汇添富策略回报股票型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011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
送出日期：2012年3月30日

§1 重要提示

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2012年3月20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2011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	汇添富策略回报股票
基金主代码	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
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	1,202,161,783.33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。

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	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楼 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	2011年	2010年	2009年12月22日（基金合同生效日）-2009年12月31日
本期已实现收益	95,608,176.00	149,139,745.27	-2,696,247.03
本期利润	-433,700,558.93	464,149,488.72	44,413,010.05
加权平均基金份额本期利润	-0.3470	0.1719	0.0138
本期基金份额净值增长率	-26.37%	21.60%	1.40%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1078	0.1067	-0.0008
期末基金资产净值	1,072,514,654.04	1,875,823,924.22	3,260,187,662.12
期末基金份额净值	0.892	1.233	1.014

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、本基金的《基金合同》生效日为2009年12月22日，至本报告期末未满三年，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2011年12月31日数据，特此说明。

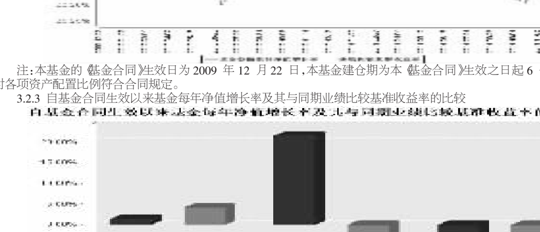
3.2 基金净值表现

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	-7.66%	1.23%	-7.05%	1.12%	-0.61%	0.11%
过去六个月	-16.87%	1.14%	-17.91%	1.09%	1.04%	0.05%
过去一年	-26.37%	1.14%	-19.20%	1.04%	-7.17%	0.10%
自基金合同生效日起至今	-9.22%	1.17%	-23.31%	1.16%	14.09%	0.01%

注：本基金的《基金合同》生效日为2009年12月22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：本基金的《基金合同》生效日为2009年12月22日，本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起6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12月22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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011	0.200	14,838,493.15	16,457,987.93	31,296,481.08	
2010	–	–	–	–	
2009	–	–	–	–	
合计	0.200	14,838,493.15	16,457,987.93	31,296,481.08	

§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，总部设在上海陆家嘴，公司旗下设立了北京分公司、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）。

截至2011年12月，汇添富资产管理规模接近600亿元人民币，是业内最早一批获得QDII资格、最早一批开展专户业务、首批获得RQFII资格的基金管理公司，同时也是全国社会保障基金的投资管理人。经过七年的发展，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。

2011年，汇添富大力发展公募基金业务，全年新发7只基金，分别是汇添富保本混合基金、汇添富社会责任股票型基金、汇添富可转换债券基金、汇添富黄金及贵金属基金、汇添富深证300ETF基金及其联接基金、汇添富信用债债券基金。目前，公司共管理19只证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征的产品线。

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。2011年，汇添富整体投资业绩继续保持行业优秀。

2011年，汇添富专户业务快速发展，在全年市场大幅下跌的背景下，13只专户组合当年实现了正收益，专户业务综合实力和竞争力进一步提升。

2011年，汇添富国际业务取得重大突破，成为业内第一批获得RQFII资格、第一批获得RQFII外汇额度、第一批获得香港证监会产品批文、第一家在港正式发行RQFII产品的基金公司。

2011年，汇添富正式开展社保组合管理，是业内少数几家在权益类和固定收益类产品上同时和社保展开合作的基金公司之一。

2011年，汇添富电子商务业务实现跨越式发展，公司推出全国首张货币市场基金直接支付消费账单的信用卡——“添富信用卡”。该卡集信用卡消费信贷功能和基金投资功能于一体，开创了“货币基金支付消费账单”的新模式，在“2012 WORLD营销大会”中，“添富信用卡”营销项目获得2011年度金赢销奖中的最佳互动创新奖。

2011年，汇添富着力实现贴心的客户服务与投资者教育工作。公司积极开展“添富通行证升级”、“定投计算器”等活动，得到广大客户的大力支持和踊跃参与。同时，公司进一步大力开展“投资者见面会”、“添富之约”客户沙龙、投资者“走进汇添富”和“走进上市公司”等全方位的投资者服务与教育活动。

2011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形式，不断丰富公益活动新内容，持续推进公益项目长期建设。在上海汇添富公益基金会的整体平台下，汇添富积极与社会组织、企业团体合作，举办了多项有影响力的活动，提升了基金业的整体社会形象。

展望2012年，基金行业仍将面临巨大的压力和挑战。汇添富全体员工将进一步发扬“正直、激情、团队、客户第一、感恩”的企业价值观，不畏挑战，不惧困难，以更加积极的心态，大力深化变革，全面提升公司核心竞争力，为实现汇添富基金中长期发展目标打下更加坚实的基础，为中国基金业的繁荣发展做出贡献。

2011年，汇添富凭借稳健的经营管理和优秀业绩，荣获权威机构评选的多个奖项：

1、汇添富优势精选混合基金荣获《中国证券报》评选的“2010五年持续优胜混合型金牛基金”。

2、汇添富基金荣获《上海证券报》评选的2010年度“金基金·创新公司奖”。

3、汇添富策略回报股票基金荣获《上海证券报》评选的2010年度一年期“金基金·主动型股票基金奖”。

4、汇添富基金荣获《证券时报》评选的“2010年度十大明星基金公司奖”。

5、汇添富策略回报股票基金荣获《证券时报》评选的“2010年度股票型明星基金奖”。

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		
顾耀强	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助理	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：曾任杭州永磁集团公司技术员、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 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

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 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

正如去年年报中预期的那样，2011年对投资者来说确是艰难的一年。从年初的中亚北非危机、日本大地震，到欧债危机的全面恶化，再至于国内的房地产调控和货币紧缩，市场环境可以说是内忧外患交加。全年A股市场基本上是单边震荡下行，沪深300指数全年跌幅超过25%，下半年还一度出现股债双杀的局面。导致市场疲弱如斯的因素，有些在预期之中，但更多的是“黑天鹅”事件。

2011年本基金重仓公司也遭遇多只“黑天鹅”，给基金净值造成了较大损失，特别是一季度大幅跑输业绩基准。此后本基金管理人坚持立足于优质成长股的投资策略，在剩下的三个季度中都跑赢了业绩基准。但在市场系统性调整中，总体上未能有效控制风险，全年仍然损失较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011年本基金年收益率-26.37%，同期业绩比较基准收益率-19.20%。

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2012年，本基金认为市场环境仍然恶劣，但已经有些积极的变化在发生。负面因素主要包括：全球经济复苏的前景仍不乐观，中国经济的转型正在摸索中前行，上市公司盈利增速整体放缓已在所难免，而全流通时代股票供求不平衡状态也在延续。积极的变化主要是包括欧美央行持续放水并维持低利率环境，有助于未来经济活力的回升；国内政策环境由紧转松的方向基本确立，只是节奏难以把握，一些关键领域的政策如房地产调控仍存较大变数。在上述背景下，本基金倾向于认为市场有望维持震荡格局，直至一些新的重大变化发生之前。

本基金认为2012年市场的主要投资机会可能仍然来自于那些能够相对独立于经济环境波动的优质成长股的超跌。此外，一些特定领域的政策变化可能也会带来相关板块的阶段性机会。

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、固定收益部、集中交易室、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根据《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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，最少一次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

本基金于2011年1月20日实施利润分配，每份基金份额派发红利0.02元人民币。

§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

2011年，本基金托管人在对汇添富策略回报股票型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

2011年，汇添富策略回报股票型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策略回报股票型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，汇添富策略回报股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配，分配金额为31,296,481.08元。

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策略回报股票型证券投资基金2011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、汤骏于2012年3月29日签字出具了安永华明（2012）审字第60466941_B10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：汇添富策略回报股票型证券投资基金

报告截止日：2011年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产：		
银行存款	74,966,479.11	146,955,739.03
结算备付金	1,233,961.39	1,651,025.60
存出保证金	1,152,542.47	1,360,967.12
交易性金融资产	993,829,432.67	1,732,072,697.68
其中：股票投资	933,523,432.67	1,681,857,697.68
基金投资	–	–
债券投资	60,306,000.00	50,215,000.00
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	–	8,922,518.83
应收利息	218,956.14	1,502,600.90
应收股利	–	–
应收申购款	3,489,299.57	13,492,215.53
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	1,074,890,671.35	1,905,957,764.69
负债和所有者权益	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010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	–	–
应付赎回款	39,511.97	24,931,245.22
应付管理人报酬	1,477,076.85	2,761,865.59
应付托管费	246,179.47	460,310.95
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	273,109.14	1,503,261.16
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	340,139.88	477,157.55
负债合计	2,376,017.31	30,133,840.47
所有者权益：		
实收基金	1,202,161,783.33	1,521,126,969.43
未分配利润	-129,647,129.29	354,696,954.79
所有者权益合计	1,072,514,654.04	1,875,823,924.22
负债和所有者权益总计	1,074,890,671.35	1,905,957,764.69

注：报告截止日2011年12月31日，基金份额净值0.892元，基金份额总额1,202,161,783.33份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富策略回报股票型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入	-405,300,853.38	524,649,917.37
1.利息收入	2,331,549.75	6,974,748.45
其中：存款利息收入	898,039.41	5,680,856.45
债券利息收入	1,433,510.34	1,270,970.09
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	–	22,921.91
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）	120,598,466.19	198,774,865.95
其中：股票投资收益	117,986,828.65	174,234,266.79
基金投资收益	–	–
债券投资收益	-4,800,134.66	13,588,763.37
资产支持证券投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	7,411,772.20	10,951,835.79
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-529,308,734.93	315,009,743.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,077,865.61	3,890,559.52
减：二、费用	28,399,705.55	60,500,428.65
1.管理人报酬	20,091,221.38	41,418,009.47
2.托管费	3,348,536.86	6,903,001.54
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	4,510,659.81	11,731,829.78
5.利息支出	–	2,368.86
其中：卖出回购金融资产支出	–	2,368.86
6.其他费用	449,287.50	445,219.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-433,700,558.93	464,149,488.72

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富策略回报股票型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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）	1,521,126,969.43	354,696,954.79	1,875,823,924.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-433,700,558.93	-433,700,558.93
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）	-318,965,186.10	-19,347,044.07	-338,312,230.17
其中：1.基金申购款	710,021,280.87	63,827,650.13	773,848,931.00
2.基金赎回款	-1,028,986,466.97	-83,174,694.20	-1,112,161,161.17
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）	–	-31,296,481.08	-31,296,481.08
五、期末所有者权益（基金净值）	1,202,161,783.33	-129,647,129.29	1,072,514,654.04
项目	上年度可比期间 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）	3,215,774,652.07	44,413,010.05	3,260,187,662.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	464,149,488.72	464,149,488.72
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）	-1,694,647,682.64	-153,865,543.98	-1,848,513,226.62
其中：1.基金申购款	1,252,606,110.35	31,272,440.09	1,283,878,550.44
2.基金赎回款	-2,947,253,792.99	-185,137,984.07	-3,132,391,777.06
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）	1,521,126,969.43	354,696,954.79	1,875,823,924.22

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

汇添富策略回报股票型证券投资基金（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］1116号文《关于核准汇添富策略回报股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2009年12月22日正式生效，首次设立募集规模为3,215,774,652.07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、注册登记机构均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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

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2011年12月31日的财务状况以及2011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》，对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入，由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	518,569,203.21	18.15%	2,351,059,909.69	31.17%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	–	–	10,670,000.00	6.19%

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 2011年1月1日至2011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	429,390.88	18.03%	17,732.00	6.49%
关联方名称	上年度可比期间 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	1,952,297.28	31.16%	41,263.13	2.74%

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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,091,221.38	41,418,009.47
其中：支付销售机构的客户维护费	1,818,332.71	4,383,161.87

注：基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%÷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款指令，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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,348,536.86	6,903,001.54

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%÷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款指令，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取。若遇法定节假日、公休日等，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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
期初持有的基金份额	50,043,000.00	50,043,000.00
期间申购/买入总份额	–	–
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	50,043,000.00	50,043,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.16%	3.29%

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

注：本年度末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	74,966,479.11	860,293.14	146,955,739.03	5,593,821.04

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

注：本基金本报告期及上年度可比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（2011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

注：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

注：本基金本期末未持有暂时停牌股票。

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	933,523,432.67	86.85
	其中：股票	933,523,432.67	86.85
2	固定收益投资	60,306,000.00	5.61
	其中：债券	60,306,000.00	5.61
	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	76,200,440.50	7.09
6	其他各项资产	4,860,798.18	0.45
7	合计	1,074,890,671.35	100.00

8.2 期末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	6,467,168.40	0.60
B	采掘业	144,814,090.60	13.50
C	制造业	436,902,334.06	40.74
C0	食品、饮料	177,689,190.60	16.57
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	8,545,000.00	0.80
C5	电子	21,600,000.00	2.01
C6	金属、非金属	24,677,514.85	2.30
C7	机械、设备、仪表	68,533,185.93	6.39
C8	医药、生物制品	135,857,442.68	12.67
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	31,308,558.88	2.92
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	24,257,609.32	2.26
H	批发和零售贸易	111,163,200.92	10.36
I	金融、保险业	127,596,300.00	11.90
J	房地产业	17,089,576.99	1.59
K	社会服务业	9,179,664.00	0.86
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	24,744,929.50	2.31
	合计	933,523,432.67	87.04

8.3 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

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	000869	张裕A	518,166	55,910,111.40	5.21
2	600519	贵州茅台	279,802	54,085,726.60	5.04
3	000417	合肥百货	3,825,788	54,058,384.44	5.04
4	600000	浦发银行	6,070,000	51,534,300.00	4.80
5	601601	中国太保	2,600,000	49,946,000.00	4.66
6	000937	冀中能源	2,855,700	48,147,102.00	4.49
7	600535	天士力	983,750	41,258,475.00	3.85
8	000538	云南白药	770,000	40,810,000.00	3.81
9	600521	华海药业	3,371,570	37,087,270.00	3.46
10	600875	东方电气	1,272,691	29,411,889.01	2.74

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

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	000937	冀中能源	65,834,210.57	3.51
2	601288	农业银行	63,020,000.00	3.36
3	600585	海螺水泥	55,240,524.16	2.94
4	600535	天士力	52,747,702.58	2.81
5	600521	华海药业	51,808,778.43	2.76
6	600519	贵州茅台	49,074,618.01	2.62
7	600000	浦发银行	47,916,235.48	2.55
8	000417	合肥百货	46,768,421.63	2.49
9	600997	开滦股份	41,494,150.62	2.21
10	600875	东方电气	40,764,939.89	2.17
11	000527	美的电器	38,775,226.89	2.07
12	601601	中国太保	35,724,685.09	1.90
13	000538	云南白药	34,245,265.83	1.83
14	600415	小商品城	32,324,067.38	1.72
15	002155	辰州矿业	31,595,266.49	1.68
16	000063	中兴通讯	31,509,360.81	1.68
17	601088	中国神华	31,438,302.45	1.68
18	601899	紫金矿业	28,367,255.00	1.51
19	600859	王府井	28,290,865.81	1.51
20	600805	悦达投资	27,362,754.62	1.46

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，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	600415	小商品城	97,485,418.26	5.20
2	600875	东方电气	68,592,299.17	3.66
3	601288	农业银行	63,872,176.34	3.41
4	600557	康缘药业	52,786,455.05	2.81
5	000937	冀中能源	49,846,522.71	2.66
6	600570	恒生电子	49,636,807.17	2.65
7	000630	铜陵有色	47,529,881.51	2.53
8	000417	合肥百货	46,091,731.22	2.46
9	600585	海螺水泥	43,273,951.84	2.31
10	600519	贵州茅台	42,998,072.78	2.29
11	000811	烟台冰轮	41,170,604.17	2.19
12	002106	莱宝高科	41,012,161.07	2.19
13	002123	荣信股份	40,426,585.97	2.16
14	600765	中航重机	39,030,710.96	2.08
15	000869	张裕A	38,091,859.16	2.03
16	300039	上海凯宝	38,071,950.06	2.03
17	600188	兖州煤业	35,718,273.51	1.90
18	601601	中国太保	34,288,875.11	1.83
19	600997	开滦股份	34,274,580.60	1.83
20	600079	人福医药	33,109,144.83	1.77

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，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	1,259,820,485.72
卖出股票收入（成交）总额	1,596,573,788.51

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	–	–
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	60,306,000.00	5.62
8	其他	–	–
9	合计	60,306,000.00	5.62

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	110015	石化转债	600,000	60,306,000.00	5.62

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

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

注：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	1,152,542.47
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	218,956.14
5	应收申购款	3,489,299.57
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,860,798.18

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	60,306,000.00	5.62

8.9.5 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。

§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
27,274	44,077.21	591,949,486.46	49.24%	610,212,296.87	50.76%

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	4,208,567.26	0.35%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年12月22日）基金份额总额	3,215,774,652.07
本报告期期初基金份额总额	1,521,126,969.43
本报告期基金总申购份额	710,021,280.87
减：本报告期基金总赎回份额	1,028,986,466.97
本报告期期末基金份额总额	1,202,161,783.33

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、《汇添富保本混合型证券投资基金基金合同》于2011年1月26日正式生效，陆文磊先生任该基金的基金经理。

2、《汇添富社会责任股票型证券投资基金基金合同》于2011年3月29日正式生效，欧阳沁春先生任该基金的基金经理。

3、《汇添富可转换债券债券型证券投资基金基金合同》于2011年6月17日正式生效，王珏池先生任该基金的基金经理。

4、基金管理人2011年6月22日公告，王珏池先生不再担任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理，陆文磊先生继续担任该基金的基金经理。

5、基金管理人2011年6月22日公告，陆文磊先生不再担任汇添富货币市场基金的基金经理，王珏池先生继续担任该基金的基金经理。

6、基金管理人2011年8月13日公告，经汇添富基金管理有限公司第二届董事会第二十六次会议审议决定，因工作变动，解聘于东升先生公司副总经理职务。

7、《汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）基金合同》于2011年8月31日正式生效，刘子龙先生任该基金的基金经理。

8、《深证300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2011年9月16日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

9、《汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于2011年9月28日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

10、基金管理人2011年11月26日公告，何仁科先生不再担任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理，吴振翔先生继续担任该基金的基金经理。

11、《汇添富信用债债券型证券投资基金基金合同》于2011年12月20日正式生效，王珏池先生任该基金的基金经理。

12、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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12月22日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内已支付当期审计费用为人民币玖万元整。

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	
东方证券	2	518,569,203.21	18.15%	429,390.88	18.03%	–
日信证券	1	364,135,622.06	12.75%	309,512.25	13.00%	–
银河证券	2	316,978,902.70	11.10%	261,192.97	10.97%	–
财富证券	1	272,328,174.34	9.53%	231,477.82	9.72%	–
联合证券	2	259,886,711.61	9.10%	211,158.92	8.87%	–
广州证券	1	221,572,541.38	7.76%	180,028.95	7.56%	–
兴业证券	2	220,488,619.80	7.72%	179,149.00	7.52%	–
中信建投	1	195,179,876.64	6.83%	165,901.84	6.97%	–
中投证券	1	129,064,311.31	4.52%	109,704.62	4.61%	–
招商证券	2	128,008,243.97	4.48%	108,580.01	4.56%	–
齐鲁证券	1	59,958,898.53	2.10%	50,965.72	2.14%	–
渤海证券	1	50,584,488.29	1.77%	42,996.66	1.81%	–
长江证券	1	32,957,727.50	1.15%	28,014.07	1.18%	–
申银万国	1	31,383,083.62	1.10%	26,674.90	1.12%	–
中信证券	1	25,766,140.44	0.90%	21,901.19	0.92%	–
国泰君安	2	18,906,128.83	0.66%	16,069.92	0.67%	–
方正证券	1	5,060,514.00	0.18%	4,111.69	0.17%	–
海通证券	1	3,952,806.00	0.14%	3,359.91	0.14%	–
上海证券	1	1,612,280.00	0.06%	1,370.47	0.06%	–
中金公司	2	–	–	–	–	–
国金证券	2	–	–	–	–	–
中银国际	1	–	–	–	–	–
德邦证券	1	–	–	–	–	–
北京高华	1	–	–	–	–	–
厦门证券	1	–	–	–	–	–
国信证券	1	–	–	–	–	–
安信证券	1	–	–	–	–	–
广发证券	1	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–
国都证券	1	–	–	–	–	–
东兴证券	1	–	–	–	–	–

注：此处的佣金指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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	–	–	–	–	–	–
日信证券	–	–	–	–	–	–
银河证券	20,366,206.70	13.00%	–	–	–	–
财富证券	21,394,271.00	13.66%	–	–	–	–
联合证券	–	–	–	–	–	–
广州证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
中投证券	40,077,386.20	25.59%	–	–	–	–
招商证券	20,015,291.00	12.78%	–	–	–	–
齐鲁证券	–	–	–	–	–	–
渤海证券	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
申银万国	26,710,492.60	17.06%	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
上海证券	28,049,820.30	17.91%	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
中银国际	–	–	–	–	–	–
德邦证券	–	–	–	–	–	–
北京高华	–	–	–	–	–	–
厦门证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
国都证券	–	–	–	–	–	–
东兴证券	–	–	–	–	–	–

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39个交易单元与汇添富成长焦点股票型证券投资基金共用。本基金本报告期内新增1家券商一个交易单元：厦门证券（上交所交易单元）。

汇添富基金管理有限公司

2012年3月30日