汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2012 第三季度 报告

2012年9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10月26日

§1 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10月24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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	汇添富深证300ETF联接
交易代码	470068
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月28日
报告期末基金份额总额	160,962,931.86份
投资目标	通过投资于目标ETF，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300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ETF的管理。本基金主要以一级市场申购的方式投资于目标ETF，获取基金份额净值上涨带来的收益；在目标ETF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ETF的基金份额。
业绩比较基准	深证300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
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ETF，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

2.2 目标基金基本情况

基金名称	深证300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159912
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月16日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年11月24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，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年跟踪误差不超过2%。
目标基金业绩比较基准	深证300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ETF，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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年7月1日 - 2012年9月30日）
1.本期已实现收益	-200,629.72
2.本期利润	-10,783,813.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0685
4.期末基金资产净值	145,038,812.97
5.期末基金份额净值	0.9011

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。

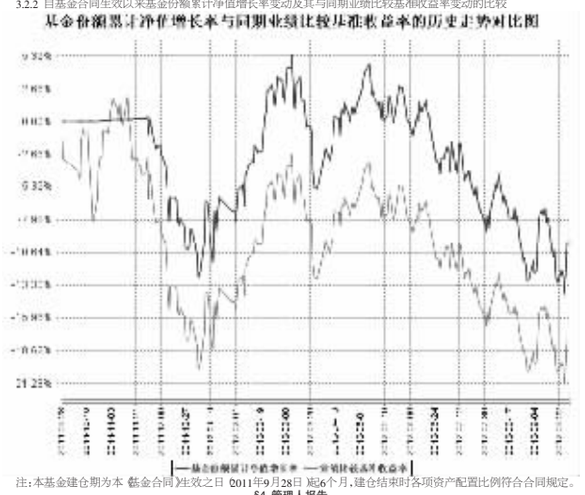
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	-7.07%	1.33%	-7.41%	1.35%	0.34%	-0.02%

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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011年9月28日）起6个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§4 管理人报告

4.1 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，深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。	2011年9月28日	-	6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：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008年3月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程研究员，2010年1月8日至2010年2月4日任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理助理，2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理，2011年9月16日至今任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2011年9月28日至今任汇添富深证300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 公平交易专项说明

4.3.1 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》等法规，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，并贯穿分工授权、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和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

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，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未出现异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况有一次。投资组合经理因指数投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年3季度通货膨胀保持在中内较低水平，经济的一些同比数据出现了较为明显的改善，PMI数据也显示制造业活动有所活跃，但经济能否真正企稳还需进一步观察。实际上，证券市场对这种数据的企稳有一定的反应，7月份A股市场以下跌为主，8月和9月在改善数据出台后，市场一直处于震荡中。

本基金在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，ETF和股票投资仓位在考察期内始终保持在92%-95%之间，在现货构建方面以深证300ETF为主要投资品，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

深证300指数在报告期内下跌了7.81%，本基金在报告期内累计收益率为-7.07%，同期业绩比较基准收益率为-7.41%，收益率领先业绩比较基准0.34%。收益率的差异因素主要来源于仓位不足95%、日常申赎赎回等因素。本基金在考察期内日均跟踪误差为0.027%，这一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。

4.5 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，本基金倾向于认为通货膨胀处于一个阶段性底部，9月份PPI创3年来新低一方面降低了我们对通胀的担心，但也说明了企业盈利水平的不稳固，上市公司年度业绩期待不大，同时今年对房价的调控基本没有达到目标，这也将一定程度上抑制为保增长而政策放松的方式和力度。央行在3季度启动了天量的逆回购，向市场投放短期流动性，同时政府的固定资产投资支出在近期明显力度增加，本基金认为政策上在后续将继续结构型积极的财政政策和偏数量化的货币政策，这种政策预期下，市场将会有一定的阶段性投资机会。外围市场中，欧洲债务问题阴霾再现，美国的就业数据尽管有所改善，数据上并没有看到企业长期增加雇员的意愿，全球经济前景依然不乐观，但在全球又一轮量化宽松政策下，权益类的投资吸引力会有所增加，这也将给股票市场带来短期的投资机会。

整体来看，2012年A股市场处于不断寻找地步的过程，目前A股市场经过前期的大幅调整，估值水平已处于历史低位，无论是横向比较还是纵向比较都有一定的吸引力。如果经济筑底成功，A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300ETF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300ETF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300ETF联接基金能继续与投资者一起分享中国经济的美好未来。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,381,893.26	1.64
	其中：股票	2,381,893.26	1.64
2	基金投资	134,902,082.91	92.61
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,083,687.85	5.55
7	其他资产	301,005.09	0.21
8	合计	145,668,669.11	100.00

5.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	37,889.00	0.03
B	采掘业	124,992.04	0.09
C	制造业	1,423,016.25	0.98
C0	食品、饮料	267,520.20	0.18
C1	纺织、服装、皮毛	24,453.07	0.02
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	9,948.00	0.01
C4	石油、化学、塑胶、塑料	150,269.62	0.10
C5	电子	138,946.43	0.10
C6	金属、非金属	258,798.48	0.18
C7	机械、设备、仪表	390,929.85	0.27
C8	医药、生物制品	180,300.60	0.12
C99	其他制造业	1,850.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	35,257.00	0.02
E	建筑业	43,305.60	0.03
F	交通运输、仓储业	19,170.00	0.01
G	信息技术业	101,456.00	0.07
H	批发和零售贸易	116,857.87	0.08
I	金融、保险业	163,680.00	0.11
J	房地产业	232,212.50	0.16
K	社会服务业	56,872.00	0.04
L	传播与文化产业	23,909.00	0.02
M	综合类	3,276.00	0.00
	合计	2,381,893.26	1.64

5.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万 科A	12,100	102,003.00	0.07
2	000858	五 粮 液	2,600	88,140.00	0.06
3	000651	格力电器	3,100	66,278.00	0.05
4	000157	中联重科	5,700	49,134.00	0.03
5	000001	平安银行	3,700	48,581.00	0.03
6	002304	洋河股份	336	42,000.00	0.03
7	002024	苏宁电器	6,041	41,924.54	0.03
8	000568	泸州老窖	900	34,650.00	0.02
9	000776	广发证券	2,400	32,640.00	0.02
10	000423	东阿阿胶	800	30,976.00	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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：本基金本报告期末未持有权证。

5.8 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	深300ETF	股票型	交易型开放式	汇添富基金管理有限公司	134,902,082.91	93.01

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	255,790.61
2	应收证券清算款	4,797.60
3	应收股利	-
4	应收利息	1,534.68
5	应收申购款	38,882.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	301,005.09

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.9.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	155,705,809.48
本报告期基金总申购份额	10,071,493.96
减：本报告期基金总赎回份额	4,814,371.58
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	160,962,931.86

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；

2、《汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》；

3、《汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

4.基金管理人业务资格批件、营业执照；

5.报告期内汇添富深证300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；

6.中国证监会要求的其他文件。

7.2 存放地点

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

7.3 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www.99fund.com查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918查询相关信息。

汇添富基金管理有限公司
2012年10月26日

汇添富货币市场基金

2012 第三季度 报告

2012年9月30日

基金管理人：汇添富基金管理有限公司
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期：2012年10月26日

§1 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月24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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富货币
交易代码	519518
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年3月23日
报告期末基金份额总额	4,334,024,314.65份
投资目标	力求在本金稳妥和基金资产高流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。
业绩比较基准	税后活期存款利率（即活期存款利率×（1-利息税率））。
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	汇添富货币A	汇添富货币B
下属两级基金的交易代码	519518	519517
报告期末下属两级基金的份额总额	1,381,034,908.98份	2,952,989,405.67份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年7月1日 - 2012年9月30日）	
	汇添富货币A	汇添富货币B
1. 本期已实现收益	12,412,559.36	51,929,226.28
2.本期利润	12,412,559.36	51,929,226.28
3.期末基金资产净值	1,381,034,908.98	2,952,989,405.67

注：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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8667%	0.0037%	0.0887%	0.00%	0.7780%	0.0037%

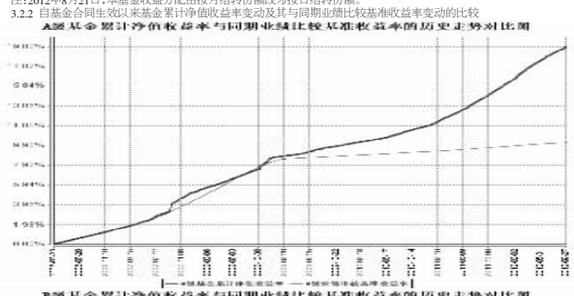
注：2012年8月21日，本基金收益分配由按月结转份额改为按日结转份额。

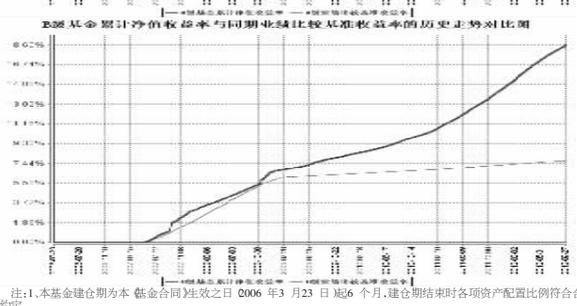
汇添富货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9275%	0.0037%	0.0887%	0.00%	0.8388%	0.0037%

注：2012年8月21日，本基金收益分配由按月结转份额改为按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2006年3月23日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

2、本基金从本《基金合同》生效之日起至2009年2月15日采用的业绩比较基准为同期税后一年定期存款利率。从2009年2月16日起，本基金业绩比较基准为同期税后活期存款利率。

§4 管理人报告

4.1 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		
王珏池	本基金的基金经理，汇添富可转换债券型证券投资基金的基金经理，汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理。	2006年3月23日	-	18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，2012年3月9日至今任汇添富逆向投资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 公平交易专项说明

4.3.1 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》等法规，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，并贯穿分工授权、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和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

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，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未出现异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况有一次。投资组合经理因指数投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

过去三个季度以来经济运行的逻辑相对清晰，消费增速伴随收入增速回落而下降，企业去产能过程中投资增速放缓，海外经济弱势复苏降低出口。PPI处于负值区域运行，产出缺口继续为负，表明经济运行于潜在增长率之下。

本基金在报告期内配置了较多银行间业存款，三季度资金面整体较二季度紧张，短融收益率受银行间市场流动性紧张影响，一路上行，在这个过程中，我们提高存款配置比例，较好的规避了资金面紧张带来的损失，获取较高的稳定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

三季度本基金A级净值收益率为0.8667%，B级净值收益率为0.9275%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去三个季度以来经济运行的逻辑相对清晰，消费增速伴随收入增速回落而下降，企业去产能过程中投资增速放缓，海外经济弱势复苏降低出口。从最重要的投资分项上看，制造业投资在去产能过程中放缓；房地产投资持续弱势；而基建投资增量有限，并且在一定程度上挤压私人投资，对经济的托底作用并不明显。过去三个季度经济运行的逻辑仍将在四季度延续下去。

四季度流动性预计较前三季度出现改善，主要体现在季节性的结售汇需求与QE3将促使外汇占款重新回流。

政策方面，美国、日本、欧元区相继推出量化宽松政策，全球流动性泛滥的担忧再次来临，无论是为了应对输入性通胀压力，还是为了降低国内流动性，国内进一步宽松货币政策的空间都大幅收窄。

我们预计四季度经济的弱势局面不会发生改变，货币政策短期内不会转向紧缩，流动性将较三季度出现改善，因此短融等短期债券品种具有较好的机会，将逐渐拉长投资组合久期，以获取较高盈利。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	2,917,517,480.22	57.67
	其中：债券	2,897,517,480.22	57.27
	资产支持证券	20,000,000.00	0.40
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,961,842,242.66	38.78
4	其他资产	179,972,150.71	3.56
5	合计	5,059,331,873.59	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	4.49	
	其中：买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	720,658,399.01	16.63
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期
1	2012年9月27日	30.08	满足流动性需求	1个交易日

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	139
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	151
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	84

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	13.04	16.63
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债券	5.37	-
2	30天（含）-60天	18.69	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债券	1.84	-
3	60天（含）-90天	18.46	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债券	0.69	-
4	90天（含）-180天	24.94	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债券	3.68	-
5	180天（含）-397天（含）	37.46	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
	合计	112.59	16.63

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	29,870,031.91	0.69
3	金融债券	662,411,841.56	15.28
	其中：政策性金融债	662,411,841.56	15.28
4	企业债券	111,228,264.38	2.57
5	企业短期融资券	2,094,007,342.37	48.32
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	2,897,517,480.22	66.86
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	502,081,900.87	11.58

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	011217001	12华电SCP001	2,500,000	250,054,595.32	5.77
2	041253028	12中粮CP002	1,900,000	190,431,782.54	4.39
3	120228	12国开28	1,600,000	159,804,645.35	3.69
4	120227	12国开27	1,500,000	149,647,333.49	3.45
5	041252023	12大唐集CP001	1,400,000	140,080,563.88	3.23
6	090213	09国开13	1,300,000	131,373,353.31	3.03
7	080213	08国开13	1,100,000	111,753,559.72	2.58
8	041260037	12陕延油CP001	1,000,000	100,180,873.58	2.31
9	011212001	12华能SCP001	1,000,000	100,001,276.97	2.31
10	041270002	12光明CP001	900,000	90,107,720.26	2.08

5.6 影子定价“与”摊余成本法“确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25（含）-0.5%间的次数	2
报告期内偏离度的最高值	0.31%
报告期内偏离度的最低值	-0.07%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.10%

5.7 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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	119017	宁公控1	200,000	20,000,000.00	0.46

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金估值采用摊余成本法计价，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.8.2

本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券，不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情况。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	75,116,061.40
4	应收申购款	104,573,017.59
5	其他应收款	-
6	待摊费用	33,071.72
7	其他	-
8	合计	179,972,150.71

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富货币A	汇添富货币B
本报告期期初基金份额总额	1,247,921,330.92	2,896,027,700.58
本报告期基金总申购份额	2,159,959,307.13	12,268,403,532.34
减：本报告期基金总赎回份额	2,026,845,729.07	12,211,441,827.25
本报告期期末基金份额总额	1,381,034,908.98	2,952,989,405.67

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富货币市场基金募集的文件；

2、《汇添富货币市场基金合同》；

3、《汇添富货币市场基金托管协议》；

4、《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》；

5.基金管理人业务资格批件、营业执照；

6.报告期内汇添富货币市场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。

7.2 存放地点

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

7.3 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www.99fund.com查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918查询相关信息。

汇添富基金管理有限公司
2012年10月26日

汇添富逆向投资股票型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年9月30日

基金管理人：汇添富基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2012年10月26日

§1 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月24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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富逆向投资股票
交易代码	470098
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月9日
报告期末基金份额总额	171,608,340.35份
投资目标	本基金主要采用逆向投资策略进行主动投资管理，在科学严格的投资风险管理前提下，谋求基金资产长期稳健回报。
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未被市场主流认同的价值被低估的股票以努力获取超额收益。
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。
基金管理人	汇添富基金管理有限公司