汇添富民营活力股票型证券投资基金

2010 第四季度报告

2010年12月31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:2011年1月21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2011年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富民营活力股票
交易代码	470009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月5日
报告期末基金份额总额	796,333,398.07份
投资目标	本基金采用自下而上的方法,精选与中国经济发展密切相关的优秀民营企业上市公司股票进行投资布局,在科学严格管理风险的前提下,力求基金资产的中长期增值。
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成长性较高且估值有吸引力的优秀民营企业上市公司以获取超额收益。本基金通过投资于具有良好的公司治理结构、灵活的用人和分配机制、独特的核心竞争优势等突出特征的优秀民营企业,以分享优秀民营企业成长所带来的资本增值。
业绩比较基准	中证民营企业综合指数×80%+上证国债指数×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,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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

§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10月1日-2010年12月31日)
1.本期已实现收益	87,097,565.62
2.本期利润	12,771,496.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0174
4.期末基金资产净值	915,929,975.97
5.期末基金份额净值	1.150

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	3.98%	1.92%	6.99%	1.45%	-3.01%	0.47%

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2010年5月5日,截至本报告期末,基金成立未满1年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2010年5月5日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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		
齐东超	本基金的基金经理,汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理,投资研究总监助理	2010年5月5日	-	6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日至2009年7月27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,2010年5月5日至今任汇添富民营活力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

本基金采用自下而上的方法,精选与中国经济发展密切相关的优秀民营企业上市公司股票进行投资布局,在科学严格管理风险的前提下,力求基金资产的中长期增值。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

回到一个季度前,呈现在我们面前的似乎是一片大好景象:出口增速和地产投资都超出预期,显示经济回升势头强劲;虽有各种农产品涨价现象,但CPI仍然在3左右,处在传统的可控区域;房地产呈现滞胀态势,政策效果的最终体现似乎只是时间问题。综合这些因素,市场普遍预期政策放松,至少与十二五相关的结构性刺激将成为大概率事件。

在这种高增长、温和通胀和宽松政策预期背景下,市场呈现出一波以传统大类资产为代表的强势上涨,并进一步过渡到调结构相关的中小市值股票。但十一月中旬以来,不断高企并迅速越过5%的CPI改变了前述乐观预期。央行持续的调升存款准备金率和加息让市场意识到,货币政策实际上已经开始从宽松转为适度稳健。流动性又一次主导了市场,市场系统性下挫。

事后回看四季度,除了投资者自己的主观分析外,市场大的运行逻辑其实并无改变,那就是经济结构转型(经济驱动力),货币政策回归正常化(流动性),控制地产泡沫(政策调控)。只是转型之年的不确定性,使得市场大容易对短期变化做出反应,而忽视中期逻辑。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

四季度,我们坚守契约,致力于优质民营企业的投资。四季度初资源品的反弹给我们的阶段性业绩形成压力(鲜有民营资源型上市公司),12月份中证500的大幅下跌,我们持仓股票未能幸免,给组合构成较大损失。本季度,本组合实现收益率为3.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一个季度,我们认为市场运行的大逻辑没有改变,经济结构转型赋以民营企业的制度红利还将延续,基于优质民企的投资方向依然值得期待。经历过去年四季度后期的普遍性下跌后,一部分优质个股的估值吸引力又得以显现,这为我们后续的精选个股提供了基础。实质上,类似的市场波动已经在过去的一年里多次上演,并不断加剧公司分化。民企集中的行业分布,使得本基金会在某热阶段无法跟住市场的贝塔,但精选个股,充分体现民企活力,通过民企更具吸引力的阿尔法,有望为持有人获取更丰厚的回报。

§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	787,627,988.91	84.84
	其中:股票	787,627,988.91	84.84
2	固定收益投资	40,160,000.00	4.33
	其中:债券	40,160,000.00	4.33
	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	96,539,024.80	10.40
6	其他资产	4,068,438.39	0.44
7	合计	928,395,452.10	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	3,352,680.30	0.37
B	采掘业	-	-
C	制造业	424,211,881.34	46.31
C0	食品、饮料	58,460,457.73	6.38
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	13,727,836.64	1.50
C4	石油、化学、塑胶、塑料	66,268,764.60	7.24
C5	电子	43,649,350.87	4.77
C6	金属、非金属	38,226,420.05	4.17
C7	机械、设备、仪表	51,480,010.00	5.62
C8	医药、生物制品	128,037,441.45	13.98
C99	其他制造业	24,361,600.00	2.66
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,849,883.00	0.64
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	112,820,841.07	12.32
H	批发和零售贸易	117,972,554.60	12.88
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	29,898,090.00	3.26
L	传播与文化产业	21,840,291.20	2.38
M	综合类	71,681,767.40	7.83
	合计	787,627,988.91	85.99

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	000861	海印股份	3,653,725	60,651,835.00	6.62
2	000915	山大华特	3,200,500	56,616,845.00	6.18
3	002153	石基信息	872,813	49,313,934.50	5.38
4	600146	大元股份	1,791,748	48,645,958.20	5.31
5	600079	人福医药	1,722,734	43,895,262.32	4.79
6	000876	新希望	1,698,991	35,593,861.45	3.89
7	300022	吉峰农机	1,074,795	34,393,440.00	3.76
8	000989	九芝堂	2,000,000	29,680,000.00	3.24
9	002003	伟星股份	920,000	24,361,600.00	2.66
10	300099	尤洛卡	214,200	24,161,760.00	2.64

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	40,160,000.00	4.38
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	40,160,000.00	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	0801050	08央票50	400,000	40,160,000.00	4.38

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	1,847,081.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,249,171.13
5	应收申购款	972,185.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,068,438.39

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§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	833,587,391.12
本报告期基金总申购份额	442,401,038.07
减:本报告期基金总赎回份额	479,655,031.12
本报告期期末基金份额总额	796,333,398.07

注:本基金合同生效日为2010年5月5日。

§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民营活力股票型证券投资基金募集的文件;

2.《汇添富民营活力股票型证券投资基金基金合同》;

3.《汇添富民营活力股票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.报告期内汇添富民营活力股票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
2011年1月21日

汇添富上证综合指数证券投资基金

2010 第四季度报告

2010年12月31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:2011年1月21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2011年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富上证综合指数
交易代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月1日
报告期末基金份额总额	7,381,183,450.73份
投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于6%,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性,主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%且年化跟踪误差小于6%的投资目标。
业绩比较基准	上证综合指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
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

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10月1日-2010年12月31日)
1.本期已实现收益	-25,916,282.83
2.本期利润	287,910,004.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.0386
4.期末基金资产净值	6,641,430,279.71
5.期末基金份额净值	0.900

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	4.65%	1.51%	5.46%	1.48%	-0.81%	0.03%

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(2009年7月1日)起3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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		
何仁科	本基金的基金经理,产品创新部总监	2009年7月1日	-	9年	国籍:中国.学历:华中科技大学数量经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任东方证券股份有限公司研究所高级经理,2004年12月加入汇添富基金管理有限公司任产品与金融工程部副总监,产品创新部总监,2009年7月1日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。
吴振翔	本基金的基金经理	2010年2月5日	-	4年	国籍:中国.学历:中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理,2008年3月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程研究员,2010年1月8日至2010年2月4日任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理助理,2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数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

本基金采用指数投资,采用被动化投资跟踪上证综合指数的收益率,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4季度通货膨胀意外攀升,央行连续加息,市场呈现出先扬后抑的态势。本基金遵循了指数基金的被动投资原则,保持了指数基金的本质属性。本基金股票投资仓位在报告期内基本保持在92%-95%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

报告期内工商银行表现好于替代组合,造成一定的投资收益偏差,本基金对抽样复制组合采取规避中式调整,有效的降低了冗余的交易量,报告期内抽样复制组合与上证综合指数中小盘股票的表现接近,抽样复制方法在报告期体现了较好的适用性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

上证综合指数在报告期内上涨了5.74%,本基金在报告期内累计收益率为4.65%,同期业绩比较基准收益率为5.46%,收益率落后业绩比较基准0.81%。收益率的差异因素主要来源于托管行股票替代、中期赎回等因素的综合作用。本基金日均跟踪误差为0.15144%,这一跟踪误差水平远低于0.35%,在报告期达到了投资目标。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一段时间,2010年末呈现的高通货膨胀在年初仍将延续,控制物价水平将成为央行首要的任务,稳健的货币政策仍将持续;在保民生影响的前提下,对房地产的调控继续是大概率事件,调控的力度可能将影响经济的增长。但一些受政策支持的新兴产业仍将保持原有的增速,快速的城市化进程将保证基础设施建设和总体消费仍将保持在较高的水平上;另外美国经济在2010年呈现出较好的复苏态势,这将有利于2011年我国的外部需求的增长。

当前市场的大盘股和周期类股票估值水平处于历史低位,尽管很多小盘股估值相对较高,但市场整体定价合理,人民币升值预期也将提高A股市场对资金的吸引力,我们认为A股市场在2011年将是全球最具有吸引力的市场之一。需要注意的是,如果通货膨胀从上半年高点的回落,市场可能出现大小盘风格的结构性转变。

作为被动投资的指数型基金,汇添富上证综合指数基金将严格遵守基金合同,继续坚持既定的指数化投资策略,积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。我们也非常望添富上证能继续与投资者一起分享中国经济的美好未来。

§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	6,278,778,084.01	94.42
	其中:股票	6,278,778,084.01	94.42
2	固定收益投资	197,160,000.00	2.96
	其中:债券	197,160,000.00	2.96
	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	155,411,639.08	2.34
6	其他资产	18,237,895.76	0.27
7	合计	6,649,587,618.85	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	42,238,217.20	0.64
B	采掘业	1,374,792,896.00	20.70
C	制造业	1,618,405,879.61	24.37
C0	食品、饮料	199,764,082.40	3.01
C1	纺织、服装、皮毛	39,595,549.20	0.60
C2	木材、家具	12,327,565.40	0.19
C3	造纸、印刷	10,617,059.70	0.16
C4	石油、化学、塑胶、塑料	170,671,054.79	2.57
C5	电子	30,937,355.90	0.47
C6	金属、非金属	336,534,200.38	5.07
C7	机械、设备、仪表	563,633,885.51	8.49
C8	医药、生物制品	195,505,368.38	2.94
C99	其他制造业	58,819,757.95	0.89
D	电力、煤气及水的生产和供应业	222,299,414.79	3.35
E	建筑业	182,532,441.34	2.75
F	交通运输、仓储业	344,603,228.46	5.19
G	信息技术业	198,799,390.72	2.99
H	批发和零售贸易	151,937,617.36	2.29
I	金融、保险业	1,831,776,434.24	27.58
J	房地产业	137,436,058.90	2.07
K	社会服务业	68,071,269.84	1.02
L	传播与文化产业	27,285,968.82	0.41
M	综合类	78,599,266.73	1.18
	合计	6,278,778,084.01	94.54

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未进行积极投资。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601857	中国石油	57,326,103	643,198,875.66	9.68
2	601288	农业银行	105,334,012	282,295,152.16	4.25
3	601988	中国银行	78,533,476	253,663,127.48	3.82
4	600028	中国石化	24,754,857	199,524,147.42	3.00
5	600036	招商银行	12,395,082	158,781,000.42	2.39
6	601628	中国人寿	7,434,318	158,350,973.40	2.38
7	601088	中国神华	5,887,551	145,481,385.21	2.19
8	601328	交通银行	24,243,694	132,855,443.12	2.00
9	600000	浦发银行	8,144,753	100,913,489.67	1.52
10	601318	中国平安	1,708,821	95,967,387.36	1.44

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未进行积极投资。

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	197,160,000.00	2.97
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	197,160,000.00	2.97

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	0801044	08央票44	1,000,000	100,360,000.00	1.51
2	1001095	10央票95	1,000,000	96,800,000.00	1.46

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	583,333.31
2	应收证券清算款	12,159,627.62
3	应收股利	-
4	应收利息	3,616,536.94
5	应收申购款	1,878,397.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,237,895.76

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

5.8.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未进行积极投资,不存在流通受限情况。

-

§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	7,344,609,858.57
本报告期基金总申购份额	852,786,162.39
减:本报告期基金总赎回份额	816,212,570.23
本报告期期末基金份额总额	7,381,183,450.73

§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上证综合指数证券投资基金募集的文件;

2.《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》;

3.《汇添富上证综合指数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.报告期内汇添富上证综合指数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
2011年1月21日

汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金

2010 第四季度报告

2010年12月31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:2011年1月21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2011年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富亚澳成熟优选股票(QDII)
交易代码	470888
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月25日
报告期末基金份额总额	128,625,234.06份
投资目标	在亚洲澳洲成熟证券市场(除日本外)精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的公司股票等证券,通过有效的资产配置和组合管理,进行中长期投资布局,在有效管理风险的前提下,追求持续稳健的较高投资回报。
投资策略	本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中,根据宏观经济和证券市场状况,并基于业绩比较基准的市场权重,通过分析各个股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征,确定投资组合中各市场的投资范围和比例。在股票投资中,采用"自下而上"的策略,精选出具有持续竞争优势,且估值有吸引力的股票,精心科学构建股票投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得中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	60%×MSCI太平洋(除日本)指数(MSCI Pacific ex Japan Index)+40%×MSCI中国指数(MSCI China Index)
风险收益特征	本基金为投资于亚洲澳洲地区成熟市场(除日本外)的主动股票型基金,属于证券投资基金中高收益高风险的品种。
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

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Capital International,Inc.	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	资本国际公司	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		11100 Santa Monica Blvd,15th Floor Los Angeles,CA 90025-3384,USA	140 Broadway New York,NY 10005
办公地址		One Raffles Quay,33rd Floor North Tower Singapore 048583	140 Broadway New York,NY 10005
邮政编码		Singapore 048583	NY 10005

§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10月1日-2010年12月31日)
1.本期已实现收益	6,080,493.30
2.本期利润	8,035,191.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0583
4.期末基金资产净值	143,264,504.56
5.期末基金份额净值	1.114

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	5.00%	0.95%	4.79%	1.08%	0.21%	-0.13%

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2010年6月25日,截至本报告期末,基金成立未满1年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2010年6月25日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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