深证100指数交易型开放式指数证券投资基金

2012 第二季度 报告

2012年6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：2012年7月18日

一、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2012年7月18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2012年4月1日起至6月30日止。

二、基金产品概况

基金简称	汇添富深证100指数交易型开放式指数证券投资基金
交易代码	159901
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006年6月5日
报告期末基金份额总额	1,000,000,000.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，正常情况下，基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	深证100指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过投资于目标指数成分股，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

三、主要财务指标和基金净值表现

1、主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年4月1日-2012年6月30日）
1、本期已实现收益	[illegible]
2、本期利润	[illegible]
3、加权平均基金份额本期利润	[illegible]
4、期末基金资产净值	[illegible]
5、期末基金份额净值	[illegible]

注：1、2、3、4、5、期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入、减：公允价值变动收益、减：费用后的余额。2、3、4、5、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

5、基金净值表现

1、本报告期末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	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

2、自基金合同生效以来基金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：1、基金的1、基金合同生效日为2006年6月5日，截至本报告期末，基金成立未满一个完整会计年度。2、基金建仓期为本1、基金合同生效之日至2007年6月5日，截至本报告期末时各项资产配置比例符合合同约定。

四、管理人报告

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		
吴振翔	本基金的基金经理、汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理、汇添富深证100指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理	2006年6月5日	原任	7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：2007年任长盛基金管理有限公司金融工程研究员；2008年5月加入长盛基金管理有限公司产品开发高级经理；2009年6月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程研究员；2009年6月至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理助理；2009年6月至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理；2009年6月至今任汇添富深证100指数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从业人员资格管理办法的相关规定。

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。基金无重大违法、违规行为。

3、基金公平交易专项说明

4、基金公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根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、证券法规、借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各投资组合、各投资市场、各投资标的、贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人对公平交易制度的执行情况进行了全面、深入的检查，未发现违反公平交易制度、公司内部交易管理制度、证券投资基金管理公司公平交易管理指引等法律法规、监管机构、自律组织、公司内部制度等规定的情况。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，未发现任何违反公平交易的行为。

5、异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人对投资交易全过程实施了严格的监控、分析和检查，未发现任何异常交易行为。

6、报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

7、报告期内基金投资策略和运作分析

2012年第二季度通货膨胀加速回调，从经济基本面和政策两方面来看，一方面经济数据持续恶化，另一方面降准和降息同时并行，在这两种因素主导下，股市场在二季度走出了先扬后抑的行情。本报告期内，遵循了指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性，追求和股票投资仓位在考察期内始终保持在[illegible]之间，在现货构建方面以深证100指数成分股为主要投资品种，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

8、报告期内基金的业绩表现

深证100指数在报告期内上涨了2.[illegible]，本基金在报告期内累计收益率为2.[illegible]，超额业绩比较基准收益率为[illegible]，收益率领先业绩比较基准[illegible]。收益率的差异因素主要来源于仓位不足。[illegible]。日常申购赎回等因素，本基金在考察期内日均跟踪误差为[illegible]，跟踪误差水平远低于合同约定上限，在报告期达到了投资目标要求。

9、管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间，基金倾向于认为，宏观和经济增速都会处于一个筑底过程，前期的货币放松也将抑制通胀的下行空间，这也很大程度上抑制了政策进一步放松的力度。需要关注成品油、食品等价格的变化方向，由于前期[illegible]数据的快速下滑，企业盈利水平料将出现较大的下滑；市公司半年报期待不大。另外进出口增速的基础是不稳定的，房地产市场的调控仍将保持一定力度。在此种大背景下，我们认为，在短期可能继续施行结构型积极的财政政策和微调的货币政策。另外，国际经济数据时好时坏，而欧债问题短期虽然有所缓解，但欧债问题长期仍待解决，从而继续影响我国的外需增速。为保增长和确保经济软着陆的角度来看，政策在短期可能出现超预期。这将给股票市场带来短期的投资机会。

整体来看，2012年粤股市场将处于底部震荡形态。目前，粤股市场经过前期的大幅调整，估值水平已处于历史低位，进一步下降空间相对有限。如果经济筑底成功，粤股市场将出现较好的投资机会。目前，也是投资者逐步进场的可选择时机。深证100指数是个弹性较大的场内交易品种，是投资者阶段性投资的理想标的。

作为被动投资的交易所上市指数型基金，汇添富深证100指数基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的指数化投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。我们也非常期望汇添富深证100指数基金能继续与投资者一起分享中国经济的美好未来。

10、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：股票	[illegible]	[illegible]
2	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
6	其他资产	[illegible]	[illegible]
7	合计	[illegible]	100.00

11、报告期末按行业分类的股票投资组合

12、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	[illegible]	[illegible]
B	采掘业	[illegible]	[illegible]
C	制造业	[illegible]	[illegible]
C0	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
C1	纺织、服装、皮毛	[illegible]	[illegible]
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	[illegible]	[illegible]
C4	石油、化学、塑胶、塑料	[illegible]	[illegible]
C5	电子	[illegible]	[illegible]
C6	金属、非金属	[illegible]	[illegible]
C7	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
C8	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
C99	其他制造业	[illegible]	[illegible]
D	电力、煤气及水的生产和供应业	[illegible]	[illegible]
E	建筑业	[illegible]	[illegible]
F	交通运输、仓储业	[illegible]	[illegible]
G	信息技术业	[illegible]	[illegible]
H	批发和零售贸易	[illegible]	[illegible]
I	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
J	房地产业	[illegible]	[illegible]
K	社会服务业	[illegible]	[illegible]
L	传播与文化产业	[illegible]	[illegible]
M	综合类	[illegible]	[illegible]
	合计	[illegible]	[illegible]

13、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

注：1、本报告期末基金本报告期末未进行积极投资。

14、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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	[illegible]	万科A	[illegible]	[illegible]	[illegible]
2	[illegible]	五粮液	[illegible]	[illegible]	[illegible]
3	[illegible]	格力电器	[illegible]	[illegible]	[illegible]
4	[illegible]	中联重科	[illegible]	[illegible]	[illegible]
5	[illegible]	深发展A	[illegible]	[illegible]	[illegible]
6	[illegible]	苏宁电器	[illegible]	[illegible]	[illegible]
7	[illegible]	泸州老窖	[illegible]	[illegible]	[illegible]
8	[illegible]	中兴通讯	[illegible]	[illegible]	[illegible]
9	[illegible]	广发证券	[illegible]	[illegible]	[illegible]
10	[illegible]	洋河股份	[illegible]	[illegible]	[illegible]

15、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：1、本基金本报告期末未进行积极投资。

16、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：1、本基金本报告期末未持有债券投资。

17、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

注：1、本基金本报告期末未持有债券投资。

18、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：1、本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

19、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：1、本基金本报告期末未持有权证。

20、投资组合报告附注

21、本基金投资前十名证券五粮液（000858）于2012年4月5日受到证监会行政处罚，该上市公司于2012年5月5日被证监会立案调查之初，我们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，亦会对其投资价值造成较大影响。

22、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范围。

23、其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	[illegible]
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	[illegible]
5	应收申购款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
8	合计	[illegible]

24、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：1、基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

25、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：1、基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

26、开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	[illegible]
本报告期基金总申购份额	[illegible]
减：本报告期基金总赎回份额	[illegible]
本报告期基金拆分变动份额	0.00
本报告期期末基金份额总额	[illegible]

27、备查文件目录

1、备查文件目录

2、中国证监会批准汇添富深证100指数交易型开放式指数证券投资基金募集的文件。

3、汇添富深证100指数交易型开放式指数证券投资基金基金合同。

4、汇添富深证100指数交易型开放式指数证券投资基金托管协议。

5、基金管理人业务资格批件、营业执照。

6、报告期内汇添富深证100指数交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

7、中国证监会要求的其他文件。

8、存放地点

上海市富城路[illegible]号震旦国际大楼[illegible]楼。汇添富基金管理有限公司

9、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[illegible]查阅，或可拨打基金管理人客户服务中心电话[illegible]查询相关信息。

汇添富基金管理有限公司
2012年7月18日

汇添富深证100指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2012 第二季度 报 告

2012年6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：2012年7月18日

一、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2012年7月18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2012年4月1日起至6月30日止。

二、基金产品概况

基金简称	汇添富深证100指数交易型开放式指数证券投资基金联接
交易代码	519901
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年6月5日
报告期末基金份额总额	[illegible]
投资目标	通过投资于目标基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以深证100指数交易型开放式指数证券投资基金作为其主要投资标的，并不参与目标基金的管理。本基金主要以一级市场申购的方式投资于目标基金，取基金份额净值上涨带来的收益。在目标基金份额二级市场交易流动性较好的情况下，也可以通过二级市场买卖目标基金的基金份额。
业绩比较基准	深证100指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%（税后）
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过投资于目标基金，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

1、目标基金基本情况

基金名称	深证100指数交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159901
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006年6月5日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006年6月19日
基金管理人名称	汇添富基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司
目标基金投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
目标基金投资策略	本基金主要采取完全复制法，正常情况下，基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
目标基金业绩比较基准	深证100指数收益率
目标基金风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过投资于目标基金，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

三、主要财务指标和基金净值表现

1、主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年4月1日-2012年6月30日）
1、本期已实现收益	[illegible]
2、本期利润	[illegible]
3、加权平均基金份额本期利润	[illegible]
4、期末基金资产净值	[illegible]
5、期末基金份额净值	[illegible]

注：1、2、3、4、5、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入、减：公允价值变动收益、减：费用后的余额。2、3、4、5、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

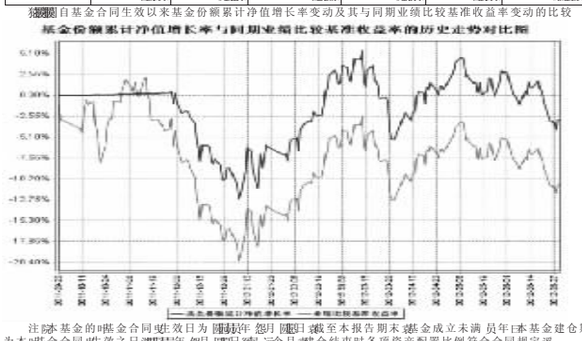
6、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、基金净值表现

1、本报告期末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	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

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：1、基金的1、基金合同生效日为2006年6月5日，截至本报告期末，基金成立未满一个完整会计年度。2、基金建仓期为本1、基金合同生效之日至2007年6月5日，截至本报告期末时各项资产配置比例符合合同规定。

四、管理人报告

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		
吴振翔	本基金的基金经理、汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理、汇添富深证100指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理	2006年6月5日	原任	7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：2007年任长盛基金管理有限公司金融工程研究员；2008年5月加入长盛基金管理有限公司产品开发高级经理；2009年6月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程研究员；2009年6月至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理助理；2009年6月至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理；2009年6月至今任汇添富深证100指数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从业人员资格管理办法的相关规定。

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。基金无重大违法、违规行为。

3、基金公平交易专项说明

4、基金公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根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、证券法规、借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各投资组合、各投资市场、各投资标的、贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人对公平交易制度的执行情况进行了全面、深入的检查，未发现违反公平交易制度、公司内部交易管理制度、证券投资基金管理公司公平交易管理指引等法律法规、监管机构、自律组织、公司内部制度等规定的情况。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，未发现任何违反公平交易的行为。

5、异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人对投资交易全过程实施了严格的监控、分析和检查，未发现任何异常交易行为。

6、报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

7、报告期内基金投资策略和运作分析

2012年第二季度通货膨胀加速回调，从经济基本面和政策两方面来看，一方面经济数据持续恶化，另一方面降准和降息同时并行，在这两种因素主导下，粤股市场在二季度走出了先扬后抑的行情。本报告期内，遵循了指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性，追求和股票投资仓位在考察期内始终保持在[illegible]之间，在现货构建方面以深证100指数成分股为主要投资品种，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

8、报告期内基金的业绩表现

深证100指数在报告期内上涨了2.[illegible]，本基金在报告期内累计收益率为2.[illegible]，超额业绩比较基准收益率为[illegible]，收益率领先业绩比较基准[illegible]。收益率的差异因素主要来源于仓位不足。[illegible]。日常申购赎回等因素，本基金在考察期内日均跟踪误差为[illegible]，跟踪误差水平远低于合同约定上限，在报告期达到了投资目标要求。

9、管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间，基金倾向于认为，宏观和经济增速都会处于一个筑底过程，前期的货币放松也将抑制通胀的下行空间，这也很大程度上抑制了政策进一步放松的力度。需要关注成品油、食品等价格的变化方向，由于前期[illegible]数据的快速下滑，企业盈利水平料将出现较大的下滑；市公司半年报期待不大。另外进出口增速的基础是不稳定的，房地产市场的调控仍将保持一定力度。在此种大背景下，我们认为，在短期可能继续施行结构型积极的财政政策和微调的货币政策。另外，国际经济数据时好时坏，而欧债问题短期虽然有所缓解，但欧债问题长期仍待解决，从而继续影响我国的外需增速。为保增长和确保经济软着陆的角度来看，政策在短期可能出现超预期。这将给股票市场带来短期的投资机会。

整体来看，2012年粤股市场将处于底部震荡形态。目前，粤股市场经过前期的大幅调整，估值水平已处于历史低位，进一步下降空间相对有限。如果经济筑底成功，粤股市场将出现较好的投资机会。目前也是投资者逐步进场的可选择时机。深证100指数联接基金是个弹性较大的指数品种，是投资者长期投资和定期定投较好的投资选择。

作为被动投资的指数型基金，汇添富深证100指数联接基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的指数化投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。我们也非常期望汇添富深证100指数联接基金能继续与投资者一起分享中国经济的美好未来。

10、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：股票	[illegible]	[illegible]
2	基金投资	[illegible]	[illegible]
3	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
7	其他资产	[illegible]	[illegible]
8	合计	[illegible]	100.00

11、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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	[illegible]	[illegible]
B	采掘业	[illegible]	[illegible]
C	制造业	[illegible]	[illegible]
C0	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
C1	纺织、服装、皮毛	[illegible]	[illegible]
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	[illegible]	[illegible]
C4	石油、化学、塑胶、塑料	[illegible]	[illegible]
C5	电子	[illegible]	[illegible]
C6	金属、非金属	[illegible]	[illegible]
C7	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
C8	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
C99	其他制造业	[illegible]	[illegible]
D	电力、煤气及水的生产和供应业	[illegible]	[illegible]
E	建筑业	[illegible]	[illegible]
F	交通运输、仓储业	[illegible]	[illegible]
G	信息技术业	[illegible]	[illegible]
H	批发和零售贸易	[illegible]	[illegible]
I	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
J	房地产业	[illegible]	[illegible]
K	社会服务业	[illegible]	[illegible]
L	传播与文化产业	[illegible]	[illegible]
M	综合类	[illegible]	[illegible]
	合计	[illegible]	[illegible]

12、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

注：1、本报告期末基金本报告期末未进行积极投资。

13、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

注：1、本报告期末基金本报告期末未持有债券投资。

14、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：1、本报告期末基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

15、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：1、本报告期末基金本报告期末未持有权证。

16、投资组合报告附注

17、本基金投资前十名证券五粮液（000858）于2012年4月5日受到证监会行政处罚，该上市公司于2012年5月5日被证监会立案调查之初，我们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，亦会对其投资价值造成较大影响。

18、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范围。

19、其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	[illegible]
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	[illegible]
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	[illegible]

20、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：1、基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

21、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：1、基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

22、开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	[illegible]
本报告期基金总申购份额	[illegible]
减：本报告期基金总赎回份额	[illegible]
本报告期基金拆分变动份额	0.00
本报告期期末基金份额总额	[illegible]

23、备查文件目录

1、备查文件目录

2、中国证监会批准汇添富深证100指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件。

3、汇添富深证100指数交易型开放式指数证券投资基金基金合同。

4、汇添富深证100指数交易型开放式指数证券投资基金托管协议。

5、基金管理人业务资格批件、营业执照。

6、报告期内汇添富深证100指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金在指定报刊上披露的各项公告。

7、中国证监会要求的其他文件。

8、存放地点

上海市富城路[illegible]号震旦国际大楼[illegible]楼。汇添富基金管理有限公司

9、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[illegible]查阅，或可拨打基金管理人客户服务中心电话[illegible]查询相关信息。

汇添富基金管理有限公司
2012年7月18日

汇添富黄金及贵金属证券投资基金（QDII）

2012 第二季度 报告

2012年6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：2012年7月18日

一、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2012年7月18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2012年4月1日起至6月30日止。

二、基金产品概况

基金简称	汇添富黄金及贵金属证券投资基金（QDII）
交易代码	519933
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月27日
报告期末基金份额总额	300,000,000.00份
投资目标	深入研究影响黄金及其他贵金属价值、白银、铂金、钯金等贵金属价格的主要因素，把握不同品种贵金属的长期价格趋势和短期市场波动，通过主动投资于有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金，在严格控制风险的前提下，追争基金收益率超越同期黄金价格走势。
投资策略	综合考虑国际政治、经济、市场、争端、主要国家货币和利率政策、贵金属市场供求等多方面因素，基金重点投资于境外上市有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金，并根据市场情况适时调整。 本基金主要投资策略包括贵金属资产配置策略、交易所交易基金选择策略、货币市场工具投资策略以及金融衍生工具投资策略。
业绩比较基准	伦敦金价格折成人民币后的收益率 注：伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价，折算成人民币后，以银行间市场最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。
风险收益特征	本基金为基金中基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，主要投资于境外有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金，其预期风险收益水平与黄金价格相似。
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

注：1、本基金为“基金中基金”，深交所的简称为“华富贵金”。

2、境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	JPMorgan Chase Bank, National Association
	中文	摩根大通银行
注册地址		纽约州曼哈顿区奥林匹克大道270号
办公地址		纽约州曼哈顿区奥林匹克大道270号
邮政编码		10017

注：1、本基金无境外投资顾问。

三、主要财务指标和基金净值表现

1、主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年4月1日-2012年6月30日）
1、本期已实现收益	[illegible]
2、本期利润	[illegible]
3、加权平均基金份额本期利润	[illegible]
4、期末基金资产净值	[illegible]
5、期末基金份额净值	[illegible]

注：1、2、3、4、5、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入、减：公允价值变动收益、减：费用后的余额。2、3、4、5、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

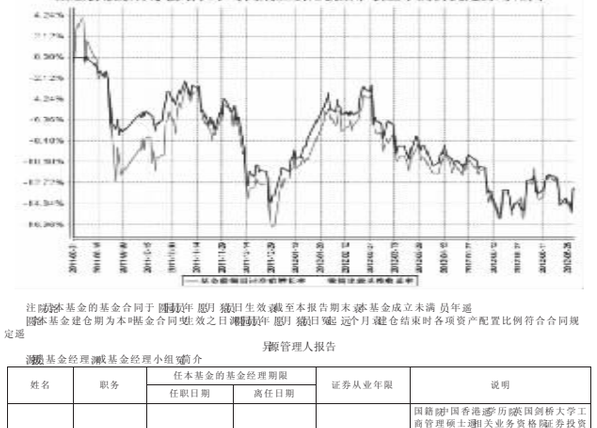
6、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、基金净值表现

1、本报告期末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	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

2、自基金合同生效以来基金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


基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
4.26%
2.34%
0.50%
-1.27%
-2.94%
-4.61%
-6.28%
-11.31%
-13.77%
-14.34%
-16.20%
2008-6-27
2008-8-29