深证300交易型开放式指数证券投资基金

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

基金简称	汇添富深证300ETF
交易代码	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
报告期末基金份额总额	292,748,991.00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,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%。
业绩比较基准	深证300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

§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	-894,387.10
2.本期利润	-20,045,435.96
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0678
4.期末基金资产净值	241,780,109.42
5.期末基金份额净值	0.8259

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。

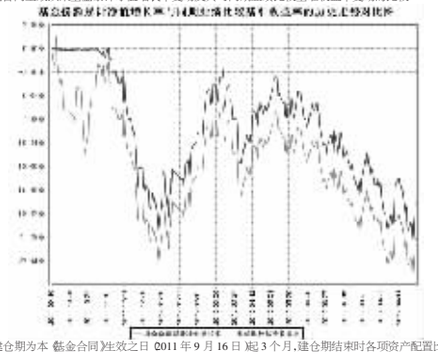
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-7.56%	1.41%	-7.81%	1.42%	0.25%	-0.01%

3.2.2 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:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2011年9月16日)起3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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,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。	2011年9月16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化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

从大类资产收益率比较来看看,三季度转债市场遭遇平价、债底、估值多重因素的打击,转债指数表现显著弱于信用债,略强于上证指数。三季度债券收益率出现上行,转债债底遭受冲击;正股下跌与股市波动性的系统下行,降低转债期权价值,转债整体估值下跌,绝大多数转债个券均为负收益。

本基金在报告期内针对目前的经济环境,大类资产配置上降低整体资产组合杠杆,降低股票投资比例,在转债品种中,减持大盘转债,提升了电力转债的配置。大盘转债目前价位对比历史水平而言处于低位,已经具有一定的安全边际,但宏观经济弱势的局面没有变化,新增转债潜在供给较大,转债市场整体前景并不明朗。

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-3.74%,C级净值收益率为-3.86%,同期业绩比较基准收益率为-2.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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是个弹性较大的场内交易品种,是投资者在场内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300ETF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	239,884,951.40	98.98
	其中:股票	239,884,951.40	98.98
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	-	-
	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	2,189,434.41	0.90
6	其他资产	273,511.39	0.11
7	合计	242,347,897.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,787,990.83	1.57
B	采掘业	12,114,995.75	5.01
C	制造业	143,117,233.20	59.19
C0	食品、饮料	26,519,155.79	10.97
C1	纺织、服装、皮毛	2,125,097.09	0.88
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,052,182.40	0.44
C4	石油、化学、塑胶、塑料	15,102,986.29	6.25
C5	电子	14,417,856.45	5.96
C6	金属、非金属	24,905,470.01	10.30
C7	机械、设备、仪表	41,724,772.63	17.26
C8	医药、生物制品	16,995,912.54	7.03
C99	其他制造业	273,800.00	0.11
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,207,271.89	1.74
E	建筑业	4,273,769.18	1.77
F	交通运输、仓储业	2,218,923.75	0.92
G	信息技术业	10,286,929.96	4.25
H	批发和零售贸易	11,421,889.77	4.72
I	金融、保险业	16,410,829.07	6.79
J	房地产业	22,983,815.60	9.51
K	社会服务业	5,823,900.91	2.41
L	传播与文化产业	2,922,290.49	1.21
M	综合类	315,315.00	0.13
	合计	239,885,155.40	99.22

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	1,193,806	10,063,784.58	4.16
2	000858	五 粮 液	247,501	8,390,283.90	3.47
3	000651	格力电器	312,439	6,679,945.82	2.76
4	000157	中联重科	566,854	4,886,281.48	2.02
5	000001	平安银行	362,648	4,761,568.24	1.97
6	002304	洋河股份	33,198	4,149,750.00	1.72
7	002024	苏宁电器	594,848	4,128,245.12	1.71
8	000568	泸州老窖	96,300	3,707,550.00	1.53
9	000776	广发证券	229,002	3,114,427.20	1.29
10	000423	东阿阿胶	74,533	2,885,917.76	1.19

5.3.2 报告期末积极投资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:本基金本报告期末未进行积极投资。

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投资。

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投资。

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 投资组合报告附注

5.8.1

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。

5.8.2

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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	273,115.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	395.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	273,511.39

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未进行积极投资,不存在流通受限情况。

§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	299,148,991.00
本报告期基金总申购份额	9,600,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	16,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	292,748,991.00

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准深证300交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

2、《深证300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3、《深证300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、报告期内深证300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;

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

汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)

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 基金基本情况

基金简称	汇添富黄金及贵金属(QDII-LOF-FOF)
交易代码	164701
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月31日
报告期末基金份额总额	457,611,871.48份
投资目标	深入研究影响黄金及其他贵金属(如白银、铂金、钯金等)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(ETF),在严格控制风险的前提下,力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、汇市、战争、主要国家货币和利率政策、贵金属市场供求等多方面因素,本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(ETF),长期持有结合动态调整。 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(ETF)投资策略、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 (伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价《London Gold Price PM Fix》,人民币汇率以报告期末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(ETF),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:本基金为LOF基金,在深交所的简称为"添富贵金"。

2.2 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	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		NY 10005

注:本基金无境外投资顾问。

§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	-5,476,847.40
2.本期利润	44,630,576.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0959
4.期末基金资产净值	440,604,007.74
5.期末基金份额净值	0.963

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。

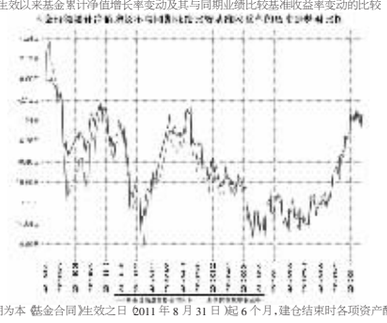
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	11.20%	0.69%	11.39%	0.89%	-0.19%	-0.20%

3.2.2 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:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2011年8月31日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
刘子龙	本基金的基金经理,汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金的基金经理。	2011年8月31日	-	17年	国籍:中国香港。学历:英国剑桥大学工商管理硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。特许金融分析师(CFA)。从业经历:曾任香港花旗银行业务经理,汇丰投资管理(香港)有限公司上海代表处首席代表,2000年11月20日至2005年11月30日任花旗投资管理(香港)有限公司全球平衡组合的基金经理,2007年9月加入汇添富基金管理有限公司任国际投资副总监,2010年6月25日至今任汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金的基金经理,2011年8月31日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

根据契约,本基金在期内一直满仓运作,但在黄金和白银之间的配置存在主动策略空间。3季度时,美国联储局终于推出QE3,而欧洲及中国央行也先后推出不同的经济刺激措施,推动期内的金银价格急速回弹。这些措施加强了全球经济再膨胀的预期,目前大大超越了收缩力量,投机资金蜂拥进入金银市场,在过去一个多月金市光复年内大部分的跌幅。

贝南奇改变了美国联邦储局货币政策主要目标,由原来以抑制通胀为目标变成以降低失业率为目标。他没有为失业率订下一个参考目标的数字,这样使本来就不跟任何实体挂钩的美元,变成仅与更虚无飘渺有所关系。贝南奇宣布将超低息承诺延后至2015年中,并立即开始每月购买400亿元美元按揭抵押证券(MBS),并表示只要就业市场没有明显改善,此举将持续。此外,扭曲操作(OT)仍继续到今年年底。这些等同美国央行公开贬低其发行的货币,减少该货币的购买力和鼓励储蓄者,同时引发一波全球股市和商品的大规模反弹。受此刺激,金价飙升到1790元的半年来高位,银价亦上扬至35元。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金3季度上涨11.2%,而基准收益持平。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球发行硬货币的央行,皆为解决经济难题而无线印刷钞票,令通胀预期心理日益普及,预示通货膨胀正在累积上升能量,愈来愈多资金流进实体投资工具,受黄金足以保值的传统智慧影响,驱使资金购进黄金。除了私人投资者外,投资基金与各国央行亦在增持黄金,前者提高投资组合中的黄金成数,后者则提升黄金占外汇储存的比重。在25种西方主要货币中,金价在印度、印度尼西亚、巴西、丹麦和瑞士都创新高,除了纽西兰、瑞典和波兰,其余17国亦均突破今年六月一日创下的高点。金价升势反映了世界各国投资者在持续性"做化宽松"下对通胀肆虐的忧虑。

供应方面,金矿业者指出,产金量高的黄金矿"石矿"冶已大部分被开掘,近年发现的金矿质量较差,开采提炼难度高令直接成本上升;另外,据监寿金矿公司Franco-Nevada主席拉松德九月中旬在"世界黄金协会"主办一次研讨会上的发言,显示目从2003年,金矿公司的资金成本和管理费用上升五倍,主要因为在基本建设不足的发展中国家开矿,支出浩繁,而更为了符合愈来愈严格的环保标准,开销激增。金矿质量逊于过去,今采金计划从80年代可于三至五年内有收入,延长至现在可能要十至十五年才有收成,黄金成本大幅上升,黄金产量便可能萎缩。

自2008年11月至今,联储局曾施行过两轮QE,期内使美国货币基础(Monetary Base)从1,493万亿元急增至2.725万亿元,至本月5日为2.651万亿元。随着货币基础的增减,伦敦金价在QE1期间大升54%,于QE2期间大升31%。两轮QE期间金价平均升幅比率为42.5%。考虑到同类措施效果递减的因素,还有现时不知QE3将于何时结束,未来贵金属能到达何水平目前不易判断,然而美元发行愈不受约制,通胀日后极可能重临,金与银再受追捧是可以预期的。

总的来说,我们对金价的信心没变,黄金是少数大方向较明确的投资品种,每次调整(1600美元以下)都提供切入机会。目前基金仓位维持在契约规定的90%以上。因为未来一段时间内金价(以有其它商品)会被美元走势主导,所以我们会继续重点跟踪美元走势。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	408,604,758.54	90.04
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	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	44,105,551.94	9.72
8	其他资产	1,070,349.52	0.24
9	合计	453,780,660.00	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

注:本基金本报告期末未持有股票以及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 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及存托凭证投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票以及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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	ETFS GOLD TRUST	ETF基金	契约型开放式	ETFs Securities US (LLC)	80,279,090.71	18.22
2	ISHARES GOLD TRUST	ETF基金	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors	80,083,982.89	18.18
3	SPROTT PHYSICAL GOLD	ETF基金	契约型开放式	Sprott Asset Management LP	78,619,776.24	17.84
4	UBS ETF-GOLD CHF HEDG	ETF基金	契约型开放式	UBS Fund Management (Switzerland) AG	70,928,527.55	16.10
5	SPDR GOLD TRUST	ETF基金	契约型开放式	State Street Bank and Trust Company	44,285,620.09	10.05
6	SPDR GOLD TRUST	ETF基金	契约型开放式	State Street Bank and Trust Company	35,628,557.29	8.09
7	VALUE GOLD ETF	ETF基金	契约型开放式	Sensible Asset Management HongKong	9,438,149.85	2.14
8	ISHARES SILVER TRUST	ETF基金	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors	9,341,053.92	2.12

注:其中第五位SPDR GOLD TRUST在美国上市;第六位SPDR GOLD TRUST在香港上市。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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、处罚的情况。

5.10.2

本基金投资的前十名基金没有超出基金合同规定的备选基金库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,739.57
5	应收申购款	229,351.70
6	其他应收款	822,371.02
7	待摊费用	14,887.23
8	其他	-
9	合计	1,070,349.52

5.10.4 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可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

§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	476,337,395.38
本报告期基金总申购份额	17,460,888.41
减:本报告期基金总赎回份额	36,186,412.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	457,611,871.48

§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黄金及贵金属证券投资基金(LOF)募集的文件;

2、《汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)基金合同》;

3、《汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、报告期内汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)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

汇添富可转换债券证券投资基金

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

基金简称	汇添富可转换债券
交易代码	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
报告期末基金份额总额	303,472,625.82份
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。	
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	
下属两级基金的基金简称	汇添富可转换债券A	汇添富可转换债券C
下属两级基金的交易代码	470058	470059
报告期末下属两级基金的份额总额	152,503,292.41份	150,969,333.41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)	
	汇添富可转换债券A	汇添富可转换债券C
1.本期已实现收益	-1,228,301.56	-1,386,027.07
2.本期利润	-5,448,353.31	-5,873,855.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0318	-0.0372
4.期末基金资产净值	144,982,684.40	142,760,257.44
5.期末基金份额净值	0.951	0.946

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

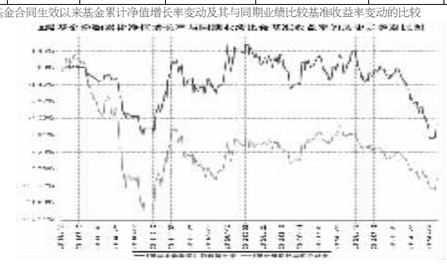
汇添富可转换债券A

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	-3.74%	0.31%	-3.15%	0.27%	-0.59%	0.04%

汇添富可转换债券C

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	-3.86%	0.30%	-3.15%	0.27%	-0.71%	0.03%

3.2.2 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



§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,汇添富货币市场基金的基金经理,汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理。	2011年6月17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