汇添富上证综合指数证券投资基金 2010年年度报告摘要

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3月28日

§1 重要提示及目录

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2011年3月23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2010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	汇添富上证综合指数
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	7,381,183,450.73份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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 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	http://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层汇添富基金管理有限公司

§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	2010年	2009年7月1日（基金合同生效日）至2009年12月31日
本期已实现收益	-124,968,393.97	136,435,477.21
本期利润	-967,325,237.92	459,360,518.60
加权平均基金份额本期利润	-0.1395	0.0537
本期基金份额净值增长率	-14.37%	5.34%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1002	0.0174
期末基金资产净值	6,641,430,279.71	7,308,929,815.32
期末基金份额净值	0.900	1.051

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、由于本基金于2009年7月1日成立，无比较式的前三年可比期间，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2010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	4.65%	1.51%	5.46%	1.48%	-0.81%	0.03%
过去六个月	15.09%	1.34%	16.24%	1.30%	-1.15%	0.04%
过去一年	-14.37%	1.38%	-13.58%	1.35%	-0.79%	0.03%
自基金合同生效起至今	-10.00%	1.56%	-4.83%	1.55%	-5.17%	0.01%

注：本基金的《基金合同》生效日为2009年7月1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（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。

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2009年7月1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

本基金成立于2009年7月1日，2009年度和2010年度均未进行利润分配。

§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

汇添富基金管理有限公司成立于2005年2月，公司总部设在上海陆家嘴。经过六年的发展，公司已成为业务布局完善、管理体系严谨、团队稳定优秀、文化优势突出、品牌日益确立，具有较强综合竞争实力的资产管理公司。公司业务覆盖公募基金管理、特定客户资产管理、QDII业务、社保委托投资管理等，并设立有北京分公司、南方分公司和汇添富资产管理（香港）有限公司（China Universal Asset Management（Hong Kong）Company Limited）。

2010年汇添富稳步推进公募基金业务，成功发行中国首只民营企业投资基金——汇添富民营活力股票型证券投资基金，中国首只医药行业基金——汇添富医药保健股票型证券投资基金，以及公司首只QDII产品——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。截至2010年12月31日，汇添富管理12只公募基金，资产管理规模达569亿，位居全行业第12位。

同时，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。2010年，汇添富取得了较为优秀的投资业绩。

2010年汇添富专户业务快速发展，专户业务团队实力进一步增强，工作模式持续优化，并率先在业内推出了“添富牛专户”专属品牌。截至本报告期末，汇添富管理的专户产品数量、专户资产规模与业绩回报居行业前列。

2010年汇添富国际业务取得重大突破。汇添富资产管理（香港）有限公司完成注册登记手续，成为业内少数几家正式设立并运作海外机构的基金管理公司之一。8月，香港子公司成功发行首只对冲基金——汇添富大中华绝对收益基金。

2010年汇添富在积极推进既有业务的同时，锐意进取，大力创新，经过长期艰苦的努力，获得社保境内委托投资管理人资格。

在稳步推进各项业务的同时，汇添富更着力实现贴心的客户服务与投资者教育工作。公司在行业内首推基于SNS平台的“添富空间”，倡导“理财+生活”的理念，并通过“汇添富微博”、“感恩五周年”、理财教育讲座、“添富之约”等活动，进一步拓展客户服务新渠道，为客户提供实惠、便利的理财生活服务。

企业的发展离不开社会各界的支持，资源来自于社会更要服务于社会，2010年，汇添富持续推进社会慈善事业，积极探索企业慈善公益事业新模式，有效推进长期公益项目建设。在报告期内，公司发起成立上海汇添富公益基金会，并开展青海玉树地震救灾、援建100所“添富幸福书屋”、支持孤残儿童寄养、关怀癌症患者等具有影响力的公益活动。同时，公司深入推进“河流？孩子”公益项目，启动开展“河流？孩子——汇添富黄河两岸助学计划”，在宁夏捐资新建第三所“添富小学”。

2011年，中国资本市场环境将更加复杂多变，基金行业的竞争将更为激烈，汇添富将以更积极的心态拥抱变革，为实现“经过长期努力发展成为中国最优秀的资产管理公司之一”的目标，进一步发扬公司“正直、激情、团队、客户第一、感恩”的文化优势，完善战略布局，夯实长远发展基础，开拓创新，持续提升公司的核心竞争力，力争为中国基金业的繁荣做出更多贡献。

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		
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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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

本基金为指数型基金，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 管理人对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年上半年由于政府出台了一系列调控措施，股票市场呈现了持续下跌的态势，中国经济增速也开始逐渐下降，三季度经济增速已经出现见底迹象，股票市场也出现了较大幅度的上涨，但四季度通货膨胀的意外攀升，致使央行连续加息，股票市场在年末亦连续下跌，纵观全年，受政策引导的节能环保等新兴产业受到市场的持续追捧。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缓冲式调整，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下跌了14.31%，本基金在报告期内累计收益率为-14.37%，同期业绩比较基准收益率为-13.58%，收益率落后业绩比较基准0.79%。收益率的差异因素主要来源于托管行股票替代、申购赎回等因素的综合作用。本基金日均跟踪误差为0.108%，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，在央行数次提高存款准备金率和利率的情况下，如果通货膨胀仍不能有效降低，可能会触发持续的紧缩政策；在保民生的前提下，对房地产的调控继续是大概率事件，调控的力度也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年末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，尽管小盘股总体估值水平相对较高可能会引发市场的结构性变化，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年将是全球较具有吸引力的市场之一。需要注意的是，如果通货膨胀在年内得到有效控制，市场可能会因为紧缩放松的预期，出现较好的投资机会。

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。我们也非常期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。

4.6 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、产品创新部、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签订了《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。

4.7 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：每年度6月和12月的最后一个交易日每份基金份额可供分配利润超过0.02元时，至少将期末可供分配利润的20%进行收益分配。本基金2010年6月30日可供分配基金份额利润为-0.2180元，2010年12月31日可供分配基金份额利润为-0.1002元，未达到收益分配的基准，因此本年度本基金未进行利润分配。

§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

2010年，本基金托管人在对汇添富上证综合指数证券投资基金的托管过程中，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

2010年，汇添富上证综合指数证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富上证综合指数证券投资基金的投资运作、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，汇添富上证综合指数证券投资基金未进行利润分配。

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有限公司编制和披露的汇添富上证综合指数证券投资基金2010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审计，注册会计师徐艳、方侃于2011年3月25日签字出具了安永华明（2011）审字第60466941_B09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：汇添富上证综合指数证券投资基金
报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产：		
银行存款	155,284,697.55	197,074,174.52
结算备付金	126,941.53	436,256.29
存出保证金	583,333.31	375,000.00
交易性金融资产	6,475,938,084.01	7,085,375,279.90
其中：股票投资	6,278,778,084.01	6,886,035,279.90
基金投资	-	-
债券投资	197,160,000.00	199,340,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	12,159,627.62	-
应收利息	3,616,536.94	298,824.56
应收股利	-	-
应收申购款	1,878,397.89	108,846,457.65
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,649,587,618.85	7,392,405,992.92
负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009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	-	30,804,600.28
应付赎回款	1,765,145.50	44,263,689.41
应付管理人报酬	4,306,886.93	4,634,359.51
应付托管费	861,377.38	926,871.93
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	797,032.78	2,419,834.61
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	426,896.55	426,821.86
负债合计	8,157,339.14	83,476,177.60
所有者权益：		
实收基金	7,381,183,450.73	6,956,558,846.35
未分配利润	-739,753,171.02	352,370,968.97
所有者权益合计	6,641,430,279.71	7,308,929,815.32
负债和所有者权益总计	6,649,587,618.85	7,392,405,992.92

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值0.900元，基金份额总额7,381,183,450.73份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金
本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年7月1日（基金合同生效日）至2009年12月31日
一、收入	-903,789,412.56	515,713,148.79
1.利息收入	5,404,490.70	3,382,154.45
其中：存款利息收入	1,849,916.23	2,135,976.01
债券利息收入	3,554,574.47	1,246,178.44
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）	-69,031,973.39	180,912,245.22
其中：股票投资收益	-147,451,967.07	154,353,003.89
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,393,862.36	1,069,558.21
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	770,301.73
股利收益	76,026,131.32	24,719,381.39
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-842,356,843.95	322,925,041.39
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,194,914.08	8,493,707.73
二、费用	63,535,825.36	56,352,630.19
1.管理人报酬	47,394,335.77	32,302,631.19
2.托管费	9,478,867.12	6,460,526.28
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	6,141,710.91	17,324,763.01
5.利息支出	80,614.06	-
其中：卖出回购金融资产支出	80,614.06	-
6.其他费用	440,297.50	264,709.71
三、利润总额	-967,325,237.92	459,360,518.60

注：由于本基金于2009年7月1日成立，因此上年度可比期间只列示从基金合同生效日至2009年12月31日数据，特此说明。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金
本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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）	6,956,558,846.35	352,370,968.97	7,308,929,815.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-967,325,237.92	-967,325,237.92
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）	424,624,604.38	-124,798,902.07	299,825,702.31
其中：1.基金申购款	2,613,850,079.11	-220,104,634.67	2,393,745,444.44
2.基金赎回款	-2,189,225,474.73	95,305,732.60	-2,093,919,742.13
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）	7,381,183,450.73	-739,753,171.02	6,641,430,279.71
项目	上年度可比期间 2009年7月1日（基金合同生效日）至2009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）	9,097,758,651.47	-	9,097,758,651.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	459,360,518.60	459,360,518.60
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）	-2,141,199,805.12	-106,989,549.63	-2,248,189,354.75
其中：1.基金申购款	4,431,370,521.47	115,302,595.03	4,546,673,116.50
2.基金赎回款	-6,572,570,326.59	-222,292,144.66	-6,794,862,471.25
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）	6,956,558,846.35	352,370,968.97	7,308,929,815.32

注：由于本基金于2009年7月1日成立，因此上年度可比期间只列示从基金合同生效日至2009年12月31日数据，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

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____
基金管理公司负责人　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

汇添富上证综合指数证券投资基金（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［2009］371号文《关于核准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的批复》的核准，由汇添富基金管理有限公司作为发起人向社会公开募集，基金合同于2009年7月1日生效，首次设立募集规模为9,097,758,651.47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与注册登记机构为汇添富基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括上海证券交易所上市交易的所有股票、新股（如一级市场初次发行或增发）等。如以后法律法规及中国证监会允许基金投资其他金融工具，如股指期货、ETF等，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定，将其纳入投资范围。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。本基金的业绩比较基准为：上证综合指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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，也参考了中国证券业协会制定的《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》、证监会公告［2010］5号关于发布《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2010年12月31日的财务状况以及2010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

1.印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字［2005］103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字［2004］78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字［2005］103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税［2008］1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字［2002］128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字［2005］107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税［2005］102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字［2005］103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金戎控股有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1. 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年7月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券股份有限公司	639,100,039.10	15.86	5,071,441,947.86	38.13

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年7月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
东方证券股份有限公司	-	-	1,666,819.10	28.53

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券股份有限公司	542,957.73	15.86	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2009年7月1日至2009年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券股份有限公司	4,310,695.23	38.13	160,030.34	6.62

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年7月1日（基金合同生效日）至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	47,394,335.77	32,302,631.19
其中：支付给销售机构的客户维护费	14,323,084.65	6,745,235.23

注：基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.75%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年7月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	9,478,867.12	6,460,526.28

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.15%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金2010年度及2009年7月1日（基金合同生效日）至2009年12月31日止期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年7月1日至2009年12月31日
基金合同生效日（2009年7月1日）持有的基金份额		30,027,875.00
期初持有的基金份额	43,496,625.00	-
期间申购/买入总份额	-	13,468,750.00
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	43,496,625.00	43,496,625.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.59%	0.63%

注：1、本公司于2009年5月26日运用固有资金30,000,000.00元认购本基金份额30,027,875.00份（含募集期利息结转的份额），认购费用1,000.00元，符合招募说明书规定的认购费率。

2、本公司于2009年9月4日运用固有资金12,500,000.00元申购本基金份额13,468,750.00份，申购费用1,000.00元，符合招募说明书规定的申购费率。

3、其中“申购/买入”含红利再投、转换入份额；“赎回/卖出”含转换出份额。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其它关联方未有投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年7月1日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	155,284,697.55	1,754,196.75	197,074,174.52	2,028,986.41

注：由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入包含了关联方保管的银行存款期末余额、除了最低备付金以外的结算备付金期末余额及当期产生的利息收入。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金2010年度及2009年7月1日（基金合同生效日）至2009年12月31日止期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家化	2010-12-6	重组停牌	37.13	-	-	591,881	10,922,425.58	21,976,541.53	-
600518	康美药业	2010-12-28	配股停牌	19.71	2011-1-6	17.29	612,614	6,223,337.80	12,074,621.94	-
600664	哈药股份	2010-12-29	重组停牌	22.57	2011-2-16	24.83	439,712	7,050,679.85	9,924,299.84	-
600816	安信信托	2010-6-2	重大事项未公告	13.60	-	-	488,852	8,443,822.62	6,648,387.20	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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
	其他各项资产	18,237,895.76	0.27
	合计	6,649,587,618.85	100.00

8.2 期末按行业分类的股票指数投资组合

8.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	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

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.99fund.com网站的年度报告正文。

8.3.2 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	314,234,953.48	4.30
2	600036	招商银行	176,230,640.93	2.41
3	601857	中国石油	124,207,979.69	1.70
4	601328	交通银行	98,433,818.84	1.35
5	600028	中国石化	71,148,192.24	0.97
6	601988	中国银行	57,718,072.56	0.79
7	601818	光大银行	53,976,683.52	0.74
8	601688	华泰证券	52,314,218.56	0.72
9	601628	中国人寿	51,054,334.66	0.70
10	601939	建设银行	44,458,630.34	0.61
11	601088	中国神华	43,250,671.24	0.59
12	601166	兴业银行	41,157,204.51	0.56
13	600016	民生银行	38,022,839.64	0.52
14	600000	浦发银行	35,148,385.46	0.48
15	601377	兴业证券	30,307,270.93	0.41
16	600050	中国联通	26,446,378.95	0.36
17	600079	人福医药	26,204,248.86	0.36
18	601158	重庆水务	24,627,758.90	0.34
19	601318	中国平安	22,000,207.02	0.30
20	601299	中国北车	21,559,403.98	0.29

注：买入金额按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601857	中国石油	178,897,255.65	2.45
2	601988	中国银行	171,901,178.38	2.35
3	600036	招商银行	133,735,751.59	1.83
4	600028	中国石化	86,078,144.94	1.18
5	601939	建设银行	64,338,908.39	0.88
6	601628	中国人寿	61,432,748.45	0.84
7	601088	中国神华	51,399,668.05	0.70
8	601328	交通银行	39,004,224.65	0.53
9	601166	兴业银行	35,164,897.76	0.48
10	600016	民生银行	34,628,073.21	0.47
11	601601	中国太保	32,536,031.81	0.45
12	600000	浦发银行	26,776,879.03	0.37
13	601318	中国平安	25,457,376.13	0.35
14	601288	农业银行	22,824,787.08	0.31
15	601998	中信银行	20,063,988.05	0.27
16	600030	中信证券	19,603,043.96	0.27
17	600104	上海汽车	17,728,494.65	0.24
18	600519	贵州茅台	17,483,037.27	0.24
19	600900	长江电力	16,869,038.60	0.23
20	600019	宝钢股份	16,109,384.79	0.22

注：卖出金额按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,238,981,199.89
卖出股票收入（成交）总额	1,858,663,691.85

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	-	-
	其他	-	-
	合计	197,160,000.00	2.97

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	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

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

8.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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	-
	其他	-
	合计	18,237,895.76

8.9.4 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。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 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。

8.9.5.2 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，不存在流通受限的情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
131,619	56,079.92	1,753,019,949.21	23.75%	5,628,163,501.52	76.25%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	740,222.99	0.01%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年7月1日）基金份额总额	9,097,758,651.47
本报告期期初基金份额总额	6,956,558,846.35
本报告期基金总申购份额	2,613,850,079.11
减：本报告期基金总赎回份额	2,189,225,474.73
本报告期期末基金份额总额	7,381,183,450.73

注：表内“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人2010年1月9日公告，增聘陈晓翔先生担任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，庞飒先生不再担任该基金的基金经理。

2、基金管理人2010年2月6日公告，增聘吴振翔先生担任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。增聘王栩先生担任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理，庞飒先生不再担任该基金的基金经理。

3、《汇添富民营活力股票型证券投资基金基金合同》于2010年5月5日正式生效，齐东超先生任该基金的基金经理。

4、《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基金合同》于2010年6月25日正式生效，刘子龙先生、王致人先生任该基金的基金经理。

5、基金管理人2010年8月5日公告，经汇添富基金管理有限公司第二届董事会第八次会议决议，并经中国证监会审核批准（证监许可［2010］1013号文），公司聘任陈灿辉先生为公司副总经理。

6、《汇添富医药保健股票型证券投资基金基金合同》于2010年9月21日正式生效，王栩先生任该基金的基金经理，周睿先生、叶从飞先生任该基金的基金经理助理。

7、基金托管人中国工商银行经证监会审批任命晏秋生为资产托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所自本基金合同生效日（2009年7月1日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期末，应付未付的审计费用为人民币捌万元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	1,238,826,036.84	30.75%	1,053,001.75	30.75%	-
东方证券	2	639,100,039.10	15.86%	542,957.73	15.86%	-
中信建投	1	627,872,253.54	15.58%	533,688.65	15.58%	-
湘财证券	1	565,259,912.91	14.03%	480,471.04	14.03%	-
广发证券	1	294,103,081.72	7.30%	249,985.35	7.30%	-
银河证券	1	167,832,670.41	4.17%	142,659.30	4.17%	-
国信证券	2	128,165,576.53	3.18%	108,941.05	3.18%	-
中投证券	1	123,248,782.11	3.06%	104,761.86	3.06%	-
海通证券	1	111,622,719.65	2.77%	94,878.97	2.77%	-
联合证券	1	83,397,089.22	2.07%	70,886.98	2.07%	-
中金公司	2	31,276,175.87	0.78%	26,584.64	0.78%	-
中银国际	1	11,812,170.01	0.29%	10,040.18	0.29%	-
华宝证券	1	6,560,000.00	0.16%	5,576.06	0.16%	-
合计	30	4,029,076,507.91	100.00%	3,424,433.56	100.00%	-

注：此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东北证券	-	-
兴业证券	-	-
国金证券	-	-
江海证券	-	-
申银万国	-	-
平安证券	-	-
恒泰证券	-	-
中信证券	-	-
国泰君安		
齐鲁证券	-	-
东吴证券	-	-
长城证券	-	-
长江证券	-	-
东方证券	-	-
中信建投	270,183,582.30	100.00%
湘财证券	-	-
广发证券	-	-
银河证券	-	-
国信证券	-	-
中投证券	-	-
海通证券	-	-
联合证券	-	-
中金公司	-	-
中银国际	-	-
华宝证券	-	-
合计	270,183,582.30	100.00%

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

（2）交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。

（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

（5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

（6）成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

（7）调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

此30个交易单元与汇添富优势精选混合型证券投资基金共用。本报告期新增3家证券公司的3个交易单元：兴业证券（上交所交易单元）、中银国际（上交所交易单元）、齐鲁证券（深交所交易单元）；

汇添富基金管理有限公司
2011年3月28日