汇添富优势精选混合型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010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:2010年10月27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2010年10月22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2010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	1,845,605,195.34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(2010年7月1日－2010年9月30日)
1.本期已实现收益	-43,917,983.07
2.本期利润	653,524,905.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.3570
4.期末基金资产净值	4,715,258,364.86
5.期末基金份额净值	2.5549

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
过去三个月	16.27%	1.03%	10.42%	0.92%	5.85%	0.11%

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(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

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		
苏竞	本基金的基金经理、汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2007年6月18日	-	7年	国籍:中国。学历:上海海事大学经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任北京中国运载火箭技术研究院助理工程师、上海申银万国证券研究所高级研究员、上投摩根基金管理有限公司高级行业研究员、博时基金管理有限公司高级行业研究员。2006年9月加入汇添富基金管理有限公司,任高级行业分析师,2007年3月6日至2007年10月7日任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理助理,2007年10月8日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理,2007年12月17日至今任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理,2008年7月8日至今任汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
王栩	本基金的基金经理、汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理	2010年2月5日	-	8年	国籍:中国。学历:同济大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任上海永嘉投资管理有限公司研究员。2004年11月加入汇添富基金管理有限公司任高级行业研究员,2009年11月30日至2010年2月4日任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理助理,2010年2月5日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理,2010年9月21日至今任汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理。

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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010年三季度国内经济总体上延续了上半年的回落态势,固定资产投资和工业生产继续下滑,出口保持强劲增长势头但前景不乐观。A股市场面临的政策环境有所改善,政府开始启动一系列政策措施以维持经济平稳增长,例如加快基建项目的审批、放松对地方政府融资的限制、大力推进保障性住房建设。市场流动性进一步宽松,银行系统信贷额度的紧缺有所缓解,美、日、欧等发达国家由于经济复苏不理想仍延续甚至加强原有的宽松货币政策。在市场整体估值水平不高、政策环境改善和流动性进一步宽松的背景下,三季度A股市场迎来大幅反弹,沪深300指数上涨14.53%,中证500指数上涨27.18%。行业结构上,与流动性泛滥、通货膨胀预期上升相关的有色金属、农业表现最好,涨幅达到40%左右,食品饮料、汽车、商业等内需消费行业的表现也比较好,涨幅都在30%以上,而金融、电力、交通运输、钢铁等周期性行业表现最差。

本基金在三季度根据经济和市场环境的变化大幅提高股票仓位,重点增持有色、化工等周期性行业以及食品饮料、商业等内需消费行业的优质个股,减持了部分金融股。

展望2010年四季度,我们的基本观点如下。第一,积极财政政策的效果已经在8月份的宏观数据得到显现,经济快速回落的阶段已经过去,尽管房地产调控力度加大,市场所面临的宏观风险并不大。第二,市场流动性会进一步宽松。国内方面,M2增速在8月份已见底回升,央行在年内加息的可能性很小。国际方面,流动性泛滥有愈演愈烈之势,美联储表示在必要的时候将再次进行量化宽松,日本央行将银行间无担保隔夜拆借利率从0.1%下调到零至0.1%,时隔4年多再次实施零利率政策。第三,成长股依然是长期方向,但面临分化,压力一方面来自于解禁高峰期的到来,另一方面来自于机构投资者由过度配置中小盘成长股转向相对均衡配置。总体而言,我们认为宽松的流动性有望推动市场继续上涨。

四季度重点关注以下方面的投资机会。第一,在全球流动性过剩和货币竞争性贬值的背景下,资源股会有持续的良好表现。第二,由于宏观经济的风险不大,周期性板块估值普遍较低,房地产调控政策落地会促使阶段性的估值修复机会。第三,在市场风格转换的过程中,优质成长股可能会被错杀,提供良好的买入时机。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010年第三季度添富优势收益为16.27%。自2005年8月25日成立运作以来,本基金累计收益率426.55%。

§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	4,099,459,903.37	86.47
	其中:股票	4,099,459,903.37	86.47
2	固定收益投资	225,464,121.40	4.76
	其中:债券	225,464,121.40	4.76
	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	400,490,160.54	8.45
6	其他资产	15,616,447.58	0.33
7	合计	4,741,030,632.89	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	303,289,949.28	6.43
C	制造业	2,126,664,526.74	45.10
C0	食品、饮料	568,679,409.36	12.06
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	490,698,749.02	10.41
C5	电子	190,835,393.33	4.05
C6	金属、非金属	97,588,163.59	2.07
C7	机械、设备、仪表	211,098,253.32	4.48
C8	医药、生物制品	567,764,558.12	12.04
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	23,758,930.80	0.50
E	建筑业	168,236,825.40	3.57
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	272,666,770.03	5.78
H	批发和零售贸易	382,743,207.96	8.12
I	金融、保险业	531,385,832.24	11.27
J	房地产业	13,573,290.51	0.29
K	社会服务业	253,241,012.56	5.37
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	23,899,557.85	0.51
	合计	4,099,459,903.37	86.94

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	002007	华兰生物	3,997,102	203,852,202.00	4.32
2	600036	招商银行	13,446,912	174,137,510.40	3.69
3	000858	五粮液	4,999,784	171,642,584.72	3.64
4	000869	张裕A	1,358,124	162,961,298.76	3.46
5	002081	金螳螂	3,331,605	161,516,210.40	3.43
6	002004	华邦制药	2,168,185	132,215,921.30	2.80
7	600143	金发科技	9,695,580	131,762,932.20	2.79
8	600519	贵州茅台	699,937	118,100,370.01	2.50
9	000001	深发展A	6,475,355	105,030,258.10	2.23
10	002215	诺普信	3,381,306	101,608,245.30	2.15

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	-	-
3	金融债券	99,690,000.00	2.11
	其中:政策性金融债	99,690,000.00	2.11
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	125,774,121.40	2.67
7	其他	-	-
8	合计	225,464,121.40	4.78

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	113001	中行转债	1,194,890	125,774,121.40	2.67
2	090301	09进出01	1,000,000	99,690,000.00	2.11

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有权证。

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	2,700,251.41
2	应收证券清算款	11,626,587.58
3	应收股利	-
4	应收利息	1,075,679.59
5	应收申购款	213,929.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,616,447.58

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002215	诺普信	14,724,500.00	0.31	非公开发行股票锁定期

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,818,774,548.66
本报告期基金总申购份额	92,407,675.56
减:本报告期基金总赎回份额	65,577,028.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,845,605,195.34

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

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;
2、《汇添富优势精选混合型证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富优势精选混合型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
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;
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
2010年10月27日

汇添富货币市场基金

2010 第三季度报告

2010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:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2010年10月27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2010年10月22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2010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:	2,676,148,496.61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	
下属两级基金简称:	汇添富货币A	汇添富货币B
下属两级交易代码:	519518	519517
下属两级基金报告期末份额总额:	208,776,048.39	2,467,372,448.22

§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(2010年7月1日－2010年9月30日)	
	汇添富货币A	汇添富货币B
1. 本期已实现收益	1,002,450.02	14,877,936.22
2.本期利润	1,002,450.02	14,877,936.22
3.期末基金资产净值	208,776,048.39	2,467,372,448.22

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

汇添富货币A

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	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	0.5243%	0.0044%	0.0907%	0.0000%	0.4336%	0.0044%

注:本基金收益分配按月结转份额。

汇添富货币B

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	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	0.5848%	0.0044%	0.0907%	0.0000%	0.4941%	0.0044%

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。	2006年3月23日	-	16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,2006年3月23日至今任汇添富货币市场基金的基金经理,2008年3月6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	-	8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:曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。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,2008年3月6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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一、操作回顾

三季度,中国经济保持良好发展态势。随着PMI指数的回暖,投资者明显感到中国经济仍然保持平稳、较速增长,之前对于房地产调控的担心逐步消退,投资信心开始回升。

本季,中国货币市场的资金面显示出"前松后紧"的态势。季度初,由于半年报的影响消退货币市场利率从高位回落,但随着新股、可转债发行的影响,市场资金面开始收紧,市场利率出现上行,临近季度末,市场利率回到季度初的高位。从收益率曲线形态上看,一年以内的收益率趋平,期间利差很小,体现了市场对于短期收益率水平提升的要求。本季,央行通过公开市场操作回笼投放了1300亿资金。步骤上,采取了小幅投放和小幅回笼相间的方法,并没有明显的趋势性操作,市场预期较为平稳。

本基金针对市场的变化积极调整组合配置结构,在控制整体投资组合剩余期限的基础上,较大比例投资企业短期融资券以提高收益,降低了央票的投资,较频繁地通过逆回购以及银行存款的手段实现组合的收益、保证了组合的流动性。

二、行情展望

展望四季度,以美国为首的一些西方国家对于人民币汇率问题反映强烈,人民币升值预期不断升温;在国内,房地产调控政策明显收紧,产业转型正逐步铺开。我们预期在汇率改革变动期,国内利率环境会相对稳定,并且随着年内大型IPO都以发行完毕,市场脉冲式的资金紧张的风险预期正在消退,四季度,货币市场利率将逐步回落到一定合理水平。

我们认为四季度央行公开市场操作将仍以回笼为主,货币市场的收益率大幅上升的可能性不大,信用产品的收益率仍将具有一定吸引力。本基金将密切关注货币市场的变化,阶段性地调整利率投资品和信用投资品的投资比例,适度调整投资期限,以期获得理想收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金A级本期净值收益率为0.5243%,B级本期净值收益率为0.5848%。

§5 投资组合报告

5.1 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	固定收益投资	1,770,488,520.17	66.00
	其中:债券	1,770,488,520.17	66.00
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	420,001,070.00	15.66
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	479,331,440.63	17.87
4	其他资产	12,832,411.17	0.48
5	合计	2,682,653,441.97	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		0.99
	其中:买断式回购融资		0.34
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 期末基金组合剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	122
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	152
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	100

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	35.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	7.43	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	10.48	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	26.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.37	-
5	180天(含)-397天(含)	27.11	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.77	-

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	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	845,440,901.07	31.59
	其中:政策性金融债	845,440,901.07	31.59
4	企业债券	109,132,211.17	4.08
5	企业短期融资券	815,915,407.93	30.49
6	其他	-	-
7	合计	1,770,488,520.17	66.16
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	208,626,944.36	7.80

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100221	10国开21	6,000,000	595,925,341.65	22.27
2	090223	09国开23	1,000,000	100,021,764.85	3.74
3	090213	09国开13	1,000,000	99,494,733.19	3.72
4	0980147	09中航工债浮	600,000	60,408,785.23	2.26
5	1081088	10华能CP01	600,000	60,043,863.07	2.24
6	1081230	10中铝业CP02	500,000	50,086,342.84	1.87
7	1081339	10首钢CP01	500,000	50,078,272.17	1.87
8	1081213	10京机电CP01	500,000	50,051,531.32	1.87
9	1081121	10百联集CP01	500,000	50,038,243.06	1.87
10	1081203	10中南方CP01	500,000	50,011,756.50	1.87

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	6
报告期内偏离度的最高值	0.26%
报告期内偏离度的最低值	0.10%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.18%

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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金估值采用摊余成本法计价,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.8.2 本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

5.8.4 其他资产构成

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	12,582,411.17
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	12,832,411.17

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富货币A	汇添富货币B
本报告期期初基金份额总额	161,185,928.87	3,196,825,695.93
本报告期基金总申购份额	382,406,104.86	2,075,462,574.36
减:本报告期基金总赎回份额	334,815,985.34	2,804,915,822.07
本报告期期末基金份额总额	208,776,048.39	2,467,372,448.22

-

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富货币市场基金募集的文件;
2、《汇添富货币市场基金基金合同》;
3、《汇添富货币市场基金托管协议》;
4、《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》;
5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
6、报告期内汇添富货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告;
7、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
2010年10月27日

汇添富增强收益债券型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010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:2010年10月27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2010年10月22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2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:	汇添富增强收益债券	
交易代码:	519078	
基金运作方式:	契约型开放式	
基金合同生效日:	2008年3月6日	
报告期末基金份额总额:	2,256,450,226.51份	
投资目标:	在严格控制投资风险的基础上,主要投资于债券等固定收益类品种和其他低风险品种,力求为基金份额持有人谋求持续稳定的投资收益。	
投资策略:	类属资产配置由本基金管理人根据宏观经济分析、债券基准收益率研究、不同类别债券利差水平研究,判断不同类别债券类属的相对投资价值,并确定不同债券类属在组合资产中的配置比例。	
业绩比较基准:	中债总指数。	
风险收益特征:	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金简称:	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C
下属两级交易代码:	519078	470078
下属两级基金报告期末份额总额:	1,988,681,817.72份	267,768,408.79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	报告期(2010年7月1日－2010年9月30日)	
	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C
1.本期已实现收益	36,939,804.35	1,262,255.78
2.本期利润	69,247,098.09	1,374,151.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0323	0.0158
4.期末基金资产净值	2,140,847,760.88	286,990,716.21
5.期末基金份额净值	1.077	1.072

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

汇添富增强收益债券A

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)
过去三个月	3.16%	0.15%	0.16%	0.05%	3.00%	0.10%

汇添富增强收益债券C

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)
过去三个月	2.98%	0.15%	0.16%	0.05%	2.82%	0.10%

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:1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2008年3月6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、本基金自2009年9月15日起增加C类收费模式,该类别基金的累计份额净值增长率和业绩比较基准收益率自2009年9月15日起计算。

§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,汇添富货币市场基金的基金经理。	2008年3月6日	-	16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,2006年3月23日至今任汇添富货币市场基金的基金经理、2008年3月6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,汇添富货币市场基金的基金经理。	2008年3月6日	-	8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:曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。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,2008年3月6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

本基金为债券型基金,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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010年三季度经济运行的显著特点是增速下滑和通胀上升并存。一方面,随着年初以来针对房地产和地方融资平台调控措施效果的进一步显现,三季度经济增速继续回落,工业生产、投资等指标增长率均已回落至09年四季度以来的低位,外需方面,由于三季度美欧发达国家经济回落以及去年基数的提高,出口增长率开始见顶回落。另一方面,CPI在三季度持续攀升,8月份CPI创下3.5%的年内高点。不过值得注意的是,CPI的上涨是典型的结构性上涨,主要是受食品价格上涨的推动,非食品价格保持平稳,而生产资料价格在三季度随经济增速的下滑而明显回落。三季度宏观政策总体上处于观察期,央行货币政策以公开市场操作为主,对市场流动性进行微调,央票发行利率保持稳定,但随着CPI持续高于3%,9月份以后市场加息预期有所升温。

三季度债券市场经历了先涨后跌的过程,7-8月份市场以上涨为主,9月份以后受通胀上升和加息预期的影响,债券市场开始出现调整,收益率曲线整体上移。本基金三季度针对市场的变化进行积极的操作,7月初我们通过增持中长期国债和金融债提高了组合久期,较好了把握了债券市场的上涨机会,8月份以后我们减持了中长期利率品种,同时我们还减持了一部分绝对收益率偏低的企业债,降低了组合久期。另外,三季度可转债迎来大规模扩容,我们较大比例提高了对估值合理的新发可转债的配置比例,并积极的参与了新股申购,可转债和新股为本基金提供了较好的收益。

8月份以来经济下滑的速度已经有所放缓,预计四季度经济增速同比将继续回落,但环比增长将逐渐企稳,因此从经济的短期波动来看,经济下滑最快的阶段已经过去,未来一到两个季度有望保持相对低位的平稳增长。物价方面,尽管三季度CPI持续攀升,但考虑到结构性的上涨特点较为显著,出现全面通胀的风险依然较低,三季度末、四季度初很可能就是近期通胀的高点。未来一段时间内导致通胀压力加大的潜在风险因素是秋粮收成对食品价格的冲击以及美元贬值对大宗商品价格的冲击,对此本基金管理人将保持密切关注。总体而言,四季度进入经济企稳和通胀回落阶段的可能性较大,债券收益率不具备大幅上行的基础,但考虑到目前中长期债券收益率绝对水平和信用利差仍偏低,债券市场的波动可能会有所加剧。本基金管理人将密切关注收益率曲线的变化趋势,争取在债券市场的波动中抓住阶段性的投资机会;考虑到四季度以后信用产品的发行速度可能会有所加快,本基金将逐渐加大对信用资质较好、期限适中、票面利率相对较高的品种的配置力度;此外,本基金将继续持有具备长期投资价值的可转债的品种,并积极关注新发可转债的投资机会,同时在做好基本面分析的基础上有选择的参与新股的申购,争取为持有人创造持续稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A级净值增长3.16%,C级净值增长2.98%。

§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	252,528,688.95	10.39
	其中:股票	252,528,688.95	10.39
2	固定收益投资	2,000,327,425.48	82.31
	其中:债券	2,000,327,425.48	82.31
	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	47,474,672.62	1.95
6	其他资产	130,000,242.13	5.35
7	合计	2,430,331,029.18	100.00

5.2 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	4,459,543.45	0.18
B	采掘业	-	-
C	制造业	90,557,245.40	3.73
C0	食品、饮料	1,208,011.20	0.05
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	3,763,086.75	0.15
C5	电子	16,205,638.46	0.67
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	42,745,369.81	1.76
C8	医药、生物制品	26,635,139.18	1.10
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	79,392,029.60	3.27
G	信息技术业	11,430,936.75	0.47
H	批发和零售贸易	2,322,878.21	0.10
I	金融、保险业	35,873,162.84	1.48
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	1,381,325.00	0.06
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	27,111,567.70	1.12
	合计	252,528,688.95	10.40

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	601018	宁波港	22,363,952	79,392,029.60	3.27
2	601718	际华集团	5,532,973	27,111,567.70	1.12
3	601288	农业银行	9,757,232	25,466,375.52	1.05
4	002422	科伦药业	163,339	20,051,495.64	0.83
5	002454	松芝股份	508,474	14,852,525.54	0.61
6	601818	光大银行	3,007,742	10,406,787.32	0.43
7	601717	郑煤机	319,088	10,156,571.04	0.42
8	300118	东方日升	184,868	8,574,177.84	0.35
9	002434	万里扬	183,883	5,185,500.60	0.21
10	300103	达刚路机	122,816	4,690,343.04	0.19

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	159,846,000.00	6.58
2	央行票据	531,803,000.00	21.90
3	金融债券	242,580,000.00	9.99
	其中:政策性金融债	242,580,000.00	9.99
4	企业债券	429,239,099.00	17.68
5	企业短期融资券	350,398,000.00	14.43
6	可转债	286,461,326.48	11.80
7	其他	-	-
8	合计	2,000,327,425.48	82.39

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	113001	中行转债	1,627,530	171,313,807.80	7.06
2	1001042	10央票42	1,500,000	150,105,000.00	6.18
3	1001047	10央票47	1,300,000	130,013,000.00	5.36
4	090310	09进出10	1,100,000	110,616,000.00	4.56
5	0801059	08央票59	1,000,000	101,560,000.00	4.18

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有权证。

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	250,000.00
2	应收证券清算款	1,386,286.81
3	应收股利	-
4	应收利息	21,399,538.54
5	应收申购款	106,964,416.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	130,000,242.13

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110003	新钢转债	24,876,392.40	1.02
2	110007	博汇转债	10,568,901.20	0.44

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601018	宁波港	79,392,029.60	3.27	网下新股锁定期
2	601718	际华集团	27,111,567.70	1.12	网下新股锁定期
3	601288	农业银行	25,466,375.52	1.05	网下新股锁定期
4	002454	松芝股份	14,852,525.54	0.61	网下新股锁定期
5	601818	光大银行	10,406,787.32	0.43	网下新股锁定期
6	601717	郑煤机	10,156,571.04	0.42	网下新股锁定期
7	300118	东方日升	8,574,177.84	0.35	网下新股锁定期
8	300103	达刚路机	4,690,343.04	0.19	网下新股锁定期

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C
本报告期期初基金份额总额	2,123,371,790.84	25,214,791.09
本报告期基金总申购份额	298,511,636.20	250,184,393.06
减:本报告期基金总赎回份额	433,201,609.32	7,630,775.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,988,681,817.72	267,768,408.79

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富增强收益债券型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富增强收益债券型证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富增强收益债券型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
5、报告期内汇添富增强收益债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;
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
2010年10月27日