汇添富社会责任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：中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012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2011年3月29日（基金合同生效日）起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富社会责任股票
基金主代码	470028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月29日
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,735,497,479.45 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	精选积极履行社会责任，并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司，谋求基金资产的稳健增值。
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积极履行社会责任的优质上市公司，以谋求基金资产稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80% + 中证全债指数收益率×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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	李芳菲
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-63201816

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3月29日（基金合同生效日）至2011年12月31日
本期已实现收益	-205,794,322.68
本期利润	-585,594,544.34
加权平均基金份额本期利润	-0.1286
本期基金份额净值增长率	-15.60%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1561
期末基金资产净值	3,152,567,203.28
期末基金份额净值	0.844

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2011年3月29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。

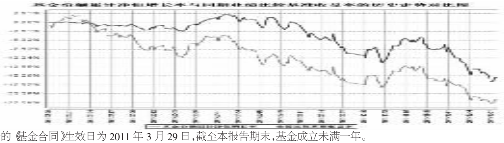
3.2 基金净值表现

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	-7.56%	1.02%	-6.41%	1.12%	-1.15%	-0.10%
过去六个月	-15.26%	0.89%	-17.45%	1.08%	2.19%	-0.19%
自基金合同生效日起至今	-15.60%	0.75%	-21.85%	1.02%	6.25%	-0.27%

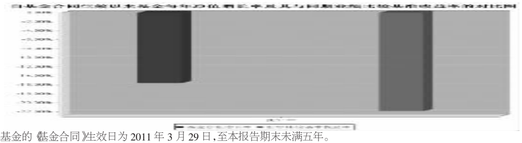
注：本基金的《基金合同》生效日为2011年3月29日，至本报告期末未满一年。

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2011年3月29日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011年3月29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2011年3月29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2011年3月29日，2011年度未进行利润分配。

§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，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，举办了众多有影响力的活动，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		
欧阳沁春	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	2011年3月29日	-	10年	国籍：中国。学历：卫生部武汉生物制品研究所医学硕士、中欧国际工商学院工商管理硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任卫生部武汉生物制品研究所助理研究员、中国网络（百慕大）有限公司项目经理、大成基金管理有限公司行业研究员、国联安基金管理有限公司行业研究员，2006年9月加入汇添富基金管理有限公司，任高级行业分析师，2007年3月6日至2007年6月17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，2007年6月18日至今任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，2011年3月29日至今任汇添富社会责任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

本基金精选积极履行社会责任，有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司，是专注于社会责任投资的股票型基金，截止报告期，与本基金管理人旗下其他基金风格不同。

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

2011年A股市场先扬后抑，虽然政策给予市场以憧憬与希望，一度刺激市场反弹，但是在困难重重的欧洲债务危机、疲弱的经济数据和股市融资压力三大因素的影响下，市场的估值体系大幅下移，A股市场持续下跌，金融股与消费行业表现最为优异，部分公司在市场大幅下跌过程中取得了非常大的超额收益，前期估值过高的和基本面趋势不好的行业与公司则出现了较大调整。

本年度是本基金成立之年，我们对于2011年的投资一直持谨慎态度，保持了中低仓位。在行业配置方面，我们试图用非周期与成长性来降低市场风险，我们在有长期增长潜力的消费品行业进行了中长期的布局，重点选择了业绩突出、成长性好、管理层优秀的公司进行了投资，我们也投资了部分估值比较低、有一定瓶颈的资源股。由于系统性的风险原因，基金整体投资效果并不太理想。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011年本基金年收益率-15.60%，同期业绩比较基准收益率-21.85%。

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，美国经济正走在回升的路上，欧债危机短期能得到一定程度缓解。国内的通货膨胀逐步下行，随着流动性逐渐改善和政府对证券市场的支持以及新股发行制度的改革，前期市场恐慌性的下跌不会再出现，股票市场已经处于底部区域，但是普涨行情不具备，一方面是企业基本面整体还是处于下降通道；另一方面市场流动性的改善是逐步的、温和的。2012年的A股市场很可能以阶段性的板块表现和个股分化为主，我们争取能够把握部分结构性机会。本基金在2012年依然会挑选能够践行社会责任的企业，结合企业的基本面，精选有企业家精神、激励机制完善、治理结构清晰、财务报表质量稳健的上市公司做中长期的布局。

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，每份基金份额每次分配比例不得低于该次收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的10%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配。

本基金2011年3月29日（基金合同生效日）至2011年12月31日止期间未进行利润分配。

§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

在托管汇添富社会责任股票型证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《汇添富社会责任股票型证券投资基金基金合同》、《汇添富社会责任股票型证券投资托管协议》的约定，对汇添富社会责任股票型证券投资基金管理人—汇添富基金管理有限责任公司2011年3月29日至2011年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，汇添富基金管理有限责任公司在汇添富社会责任股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，汇添富基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的汇添富社会责任股票型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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_B15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：汇添富社会责任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
资 产：	
银行存款	558,920,343.33
结算备付金	4,022,231.69
存出保证金	2,750,000.00
交易性金融资产	2,390,968,051.15
其中：股票投资	2,390,968,051.15
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	207,400,751.10
应收证券清算款	4,497,892.46
应收利息	270,637.47
应收股利	-
应收申购款	25,168.78
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	3,168,855,075.98
负债和所有者权益	本期末 2011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	5,665,618.40
应付赎回款	965,461.37
应付管理人报酬	4,213,468.99
应付托管费	702,244.86
应付销售服务费	-
应付交易费用	1,697,440.45
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	3,043,638.63
负债合计	16,287,872.70
所有者权益：	
实收基金	3,735,497,479.45
未分配利润	-582,930,276.17
所有者权益合计	3,152,567,203.28
负债和所有者权益总计	3,168,855,075.98

注：1、本基金于2011年3月29日成立，无比较式的上年度可比期间，因此资产负债表只列示2011年12月31日数据，特此说明。

2、报告截止日2011年12月31日，基金份额净值0.844元，基金份额总额3,735,497,479.45份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富社会责任股票型证券投资基金

本报告期：2011年3月29日（基金合同生效日）至2011年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2011年3月29日（基金合同生效日）至2011年12月31日
一、收入	-518,180,425.29
1.利息收入	27,611,023.33
其中：存款利息收入	9,983,051.09
债券利息收入	792,986.30
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	16,834,985.94
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-168,746,955.79
其中：股票投资收益	-182,325,156.81
基金投资收益	-
债券投资收益	-173,100.00
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	13,751,301.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-379,800,221.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,755,728.83
减：二、费用	67,414,119.05
1.管理人报酬	50,138,982.26
2.托管费	8,356,497.12
3.销售服务费	-
4.交易费用	8,478,664.71
5.利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	439,974.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-585,594,544.34

注：本基金于2011年3月29日成立，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示从基金合同生效日至2011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：汇添富社会责任股票型证券投资基金

本报告期：2011年3月29日（基金合同生效日）至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月29日（基金合同生效日）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）	5,622,650,211.18	-	5,622,650,211.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-585,594,544.34	-585,594,544.34
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）	-1,887,152,731.73	2,664,268.17	-1,884,488,463.56
其中：1.基金申购款	324,442,861.24	-4,399,297.67	320,043,563.57
2.基金赎回款	-2,211,595,592.97	7,063,565.84	-2,204,532,027.13
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）	3,735,497,479.45	-582,930,276.17	3,152,567,203.28

注：本基金于2011年3月29日成立，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益（基金净值）变动表只列示从基金合同生效日至2011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

汇添富社会责任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［2010］1887号文《关于核准汇添富社会责任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作为发起人于2011年2月28日至2011年3月25日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2011）验字第60466941_B03号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2011年3月29日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币5,620,367,127.29元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币2,283,083.89元，以上实收基金（本息）合计为人民币5,622,650,211.18元，折合5,622,650,211.18份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金精选积极履行社会责任，并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司，谋求基金资产的稳健增值。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。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80% + 中证全债指数收益率×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，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3月29日（基金合同生效日）至2011年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2011年3月29日（基金合同生效日）起至2011年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债；本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债；

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益；每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1）股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资；股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益；卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

（2）债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资；债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

（3）权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资；权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益；卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

（4）分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述（2）、（3）中相关原则进行计算；

（5）回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1）股票投资

（1）上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

（2）未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B.首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

C.首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

D.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2）债券投资

（1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

（2）证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

（3）未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

（4）在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3）权证投资

（1）上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

（2）未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

（3）因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4）分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述2）、3）中的相关原则进行估值；

5）其他

（1）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（2）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

（3）资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

（4）买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

（5）股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

（6）债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

（7）衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

（8）股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

（9）公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

（10）其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

（1）基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

（2）基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

（3）卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

（4）其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）本基金的每份基金份额享有同等分配权；

（2）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，每份基金份额每次分配比例不得低于该次收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的10%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配；

（3）基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（4）本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

（5）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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
中国农业银行股份有限公司	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3月29日（基金合同生效日）至2011年12月31日	
	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	3,349,980,788.88	51.16%

7.4.8.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年3月29日（基金合同生效日）至2011年12月31日	
	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	2,611,000,000.00	100.00%

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3月29日（基金合同生效日）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	2,795,251.25	51.21%	485,986.07	28.64%

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3月29日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	50,138,982.26
其中：支付销售机构的客户维护费	15,320,678.57

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：

$H=E\times 1.50\%\div$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

基金管理费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日，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3月29日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,356,497.12

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：

$H=E\times 0.25\%\div$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

基金托管费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日，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

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场债券（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3月29日（基金合同生效日）至2011年12月31日
基金合同生效日（2011年3月29日）持有的基金份额	30,002,300.00
期初持有的基金份额	-
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	30,002,300.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.80%

注：本公司于2011年3月23日运用固有资金30,000,000.00元认购本基金份额30,002,300.00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。

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3月29日（基金合同生效日）至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	558,920,343.33	9,899,277.53

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2011年3月29日（基金合同生效日）至2011年12月31日止期间在承销期内未参与关联方承销证券。

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

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002623	亚玛顿	2011年9月28日	2012年1月13日	网下新股流通受限	38.00	26.00	1,200,000	45,600,000.00	31,200,000.00	-
601100	恒立油缸	2011年10月21日	2012年1月30日	网下新股流通受限	23.00	16.71	1,648,598	37,917,754.00	27,548,072.58	-

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
000522	白云山A	2011年11月7日	重组停牌	12.16	2012年3月28日	12.80	1,482,592	22,360,026.06	18,028,318.72	-

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	2,390,968,051.15	75.45
	其中：股票	2,390,968,051.15	75.45
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	买入返售金融资产	207,400,751.10	6.54
	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	562,942,575.02	17.76
6	其他各项资产	7,543,698.71	0.24
7	合计	3,168,855,075.98	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	-	-
B	采掘业	355,986,835.77	11.29
C	制造业	1,423,930,344.07	45.17
C0	食品、饮料	422,810,103.66	13.41
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	28,025,737.19	0.89
C5	电子	159,259,883.10	5.05
C6	金属、非金属	31,200,000.00	0.99
C7	机械、设备、仪表	239,699,855.61	7.60
C8	医药、生物制品	533,452,973.81	16.92
C99	其他制造业	9,481,790.70	0.30
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,195,084.89	0.45
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	91,120,415.25	2.89
H	批发和零售贸易	238,760,564.16	7.57
I	金融、保险业	206,256,084.74	6.54
J	房地产业	13,324,525.28	0.42
K	社会服务业	15,856,421.49	0.50
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	31,537,775.50	1.00
	合计	2,390,968,051.15	75.84

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	600519	贵州茅台	1,521,166	294,041,387.80	9.33
2	002241	歌尔声学	4,599,095	110,378,280.00	3.50
3	600535	天士力	2,566,916	107,656,457.04	3.41
4	000501	鄂武商A	5,639,821	86,007,270.25	2.73
5	000538	云南白药	1,576,227	83,540,031.00	2.65
6	600887	伊利股份	4,071,022	83,170,979.46	2.64
7	600859	王府井	2,391,073	76,777,354.03	2.44
8	002353	杰瑞股份	1,016,678	71,167,460.00	2.26
9	600000	浦发银行	7,934,838	67,366,774.62	2.14
10	300124	汇川技术	1,204,922	65,306,772.40	2.07

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	284,460,489.91	9.02
2	000937	冀中能源	129,321,078.61	4.10
3	600415	小商品城	119,918,787.34	3.80
4	600188	兖州煤业	116,771,169.33	3.70
5	600887	伊利股份	116,443,884.49	3.69
6	600997	开滦股份	116,259,313.58	3.69
7	002241	歌尔声学	109,455,434.90	3.47
8	600809	山西汾酒	108,743,613.71	3.45
9	600535	天士力	104,969,536.22	3.33
10	000968	煤气化	104,073,128.27	3.30
11	000501	鄂武商A	103,216,422.13	3.27
12	000538	云南白药	102,491,230.74	3.25
13	002106	莱宝高科	100,387,465.87	3.18
14	600859	王府井	99,904,844.89	3.17
15	601601	中国太保	99,494,890.25	3.16
16	601699	潞安环能	96,505,340.07	3.06
17	000338	潍柴动力	94,747,900.44	3.01
18	002123	荣信股份	87,386,724.45	2.77
19	600079	人福医药	84,702,339.14	2.69
20	300124	汇川技术	82,602,113.89	2.62
21	601100	恒立油缸	81,349,586.06	2.58
22	600000	浦发银行	80,902,250.83	2.57
23	600690	青岛海尔	79,834,243.14	2.53
24	600123	兰花科创	76,988,608.50	2.44
25	000650	仁和药业	75,947,128.62	2.41
26	000933	神火股份	74,318,142.70	2.36
27	000566	海南海药	72,140,133.19	2.29
28	000915	山大华特	71,322,344.74	2.26
29	600729	重庆百货	70,917,566.04	2.25
30	002353	杰瑞股份	70,902,067.34	2.25
31	600062	双鹤药业	70,187,251.17	2.23
32	002099	海翔药业	67,764,567.84	2.15
33	002475	立讯精密	64,494,351.05	2.05

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600809	山西汾酒	122,778,228.54	3.89
2	000937	冀中能源	101,130,396.45	3.21
3	600123	兰花科创	85,589,342.76	2.71
4	002106	莱宝高科	81,302,893.64	2.58
5	600997	开滦股份	80,792,328.30	2.56
6	000338	潍柴动力	79,784,418.03	2.53
7	600062	双鹤药业	72,374,468.68	2.30
8	600415	小商品城	67,824,447.74	2.15
9	600729	重庆百货	65,396,602.35	2.07
10	600088	中视传媒	63,118,591.84	2.00
11	600188	兖州煤业	59,114,738.43	1.88
12	002123	荣信股份	53,809,840.44	1.71
13	000933	神火股份	53,574,723.24	1.70
14	600750	江中药业	52,377,708.40	1.66
15	002422	科伦药业	46,547,199.73	1.48
16	601601	中国太保	46,352,092.38	1.47
17	002099	海翔药业	43,811,142.14	1.39
18	600508	上海能源	43,084,541.11	1.37
19	000983	西山煤电	42,285,555.64	1.34
20	002304	洋河股份	41,262,242.05	1.31

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	4,801,984,821.87
卖出股票收入（成交）总额	1,848,891,392.25

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	2,750,000.00
2	应收证券清算款	4,497,892.46
3	应收股利	-
4	应收利息	270,637.47
5	应收申购款	25,168.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,543,698.71

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

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
86,176	43,347.31	529,278,507.23	14.17%	3,206,218,972.22	85.83%

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	426,435.62	0.01%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年3月29日）基金份额总额	5,622,650,211.18
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	324,442,861.24
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,211,595,592.97
本报告期期末基金份额总额	3,735,497,479.45

注：表内“总申购份额”含转换入份额；“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、2011年1月21日，中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格（证监许可［2011］116号），张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

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（2011年3月29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	
东方证券	2	3,349,980,788.88	51.16%	2,795,251.25	51.21%	-
兴业证券	2	939,455,427.76	14.35%	781,551.56	14.32%	-
德邦证券	2	628,343,330.19	9.60%	520,772.06	9.54%	-
长江证券	2	567,819,697.94	8.67%	472,312.52	8.65%	-
华创证券	1	401,987,367.58	6.14%	326,617.24	5.98%	-
渤海证券	2	265,744,447.28	4.06%	225,882.74	4.14%	-
五矿证券	2	199,570,730.30	3.05%	169,634.14	3.11%	-
财富证券	2	160,680,232.72	2.45%	136,576.44	2.50%	-
齐鲁证券	1	34,876,437.47	0.53%	29,644.46	0.54%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	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	债券回购交易	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券	2,611,000,000.00	100.00%
兴业证券	-	-
德邦证券	-	-
长江证券	-	-
华创证券	-	-
渤海证券	-	-
五矿证券	-	-
财富证券	-	-
齐鲁证券	-	-
方正证券	-	-
招商证券	-	-
中信建投	-	-
中投证券	-	-
国联证券	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金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24个交易单元均为本基金本报告期内新增交易单元：长江证券（上交所交易单元、深交所交易单元）、齐鲁证券（上交所交易单元）、兴业证券（上交所交易单元、深交所交易单元）、中投证券（上交所交易单元、深交所交易单元）、东方证券（上交所交易单元、深交所交易单元）、德邦证券（上交所交易单元、深交所交易单元）、招商证券（上交所交易单元、深交所交易单元）、渤海证券（上交所交易单元、深交所交易单元）、财富证券（上交所交易单元、深交所交易单元）、五矿证券（上交所交易单元、深交所交易单元）、中信建投证券（上交所交易单元、深交所交易单元）、华创证券（深交所交易单元）、方正证券（上交所交易单元）、国联证券（上交所交易单元）。

汇添富基金管理有限公司
2012年3月30日