

汇添富价值精选股票型证券投资基金 2009第三季度报告

2009年9月30日

基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2009年10月29日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明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责任。

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2009年10月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期自2009年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇添富价值精选股票
交易代码	519008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年8月7日
报告期末基金份额总额	27,109,595,253.72份

本基金精挑细选优质的上市公司股票，在有效管理风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。

本基金采用灵活的资产配置和股票投资策略，在资产配置中，通过以宏观经济及经济政策分析为核心的基金经理决策来确定投资组合比例，力争实现基金资产的稳定增值，并结合市场价格估值，适时调整资产配置比例，从而达到资产配置的动态平衡。

本基金的投资策略是：本基金将重点考虑资产配置和选股两个方面。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

本基金的股票型基金，属于股票型基金中较高风险较高收益的品种。

基金管理人:汇添富基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2009年07月01日至2009年09月30日)

1.本期已实现收益 89,430,759.42

2.本期利润 -65,944,409.48

3.期初平均基金份额本期利润 -0.0709

4.期末基金份额净值 1,231,218,769.75

5.期末可供分配基金份额净值 1.331

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，本期期初为零，因此本报告期以上期间数为零。

2.本期利润指基金本期利润减去期间费用后的金额，即为本期利润。

3.2基金净值表现

3.2.1本基金报告期内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 净值增长率① 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

本期报告 -2.28% 2.22% -4.02% 1.92% 1.74% 0.30%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600036 招商银行 3,999,960 11,191,408.80 4.80

2 601318 中国平安 1,100,000 55,770,000.00 4.53

3 601166 兴业银行 1,500,000 50,685,000.00 4.12

4 600570 邮储银行 2,999,919 41,848,870.00 3.40

5 600000 浦发银行 1,800,000 35,370,000.00 2.87

6 600519 广州银行 210,000 34,620,600.00 2.81

7 000961 中南建设 2,000,000 34,420,000.00 2.80

8 000983 西山煤电 900,000 28,179,000.00 2.29

9 600880 博瑞传播 1,359,914 22,357,676.56 2.21

10 000501 郑州公用 2,219,861 26,727,126.44 2.17

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 090104 09央票 47 500,000 49,835,000.00 4.05

2 211006 龙蓝转债 1,030 125,763.00 0.01

5.4报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 - -

2 央行票据 49,835,000.00 4.05

3 金融债券 - -

4 企业债券 - -

5 企业短期融资券 - -

6 可转债 125,763.00 0.01

7 其他 - -

8 合计 49,960,763.00 4.06

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 090104 09央票 47 500,000 49,835,000.00 4.05

2 211006 龙蓝转债 1,030 125,763.00 0.01

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

序号 基金代码 基金名称 数量(只) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 090104 09央票 47 500,000 49,835,000.00 4.05

2 211006 龙蓝转债 1,030 125,763.00 0.01

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600036 招商银行 3,999,960 11,191,408.80 4.80

2 601318 中国平安 1,100,000 55,770,000.00 4.53

3 601166 兴业银行 1,500,000 50,685,000.00 4.12

4 600570 邮储银行 2,999,919 41,848,870.00 3.40

5 600000 浦发银行 1,800,000 35,370,000.00 2.87

6 600519 广州银行 210,000 34,620,600.00 2.81

7 000961 中南建设 2,000,000 34,420,000.00 2.80

8 000983 西山煤电 900,000 28,179,000.00 2.29

9 600880 博瑞传播 1,359,914 22,357,676.56 2.21

10 000501 郑州公用 2,219,861 26,727,126.44 2.17

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 090104 09央票 47 500,000 49,835,000.00 4.05

2 211006 龙蓝转债 1,030 125,763.00 0.01

5.9报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 1,053,104,698.67 85.10

其中:股票 1,053,104,698.67 85.10

2 固定收益投资 49,960,763.00 4.04

其中:债券 49,960,763.00 4.04

3 货币市场工具 - -

4 货币市场基金 - -

5 其他资产 - -

其中:实物资产回购的买入返售金融资产 - -

6 其他 - -

其中:银行存款和结算备付金 - -

7 合计 130,857,419.14 10.57

5.10报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 0.00 0.00

B 采矿业 99,775,000.00 8.10

C 制造业 349,899,715.04 28.42

D 食品、饮料 62,061,908.13 5.04

E 纺织、服装、皮毛 0.00 0.00

F 木材、家具 0.00 0.00

G 动漫、印刷 19,214,138.45 1.56

H 石油、化学、塑胶、塑料 31,503,856.00 2.56

I 电子 11,911,821.32 0.97

J 金属、非金属 53,538,875.38 4.35

K 机械设备 98,357,267.88 7.99

L 化工、生物制品 73,311,847.88 5.95

M 其他制造业 0.00 0.00

N 电力、煤气及水的生产和供应业 18,225,158.80 1.48

O 建筑业 50,589,554.80 4.11

P 交通运输、仓储和邮电通信业 13,889,185.12 1.13

Q 信息传输、计算机服务和软件业 63,676,526.51 5.17

R 批发和零售业 79,692,014.10 7.93

S 金融业 268,603,951.24 21.82

T 地产业 35,642,356.50 2.89

K 社会服务业 23,560.00 0.00

L 传媒与文化产业 36,078,676.56 2.93

M 合计 1,053,104,698.67 85.10

5.11报告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组合

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600036 招商银行 3,999,960 11,191,408.80 4.80

2 601318 中国平安 1,100,000 55,770,000.00 4.53

3 601166 兴业银行 1,500,000 50,685,000.00 4.12

4