金额单位:人民币元

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

1.1 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 和完整性承担个则及是带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签处。 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日夏核丁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复记载、误导性陈述或者重大遗漏。 基金管理人承诺以读求信用,勤勉尽责的原则管理和证用基金资产。但不除正基金一定盈利。 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

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	§2 基金简介	
2.1 基金基本情况	•	
基金简称	汇添富民营活力股票	
基金主代码	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	
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	588,807,373.20 份	
基金合同存续期	不定期	
2.2 基金产品说明		
投资目标	本基金采用自下而上的; 营企业上市公司股票进行力求基金资产的中长期;	5法,精选与中国经济发展密切相关的优秀 5投资布局,在科学严格管理风险的前提了 曾值。
投资策略	本基金为原理型基金、股票投资的主要策略包括资产配置策 精连策略。其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例 避系统性系统,设产配置策略用于控制成长性较高且信值有 优秀民营企业上市公司以录取超额收益。本基金通过投资于 的公司治理结构,或应由用人和分配制,独特的核心竞争 出特证的优秀民营企业,以分享优秀民营企业或长所带来 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		于证券投资基金中较高预期风险较高预期 以益水平高于混合型基金、债券型基金及货
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

021-28932888 010-66105799 021-2893299

63 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 -164,729,882.78

123,878,263.20 -20.78% 15.00% 3.1.2 期末数据和指标 536,403,969,44 915,929,975,97 0.911 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)和除相关费用局 註: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约有人认同政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

注于所列数字。 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来规部分的孰低数。 4.本基金的《基金的周上数日为 2010 年 5 月 5 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 ;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	其与同期业绩比:	较基准收益率的	比较		
阶段	份額净值增长 率①	份額净值增长 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	-5.20%	0.94%	-10.86%	1.30%	5.66%	-0.36%
过去六个月	-14.38%	0.91%	-19.18%	1.21%	4.80%	-0.30%
过去一年	-20.78%	1.00%	-23.95%	1.15%	3.17%	-0.15%
自基金合同生效 日起至今	-8.90%	1.12%	-15.63%	1.28%	6.73%	-0.16%
3.2.2 自基金合		会份额累计净值:	增长率变动及其	与同期业绩比较数	。准收益率变动的比 图 历 史 走 势 对	

注:本基金建仓期为本《基金合同》与

注:1.本基金的(基金合同)生效日为2010年5月5日,至本报告期末未满五年。
2.合同生效当年被实际存线期计算。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2010年5月5日,2010年度和2011年度均未进行利润分配。
54 管理人报告

一个品面,形成只需查,形成了概量商、中、飲各类风险收益特征的产品线。 汇溶富的整整特"以企业基本分析为立足点,挑选高质量的证券,把握市场款络,做中长期投资市局,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,汇添富整体投资业纳维续保持行业优秀。 经候转行业优秀。
2011年,汇落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,汇落富国际业务取得量大实破,成为业内第一批获得 RQFII 资格 第一批获得 RQFII 外汇额度,第一批获得香港证金产品比次,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
2—

2011年,正器富工并展社保組合管理,是业内少数几常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,正器富电子商务业务实现跨越式发展、公司推出公司音张货币市场基金建接支付消费账单的信用卡——活富信用卡"高标准信用非"商品贷价分离机"基础恢变功能于一体,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。"语富信用卡"营销距目获得 2011年度全量销费单的最佳互动创新奖。
2011年,正常富者力实现站心的客户服务与投资者教育工作。公司积极开展"谐富温行证升级"、定投计算器"等活动,得到一大定户的大力支持和确联参与。同时、公司进一步大力方展"投资金营业"、谐富之为"客户涉龙"、投资者"造走正游"高"和走进上市公司"等全分位的投资者服务与教育活动。
2011年,正常高营特殊推进社会营普单。从股限常金企业营业新形式,不断丰富公益活动新内容,持续推进公益项目长期建设。在上海汇流高公益基金全的整体平台下,汇添富是接上分组织。企业团体合作、举办了众多有影响力的活动,提升了基金业的整体社会完整。
展望 2012年,基金产业仍将而临日大的压力和挑战。正添富全体员工将进一步发扬"正直、激情",团队、客户第一、感恩"的企业价值从"不是挑战"不是挑战,实有国际的公司,大为军化支革、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,发展目标上可以企业分组、中国基金业的繁荣发展做出贡献,
2011年,汇高富不供给撤售的经营管理和优秀业绩,实现或规制评选的多个发现。
1.汇高富在金宝板(证券申报》评选的"2010年产生物优性混合型金牛基金"。
2.汇高富基金全坡大证海市新评选的"2010年度"大型市场优性混合型金牛基金"。
3.汇高富金金宝板工厂建市新用资格公的中度"全金金"和新公本企业,1010年度,10

任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期 离任日期 证券从业年 说明 姓名 **齐东超** 010年5月5日

在:1.基金的百任基金经理,其一任职日则个为基金合同生农日,其"国职日则"为根据公司庆以确定的解码目期;
2.非百任基金经理,其"任职日则"和"国任日期"分别报报公司庆设商业的聘任日则和解释日期;
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企作推测户信贷应的识明
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台同的约定、本营业实任用、现验是 劳政 医闭管 理证证 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,无期率基金持有人利益的行为。本基金无重大违法, 法规行为,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多易情况的专项证明
4.3.1 公平交易制度的执行情况。
基本会管理人目标报中国市证会企作基本投资基金管理公司公平交易制度批导意用以建立起除全。有价。初前的公平交易制度

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制制。施量了各投资组合、各投资市场、各投资标的、贯穿了投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估 会过程、并重过分析报告、监控、精保保证制度流程的有效执行。 4.32 本投资组合与其体验质风格相似的投资组合之间的业绩比较 本基金采用目下面上的方法。精选与中国经济发展密切相关的比赛民营企业上市公司股票进行投资布局。在科学严格管 理风险的商提下、力求基金资产的中长期增值。本本基金管理、股下其他基金投资组合风格不同。 4.33 异常交易行为的专项证明 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路和业绩表现的说明 4.4 1 报告期内基金的投资路和业绩表现的说明

4.4 管理人对报告则内基金的投资额的和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金的投资额的工作分析
2011年市场走势之低差超出了绝大多数投资者的预别。一方面,中小市值个股持续的对 2010年的结构性牛市实施纠编;
另一方面,中、大盘监察投资的表现出色到倒长之力的态势,遭受估值和超利的双条,以从泥、江麓机械为代表的投资品产业
并举年表现起版 但国点迹象对职能通过的下影响有各品计较处将以横顶资单、实是正收益。
正如我们在过去一年的提次报告中与综沟通的观点。2011年是对整个中国经济走势仍反映。自 2001年加入 WTO 始,中国经济报告了牛岛海性的解阻成就,其中出口投资是主要驱动力,消费都面积收入的对线处并和人口结构的变化在近近年或据发力。但金融危机之后,出口格人低速,4万亿剩款下的投资成为主要驱动力,并逐渐显现出严重的弊端(高房价、从方施按中与的债务风险和高胀等),则非其继续发力,消费后周的特征也振新是发,但金融危机之后,出口格人低速,4万亿剩款下的投资成为主要驱动力,并逐渐显现的影响的影响。高房价、从方施按中与的债务风险和高胀等,则非其继续发力,消费后周的特征运输后最后的运输上增长的企业的发现,但是一个企业的发现,但是一个企业的发现的现象,一个变现,现代基本或持了创业板和中小条的次新报。主要源于 2010年全年段上市公司研究和投资工作。我们意识到市场态估了这些景景的原则未经,一个企业的企业的成功,从市场的发现,是有企业的发现的发现,是一个企业的发现的发现,是一个企业,是一个企业的发现,是一个企业的发现,是一个企业的发现,是一个企业的发现,是一个企业的发现,是一个企业的发现,是一个企业的发现,是一个企业,是一个企业的发现,是一个企业的发现,是一个企业的发现象的发现,是一个企业的发现的发现象的发现象,是一个企业的发现的发现象的发现象的发现象,是一个企业,是一

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。俄劳研究、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中突。基金经理作为公司估值委员会的成员。不介人 基金日常估值业务,但应参加估值小组会议、可以提议测算来一投资品种的估值调整等明,并有权表决有关设案但仅享有一

汇添富民营活力股票型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年 12 月 31 日

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,本基金与中央围债登记结算有限责任公司根据(中债收益丰曲线和中债估值最终用户服务协议)而取得中债估值服务。

信值服务。 4.7 管型人对报告期内基金利润分配情况的说明 本基金(基金台同)约定,在符合有关基金分组条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 6 次,每次收益分配比例 不得低于按次收益分配基础口明先0配润前的 10%,若(基金台同)生效不满 3 个月可不进行收益分配。 本基金本报告期内未进行利润分配。

本基金本报告期內未进行利润分配。 \$5 托管人报告

5.1 报告期內本基金托管力遵理守信情况声明 \$5 托管人报告
2011年,未基金托管人遵理守信情况声明 數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分额持有人利益的行为,完全保职尽费地履行 活金托管人应尽的义务。
5.2 托管人对报告期內本金投资宣作通理守信,净值计等,利润的信等情况的说明
2011年,汇率宽民营活力股票型证券投资基金的管理人——汇添富基金管查有限公司在汇添层管活力股票型证券投资基金的投资定作基金变产净值计算,基金份额申转取的格计算,基金费用开文等同理上不存任任例据事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,汇添富民营活力股票型证券投资基金未进行利润分配。

行利润分配。
5.3 托管 內本年度报告中財各信息等內容的真实,准确和完整发表意见
本托管人依法对汇源富基金管理有限公司编制和披露的汇源富民营活力股票型证券投资基金 2011 年年度报告中财务
指标,净值录现,利润分配情况,财务会计报告,投资组合报告等內容进行了核查,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年明会计师事务所审计,注册会计师徐艳,添破于 2012 年 3 月 29 日签字出具了安 未年明(2012)审字第 60466941_B11 号标准无保管意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。
7.1 资产值债表

7.1 资产负债表 会计主体:汇添富民营活力股票型证券投资基金 报告截止日: 2011年12月31日

资产	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
迕 j ^{ta} :		
银行存款	143,318,457.39	91,288,452.
古算备付金	445,529.32	5,250,572.4
字出保证金	788,331.44	1,847,081.
 交易性金融资产	390,842,223.11	827,787,988.
其中:股票投资	390,842,223.11	787,627,988.
集金投资	-	
贵券投资	-	40,160,000.
货产支持证券投资	_	
汀生金融资产	_	
买人返售金融资产	_	
立收证券清算款	2,349,074.74	
立收利息	25,077.10	1,249,171.
立收股利	_	
立收申购款	82,689.78	972,185.
兼延所得税资产	_	
其他资产	_	
货产总计	537,851,382.88	928,395,452
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
5 债:		
豆期借款	_	
交易性金融负债	_	
汀生金融负债	_	
卖出回购金融资产款	_	
立付证券清算款	_	
並付赎回款	31,740.81	9,537,444
立付管理人报酬	717,017.49	1,253,645
立付托管费	119,502.89	208,940
立付销售服务费	_	
並付交易费用	239,046.79	1,119,500
立交税费	_	
立付利息	_	
立付利润	_	
递延所得税负债	_	
其他负债	340,105.46	345,945
负债合计	1,447,413.44	12,465,476
所有者权益:	.,,	11051170
实收基金	588,807,373.20	796,333,398
未分配利润	-52,403,403.76	119,596,577
所有者权益合计	536,403,969,44	915,929,975
// D TE 1A III. LI FI	330,403,909.44	913,929,973.

在: 你口嘅品口 2017 7.2 利润表 会计主体: 汇添富民营活力股票型证券投资基金

本报告期: 2011年1月1日 至 2011年	F 12 / 31 🗆	单位:人民
項 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 5 月 5 日 (基金合同生效日)至 2010年 12 月 31 日
一、收入	-146,827,624.47	144,383,243
1.利息收入	2,152,063.21	3,763,539.:
其中:存款利息收入	897,203.31	2,680,803.
债券利息收入	959,209.54	864,395
资产支持证券利息收入	-	
买人返售金融资产收入	295,650.36	218,341.0
其他利息收入	-	
2.投资收益(损失以"-"填列)	-79,175,404.44	121,014,820.
其中:股票投资收益	-84,299,571.89	119,842,605.
基金投资收益	-	
债券投资收益	-424,533.80	900,880.
资产支持证券投资收益	-	
衍生工具收益	-	
股利收益	5,548,701.25	271,334.
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-70,154,033.52	18,140,126.
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	
5.其他收入(损失以"-"号填列)	349,750.28	1,464,756.
减:二、费用	17,902,258.31	20,504,980.
1.管理人报酬	11,017,118.84	11,220,044.
2.托管费	1,836,186.47	1,870,007.
3.销售服务费	-	
4.交易费用	4,590,099.49	7,078,467.:
5.利息支出	8,739.51	18,697.9
其中:卖出回购金融资产支出	8,739.51	18,697.9
6.其他费用	450,114.00	317,762.:
三、利润总额(亏损总额以"_"号填列)	-164,729,882.78	123,878,263.

 □ 共同是額(字預益額以一"号值列)
 −164.729.882.78
 123.878.263.20

 註:由于本基金子2010 年 月 月 5 日成立、因此上年度可比期间只列示从基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日敦耀、粹比明。

 7.3. 所有者权益(基金净值) 变动表会计主体,汇添属民营活力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

			T-111:7(F(11))
项目	2011	本期 年1月1日至2011年12月31	В
	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)	796,333,398.07	119,596,577.90	915,929,975.97
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期利润)	-	-164,729,882.78	-164,729,882.78
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)	-207,526,024.87	-7,270,098.88	-214,796,123.75
其中:1.基金申购款	85,906,633.19	7,403,061.77	93,309,694.96
2.基金赎回款	-293,432,658.06	-14,673,160.65	-308,105,818.71
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)	588,807,373.20	-52,403,403.76	536,403,969.44
项目	2010年 5 月 5	上年度可比期间 日(基金合同生效日)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)	1,407,531,401.75	-	1,407,531,401.75
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期利润)	-	123,878,263.20	123,878,263.20
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)	-611,198,003.68	-4,281,685.30	-615,479,688.98
其中:1.基金申购款	453,686,106.58	102,627,038.97	556,313,145.55
2.基金赎回款	-1,064,884,110.26	-106,908,724.27	-1,171,792,834.53
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)	796,333,398.07	119,596,577.90	915,929,975.97

(3-1 被亚热平雨(3) 江港高民营活力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 可[2010]308号文(关于核准汇添层层营活力股票型证券投资基金募集的批复)的核准。由基金管理人汇添品金管理有 可向社会公开发存募集、基金与同于2010年5月5日正文生处,省次设立募集股债》1,407,31,401,75份基金份额,本 为契约型升放式,存线期限不定。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

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

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。

平取台前所采用的公司取取。云山山口与取处一部中2 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 段项 1.印花税

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%e 调整为196c; 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

.宫里段,企业所特配 黑腿树灰部,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 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 国家税务总局财税学[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 哲免证收流通股股东应缴纳的企业所得税。 根据财政部(国家税务仓局财税[2008] [59](关于企业作税税至产性基政政的通知的资地定、对证税及经营金从证券市 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 3.个人所得稅 根据財政部、国家稅多总局財稅字[2002]128 号文(关于开放式证券投资基金有关稅收问题的通知)、对基金取得的股票

根据财政部。国家报务总局财积学[2002]128 与义(宋丁井政八世,异汉政业年升大化以中建约28世)4,7 (如至水环中2008) 电复。红风使势的利息等处,由上市公司,佛安发行企业车向出途需要时代和代徵2006)个人所得税。根据财政部。国家报务总局财积学[2005]107 与文(关于股息红利有关个人所得税政策的外光清知)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银种的股盘证利所得,按照财税[2005]100 号文级上市级少分在代和代缴个标报时,被按506计算应纳原所得额。 根据财政部。国家报务总局财积学[2005]103 号文(关于股权分置试点改革有关税收改策问题的通知)的规定。股权分置改革中非准通股股活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。 747 辛格方米区

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

ú mi → de sia	本期 2011年1月1日至2011年1	2月31日	上年度可比期间 2010年5月5日(基金合同生效日 日	
长联方名称	成交金額	占当期股票 成交总额的比 例(%)	成交金額	占当期股票 成交总额的比例 (%)
方证券股份 限公司	1,142,764,883.76	38.83	2,861,518,999.87	58.57

上年度可比期间 2010年5月5日(基金合同生效日)至2010年12月31

关联方名称				
大联刀右称	成交金額	占当期债券 成交总额的比 例(%)	成交金額	占当期债券 成交总额的比例 (%)
东方证券股份 有限公司	29,079,666.40	71.98	19,825,744.80	100.00
7.4.8.1.3 债券	回购交易	•		金额单位:人民币
	本期 2011年1月1日至2011年	12月31日	上年度可比期间 2010年5月5日(基金合同生效日 日	
关联方名称	回购成交金額	占当期债券回 购 成交总额的比 例(%)	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例 (%)
东方证券股份 有限公司	100,000,000.00	100.00	360,000,000.00	88.85

东万证券股份 有限公司	100,000,000.00	100.00	360,000,000.00	88.85
7.4.8.1.4 应支 金额单位:人	付关联方的佣金 民币元			
关联方名称		2011年1月1日	本期 至 2011 年 12 月 31 日	
人机力石机	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	953,269.49	39.11	56,519.78	23.64
关联方名称	2010年 5		度可比期间 引生效日)至 2010 年 12 月 31 日	
天联刀石桥	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	2,382,576.45	58.80	266,144.72	23.78
			包括但不限于买(卖)经手费、证券结算 三要包括:为本基金提供的证券投资6	

		単位:人民市
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5月5日(基金合同生效日)至2010年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理 费	11,017,118.84	11,220,044.56
其中:支付销售机构的客户维护 费	1,997,076.79	1,954,438.61
注:基金管理费按前一日基金资产 H=E×1.50%+当年天数	"净值的 1.50%年费率计提。计算方法如下	:

11日本自日記計組的基金管理费 E 为前一日基金资产单值 基金管理费目计算。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 核后于没有前2个工作自身从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休服等,支付日期顺延。 748.22 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 5 月 5 日(基金合同生效日)至 2010年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管 费	1,836,186.47	1,870,007.48
注,基金托管费按前一日的基金	金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方	法如下,

任、基金托管政按则一日的基金资产净值的 0.25%的牛费率计提。计算方法如卜; HENO25%上等干发 H 为每日应计提的基金资产给 E 为前一日的基金资产给 基金托管费每日计算,逐日聚十至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费到款指令,基金托管人复 核6于次月旬 2 个几年日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节要目、公休日等,支付日期顺延。 7.48.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(合归购)交易 本基金 2011 年度和 2010 年度均未与关联分 7.48.4 各关联方投资本基金的情况 7.48.4 各关联方投资本基金的情况 7.48.4 相从购购基金资理人 法国际有资金投资本基金的情况

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5月5日(基金合同生效日)至2010 年12月31日
基金合同生效日(2010年5月5日)持有的基金份額	-	50,044,375.00
期初持有的基金份额	50,044,375.00	-
期间申购/买人总份额	_	-
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	50,044,375.00	50,044,375.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例(%)	8.50	6.28

注:本公司于2010年3月31日运用固有资金50,000,000.00元认购本基金份额50,044,375.00份(含募集期利息结转的份额)认购费用100000元 符合权套的阻共和信的认购费率

	本期末 2011年 12 月 31 日		上年度末 2010年 12 月 31 日		
关联方名 称	持有的 基金份額	持有的基金份 额 占基金总份额 的比例(%)	持有的 基金份额	持有的基金份額 占基金总份額的 比例(%)	
上海汇添 富公益基 金会	1,984,126.98	0.34	1,984,126.9	8 0.2	

				单位:人民币元	
关联方 名称		本期 至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年5月5日(基金合同生效日)至2010年12月31日		
	期末余額	当期利息收入	期末余額	当期利息收入	
中国工商银行 股份有限公司	143,318,457.39	875,359.81	91,288,452.34	2,639,314.92	
分 中大斯子	但然仍但仁力参心部"	以业期 本开始到自由 1 台。	会了关联士和然的组织云台参加。	と公然 以ア思になけるい か	

注:由支联方保管的银行体载余额及当期产生的利息收入包含了关联; 的结期备付金期未余额及当期产生的自取处人 74.8.6 本基金正米销期内参与关联方承销证券的情况 本基金 2011年度 2010年度在美销期内均未参与关联方承销证券。 74.9 期末(至2011年12月31日) 书基金持有的流通受限证券 74.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券 本基金本期未未持有因认购新发/增发证基础更限的证券。 74.9.2 期末持有的暂时停脚等流播受限股票

									金额单位:人	民币元
投票代 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 成本总額	期末估值总额	备注
500315	上海家 化	2011年 12 月 30 日	重大事 项停牌	34.09	2012年1月4日	34.75	404,303	13,470,309.99	13,782,689.27	-
300026	红日药 业	2011年 12 月 27 日	重组停 牌	25.00	2012年2月29日	27.50	154,214	4,010,859.00	3,855,350.00	-

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。 本基金本期末未持有交納所印砌回夯正巴姆及2017 [172] 1841 [174] 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。 88 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金額	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	390,842,223.11	72.67
	其中:股票	390,842,223.11	72.67
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	143,763,986.71	26.73
6	其他各项资产	3,245,173.06	0.60
7	소규	537 951 397 99	100.00

金额单位:人民币元

011-5	11.35.90.01	ZA /U (/ I Inc	F1 999 207 347 1-12-12-12-12-12 (AD)
A	农、林、牧、渔业	-	
В	采掘业	-	
С	制造业	210,103,106.60	39.17
C0	食品、饮料	59,855,100.00	11.16
C1	纺织、服装、皮毛	6,621,339.10	1.23
C2	木材、家具	-	
C3	造纸、印刷	-	
C4	石油、化学、塑胶、塑料	39,384,176.95	7.34
C5	电子	-	
C6	金属、非金属	22,616,400.00	4.2
C7	机械、设备、仪表	4,190,000.00	0.73
C8	医药、生物制品	66,490,794.55	12.4
C99	其他制造业	10,945,296.00	2.0
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	
E	建筑业	36,600,317.70	6.8
F	交通运输、仓储业	-	
G	信息技术业	13,825,209.84	2.5
Н	批发和零售贸易	86,138,588.97	16.0
I	金融、保险业	44,175,000.00	8.24
J	房地产业	-	
K	社会服务业	-	
L	传播与文化产业	-	
M	综合类	-	

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	000861	海印股份	3,208,985	44,380,262.55	8.2
2	600016	民生银行	7,500,000	44,175,000.00	8.2
3	000869	张裕A	390,000	42,081,000.00	7.8
4	002081	金螳螂	1,037,130	36,600,317.70	6.8
5	002250	联化科技	1,356,011	25,601,487.68	4.
6	600660	福耀玻璃	2,820,000	22,616,400.00	4.
7	000650	仁和药业	1,822,943	21,893,545.43	4.0
8	000501	鄂武商 A	1,239,540	18,902,985.00	3.:
9	600887	伊利股份	870,000	17,774,100.00	3.:
10	002004	华邦制药	482,268	16,397,112.00	3.0

注:投资者欲了解本报告期未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文变动 8.41 累计文人全额起出期初基金按广净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	88,418,022.16	9.65
2	002004	华邦制药	61,371,403.40	6.70
3	002024	苏宁电器	58,314,507.52	6.37
4	600660	福耀玻璃	54,385,133.19	5.94
5	000861	海印股份	46,739,081.07	5.10
6	600688	S上石化	46,114,219.78	5.03
7	002081	金螳螂	44,533,259.57	4.86
8	600089	特变电工	42,572,733.22	4.65
9	000501	鄂武商 A	39,661,621.05	4.33
10	600415	小商品城	38,519,323.80	4.21
11	600233	大杨创世	38,385,683.61	4.19
12	600240	华业地产	35,690,600.00	3.90
13	600331	宏达股份	34,205,583.58	3.73
14	000780	平庄能源	33,802,795.96	3.69
15	000869	张裕 A	32,826,165.89	3.58
16	002250	联化科技	31,765,135.96	3.47
17	000961	中南建设	30,751,114.72	3.36
18	600335	*ST 盛工	29,625,936.57	3.23
19	000527	美的电器	27,582,455.33	3.01
20	000650	仁和药业	26,450,540.54	2.89
21	000026	飞亚达 A	25,789,883.49	2.82
22	000063	中兴通讯	25,540,412.58	2.79
23	000968	煤气化	24,983,903.00	2.73
24	002384	东山精密	22,946,996.30	2.51
25	600887	伊利股份	21,270,812.75	2.32
26	000603	ST盛达	20,646,672.92	2.25
27	600146	大元股份	19,861,664.84	2.17
28	600612	老凤祥	19,115,435.05	2.09
29	600518	康美药业	18,489,135.74	2.02
		买人成交金额填列,不考 出期初基金资产净值 20		·

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	000861	海印股份	71,881,229.22	7.8
2	600146	大元股份	69,563,549.22	7.5
3	000915	山大华特	56,203,420.94	6.1
4	600016	民生银行	54,563,680.80	5.9
5	600240	华业地产	52,250,450.18	5.7
6	600415	小商品城	49,734,816.75	5.4
7	600688	S上石化	48,929,526.42	5.3
8	000876	新希望	46,049,765.52	5.0
9	002024	苏宁电器	40,624,808.32	4.4
10	300022	吉峰农机	39,880,355.58	4.3
11	600089	特变电工	35,514,484.60	3.8
12	600079	人福医药	34,108,126.66	3.7
13	002004	华邦制药	33,208,400.30	3.6
14	300099	尤洛卡	31,651,128.04	3.4
15	002153	石基信息	31,239,982.02	3.4
16	600335	*ST 盛工	30,162,812.26	3.2
17	000780	平庄能源	29,509,955.18	3.2
18	600331	宏达股份	28,383,399.25	3.1
19	002003	伟星股份	28,204,190.96	3.0
20	002384	东山精密	26,541,150.36	2.9
21	600518	康美药业	26,426,823.53	2.8
22	000989	九芝堂	25,907,395.79	2.8
23	000026	飞亚达 A	25,815,445.54	2.8
24	600233	大杨创世	25,098,174.93	2.7
25	000629	攀钢钒钛	25,032,583.75	2.7
26	000527	美的电器	22,791,170.43	2.4
27	000968	煤气化	21,935,117.96	2.3
28	000961	中南建设	21,333,448.62	2.3
29	300027	华谊兄弟	20,025,340.78	2.1
30	002106	莱宝高科	19,683,984.16	2.1
31	000603	ST盛达	19,008,789.92	2.0
32	000063	中兴通讯	18,707,103.17	2.0
33	000528	柳工	18,553,324.68	2.0
		出成交金额填列,不考验 额及卖出股票的收入总		单位:人民市

1,352,049,645.09

平磁业平级百期末末特有债券。 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 本基金本报告期末末特有资产支持证券。 8.8 期末按公允价值占基金资产海值比例十小堆分价地下入 .持有资产支持证券。 占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

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。 10.2 生态均倍构前十么股票未超出基金合同规定的备选股票库。

		单位:人民
序号	名称	金额
1	存出保证金	788,331.4
2	应收证券清算款	2,349,074.7
3	应收股利	
4	应收利息	25,077.
5	应收申购款	82,689.7
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	3,245,173.0

本基金本报告期末未持有处于表版为即573456000 8.9.5 期末前十名投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的情况。 \$9 基金份额持有人信息

		持有人结构					
持有人户数(户)	户均持有的基金 份額	机构投资者			个人投资者		
		持有份額	占总份额比 例(%)		持有份额	占总份額比 例(%)	
12,916	45,587.44	258,594,330.97	43.92		330,213,042.23	56.08	
9.2 期末基金管	了理人的从业人员持	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		2,670,387.78			0.45		

基金合同生效日(2010年5月5日)基金份额总额	1,407,531,401.75
本报告期期初基金份額总额	796,333,398.07
本报告期基金总申购份额	85,906,633.19
减:本报告期基金总赎回份额	293,432,658.06
本报告期期末基金份額总额	588,807,373.20
注 末由"首由助仍解"《杜格】仍解"首膝同仍解"《杜格山》	(a)/5

报告期内沒有举行基金份額持有人不会。 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 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组 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组 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,陆文副 生 班採担 比 收 盡金 的 轟金 於 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,王廷池先生继续担任设金的基金经理。

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,因工作或 ,稿門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(10F)基金台同)于2011年8月31日正式生效,刘子龙先生任该基金的基金组 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 。 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,吴振翔先生任基金的基金经理。 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,吴聚期 生继续担任该基金的基金经理。 11.(元温客任用储债券型证券投资基金基金合同)于2011年12月20日正式生效,王廷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。

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 安·朱年明会计师事务所自本基金合同生效日(2010年5月5日)起至本根告期末,为本基金进行审计。本根期审计费用为人民币以万元整。

					金额	单位:人民币
		股票	交易	应支付该券		
券商名称	交易单元数 量	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(%)	备注
东方证券	2	1,142,764,883.76	38.83	953,269.49	39.11	-
中信证券	2	803,131,343.53	27.29	652,549.41	26.77	-
国信证券	2	315,174,755.12	10.71	256,810.52	10.54	-
国金证券	2	278,391,497.52	9.46	234,063.38	9.60	-
招商证券	2	169,913,110.52	5.77	144,426.35	5.93	-
广发证券	2	141,586,582.50	4.81	119,159.44	4.89	-
中金公司	2	83,225,151.82	2.83	69,451.91	2.85	-
徳邦证券	2	8,904,222.76	0.30	7,538.57	0.31	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
早生证券	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。 1172 基全租用证券公司交易单元进行基他证券投资的情况

11.7.2 ===================================	24,200-70211741612	0-13C 9C H3 IN OC		金额单位:人民币
券商名称	债券交易		债券回购交易	
	成交金額	占当期债券 成交总额的比例(%)	成交金額	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
东方证券	29,079,666.40	71.98	100,000,000.00	100.00
中信证券	-	-	-	-
国信证券	-	-		_
国金证券	6,174,000.00	15.28		_
招商证券	-	-		_
广发证券	5,145,000.00	12.74	-	-
中金公司	-	-	-	_
德邦证券	-	-		_
金元证券	_	-	-	_

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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接取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)投资研究部根据符合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报分例,并在综合分案年度券的债务作准名发展计构交易分配量的金融上还可需要。使得后位交易的全局公配符合综合排名及案计构交易分配量的分配符合综合排名。

配比例,并在陷合为縣年度券前的綜合都名及由日內之。 同時指个交易单元的分配量不超过总或交换的 30%。 (4)指字年綜合考遊至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。

的依据。
(5) 调整组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) 成交服分布的决定应于每月第一个工作日完成,更换券需交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
(7) 调整可赖交易单元形形改契的交易并元冠行型及其他相关费用,基金会计应费,协助及时储缴。
2. 报告期内租用证券公司交易年元的变更情况。
此18个全易单元与机器或需整电视易处理检查,共用。本报告期新增 4 家证券公司的 5 个交易单元,招商证券(上交所和定交所交易单元),德邦证券(附交易单元),金元证券(上交所交易单元),民生证券(上交际交易单元),

汇添富基金管理有限公司 2012年3月30日