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

汇添富可转换债券债券型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年12月31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6月17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	汇添富可转换债券	
基金主代码	470058	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月17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	633,427,901.15份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇添富可转换债券A	汇添富可转换债券C
下属分级基金的交易代码:	470058	470059
报告期末下属分级基金的份额总额	333,252,356.24份	300,175,544.91份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于可转换债券(含可分离交易可转债),努力在控制投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金80%以上的基金资产投资于固定收益类金融工具,并在严格控制风险的基础上,通过对全球经济形势、中国经济发展(包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况)、证券市场估值水平等的研判,适度参与权益类资产配置,适度把握市场时机力争为基金资产获取稳健回报。类属资产配置由本基金管理人根据宏观经济分析、债券基准收益率研究、不同类属债券利差水平研究,判断不同类属债券的相对投资价值,并确定不同债券类属在组合资产中的配置比例。
业绩比较基准	天相转债指数收益率×70%+中债综合指数收益率×20%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。

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6月17日(基金合同生效日)-2011年12月31日	
	汇添富可转换债券A	汇添富可转换债券C
本期已实现收益	1,026,072.02	-331,439.79
本期利润	-10,497,921.16	-7,518,975.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0239	-0.0210
本期基金份额净值增长率	-1.60%	-1.80%
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	-0.0159	-0.0180
期末基金资产净值	327,962,454.71	294,766,349.83
期末基金份额净值	0.984	0.982

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6月17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

汇添富可转换债券A

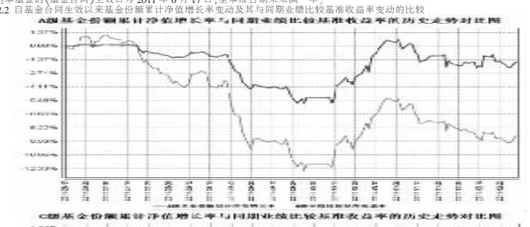
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.80%	0.48%	3.38%	0.55%	0.42%	-0.07%
过去六个月	-1.70%	0.40%	-9.39%	0.61%	7.69%	-0.21%
自基金合同生效日起至今	-1.60%	0.38%	-9.00%	0.60%	7.40%	-0.22%

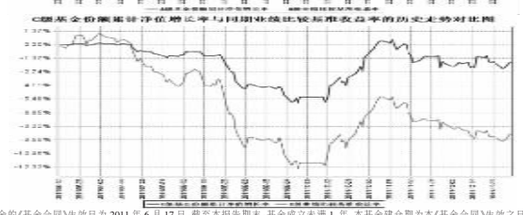
汇添富可转换债券C

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	3.70%	0.48%	3.38%	0.55%	0.32%	-0.07%
过去六个月	-1.80%	0.40%	-9.39%	0.61%	7.59%	-0.21%
自基金合同生效日起至今	-1.80%	0.39%	-9.00%	0.60%	7.20%	-0.21%

注:本基金的(基金合同)生效日为2011年6月17日,至本报告期末未满一年。

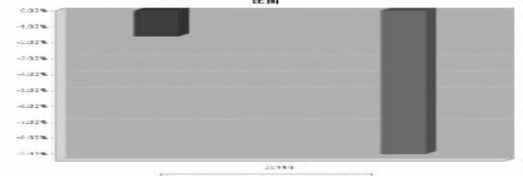
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

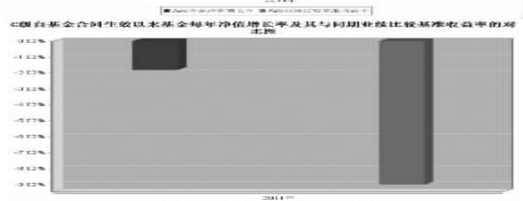




注:本基金的(基金合同)生效日为2011年6月17日,截至本报告期末,基金成立未满1年。本基金建仓期为本(基金合同)生效之日(2011年6月17日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

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6月17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

本基金的(基金合同)生效日为2011年6月17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,公司已成为业务市场完善、管理体系严谨、团队稳定优秀、文化优势突出、品牌信誉响亮、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、汇添富信用债券基金。目前,公司共管理19只证券投资基金,形成了覆盖股票、债券、混合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,做中长期投资市场,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QDII资格、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,是业内少数几家有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稳健发展,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——"汇添富信用卡",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 音销大会"中,"汇添富信用卡"获销项目获得2011年度金属销奖中的最佳互动创新奖。

2011年,汇添富为实现贴心的客户服务与投资者教育工作,公司积极开展"汇添通行证升级"、"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"投资者走进汇添富"、"汇添富之约"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,汇添富将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,汇添富凭借雄厚的经营管理和优秀业绩,荣获权威机构评选的多个奖项:

1.汇添富价值精选混合基金荣获《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"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		
王珏池	本基金的基金经理、汇添富货币市场基金的基金经理、汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理、汇添富信用债券型证券投资基金的基金经理。	2011年6月17日	-	17年	国籍:中国,学历:澳门科技大学管理学硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾任中银万国证券股份有限公司固定收益总部投资部经理。2005年4月加入汇添富基金管理有限公司任交易主管,2006年3月23日至今任汇添富货币市场基金的基金经理,2008年3月6日至2011年6月21日任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理,2011年6月17日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理,2011年12月20日至今任汇添富信用债券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 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

本基金为债券型基金,重点投资于可转换债券(含可分离交易可转债),与本基金管理人旗下其他基金投资组合不同。

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

本基金于2011年6月17日成立,于6月底开始建仓。

今年下半年国内经济出现增速放缓的趋势,受出口放缓以及国内房地产调控的影响,PMI生产、工业增加值增速等的指标明显放缓,四季度CPI出现回落趋势,从三季末的6.1%回落至年底的4.1%,经济启动呈现通胀与增长双难权衡局面,受此影响转债市场出现了大幅度下跌,下半年中信标普可转债指数大跌9.71%,为历年之最,投资者在担心经济下滑的同时,又遇到了严厉的紧缩政策,市场资金明显趋紧,转债票息较低,在高企的短期利率面前,短期价值受到质疑,抛售源源不断,其中几个大型转债受供求面的影响,跌幅较大,一度跌至债券价格附近,盘面上大批转债破面值,价值严重低估。

本基金在报告期内完成了建仓,6月底我们认识到无论经济面还是投资者的心态都处于低谷,我们随即放慢了建仓的步伐,在众多转债跌破面值之际,我们认为市场的心态仍未平复,资金面依然紧张,直到9月底,在9月30日转债跌入历史罕见的最低谷时,本基金坚决地增加转债仓位,我们认为:第一,由于综合因素,转债市场出现了史无前例地下跌,其中一些原因是具有持续性的,而有一些原因是短期的,可以改变的,而且已经在转债价格中反映出来了,第二,由于转债具有债性保护,很多品种在大幅下跌后,其债券价值与普通债券品种的价值距差不多,其限权价值则显低估;第三,一些转债受条款限制,已经出现回售和下修转股价等对于投资者有利的条件,其转债价值也得到了提升,事实证明,转债的价值转买会反映到价格上来,随着四季度资金面的放松,大部分的转债回到了面值附近,本基金放慢建仓节奏,较好地规避了风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,汇添富可转换债券A净值增长-1.60%,汇添富可转换债券C净值增长-1.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

明年国际环境依然复杂,美国经济在今年年底已经出现了企稳、回升的迹象,房地产和就业数据逐步好转让投资者寻找到了复苏的迹象,投市的接连走高更提升了投资者的信心;欧洲方面,虽改不太乐观,希腊、意大利等国的债务危机再次爆发,各方利益难以达成一致,数度实施一拖再拖,很难让人乐观起来;其他经济体步履蹒跚,新兴经济体还面临通胀的问题。我们认为,明年国际经济环境仍以危机后的经济复苏为主线,欧美宽松的货币政策仍将持续,而地域性的军事冲突也会成为市场关注的焦点,中国要面对的输入性通胀压力不会减轻。

对于国内明年的经济形势,我们刚刚过乐观,首先,中国仍处于工业化、城市化进程中,经济增长动力依然强劲;其次,由于前期一段时期的严格控制,无论是利率、汇率政策各家都具有很好的弹性以应对经济的下滑,并且银行盈利情况良好,房地产泡沫得到了很好的控制,宏观经济面的风险完全处于可控范围内,同时能够刺激经济长期稳定的政策众多,但对于转债乃至股票市场不确定性依然很强,为了对冲输入性通胀的压力,货币政策的阶段性调整带来的冲击相对剧烈,从今年股市、债市的表现就可以看到,一旦通胀走高,央行的调控手段便随之而来,证券市场的波动明显加大。

对于转债的品种的选择,我们坚持以价值投资为取向,在考虑流动性的前提下,我们根据企业的行业基本面以及其盈利情况,判断正股及转债的价值是否适合投资,对于转债的投资我们不局限于其债性保护,对于一些并不影响企业经营的次要因素将进行认真识别,寻找合适的时机实施中长期布局。

总体而言,目前转债的价格仍然偏低,其中不乏一些业绩优良的公司,我们注意到市场上一些因素正在向着有利于转债市场的方向发展,我们明年将深入研究,把握投资机会,为基金持有人创造良好的投资收益。

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,按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、基金资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,并有权表决其认为重大事项,以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致性。

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,每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日可供分配利润的10%;在(基金合同)生效不满3个月的可供分配利润中,不设分红。

本基金2011年6月17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

2011年,本基金托管人在对汇添富可转换债券债券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

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	600036	招商银行	14,754,048.80	2.21
2	600519	贵州茅台	9,210,203.05	1.99
3	601989	中国重工	8,094,046.08	1.86
4	600016	民生银行	4,020,042.00	0.65
5	000858	五粮液	3,838,873.54	0.62
6	600188	兖州煤业	2,710,359.00	0.44
7	600875	东方电气	2,580,309.00	0.41
8	002325	洪涛股份	2,525,601.76	0.41
9	000651	格力电器	2,435,220.00	0.39
10	601699	潞安环能	2,363,052.00	0.38
11	600660	福耀玻璃	2,039,725.00	0.33
12	600425	青松建化	2,032,900.00	0.33
13	600123	兰花科创	2,003,627.06	0.32
14	601601	中国太保	1,880,781.00	0.30
15	002106	莱宝高科	1,678,390.00	0.27
16	000887	中鼎股份	1,561,777.64	0.25
17	600348	阳泉煤业	1,517,680.00	0.24
18	601088	中国神华	1,486,467.99	0.24
19	300039	上海凯宝	1,415,000.00	0.23
20	600089	特变电工	1,349,404.61	0.22

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。

8.4.3 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	100,275,621.77
卖出股票收入(成交)总额	69,644,773.70

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	28,992,000.00	4.66
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	82,611,000.00	13.27
7	可转债	463,646,734.88	74.45
8	其他	-	-
9	合计	575,249,734.88	92.38

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	2,543,750	255,672,312.50	41.06
2	113001	中行转债	1,097,740	103,824,249.20	16.67
3	1182282	11三一MTN2	500,000	52,455,000.00	8.42
4	110018	国电转债	401,370	42,541,206.30	6.83
5	1182351	11中石油MTN6	300,000	30,156,000.00	4.84

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	383,581.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,188,801.41
5	应收申购款	2,291.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,574,676.76

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	255,672,312.50	41.06
2	113001	中行转债	103,824,249.20	16.67
3	110011	歌华转债	24,980,400.00	4.01
4	125887	中鼎转债	13,239,370.03	2.13
5	110003	新钢转债	3,146,532.00	0.51
6	125709	唐钢转债	2,607,906.95	0.42
7	110016	川投转债	1,843,200.00	0.30
8	110012	海运转债	1,152,631.20	0.19

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

份额级别	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
汇添富可转换债券A	2,209	150,861.18	215,389,782.10	64.63%	117,862,574.14	35.37%
汇添富可转换债券C	3,420	87,770.63	2,881,535.97	0.96%	297,294,008.94	99.04%
合计	5,507	115,022.32	218,271,318.07	34.46%	415,156,583.08	65.54%

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	份额级别	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	汇添富可转换债券A	20,911.88	0.01%
	汇添富可转换债券C	230,000.00	0.08%
	合计	250,911.88	0.04%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富可转换债券A	汇添富可转换债券C
基金合同生效日(2011年6月17日)基金份额总额	534,705,517.36	388,035,424.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	88,643,945.40	5,022,226.65
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	290,097,106.52	92,882,105.74
本报告期期末基金份额总额	333,252,356.24	300,175,544.91

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,欧阳必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、基金托管人的诉讼

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6月17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	167,817,796.47	98.76%	140,589.83	98.74%	-
东吴证券	1	2,102,599.00	1.24%	1,787.22	1.26%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
中银万国	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

注:此处的佣金指通过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	471,014,325.77	94.45%	4,356,300,000.00	100.00%	-	-
东吴证券	27,651,025.20	5.55%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中银万国	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

注:1.专用交易单元的选择标准和程序:

(1)基金交易名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)每年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期期前一个月完成。

(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,本基金本报告期内未新增和退租证券公司交易单元。

汇添富基金管理有限公司
2012年3月30日

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	600036	招商银行	13,767,624.23	2.21
2	600519	贵州茅台	6,177,402.00	0.99
3	601989	中国重工	5,336,404.20	0.86
4	600016	民生银行	4,020,042.00	0.65
5	000858	五粮液	3,838,873.54	0.62
6	600188	兖州煤业	2,710,359.00	0.44
7	600875	东方电气	2,580,309.00	0.41
8	002325	洪涛股份	2,525,601.76	0.41
9	000651	格力电器	2,435,220.00	0.39
10	601699	潞安环能	2,363,052.00	0.38
11	600660	福耀玻璃	2,039,725.00	0.33
12	600425	青松建化	2,032,900.00	0.33
13	600123	兰花科创	2,003,627.06	0.32
14	601601	中国太保	1,880,781.00	0.30
15	002106	莱宝高科	1,678,390.00	0.27
16	000887	中鼎股份	1,561,777.64	0.25
17	600348	阳泉煤业	1,517,680.00	0.24
18	601088	中国神华	1,486,467.99