# 汇添富优势精选混合型证券投资基金

## 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 | 汇添富优势精选混合 |
| 交易代码 | 519008 |
| 前端交易代码 | 519008 |
| 后端交易代码 | 519009 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2005年8月25日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,211,881,256.41份 |
| 投资目标 | 投资具有持续竞争优势的企业,分享其在中国经济持续高速成长背景下的长期优异业绩,为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金采用适度动态资产配置策略,同时运用汇添富持续竞争优势企业评估系统自下而上精选个股,并对投资组合进行积极而有效的风险管理。 |
| 业绩比较基准 | 70%×沪深300指数收益率+30%×上证国债指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金是精选股票,并且进行积极风险控制的混合型基金,本基金的风险和预期收益比较均衡,在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。 |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 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 | 20,377,391.89 |
| 2.本期利润 | -25,487,545.90 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0209 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,512,066,440.96 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.0729 |

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 | -1.00% | 0.86% | -4.55% | 0.83% | 3.55% | 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

注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日2005年8月25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。

### §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 | | |
| 苏竞 | 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,汇添富盈筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 | 2007年10月8日 | - | 9年 | 国籍:中国。学历:上海海事大学经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任北京中国远程火箭技术研究院助理工程师,上海中银万国证券研究所高级研究员,上投摩根基金管理有限公司高级行业研究员,博时基金管理有限公司高级行业研究员。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10月7日任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理助理,2007年10月8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,2008年7月8日至今任汇添富盈筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 王栩 | 本基金的基金经理,汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理,汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理。 | 2010年2月5日 | - | 10年 | 国籍:中国。学历:同济大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任上海永嘉投资管理有限公司研究员。2004年11月加入汇添富基金管理有限公司任高级行业研究员,2009年11月30日至2010年2月4日任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理助理,2010年2月5日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理,2010年9月21日至今任汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理,2012年7月10日至今任汇添富理财14天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 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年三季度,本基金的净值增长率为-1.00%,同期业绩比较基准收益率为-4.55%,基金净值增长率高于业绩比较基准3.55个百分点。

2012年三季度,国内经济增长继续放缓,CPI和PPI均创出新低,工业企业利润增速大幅下滑,固定资产投资增速也有所回落,显示经济下行压力较大。9月份以来,随着一系列稳增长政策的出台,经济下行的趋势有所减缓,但是经济复苏的基础仍不牢固,经济回暖的力度和持续性有待观察。

本基金在三季度继续坚持自下而上的选股策略,重点投资于具有持续竞争优势的企业,并根据市场变化对组合进行了积极的风险管理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2012年三季度本基金的收益率为-1.00%,比业绩比较基准高3.55百分点。

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年四季度,本基金的观点如下。第一,四季度国内经济仍然处于探底过程,上市公司的盈利状况总体上很难有明显起色。但国内经济经过两年半的下滑之后,下滑最快的阶段可能已经过去,部分行业有望逐步企稳甚至复苏。第二,十八大之后,政府为了推动经济结构转型,可能会启动部分领域的改革,并带来相应的投资机会。第三,尽管央行年内两次下调了存、贷款基准利率,但国内货币政策目前实际上仍处于偏紧状态,与低迷的经济并不相称,预计这一状况有望在四季度或明年开始逐步得到解决,基准利率有1—2个百分点的下调空间。综合上述分析,本基金认为A股市场四季度依然存在结构性投资机会。本基金主要寻找以下方面的投资机会。第一,继续在成长性行业寻找优质的上市公司,看好医药、文化传媒、环保、旅游等行业的长期投资机会。第二,在经济下滑速度逐渐趋缓的背景下,寻找率先出现复苏并具有强大竞争优势的上市公司。第三,关注政府在重点领域推动改革带来的投资机会,重点关注金融、能源、铁路、农村等领域。第四,在目前A股市场的估值体系中部分行业已经出现明显的低估,关注产业资本介入这些行业带来的投资机会。

### §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 | 1,878,049,133.99 | 74.50 |
| | 其中:股票 | 1,878,049,133.99 | 74.50 |
| 2 | 固定收益投资 | 39,872,000.00 | 1.58 |
| | 其中:债券 | 39,872,000.00 | 1.58 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 400,000,420.00 | 15.87 |
| | 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 | 200,993,190.08 | 7.97 |
| 6 | 其他资产 | 2,119,568.98 | 0.08 |
| 7 | 合计 | 2,521,034,313.05 | 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 | - | - |
| B | 采掘业 | 8,772,178.60 | 0.35 |
| C | 制造业 | 946,010,042.88 | 37.66 |
| C0 | 食品、饮料 | 351,295,409.00 | 13.98 |
| 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 | 66,559,544.91 | 2.65 |
| C5 | 电子 | - | - |
| C6 | 金属、非金属 | - | - |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 42,856,269.10 | 1.71 |
| C8 | 医药、生物制品 | 485,298,819.87 | 19.32 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 235,671,307.66 | 9.38 |
| F | 交通运输、仓储业 | 32,343,606.00 | 1.29 |
| G | 信息技术业 | 34,228,081.72 | 1.36 |
| H | 批发和零售贸易 | 175,109,119.82 | 6.97 |
| I | 金融、保险业 | 211,763,785.92 | 8.43 |
| J | 房地产业 | 34,980,000.00 | 1.39 |
| K | 社会服务业 | 145,121,781.02 | 5.78 |
| L | 传播与文化产业 | 54,049,230.37 | 2.15 |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 1,878,049,133.99 | 74.76 |

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 | 002081 | 金 螳 螂 | 3,893,167 | 144,047,179.00 | 5.73 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 13,446,912 | 136,620,625.92 | 5.44 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 489,033 | 120,204,311.40 | 4.79 |
| 4 | 600535 | 天士力 | 2,153,759 | 110,789,362.96 | 4.41 |
| 5 | 600199 | 金种子酒 | 4,836,058 | 103,008,035.40 | 4.10 |
| 6 | 600079 | 人福医药 | 4,202,219 | 90,515,797.26 | 3.60 |
| 7 | 600000 | 浦发银行 | 10,182,000 | 75,143,160.00 | 2.99 |
| 8 | 600315 | 上海家化 | 1,355,511 | 63,234,588.15 | 2.52 |
| 9 | 600280 | 南京中商 | 1,714,412 | 61,684,543.76 | 2.46 |
| 10 | 300039 | 上海凯宝 | 2,600,000 | 61,126,000.00 | 2.43 |

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 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 39,872,000.00 | 1.59 |
| | 其中:政策性金融债 | 39,872,000.00 | 1.59 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 39,872,000.00 | 1.59 |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 120228 | 12国开28 | 400,000 | 39,872,000.00 | 1.59 |

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、处罚的情况。

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 | 1,399,913.10 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 542,446.26 |
| 5 | 应收申购款 | 177,209.62 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,119,568.98 |

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

注:本基金本报告期末前十名股票中未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 | 1,224,556,761.83 |
| 本报告期基金总申购份额 | 16,202,162.13 |
| 减,本报告期基金总赎回份额 | 28,877,667.55 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,211,881,256.41 |

### §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优势精选混合型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富优势精选混合型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富优势精选混合型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、报告期内汇添富优势精选混合型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**

# 汇添富民营活力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 | 汇添富民营活力股票 |
| 交易代码 | 470009 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年5月5日 |
| 报告期末基金份额总额 | 549,704,832.34份 |
| 投资目标 | 本基金采用自下而上的方法,精选与中国经济发展密切相关的优秀民营企业上市公司股票进行投资布局,在科学严格管理风险的前提下,力求基金资产的中长期增值。 |
| 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成长性较高且估值有吸引力的优秀民营企业上市公司以获取超额收益。本基金通过投资于具有良好的公司治理结构、灵活的用人和分配机制、独特的核心竞争优势等突出特征的优秀民营企业,以分享优秀民营企业成长所带来的资本增值。 |
| 业绩比较基准 | 中证民营企业综合指数×80% + 上证国债指数×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 |
| 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 | 6,785,544.90 |
| 2.本期利润 | -3,319,937.87 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0064 |
| 4.期末基金资产净值 | 554,411,808.86 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.009 |

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 | -0.39% | 1.08% | -5.02% | 1.13% | 4.63% | -0.05% |

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2010年5月5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 | | |
| 齐东超 | 本基金的基金经理,汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理,研究总监助理 | 2010年5月5日 | - | 8年 | 国籍:中国。学历:清华大学工学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任海通证券研究所证券分析师,2005年4月加入汇添富基金管理有限公司,任行业分析师、投资研究总部研究总监助理,2009年2月2日至2009年7月27日任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理助理,2009年7月28日至今任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理,2010年5月5日至今任汇添富民营活力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

宏观经济方面,市场预期的经济见底现象迟迟得不到证实,政府对经济下滑的忍耐力也超出市场预期。在此背景下,市场延续了上半年的调整走势。

我们在二季度持仓向成长股集中的基础上,进一步在行业配置上做了大的选择,尤其是显著增加了在优质医药股上面的投资比重。从三季度市场表现来看,这一策略得到了较好的回报。

商业股的投资是我们上半年的主要亏损点。这一投资失误的教训是,在行业景气下滑的背景下,企业经营层再优秀,获得高增长的难度也会变大。我们在三季度初大幅降低了这一行业的投资权重。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金2012年三季度实现收益率为-0.39%,战胜业绩基准4.63个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年10月10日,国务院在《国务院关于第六批取消和调整行政审批项目的决定》中旗帜鲜明的提出"允许法人或者其他组织能够自主决定,市场竞争机制能够有效调节,行业组织或者中介机构能够自律管理的事项,政府都要退出。凡可以采用事后监管和间接管理方式的事项,一律不设前置审批。",目前被广泛提升到新的"两个凡是"的高度。这一政策精神如果能够得到有效执行,民营企业将是最大的受益者,大量新的制度红利有望催生更多投资机会。

### §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 | 368,231,244.86 | 66.17 |
| | 其中:股票 | 368,231,244.86 | 66.17 |
| 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 | 177,087,524.55 | 31.82 |
| 6 | 其他资产 | 11,198,607.97 | 2.01 |
| 7 | 合计 | 556,517,377.38 | 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 | - | - |
| B | 采掘业 | - | - |
| C | 制造业 | 343,810,132.86 | 62.01 |
| C0 | 食品、饮料 | 24,537,428.10 | 4.43 |
| 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 | 43,298,104.20 | 7.81 |
| C5 | 电子 | 19,677,488.00 | 3.55 |
| C6 | 金属、非金属 | - | - |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 24,555,682.80 | 4.43 |
| C8 | 医药、生物制品 | 231,741,429.76 | 41.80 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 16,974,712.00 | 3.06 |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | - | - |
| H | 批发和零售贸易 | - | - |
| I | 金融、保险业 | - | - |
| J | 房地产业 | 7,446,400.00 | 1.34 |
| K | 社会服务业 | - | - |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 368,231,244.86 | 66.42 |

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 | 600315 | 上海家化 | 928,148 | 43,298,104.20 | 7.81 |
| 2 | 002038 | 双鹭药业 | 1,200,000 | 42,960,000.00 | 7.75 |
| 3 | 600557 | 康缘药业 | 2,100,000 | 40,866,000.00 | 7.37 |
| 4 | 600079 | 人福医药 | 1,844,307 | 39,726,372.78 | 7.17 |
| 5 | 300026 | 红日药业 | 877,700 | 29,051,870.00 | 5.24 |
| 6 | 300273 | 和佳股份 | 1,440,216 | 24,555,682.80 | 4.43 |
| 7 | 600422 | 昆明制药 | 1,183,082 | 21,875,186.18 | 3.95 |
| 8 | 000799 | 酒 鬼 酒 | 394,923 | 21,602,288.10 | 3.90 |
| 9 | 300204 | 舒泰神 | 437,558 | 20,171,423.80 | 3.64 |
| 10 | 002081 | 金 螳 螂 | 458,776 | 16,974,712.00 | 3.06 |

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 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、处罚的情况。

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 | 689,132.18 |
| 2 | 应收证券清算款 | 10,349,686.16 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 26,822.54 |
| 5 | 应收申购款 | 132,967.09 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 11,198,607.97 |

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

注:本基金本报告期末前十名股票中未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 | 478,967,592.06 |
| 本报告期基金总申购份额 | 102,036,974.45 |
| 减,本报告期基金总赎回份额 | 31,299,734.17 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 549,704,832.34 |

### §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民营活力股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富民营活力股票型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富民营活力股票型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、报告期内汇添富民营活力股票型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

## 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 | 汇添富亚澳成熟优选股票(QDII) |
| 交易代码 | 470888 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年6月25日 |
| 报告期末基金份额总额 | 77,508,000.05份 |
| 投资目标 | 在亚洲澳洲成熟证券市场(除日本外)精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的公司股票等证券,通过有效的资产配置和组合管理,进行中长期投资布局,在有效管理风险的前提下,追求持续稳健的较高投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中,根据宏观经济和证券市场状况,并基于业绩比较基准的市场权重,通过分析各个股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征,确定投资组合中各市场的投资范围和比例。在股票投资中,采用"自下而上"的策略,精选出具有持续竞争优势,且估值有吸引力的股票,精心科学构建股票投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。 |
| 业绩比较基准 | 60%×MSCI 太平洋(除日本)指数(MSCI Pacific ex Japan Index)+ 40%×MSCI中国指数(MSCI China Index) |
| 风险收益特征 | 本基金为投资于亚洲澳洲地区成熟市场(除日本外)的主动股票型基金,属于证券投资基金中高收益高风险的品种。 |
| 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 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外投资顾问 | 境外资产托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | 英文 | Capital International,Inc. | Brown Brothers Harriman & Co. |
| | 中文 | 资本国际公司 | 布朗兄弟哈里曼银行 |
| 注册地址 | | 11100 Santa Monica Blvd, 15th Floor Los Angeles, CA 90025-3384,USA | 140 Broadway New York, NY 10005 |
| 办公地址 | | One Raffles Quay, 33rd Floor North Tower Singapore 048583 | 140 Broadway New York, NY 10005 |
| 邮政编码 | | Singapore 048583 | NY 10005 |

### §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 | -688,987.86 |
| 2.本期利润 | 5,269,273.46 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0658 |
| 4.期末基金资产净值 | 70,941,619.02 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.915 |

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。

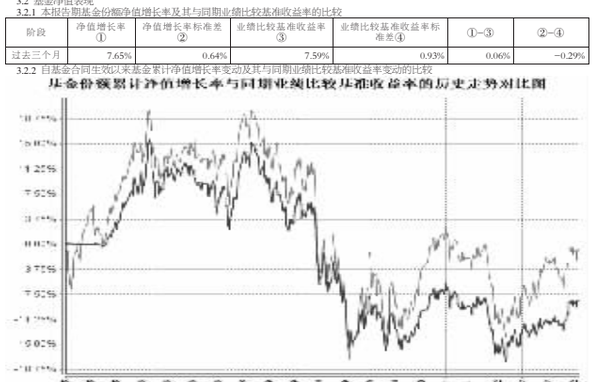
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 7.65% | 0.64% | 7.59% | 0.93% | 0.06% | -0.29% |

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2010年6月25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 | | |
| 刘子龙 