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

汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)

2013 年度 报告摘要

2013年12月31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	汇添富黄金及贵金属 (QDII-LOF-FOF)(LOF)(场内简称:添富贵金)
基金主代码	164701
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月31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	321,573,575.98份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年3月1日

注:本基金为LOF基金,在深交所的简称为"添富贵金"。

2.2 基金产品说明

投资目标	深入研究影响黄金及其他贵金属(如白银、铂金、钯金等)价格的主要因素,把握不同品种贵金属的长期价格趋势和短期市场波动,通过主动投资于有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF),在严格控制风险的前提下,力争基金收益率超越同期黄金价格走势。
投资策略	综合考虑国际政治、经济、汇市、战争、主要国家货币和利率政策、贵金属市场供求等多方面因素,本基金重点投资于境外上市有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF),长期持有结合动态调整。 本基金主要投资策略包括贵金属资产配置策略、交易所交易基金(ETF)投资策略、货币市场工具投资策略以及金融衍生工具投资策略。
业绩比较基准	伦敦金价格折成人民币后的收益率 《伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix),人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。)
风险收益特征	本基金为基金中基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,主要投资于境外有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF),其预期风险收益水平与黄金价格相很。

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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		NY 10005

注:本基金无境外投资顾问。

2.5 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8月31日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益	-42,754,229.73	-26,192,304.72	-3,491,235.95
本期利润	-105,754,613.46	20,710,403.90	-78,560,759.74
加权平均基金份额本期利润	-0.2738	0.0432	-0.1398
本期基金份额净值增长率	-29.48%	4.53%	-14.00%
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	-0.3664	-0.1011	-0.1402
期末基金资产净值	203,742,835.39	396,579,563.11	453,034,222.61
期末基金份额净值	0.634	0.899	0.860

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2011年8月31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。

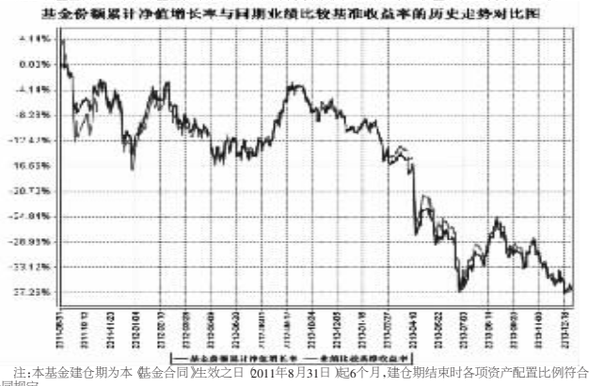
3.2 基金净值表现

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	-8.65%	0.99%	-9.95%	1.15%	1.30%	-0.16%
过去六个月	-0.94%	1.07%	-0.29%	1.24%	-0.65%	-0.17%
过去一年	-29.48%	1.25%	-29.51%	1.33%	0.03%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-36.60%	1.07%	-36.98%	1.28%	0.38%	-0.21%

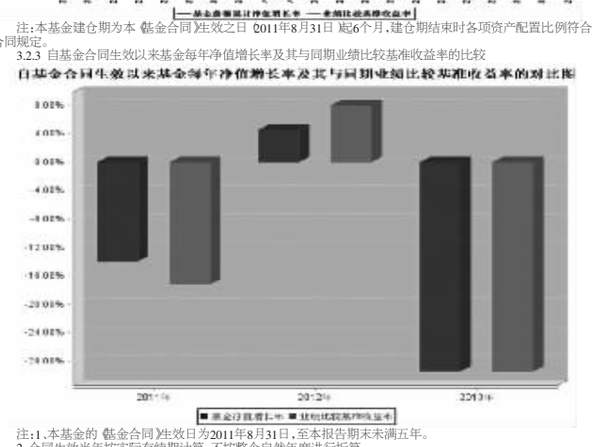
注:本基金的(基金合同)生效日为2011年8月31日,至本报告期末未满三年。

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(2011年8月31日)起6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2011年8月31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:本基金的(基金合同)生效日为2011年8月31日,本基金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。"阳流·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"阳流·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		
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11月1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"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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

整个2013年,全球黄金价格经历了大幅的下挫,终结了黄金资产长达十年的牛市,全年美元计价的黄金价格跌幅为27.33%。

2013年一季度,美国经济的复苏状况出人意料的强劲,带来了美国股市的强劲上行;而欧洲经济仍然在在较大风险,从希腊到塞浦路斯,债务问题连拖累欧洲经济复苏的持续成肋;日本经济仍然陷入通缩的境地,但在新任首相安倍晋三与新任央行行长黑田东彦支持下,日本展开了史无前例的量化宽松政策,日元也大幅贬值了近30%,意图提升日本国内的通胀预期;全球避险情绪仍然高企,避险资金急切地寻找避风港,以往的避险首选是黄金,但在美联储几次会议纪要显示其对于QE后续效果的担忧后,人们普遍预期联储会提前结束货削减QE。

2013年二季度,全球黄金市场经历了两轮恐慌性的下跌。第一轮下跌发生在4月上旬,美国和中国的经济数据低于预期,引发市场对全球经济增速放缓的担忧;期间美联储的两次议会会议提出退出QE的声音增强,加上美国经济的复苏在发达国家中一枝独秀,美元指数中期走强的预期越来越强;最后包括塞浦路斯等抛售黄金的传闻,以及随市场对西班牙、意大利等经济陷入困境国家抛售黄金的担忧,是这次暴跌的催化剂。金价从1600美元左右跌破1400美元。第二轮下跌发生在六月中下旬,在市场的各方猜测中,美联储关于退出QE政策的一只靴子终于落地,伯南克在新闻发布会上更明确表示,如果对美国经济的预测是准确的,那么美联储很可能在今年稍晚放缓资产购买,并于2014年年中结束QE。"市场担心QE的退出将引发市场长期宽松的流动性将不复存在,而资金也从商品、新兴市场资产等资产品中撤回美国,从而引发了黄金的大幅下挫。金价从1400美元平台迅速下穿1200美元的整数关口。

2013年三季度,全球黄金市场经历了每盎司1200美元至1400美元的窄幅震荡。首先是在7月份至8月下旬,受叙利亚危机的影响以及美国为首北约国家的强势表态,中东地区再次陷入战争乌云中,黄金也顺势表现其避险工具的特征,从6月底的1192美元大涨至8月下旬的逼1400美元。随后,叙利亚政治局势缓和,叙利亚方面表示愿意接受俄罗斯的建议将化武交由联合国控制,同时美国总统奥巴马回应称如果叙利亚放弃化武,或将停止对其进行军事打击,令战争风险大大降低,其危机有望通过外交解决,打压金价,后续黄金连续下跌。

2013年四季度,市场一直在猜测美联储何时退出QE。而美国经济持续回暖,多个经济部门的数据有了明显改善,尤其是就业方面,失业率稳步下降,非农就业人口月均增速在10万人以上,市场对美联储缩减量化宽松政策规模的预期逐步升温,削弱了黄金价格上行的基础。同时以美国股市为代表的风险资产吸引了更多投资者的目光,美国市场表征指数标普500持续走强,并在2013年年底达到1850的历史高点;而欧债危机声音的逐渐消弱,进一步带来了投资者对风险资产的偏好。

2013年,贵穿全年的主题是对经济增长的担忧以及QE政策的退出预期,这些极大压制了黄金的金融属性,导致了对黄金为首的贵金属投资性需求的压制。在几大贵金属中,黄金的金融属性最强,受到投资性需求下滑的打击也应该最大,而白银、铂金等贵金属工业属性和消费属性将受益于经济的增长。基于上述逻辑,本基金在2013年维持配置一定仓位的金融属性较低的白银、铂金等贵金属品种。虽然白银和铂金在经济复苏背景下工业与消费需求均有所上升,但由于白银库存量较大,而铂金存量较少且产量有所放缓,导致了白银和铂金走势分化,整个2013年铂金的走势强于黄金,而白银的走势最弱。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金2013年度表现情况如下:

阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	超额收益
过去一个月	-2.91%	-4.43%	1.52%
过去三个月	-8.65%	-9.95%	1.30%
过去六个月	-0.94%	-0.29%-	-0.65%
过去一年	-29.48%	-29.51%	0.03%
自基金合同生效日起至今	-36.60%	-36.98	0.38%

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总的来看,2014年全球经济将维系复苏的态势。预计2014年,美国经济增长仍将在发达国家中一枝独秀,美国经济的自我修复机制与能力保证了其能在发达国家中率先走出经济增长的泥潭。而中国在十八届三中全会后确立了改革的新思路,在经济上采取市场为主导的思想,预计将会持续释放政策红利;而最新的数据也显示,中国经济正在走出谷底,并开始逐渐恢复。在美国与中国这两个世界最大经济体的带动下,全球经济有望逐渐回到温和回暖的通道,相对强势的经济增长,以及相对缓和的政治格局,短期将持续压制黄金为首的大宗商品价格。

而从货币供应的角度来看,除美国和中国外,其余经济体仍然选择宽松的货币政策,特别是日本在QE的道路上继续狂奔,从中长期来看,随着经济增长的逐渐趋稳,持续超发货币导致的通胀将有逐渐抬头的趋势,黄金也将展现其抗通胀方面的独特优势。

总的来看,在较长期范围内我们对黄金价格仍抱有较乐观态度,但在通胀尚未抬头、经济回升、货币逐渐收紧、实物需求被持续压抑的多重压下,黄金的短期表现预期将偏弱,在这种逻辑下我们仍然保持合同规定范围内的仓位下限,同时继续配置金融属性较弱、受益于经济增长的白银和铂金,以期在经济逐渐企稳情况下对冲部分金融属性给黄金带来的压力。

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。

4.8 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6次,每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)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黄金及贵金属证券投资基金(LOF)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,汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)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,汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)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黄金及贵金属证券投资基金(LOF)2013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,注册会计师陈露、汤骏于2014年3月24日签字出具了安永华明(2014)审字第60466941_B17号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:汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)

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	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	12,777,466.73	29,437,114.71
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	191,429,522.75	367,877,711.49
其中:股票投资	-	-
基金投资	191,429,522.75	367,877,711.49
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	471,100.00	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	496,311.73
应收利息	1,172.09	1,855.95
应收股利	-	-
应收申购款	171,335.96	239,175.79
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	496,288.87
资产总计	204,850,597.53	398,548,458.54
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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	704,966.83	830,231.84
应付管理人报酬	176,659.66	341,403.17
应付托管费	45,931.49	88,764.84
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	180,204.16	708,495.58
负债合计	1,107,762.14	1,968,895.43
所有者权益:		
实收基金	321,573,575.98	441,175,671.66
未分配利润	-117,830,740.59	-44,596,108.55
所有者权益合计	203,742,835.39	396,579,563.11
负债和所有者权益总计	204,850,597.53	398,548,458.54

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.634元,基金份额总额321,573,575.98份。

7.2 利润表

会计主体:汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	-101,131,969.59	27,135,613.91
1.利息收入	35,396.53	97,944.55
其中:存款利息收入	35,396.53	97,944.55
债券利息收入	-	-
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)	-36,699,947.88	-19,882,596.87
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-41,377,398.81	-19,882,596.87
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	4,677,450.93	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-63,000,383.73	46,902,708.62
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-1,530,294.28	-114,754.55
5.其他收入(损失以"-"号填列)	63,259.77	132,312.16
减:二、费用	4,622,643.87	6,425,210.01
1.管理人报酬	2,902,687.23	4,351,909.30
2.托管费	754,698.61	1,131,496.48
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	515,035.53	431,562.23
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	450,222.50	510,242.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-105,754,613.46	20,710,403.90

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1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)	441,175,671.66	-44,596,108.55	396,579,563.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-105,754,613.46	-105,754,613.46
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)	-119,602,095.68	32,519,981.42	-87,082,114.26
其中:1.基金申购款	26,689,699.13	-6,599,799.18	20,089,899.95
2.基金赎回款	-146,291,794.81	39,119,780.60	-107,172,014.21
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)	321,573,575.98	-117,830,740.59	203,742,835.39

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	526,924,810.67	-73,890,588.06	453,034,222.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	20,710,403.90	20,710,403.90
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)	-85,749,139.01	8,584,075.61	-77,165,063.40
其中:1.基金申购款	45,112,398.12	-2,974,153.82	42,138,244.30
2.基金赎回款	-130,861,537.13	11,558,229.43	-119,303,307.70
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)	441,175,671.66	-44,596,108.55	396,579,563.11

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

汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)(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[2011]838号文《关于核准汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)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2011年8月31日正式生效,首次设立募集规模为614,808,767.15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为汇添富基金管理股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金中有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF)、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金综合考虑国际政治、经济、汇市、战争、主要国家货币和利率政策、贵金属市场供求等多方面因素,重点投资于境外上市有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF),长期持有结合动态调整。本基金的业绩比较基准为:伦敦金价格折成人民币后的收益率(伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix),人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准)。

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改的《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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税;

(2)基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂免征营业税和企业所得税;