汇添富增强收益债券型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12月31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:2013年1月21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2013年1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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富增强收益债券	
交易代码	519078	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年3月6日	
报告期末基金份额总额	1,183,760,742.23份	
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,主要投资于债券等固定收益类品种和其他低风险品种,力求为基金份额持有人谋求持续稳定的投资收益。	
投资策略	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、不同类别债券利差水平研究,判断不同类别债券类属的相对投资价值,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	中债总指数。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C
下属两级基金的交易代码	519078	470078
报告期末下属两级基金的份额总额	1,133,642,793.20份	50,117,949.03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10月1日 - 2012年12月31日)	
	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C
1.本期已实现收益	1,331,341.18	15,679.38
2.本期利润	21,444,360.43	752,998.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0171	0.0183
4.期末基金资产净值	1,185,117,885.88	51,872,396.99
5.期末基金份额净值	1.045	1.035

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

汇添富增强收益债券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	1.75%	0.09%	-0.29%	0.04%	2.04%	0.05%

汇添富增强收益债券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	1.67%	0.09%	-0.29%	0.04%	1.96%	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

A级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

C级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

注:1.本基金建仓期为本(基金合同)生效之日(2008年3月6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.本基金自2009年9月15日起增加C类收费模式,该类别基金的累计份额净值增长率和业绩比较基准收益率自2009年9月15日起计算。

§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		
陆文磊	本基金的基金经理,汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理,汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。	2008年3月6日	-	10年	国籍:中国。学历:华东师范大学金融学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。2007年8月加入汇添富基金管理有限公司任固定收益高级经理。2008年3月6日至今任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理,2009年1月21日至2011年6月21日任汇添富货币市场基金的基金经理,2011年1月26日至今任汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理,2012年7月26日至今任汇添富季季红定期开放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,形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合,交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资标的,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

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》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内,本公司管理的所有投资组合未发生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%的情形。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

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年四季度美国经济复苏态势较为强劲,房地产企稳带动经济平稳增长,欧元区债务状况保持相对稳定,在各国央行纷纷采取宽松货币政策的影响下,投资者风险偏好进一步上升,全球股票市场持续上涨,债券市场出现调整。国内经济四季度同样出现企稳回升走势,工业增加值增速逐月回升,11月份已恢复至10%以上,房地产市场回暖迹象明显,带动投资增速有所反弹,通胀继续保持低位,但12月份以来食品价格开始出现加速上涨态势,四季度货币政策以微调为主,央行主要通过公开市场操作维持市场流动性,市场资金面偏紧,临近年末回购利率大幅上升。

四季度债券市场总体上延续调整的走势,国债、金融债等利率品种收益率持续上行,收益率曲线比三季度更为平坦化。信用债表现明显好于利率债,四季度大部分时间信用债收益率保持平稳甚至略有下行,仅在12月份受市场资金面的影响收益率有所上行。随着12月份股票市场大幅反弹,可转债也有明显的上涨。本基金四季度在信用债券上保持了较高的配置比例,以获取较高的票息收益,同时,对可转债积极主动的操作,12月份以来在股票市场见底回升的过程中提高了可转债配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A级净值增长率为1.75%,C级净值增长率为1.67%。

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2013年一季度,美国经济短期内复苏趋势不会改变,但全球经济运行存在一些不确定事件的潜在冲击,美国主要是财政悬崖谈判和政府减赤的冲击,欧元区1-4月份是西班牙和意大利债务集中到期的窗口,叠加意大利大选,政治上仍存有不确定性,经济短期难有显著改善。从国内经济增长动力来看,一季度外需难有明显起色,内需在房地产市场回暖和基建投资稳定增长的作用下有望小幅回升,加上去年低基数的影响,一季度国内经济增长率有望继续回升,但回升幅度相对有限。随着经济企稳回升和春节前需求季节性上升,一季度通胀将有所上行,气候偏冷对食品价格的冲击值得关注,但总体看,物价回升的幅度有望保持温和。央行短期内货币政策基调仍然偏中性,一季度降息和降准的概率均偏小。

在经济增长和通胀阶段性回升的情况下,一季度债券市场难以出现趋势性的投资机会,但从中期来看,转型期内经济增长难以出现强劲回升,通胀中枢水平也将维持相对稳定,债券市场也没有明显的系统性风险,目前利率债收益率水平已经达到2012年以来高点,市场对经济基本面的变化已有较为充分的预期,短期内收益率继续大幅上升的可能性很小,信用债的信用利差处于平均水平附近,票息仍存在一定吸引力。随着一季度市场资金面趋于宽松,债券收益率曲线有望出现陡峭化趋势,部分债券品种存在结构性的投资机会。本管理人将密切关注经济基本面的走势和政策变化积极调整组合结构,未来一段时间将保持较高的信用债配置比例,以获取较高票息收益,同时积极把握利率债和可转债的投资机会,力争在控制风险的前提下为投资者创造持续稳定的收益。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,156,989,985.09	93.41
	其中:债券	1,156,989,985.09	93.41
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	30,000,000.00	2.42
	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	14,941,248.32	1.21
6	其他资产	36,693,257.29	2.96
7	合计	1,238,624,490.70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	49,935,000.00	4.04
3	金融债券	69,755,000.00	5.64
	其中:政策性金融债	69,755,000.00	5.64
4	企业债券	716,880,454.69	57.95
5	企业短期融资券	49,890,000.00	4.03
6	中期票据	20,636,000.00	1.67
7	可转债	249,893,530.40	20.20
8	其他	-	-
9	合计	1,156,989,985.09	93.53

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	113003	重工转债	931,960	98,582,728.80	7.97
2	120220	12国开20	600,000	59,778,000.00	4.83
3	1080033	10常经债	500,000	50,635,000.00	4.09
4	1001060	10央票60	500,000	49,935,000.00	4.04
5	041256022	12武钢CP003	500,000	49,890,000.00	4.03

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	125,000.00
2	应收证券清算款	13,193,593.18
3	应收股利	-
4	应收利息	23,142,990.99
5	应收申购款	231,673.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,693,257.29

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113003	重工转债	98,582,728.80	7.97
2	110016	川投转债	37,353,622.00	3.02
3	110003	新钢转债	26,211,499.40	2.12
4	110015	石化转债	23,143,429.90	1.87
5	125089	深机转债	13,717,650.00	1.11
6	110013	国投转债	12,380,765.10	1.00
7	110012	海运转债	8,623,137.60	0.70
8	110018	国电转债	3,276,697.60	0.26

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§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	1,328,327,880.52
本报告期基金总申购份额	12,091,067.52
减:本报告期基金总赎回份额	206,776,154.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,133,642,793.20

§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增强收益债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富增强收益债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富增强收益债券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、报告期内汇添富增强收益债券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
2013年1月21日

汇添富价值精选股票型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12月31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:2013年1月21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2013年1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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富价值精选股票
交易代码	519069
前端交易代码	519069
后端交易代码	519070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年1月23日
报告期末基金份额总额	2,578,508,161.26份
投资目标	本基金精选价值相对低估的优质公司股票,在有效管理风险的前提下,追求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金采用灵活积极的资产配置和股票投资策略。在资产配置中,通过以宏观经济及宏观经济政策分析为核心的情景分析法来确定投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例,并结合对市场估值、市场资金、投资主体行为和市场信心影响等因素的综合判断进行灵活调整;在股票投资中,采取"自下而上"的策略,优选价值相对低估的优质公司股票构建投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得长期持续稳健的投资收益。本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×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风险较高收益的品种
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

§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10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-13,598,715.12
2.本期利润	322,674,041.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.1276
4.期末基金资产净值	3,047,428,010.34
5.期末基金份额净值	1.182

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。

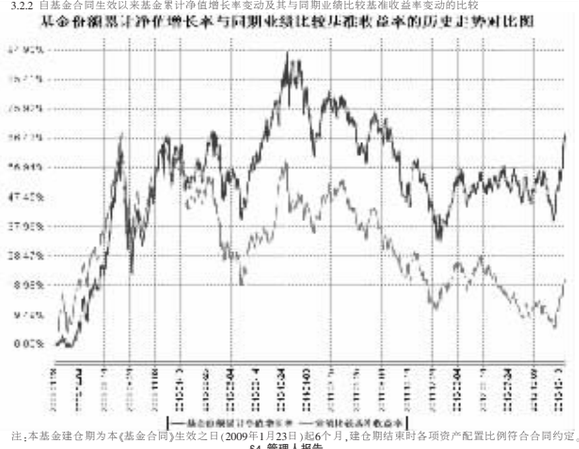
3.2 基金净值表现

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	11.93%	1.14%	8.17%	1.02%	3.76%	0.12%

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

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



注:本基金建仓期为本(基金合同)生效之日(2009年1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。

§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		
陈晓翔	本基金的基金经理。	2009年1月23日	-	11年	国籍:中国。学历:南京理工大学产业经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任宁波中银国际仓储运输有限公司业务员、华泰证券有限责任公司行业研究员、上海申银万国研究所有限责任公司行业研究员、建信基金管理有限公司行业研究员。2007年4月加入汇添富基金管理有限公司任行业研究员。2009年1月23日至今任汇添富价值精选股票型证券投资基金的基金经理,2010年1月8日至2012年3月2日任汇添富均衡增长股票型基证券投基金的基金经理。

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,形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合,交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资标的,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

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》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。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未发生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%的情形。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

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

四季度,A股市场呈现先抑后扬的走势。其中前两个月市场延续此前的下跌惯性连创新低,投资者情绪极度悲观。进入十二月后,在宏观经济有所企稳、海外市场不断走强、QFII和RQFII等增量资金入市等因素影响下,A股市场出现迅速了久违的强劲反弹。沪深300指数当季上涨10%,分行业看,房地产、金融、汽车、建筑建材等领跑市场,而食品饮料、餐饮旅游、信息服务等此前受到投资者追捧的行业则出现阶段性调整现跌幅榜前列。

添富价值在本季度延续了此前的投资策略,一方面保持了信用史低位的金融、地产等价值型股票的较高配置比例,并在市场下跌过程中对其进行了进一步增持,同时继续看好并超配具有持续成长能力的优质成长股。上述策略在四季度取得了较好的投资效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2012年四季度,添富价值收益11.93%,同期业绩比较基准收益率8.17%

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2013年,我们认为国内外经济形势仍然复杂,但环比有望逐步改善。美国经济虽然复苏力度并不强劲,但其房地产市场见底回升、能源自给率提高、制造业回流等因素都有利于美国经济的进一步复苏;欧债危机短期难以根治,欧洲经济有可能在较长时间内延续衰退的局面;但此前关于欧元区将解体等极度悲观的预期已经成为小概率事件,欧洲最困难的阶段有望过去;国内仍然面临产能过剩问题,经济转型和调结构需要一个循序渐进较为漫长的过程,但新政府上任后在城镇化建设、基建投资等拉动下,国内经济预计将出现一段相对平稳的阶段。因此,我们认为2013年国内外经济环境将好于已经过去的2012年。

证券市场方面,我们认为虽然近期市场已出现一定幅度的反弹,但A股市场整体估值水平仍处于较低水平,在经济缓慢回升而估值相对较低的背景下,市场出现单边大涨的概率较小,但结构性行情仍然值得期待。因此,2013年我们的工作重点依然是保持积极的心态,通过自下而上深入研究寻找具有良好盈利模式、优秀管理团队、合理估值水平的公司,重点关注"基本面良好而估值偏低的蓝筹股"以及"估值合理且具备持续成长能力的优质成长股"两个方向来构建组合,力争通过中长期持股来获取长期较好的回报。

§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	2,813,715,744.26	90.87
	其中:股票	2,813,715,744.26	90.87
2	固定收益投资	50,824,744.00	1.64
	其中:债券	50,824,744.00	1.64
	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	217,084,595.92	7.01
6	其他资产	14,691,962.20	0.47
7	合计	3,096,317,046.38	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	45,055,569.92	1.48
B	采掘业	-	-
C	制造业	691,159,385.08	22.68
C0	食品、饮料	-	-
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	72,456,232.00	2.38
C5	电子	188,362,655.25	6.18
C6	金属、非金属	17,539,780.75	0.58
C7	机械、设备、仪表	74,811,778.00	2.45
C8	医药、生物制品	337,988,939.08	11.09
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	37,189,287.10	1.22
E	建筑业	293,865,252.96	9.64
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	141,186,326.73	4.63
H	批发和零售贸易	201,196,210.50	6.60
I	金融、保险业	722,729,094.98	23.72
J	房地产业	414,216,401.23	13.59
K	社会服务业	238,552,215.76	7.83
L	传播与文化产业	28,566,000.00	0.94
M	综合类	-	-
	合计	2,813,715,744.26	92.33

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	600000	浦发银行	20,000,000	198,400,000.00	6.51
2	002236	大华股份	3,400,011	157,590,509.85	5.17
3	601318	中国平安	3,199,932	144,924,920.28	4.76
4	600016	民生银行	17,999,895	141,479,174.70	4.64
5	600697	欧亚集团	5,700,000	126,255,000.00	4.14
6	000671	阳光城	8,078,689	125,219,679.50	4.11
7	601166	兴业银行	7,500,000	125,175,000.00	4.11
8	600036	招商银行	8,200,000	112,750,000.00	3.70
9	600048	保利地产	7,999,803	108,797,320.80	3.57
10	000961	中南建设	6,799,919	93,294,888.68	3.06

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	49,930,000.00	1.64
	其中:政策性金融债	49,930,000.00	1.64
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	894,744.00	0.03
8	其他	-	-
9	合计	50,824,744.00	1.67

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	120238	12国开38	500,000	49,930,000.00	1.64
2	110022	同仁转债	7,650	894,744.00	0.03

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中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,043,262.82
2	应收证券清算款	361,870.10
3	应收股利	-
4	应收利息	499,189.51
5	应收申购款	11,787,639.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,691,962.20

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	2,444,482,857.17
本报告期基金总申购份额	559,676,129.64
减:本报告期基金总赎回份额	425,650,825.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,578,508,161.26

§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价值精选股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富价值精选股票型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富价值精选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、报告期内汇添富价值精选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
2013年1月21日

汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12月31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:2013年1月21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2013年1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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富蓝筹稳健混合
交易代码	519066
前端交易代码	519066
后端交易代码	519067
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月8日
报告期末基金份额总额	314,527,699.10份
投资目标	通过投资于价值相对低估的蓝筹公司股票,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为灵活配置混合型基金,属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。
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

§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10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-6,617,857.71
2.本期利润	2,654,166.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.0082
4.期末基金资产净值	357,804,862.48
5.期末基金份额净值	1.138

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	0.53%	0.80%	6.31%	0.77%	-5.78%	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

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

注:本基金建仓期为本(基金合同)生效之日(2008年7月8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