	32,364.48
其中:卖出回购金融资产支出	32,364.48
6.其他费用	212,304.03
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	50,111,570.74

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富环保行业股票型证券投资基金

本报告期:2014年9月16日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年9月16日(基金合同生效日)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)	2,080,605,361.08	-	2,080,605,361.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	50,111,570.74	50,111,570.74
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)	-219,671,993.61	-8,527,258.18	-228,199,251.79
其中:1.基金申购款	1,015,263,354.39	66,111,532.95	1,081,374,887.34
2.基金赎回款	-1,234,935,348.00	-74,638,791.13	-1,309,574,139.13
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)	1,860,933,367.47	41,584,312.56	1,902,517,680.03

注:报表附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

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

汇添富环保行业股票型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证监会《关于核准汇添富环保行业股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由汇添富基金管理股份有限公司作为发起人于2014年8月18日至2014年9月12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)验证并出具了(2014)验字第60466941_B24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2014年9月16日生效。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2,079,596,421.80元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币1,008,939.28元,以上实收基金(本息)合计为人民币2,080,605,361.08元,折合2,080,605,361.08份基金份额。本基金的基金管理人与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、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可分离债券、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等)、债券回购、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款(含定期存款、协议存款、大额存单等)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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金采用自下而上的策略,以基本面分析为立足点,主要投资于环保行业的优质上市公司,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。本基金的业绩比较基准为中证环保产业指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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》、中国证监会颁布的《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2014年12月31日的财务状况以及2014年9月16日(基金合同生效日)至2014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日期至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2014年9月16日(基金合同生效日)起至2014年12月31日止期间。

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及贷款和应收款项;

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。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、结算备付金、存出保证金和各类应收款项等。

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归入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均划分为其他金融负债,主要包括各类应付款项。

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

初始确认

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,按照取得时的公允价值作为初始确认金额。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取得时发生的相关交易费用计入当期损益;应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类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;应收款项及其他金融负债采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量,其摊销或减值产生的利得或损失,均计入当期损益。

终止确认

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,届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;

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。

金融资产转移

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值;估值日无市价,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,按最近交易市价确定公允价值;如估值日无市价,且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,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

(2)不存在活跃市场的金融工具,采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术,优先使用相关可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值。

(3)如有确定证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能适当反映公允价值的价格估值:

(4)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

当本基金同时满足下列条件时,金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示:具有抵销已确认金额的法定权利,且该种法定权利是当前可执行的;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。

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结转。

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,并于期末金额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

7.