汇添富成长焦点股票型证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年09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。

本报告中财务资料未经审计。

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	汇添富成长焦点股票
交易代码	519068
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月12日
报告期末基金份额总额	10,269,007,900.35份
投资目标	本基金是主动股票型基金，精选成长性较高，且估值有吸引力的股票进行布局，在有效管理风险的前提下，追求中长期较高的投资回报。
投资策略	本基金采用积极的资产配置和股票投资策略。在资产配置中，通过资产战略配置和战术配置来确定每一阶段投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例；在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出成长性较高，且估值有吸引力的股票，精心构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为主动股票型基金，属于证券投资基金中风险偏上的品种。
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

3.1 主要财务指标

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	1,338,454,266.46
2.本期利润	-406,896,167.58
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0379
4.期末基金资产净值	11,149,496,836.31
5.期末基金份额净值	1.0857

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、所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
本报告期	-4.28%	2.23%	-4.02%	1.92%	-0.26%	0.31%

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

注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2007年3月12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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁建军	本基金的基金经理。	2006年9月5日	2009年7月28日	12年	国籍:中国。学历:上海交通大学工学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任华夏证券研究所高级分析师,2005年4月加入汇添富基金管理有限公司，历任高级行业研究员、研究主管、投资决策委员会成员，2006年9月5日至2009年7月28日任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理。
齐东超	本基金的基金经理，投资研究总部研究总监助理。	2009年7月28日	-	5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,2005年4月加入汇添富基金管理有限公司,任行业分析师、投资研究总部研究总监助理,2009年2月2日任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理助理,2009年7月28日至今任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理。

注:1、基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

2、基金经理的证券从业年限按其从事证券研究分析、投资管理等业务的年限计算。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 管理人对投资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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易机制，涵盖了各投资组合、各投资市场、各投资标的，贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程，并通过分析报告、监控、稽核保证制度流程的有效执行。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为成长风格的股票型基金，截止报告期，与本基金管理人旗下其他基金投资组合风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司公平交易制度执行情况良好，未发生任何异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

支撑市场上半年单边上涨的流动性以及流动性预期在三季度出现了反复，引发指数大幅振荡。上半年的三大明星板块金融、地产和资源在三季度的调整幅度尤为明显，相当一部分的股票价格几乎回到二季度上涨前的水平。相应地，以医药、食品饮料和其他消费品为代表的稳定成长类资产在三季度表现出色。

本基金在三季度继续维持较高仓位运作，并严格遵照契约精神，增持了原有组合中传统的核心成长类标的，同时新增持了一批竞争优势突出、成长预期明确且估值合理的标的，并逐步减持了一批宏观经济关联度高的标的。我们认为，目前的资产组合自下而上的特征更趋明显，抗风险性和平衡性都有所加强。

如前所述，上半年的市场走势，主线就是周期类资产的重估。经过第三季度的泡沫化后的大幅调整，可以判断这轮建立在2008年过度恐慌基础上的重估已经告一段落。具体来看，如工程机械、家电、水泥、造船、造纸、纺织服装等行业，05—07年数量上的高增长必将难以为继，因而估值上升空间有限，未来股价上行推动力主要依赖于盈利的增长。

在流动性的角度来看，随着各项经济指标趋于正常化（目前，仅存不正常的指标是过高的投资增速和货币增速），无论是货币政策还是财政政策，问题的核心已经不是退出与否，而是退出的时间窗口。上半年以流动性为主要脉络，自上而下大类资产波澜壮阔的系统性行情也必将告一段落。

相比而言，从更长的眼光来看，成长类资产的机会则显得更为清晰。虽然大类的周期资产数量上的故事告一段落，但经济转型意味着很多新的业态模式只是刚刚起步。一些新技术、新服务和新的商业模式等将迎来一轮蓬勃发展期，并有望获得高质量的高速成长。

因此，逐步降低自上而下的策略配置，以调结构为导向精选个股的自下而上的投资将会成为未来较长一段时间市场运行的主线。我们也将秉持这一思路，严守基金契约，加大自下而上选股力度，为持有人创造持续收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	9,900,257,502.15	88.39
	其中:股票	9,900,257,502.15	88.39
2	固定收益投资	199,340,000.00	1.78
	其中:债券	199,340,000.00	1.78
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,089,987,559.28	9.73
6	其他资产	10,911,931.29	0.10
7	合计	11,200,496,992.72	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	1,369,637,796.08	12.28
C	制造业	2,949,448,283.88	26.45
C0	食品、饮料	1,181,425,314.69	10.60
C1	纺织、服装、皮毛	19,946,571.84	0.18
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	109,811,129.08	0.98
C4	石油、化学、塑胶、塑料	143,300,426.08	1.29
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	211,270,353.42	1.89
C7	机械、设备、仪表	398,434,982.80	3.57
C8	医药、生物制品	885,259,505.97	7.94
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	125,142,612.20	1.12
E	建筑业	455,927,107.16	4.09
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	517,954,931.66	4.65
H	批发和零售贸易	870,100,227.49	7.80
I	金融、保险业	2,376,356,086.75	21.31
J	房地产业	495,715,124.86	4.45
K	社会服务业	285,833,325.00	2.56
L	传播与文化产业	6,378,516.60	0.06
M	综合类	447,763,490.47	4.02
	合计	9,900,257,502.15	88.80

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	600519	贵州茅台	5,141,490	847,626,041.40	7.60
2	002024	苏宁电器	43,746,511	717,005,315.29	6.43
3	601318	中国平安	11,053,138	560,394,096.60	5.03
4	002007	华兰生物	9,568,347	497,554,044.00	4.46
5	601166	兴业银行	13,513,728	456,628,869.12	4.10
6	601939	建设银行	76,132,292	424,818,189.36	3.81
7	600000	浦发银行	21,573,259	423,914,539.35	3.80
8	600415	小商品城	9,446,141	374,067,183.60	3.36
9	600546	中油化建	12,836,531	296,010,404.86	2.65
10	000069	华侨城A	15,450,450	285,833,325.00	2.56

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	199,340,000.00	1.79
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	199,340,000.00	1.79

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五名债券投资明细

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	0901047	09央票47	2,000,000	199,340,000.00	1.79

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资产支持证券投资明细

本基金本报告期未持有资产支持证券。

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五名权证投资明细

本基金本报告期未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	7,434,888.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,665,868.37
4	应收利息	204,005.96
5	应收申购款	1,607,168.07
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,911,931.29

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	11,342,677,671.48
报告期期间基金总申购份额	491,650,800.88
报告期期间基金总赎回份额	1,565,320,572.01
报告期期间基金拆分变动份额（份额或少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	10,269,007,900.35

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

7.1.1 中国证监会批准汇添富成长焦点股票型证券投资基金募集的文件;
7.1.2《汇添富成长焦点股票型证券投资基金合同》;
7.1.3《汇添富成长焦点股票型证券投资基金托管协议》;
7.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照;
7.1.5 报告期内汇添富成长焦点股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;
7.1.6 中国证监会要求的其他文件。

7.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理有限公司

7.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站www.99fund.com查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-888-9918查询相关信息。

汇添富基金管理有限公司
2009年10月29日

汇添富优势精选混合型证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年09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。

本报告中财务资料未经审计。

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	汇添富优势精选混合
交易代码	519008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年8月25日
报告期末基金份额总额	1,946,460,690.47份
投资目标	投资具有持续竞争优势的企业，分享其在中国经济持续高速成长背景下的长期优异业绩，为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采用适度动态资产配置策略，同时运用汇添富持续竞争优势企业评估系统自下而上精选个股，并对投资组合进行积极而有效的风险管理。
业绩比较基准	70%×沪深300指数收益率+30%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金是精选股票，并且进行积极风险控制的混合型基金，本基金的风险和预期收益比较均衡，在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。
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

3.1 主要财务指标

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	550,780,958.38
2.本期利润	-90,344,323.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0427
4.期末基金资产净值	5,237,813,322.85
5.期末基金份额净值	2.6909

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、所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
本报告期	-2.61%	1.96%	-3.48%	1.68%	0.87%	0.28%

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

注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2005年8月25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 基金经理（或基金经理小组）简介

注:1、基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

2、基金经理的证券从业年限按其从事证券研究分析、投资管理等业务的年限计算。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 管理人对投资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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易机制，涵盖了各投资组合、各投资市场、各投资标的，贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程，并通过分析报告、监控、稽核保证制度流程的有效执行。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为混合型基金，股票投资对象主要是“持续竞争优势企业”，与本基金管理人旗下其他基金投资组合风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司公平交易制度执行情况良好，未发生任何异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2009年第三季度沪富优势收益为-2.61%。目前2005年8月25日成立运作以来，本基金累积收益率363.59%。

由于局部泡沫严重、融资进程加快特别是货币政策预期变化等原因，三季度沪深A股先扬后抑，其中8月份深幅调整，随后出现反弹收复了部分失地，最终沪深300指数下跌了5.11%。行业指数表现出现了结构性分化，消费品、信息设备、交运设备和医药生物等行业涨幅超过15%，而此前表现较好的房地产等与宏观经济高度相关的行业的跌幅居前。

本基金在三季度降低了股票仓位，并大力调整优化了股票组合结构。风格资产方面，本基金立足于防御，减持了金融、地产、煤炭等受到宏观冲击较大的行业，增持了食品饮料、商业贸易、医药生物等盈利增长比较确定的行业；个股选择方面，自下而上精选轻资产的优质企业来完善投资组合。

展望四季度乃至明年，本基金认为，经济回升态势明显，但V型反转不能成立。防通胀并不是主要矛盾，实际通胀水平不会很高，但是市场对高通胀的预期还将持续一段时间。在这种背景下，资产价格大幅上涨的基础并不牢固。未来行情将从估值提升向盈利驱动转变，结构性投资机会依然存在。本基金将积极寻找投资机会。

消费和服务、资源和能源依然是股票市场中长期的投资脉络主线，本基金将继续加大这些大类资产的投资。就1-2个季度短期投资机会而言，消费领域的医药和汽车行业将继续有较大的市场扩张潜力，优质企业将在未来两年内脱颖而出。工程机械行业竞争结构转好，受益于基础设施投资，盈利存在超出预期的可能，值得重点关注。TMT等中小盘高成长企业比较集中的行业以及近两年上市的次新股在四季度到明年年初也将存在较大投资机会。

以“为投资者创造持续稳定的较高收益”为己任，本基金将继续采取积极主动的投资策略和思路，继续完善现有投资组合。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,087,015,771.51	77.75
	其中:股票	4,087,015,771.51	77.75
2	固定收益投资	229,388,000.00	4.36
	其中:债券	229,388,000.00	4.36
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	924,798,207.37	17.59
6	其他资产	15,474,990.98	0.29
7	合计	5,256,676,969.86	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	686,083,399.74	13.10
C	制造业	1,173,872,336.55	22.41
C0	食品、饮料	825,292,332.70	15.76
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	141,535,339.41	2.70
C8	医药、生物制品	207,044,664.44	3.95
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	315,766,831.90	6.03
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	134,651,048.50	2.57
H	批发和零售贸易	164,010,566.94	3.13
I	金融、保险业	845,992,000.00	16.15
J	房地产业	380,397,528.28	7.26
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	275,274,900.00	5.26
M	综合类	110,967,159.60	2.12
	合计	4,087,015,771.51	78.03

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	601166	兴业银行	8,800,000	297,352,000.00	5.68
2	000895	双汇发展	6,600,000	276,276,000.00	5.27
3	600970	中材国际	7,300,821	247,497,831.90	4.73
4	600016	民生银行	30,000,000	202,200,000.00	3.86
5	600048	保利地产	8,182,002	197,513,528.28	3.77
6	600519	贵州茅台	1,180,000	194,534,800.00	3.71
7	000729	燕京啤酒	13,183,426	193,796,362.20	3.70
8	600583	海油工程	16,515,837	177,049,772.64	3.38
9	601088	中国神华	5,800,000	176,088,000.00	3.36
10	002024	苏宁电器	10,006,746	164,010,566.94	3.13

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	199,340,000.00	3.81
3	金融债券	30,048,000.00	0.57
	其中:政策性金融债	30,048,000.00	0.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	229,388,000.00	4.38

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五名债券投资明细

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	0901047	09央票47	2,000,000	199,340,000.00	3.81
2	060413	06农发13	300,000	30,048,000.00	0.57

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资产支持证券投资明细

本基金本报告期未持有资产支持证券。

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五名权证投资明细

本基金本报告期未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,341,955.87
2	应收证券清算款	6,094,222.36
3	应收股利	1,835,997.92
4	应收利息	999,922.76
5	应收申购款	1,202,892.07
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	15,474,990.98

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,274,433,131.39
报告期期间基金总申购份额	130,049,214.70
报告期期间基金总赎回份额	458,021,655.62
报告期期间基金拆分变动份额（份额或少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,946,460,690.47

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

7.1.1 中国证监会批准汇添富优势精选混合型证券投资基金募集的文件;
7.1.2《汇添富优势精选混合型证券投资基金合同》;
7.1.3《汇添富优势精选混合型证券投资基金托管协议》;
7.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照;
7.1.5 报告期内汇添富优势精选混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;
7.1.6 中国证监会要求的其他文件。

7.2 存放地点

上海市浦东新区富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理有限公司

7.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站www.99fund.com查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-888-9918查询相关信息。

汇添富基金管理有限公司
2009年10月29日

汇添富货币市场基金

2009 第三季度报告

2009年09月30日

基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
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责任。

基金托管人上海浦东发展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。

本报告中财务资料未经审计。

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	汇添富货币
交易代码	519518
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年3月23日
报告期末基金份额总额	5,998,126,832.71份
投资目标	力求在本金稳妥和基金资产高流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。
业绩比较基准	税后活期存款利率(即活期存款利率×(1-利息税率))。
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	汇添富货币A　汇添富货币B
下属两级基金的交易代码	519518　519517
报告期末下属两级基金的份额总额	252,662,419.64份　5,745,464,413.07份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	A级报告期（2009年07月01日至2009年09月30日）	B级报告期（2009年07月01日至2009年09月30日）
1.本期已实现收益	1,217,415.36	17,713,587.28
2.本期利润	1,217,415.36	17,713,587.28
3.期末基金资产净值	252,662,419.64	5,745,464,413.07

注: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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期A级基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
本报告期	0.4019%	0.0078%	0.0907%	0%	0.3112%	0.0078%

本报告期B级基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
本报告期	0.4627%	0.0078%	0.0907%	0%	0.3720%	0.0078%

注:本基金收益分配按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来A级基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来B级基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2006年3月23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。

2、本基金从本《基金合同》生效之日起至2009年2月15日采用的业绩比较基准为同期税后一年定期存款利率。从2009年2月16日起，本基金业绩比较基准为同期税后活期存款利率。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王珏池	本基金的基金经理、汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。	2005年11月8日	-	15年	国籍:中国。学历:澳门科技大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任申银万国证券股份有限公司固定收益总部投资部经理。2005年4月加入汇添富基金管理有限公司任交易主管,2005年11月8日至今任汇添富货币市场基金的基金经理,2007年11月3日至今任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。
陆文磊	本基金的基金经理，汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。	2009年1月21日	-	7年	国籍:中国。学历:华东师范大学金融学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任申银万国证券研究所宏观经济、固定收益深高级分析师,2007年8月加入汇添富基金管理有限公司，任固定收益高级经理,2007年12月13日至今任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理,2009年1月21日至今任汇添富货币市场基金的基金经理。

注:1、基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

2、基金经理的证券从业年限按其从事证券研究分析、投资管理等业务的年限计算。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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易机制，涵盖了各投资组合、各投资市场、各投资标的，贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程，并通过分析报告、监控、稽核保证制度流程的有效执行。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为货币市场基金，截止报告期，与本基金管理人旗下其他基金投资组合风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司公平交易制度执行情况良好，未发生任何异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

一、行情和操作回顾

三季度，工业增加值、PMI等指标显示经济明显见底回升，政府在宏观经济政策方面所采取的积极的财政政策和适度宽松的货币政策初见成效。政策层面从全面刺激经济转向“适度微调”。具体表现在银行信贷规模下降以及货币市场利率上升。

本季，本基金在央行提高货币市场利率后，迅速采取行动，及时降低了银行存款的比例，调高组合剩余期限以及信用债的投资比例，获得了较好的收益，并且促使投资组合在战略上处于有利位置。

二、行情展望

展望四季度，全球普遍采取的经济刺激政策、宽松的货币政策正逐步发挥作用，世界经济总体上处于缓慢复苏的阶段。由于各国的产业结构不同，所处的经济环境也不同，各国复苏进程出现分化，可以看到美国、欧盟等西方主要经济体仍将基准利