汇添富价值精选股票型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:2011年10月26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10月24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2011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	519069
前端交易代码	519069
后端交易代码	519070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年1月23日
报告期末基金份额总额	1,588,213,146.57份
投资目标	本基金精选价值相对低估的优质公司股票,在有效管理风险的前提下,追求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金采用灵活积极的资产配置和股票投资策略,在资产配置中,通过以宏观经济及宏观经济政策分析为核心的情景分析法来确定投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例,并结合对市场估值、市场资金、投资主体行为和市场信心影响等因素的综合判断进行灵活调整;在股票投资中,采取"自下而上"的策略,优选价值相对低估的优质公司股票构建投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得长期持续稳健的投资收益。本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
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(2011年7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-44,675,339.96
2.本期利润	-285,492,258.96
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1797
4.期末基金资产净值	2,113,072,983.94
5.期末基金份额净值	1.330

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。

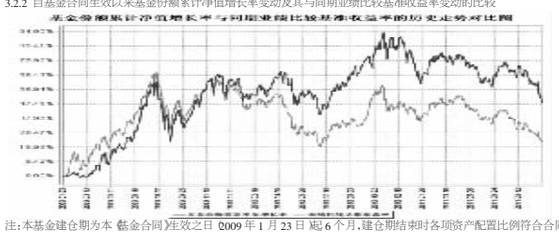
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-11.92%	1.07%	-11.97%	1.06%	0.05%	0.01%

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1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。

§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		
陈晓翔	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。	2009年1月23日	-	10年	国籍:中国。学历:南京理工大学产业经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任宁波中银国际仓储运输有限公司业务员、华泰证券有限责任公司行业研究员、上海中银万国研究所有限责任公司行业研究员、建信基金管理有限公司行业研究员。2007年4月加入汇添富基金管理有限公司任行业研究员,2009年1月23日至今任汇添富价值精选股票型证券投资基金的基金经理,2010年1月8日至今任汇添富均衡增长股票型基证券投基金的基金经理。

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

注:本基金为股票型基金,股票投资对象主要是"价值相对低估的优质公司股票",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

三季度,国内通胀水平居高不下,宏观调控力度不减,经济增长放缓迹象明显,IPO和再融资速度过快,同时欧债危机愈演愈烈导致欧美股市出现较大幅度下跌。这些因素都对A股市场造成巨大的考验。当季上证指数下跌14.6%,分行业看,食品原料、餐饮旅游等消费类行业跌幅相对较小,而建筑建材、钢铁、家电等行业居跌幅榜前列。

本基金在三季度延续了此前的投资策略,继续超配受益于消费升级的食品原料、旅游、商业、家电等行业,同时保持了估值处于历史底部的银行和保险等价值股的较高配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011年三季度,添富价值收益-11.92%,同期沪深300指数收益-15.2%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从短期看,造成三季度市场大跌的因素目前尚无消除的迹象:欧债危机难以在短期内消除,美国经济在缓慢复苏与衰退边缘挣扎,国内以控制通胀和房价为核心的宏观调控暂时看不到放松的迹象,市场融资行为尚未出现减缓的趋势。因此,我们可能还得继续忍受一段时间的煎熬。但站在一个相对较长的角度看,我们此前看好中国经济的基本逻辑没有变化:如国家拥有巨额的外汇储备,居民拥有大量的家庭储蓄,国民教育和企业科研水平不断提高,人民勤奋和吃苦耐劳的优良传统继续保持,一批装备制造业公司正处于效率提升和竞争力赶超国外同行的阶段),同时随着投资者悲观气氛的蔓延,目前市场估值水平已经处于历史底部。因此,我们对A股的中长期前景依然保持乐观。

经济和股市出现调整之时,也正是检验上市公司是否具备真正的核心竞争力的时候。因此,在弱市中我们将保持更加积极的心态,加大对个股的挖掘与研究力度。我们将继续围绕居民收入提高与消费升级、经济结构调整与发展战略新兴产业、城镇化进程不断推进、装备制造业升级等主线构建相对均衡的投资组合,重点关注安全边际高、估值偏低、增长确定的股票,包括因过度悲观而被错杀的核心竞争力强的稳定成长类股票以及周期性龙头公司股票。

§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	1,877,076,157.03	88.57
	其中:股票	1,877,076,157.03	88.57
2	固定收益投资	50,556,332.70	2.39
	其中:债券	50,556,332.70	2.39
	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	188,930,935.33	8.91
6	其他资产	2,828,316.09	0.13
7	合计	2,119,391,741.15	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	150,333,844.33	7.11
C	制造业	690,131,191.51	32.66
C0	食品、饮料	226,988,354.95	10.74
C1	纺织、服装、皮毛	21,134,113.92	1.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	10,272,000.00	0.49
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	9,866,568.52	0.47
C6	金属、非金属	47,133,144.45	2.23
C7	机械、设备、仪表	226,972,703.89	10.74
C8	医药、生物制品	129,528,394.90	6.13
C99	其他制造业	18,235,910.88	0.86
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	88,447,909.91	4.19
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	202,309,394.51	9.57
H	批发和零售贸易	243,252,606.44	11.51
I	金融、保险业	391,886,430.93	18.55
J	房地产业	17,820,540.00	0.84
K	社会服务业	92,894,239.40	4.40
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,877,076,157.03	88.83

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	601318	中国平安	4,349,849	146,024,430.93	6.91
2	601288	农业银行	55,000,000	135,300,000.00	6.40
3	000501	鄂武商A	5,126,407	86,585,014.23	4.10
4	002159	三特索道	5,979,892	86,409,439.40	4.09
5	000858	五粮液	2,380,000	86,394,000.00	4.09
6	600697	欧亚集团	3,261,406	85,611,907.50	4.05
7	000669	领先科技	4,599,965	81,649,378.75	3.86
8	600519	贵州茅台	427,995	81,571,567.05	3.86
9	600016	民生银行	14,000,000	77,280,000.00	3.66
10	000527	美的电器	5,000,000	73,700,000.00	3.49

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	48,330,000.00	2.29
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	中期票据	-	-
7	可转债	2,226,332.70	0.11
8	其他	-	-
9	合计	50,556,332.70	2.39

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	1101018	11央票18	500,000	48,330,000.00	2.29
2	110015	石化转债	25,470	2,226,332.70	0.11

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

注: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

注: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 本基金投资前十名证券五粮液(000858)于2011年5月27日受到证监会行政处罚,该上市公司于2009年9月被证监会立案调查之初,我司即对其可能产生的影响进行过研究评估,认为此事件并不影响其经营业绩,不会对其投资价值造成较大影响。本基金一直重仓持有该股,并经过合理的投资决策授权审批。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,810,518.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	824,734.14
5	应收申购款	193,063.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,828,316.09

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	110015	石化转债	2,226,332.70	0.11

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

§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	1,594,940,028.45
本报告期基金总申购份额	30,662,341.20
减:本报告期基金总赎回份额	37,389,223.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,588,213,146.57

§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价值精选股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富价值精选股票型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富价值精选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、报告期内汇添富价值精选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10月26日

汇添富策略回报股票型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:2011年10月26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10月24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2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富策略回报股票
交易代码	470008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月22日
报告期末基金份额总额	1,297,064,968.23份
投资目标	本基金采用"自上而下"的投资方式,灵活运用资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略,构建有效的投资组合,并在科学严格的投资风险管理前提下,力求为基金份额持有人实现持续稳健的较高投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金,以股票投资为主。股票投资的主要策略包括资产配置策略、行业轮动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,行业轮动策略用于把握行业基本面变化以精选优势行业,个股精选策略用于挖掘各行业中的优质股票以获取超额收益。
业绩比较基准	沪深300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风险较高预期收益的品种。
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(2011年7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	10,848,222.12
2.本期利润	-141,106,663.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1210
4.期末基金资产净值	1,252,605,487.76
5.期末基金份额净值	0.966

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	-9.97%	1.06%	-11.97%	1.06%	2.00%	0.00%

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12月22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		
顾耀强	本基金的基金经理	2009年12月22日	-	7年	国籍:中国。学历:清华大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任杭州冰熊集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、中海优质成长基金经理助理、中海能源策略基金经理助理。2009年3月加入汇添富基金管理有限公司任高级行业分析师。2009年7月7日至2011年3月13日任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理助理,2009年12月22日至今任汇添富策略回报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

注:本基金为股票型基金,采用"自上而下"的投资方式,灵活运用资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略,构建投资组合,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

三季度市场在内忧外患下呈现单边震荡下行走势。外部主要是部分欧洲国家债务危机加剧,而且全球经济增长前景一片阴霾;国内则是通胀处于高位,调控政策仍在继续收紧,并逐步对实体经济产生负面影响。由于流动性状况持续紧张,三季度债市也出现了系统性大跌,资本市场出现了罕见的股债双杀。整个季度没有行业取得正收益,与经济周期相关性强的板块如钢铁、水泥等更是跌幅巨大。

三季度本基金仍然坚持以成长确定性强的优质成长股为配置核心,并随着市场下行,适度提高了组合的弹性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2011年9月30日,本基金净值0.966元,累积净值0.986元,三季度期间收益率为-9.97%,小幅跑赢业绩基准。自2009年12月23日成立以来,本基金累计收益率为-1.4%。

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,本基金坚持此前观点,在经济转型大背景下,市场较长时期内都将是结构性的,难有系统性机会。仅就四季度来看,本基金倾向于认为市场会出现一些结构性转机,因为当前市场对盈利下滑的预期已经较为悲观,而随着通胀见顶流动性环境存在改善的可能,外部风险的冲击也有望减弱。

从角度来看,本基金管理人认为四季度一些明年估值已经相当便宜且基本面向上的优质公司,无论成长型还是价值型,都有望受益于估值迁移,取得较好的回报。

§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	998,245,620.65	79.38
	其中:股票	998,245,620.65	79.38
2	固定收益投资	110,199,920.60	8.76
	其中:债券	110,199,920.60	8.76
	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	146,501,855.48	11.65
6	其他资产	2,576,086.68	0.20
7	合计	1,257,523,483.41	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	124,491,861.45	9.94
C	制造业	503,043,097.16	40.16
C0	食品、饮料	215,342,536.84	17.19
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	10,530,000.00	0.84
C5	电子	33,106,000.00	2.64
C6	金属、非金属	16,948,466.80	1.35
C7	机械、设备、仪表	44,856,792.48	3.58
C8	医药、生物制品	182,259,301.04	14.55
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,425,424.02	2.91
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	28,017,489.68	2.24
H	批发和零售贸易	104,159,640.25	8.32
I	金融、保险业	124,054,800.00	9.90
J	房地产业	19,647,004.09	1.57
K	社会服务业	8,328,304.00	0.66
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	50,078,000.00	4.00
	合计	998,245,620.65	79.69

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	399,802	76,198,263.18	6.08
2	000417	合肥百货	3,599,892	64,618,061.40	5.16
3	000538	云南白药	1,126,667	63,656,685.50	5.08
4	000869	张裕A	598,200	62,577,702.00	5.00
5	600000	浦发银行	6,070,000	51,837,800.00	4.14
6	601601	中国太保	2,600,000	48,074,000.00	3.84
7	000937	冀中能源	2,000,000	47,220,000.00	3.77
8	600535	天士力	1,179,857	46,793,128.62	3.74
9	600521	华海药业	2,606,717	36,129,097.62	2.88
10	600997	开滦股份	1,705,895	28,317,857.00	2.26

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	39,952,000.00	3.19
	其中:政策性金融债	39,952,000.00	3.19
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	70,247,920.60	5.61
8	其他	-	-
9	合计	110,199,920.60	8.80

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	110015	石化转债	803,660	70,247,920.60	5.61
2	090309	09进出09	400,000	39,952,000.00	3.19

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

注: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

注: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	1,289,036.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,117,285.25
5	应收申购款	169,764.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,576,086.68

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	110015	石化转债	70,247,920.60	5.61

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§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	1,022,385,902.56
本报告期基金总申购份额	319,567,574.93
减:本报告期基金总赎回份额	44,888,509.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,297,064,968.23

§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策略回报股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富策略回报股票型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富策略回报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、报告期内汇添富策略回报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10月26日

汇添富上证综合指数证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:2011年10月26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10月24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2011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	6,103,722,273.58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(2011年7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	8,796,870.77
2.本期利润	-739,072,903.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1206
4.期末基金资产净值	4,659,883,336.59
5.期末基金份额净值	0.763

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。

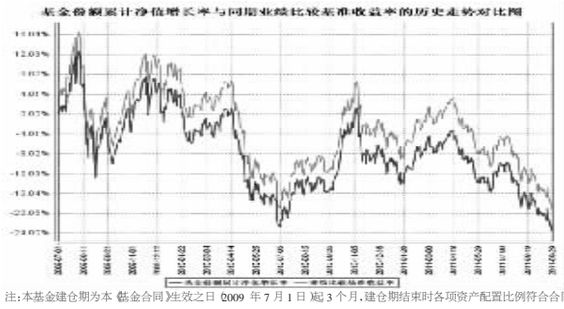
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-13.69%	1.15%	-13.85%	1.15%	0.16%	0.00%

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	-	10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,深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。	2010年2月5日	-	5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,2011年9月16日至今任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2011年9月28日至今任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

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