汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2011 第四季度 报告

2011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:2012年1月20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2011年10月1日起至12月31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	232,005,810.56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(2011年10月1日 - 2011年12月31日)
1.本期已实现收益	-3,691,509.79
2.本期利润	-24,501,345.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0795
4.期末基金资产净值	211,500,369.83
5.期末基金份额净值	0.9116

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。

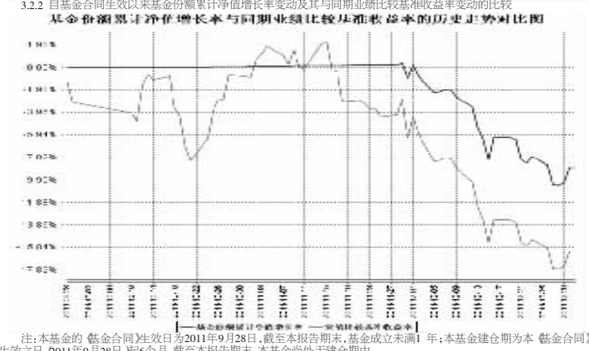
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-8.84%	0.69%	-13.51%	1.49%	4.67%	-0.80%

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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末,基金成立未满1年: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,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

§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	-	5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

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易机制,涵盖了各投资组合、各投资市场、各投资标的,贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程,并通过分析报告、监控、稽核保证制度流程的有效执行。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

注:本基金为指数型基金,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,紧密跟踪深圳300指数,与本基金管理人旗下其他基金投资组合风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,公司公平交易制度执行情况良好,未发生任何异常交易行为。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金成立于2011年9月28日,在4季度经历了建仓期,在预判市场下跌风险较大的情况下,本基金在成立之后始终保持较低的股票仓位,在深证300ETF打开申购赎回之后开始逐步减仓,目前仍处于建仓期。4季度A股市场基本上呈现先扬后抑的态势,尽管本基金净值表现好于业绩比较基准,但仍发生了8.84%的亏损。本基金基本遵循了指数基金的被动投资原则,在现货构建方面采取完全复制的方法。

本基金日常管理中非常重视风险管理,对股票和现金头寸严格管理、实时监控,基本实现了建仓期平稳运作管理的目的。

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14.23%,本基金在报告期内累计收益率为-8.84%,同期业绩比较基准收益率为-13.51%,收益率好于业绩比较基准4.67%。收益率的差异因素主要来源于11月市场下跌阶段仍保持较低的股票仓位。

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,市场对经济增速回落的担心超过2011年对CPI高企的担心,预计通胀在2012年将出现较为明显的回落,同时企业盈利水平也可能会出现较大幅度下滑,对经济增长回落的担忧已成为政策和证券市场更加关注的问题。在此种大背景下,央行在继续实行积极的财政政策和稳健的货币政策的同时,具体政策上将会体现出更多的微调特征,信贷宽松可能会逐步展开。同时进出口增速的下降和房地产市场的调整将是经济增长的两大风险。外围市场中,全球经济继续缓慢复苏,尽管美国经济进一步严重恶化的概率较小,但欧洲将继续面临严重危机,从而继续影响我国的外需,将可能导致外需继续下降。综合考虑政府的积极财政政策、稳健偏灵活的货币政策以及保障房的持续建设对房地产市场的对冲,经济实现软着陆将是大概率事件。

整体来看,2012年A股市场将处于底部震荡,中枢逐步抬升的趋势。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,下降空间相对有限。伴随着政策的缓步放松、流动性的改善,A股市场将出现较好的投资机会。

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	1,471,767.18	0.69
	其中:股票	1,471,767.18	0.69
2	基金投资	179,452,800.00	84.73
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	30,830,776.50	14.56
7	其他资产	43,707.61	0.02
8	合计	211,799,051.29	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	23,918.01	0.01
B	采掘业	61,319.20	0.03
C	制造业	915,995.07	0.43
C0	食品、饮料	220,258.06	0.10
C1	纺织、服装、皮毛	16,491.93	0.01
C2	木材、家具	988.00	0.00
C3	造纸、印刷	9,698.92	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	88,057.44	0.04
C5	电子	54,514.83	0.03
C6	金属、非金属	160,259.46	0.08
C7	机械、设备、仪表	249,656.36	0.12
C8	医药、生物制品	113,575.07	0.05
C99	其他制造业	2,495.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	23,533.77	0.01
E	建筑业	10,745.65	0.01
F	交通运输、仓储业	13,009.15	0.01
G	信息技术业	66,404.87	0.03
H	批发和零售贸易	74,005.44	0.03
I	金融、保险业	84,134.57	0.04
J	房地产业	118,308.71	0.06
K	社会服务业	32,128.84	0.02
L	传播与文化产业	16,440.70	0.01
M	综合类	31,823.20	0.02
	合计	1,471,767.18	0.70

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	002304	洋河股份	600	77,382.00	0.04
2	000002	万 科A	6,946	51,886.62	0.02
3	000858	五 粮 液	1,400	45,920.00	0.02
4	000001	深发展A	2,129	33,191.11	0.02
5	002024	苏宁电器	3,500	29,540.00	0.01
6	000651	格力电器	1,692	29,254.68	0.01
7	000063	中兴通讯	1,499	25,333.10	0.01
8	000157	中联重科	3,258	25,054.02	0.01
9	000568	泸州老窖	600	22,380.00	0.01
10	000895	双汇发展	315	22,034.25	0.01

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	179,452,800.00	84.85

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金投资前十名证券方粮液(000858)于2011年5月27日受到证监会行政处罚,本基金是深300ETF的联接基金,本基金股票投资部分对五粮液基本维持了标准配置比例。除五粮液外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,612.78
5	应收申购款	24,004.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	12,090.40
9	合计	43,707.61

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情况的情况。

§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	336,005,348.19
本报告期基金总申购份额	552,846.99
减:本报告期基金总赎回份额	104,552,384.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	232,005,810.56

§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1月20日

汇添富可转换债券债券型证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011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:2012年1月20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2011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	633,427,901.15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	
下属两级基金简称	汇添富可转换债券A	汇添富可转换债券C
下属两级交易代码	470058	470059
下属两级基金报告期末份额总额	333,252,356.24份	300,175,544.91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(2011年10月1日 - 2011年12月31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	-1,393,069.50	-1,576,238.47
2.本期利润	15,707,130.24	12,879,868.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0451	0.0395
4.期末基金资产净值	327,962,454.71	294,766,349.83
5.期末基金份额净值	0.984	0.982

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

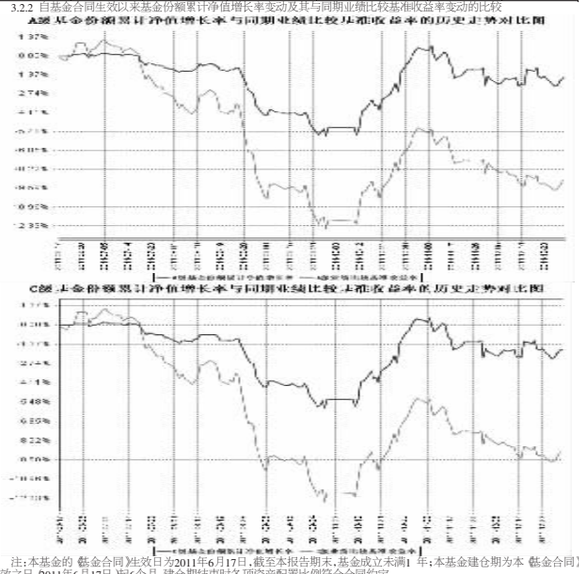
汇添富可转换债券A

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	3.80%	0.48%	3.38%	0.55%	0.42%	-0.07%

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	3.70%	0.48%	3.38%	0.55%	0.32%	-0.07%

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:本基金的《基金合同》生效日为2011年6月17日,截至本报告期末,基金成立未满1年:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2011年6月17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		
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	-	17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:曾任中银万国证券股份有限公司固定收益总部投资部经理。2005年4月18日加入汇添富基金管理有限公司任交易主管,2006年3月23日至今任汇添富货币市场基金的基金经理,2008年3月6日至2011年6月21日任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理,2011年6月17日任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理,2011年12月20日至今任汇添富信用债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

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易机制,涵盖了各投资组合、各投资市场、各投资标的,贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程,并通过分析报告、监控、稽核保证制度流程的有效执行。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

注:本基金为债券型基金,重点投资于可转换债券(含可分离交易可转债),与本基金管理人旗下其他基金投资组合不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,公司公平交易制度执行情况良好,未发生任何异常交易行为。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度CPI出现回落趋势,从三季末的6.1%回落至年底的4.1%,同时,经济增长出现温和回落的走势,企业景气指数四季度环比下降了5.2%,工业增加值也小幅回落,经济总体呈现通胀与增长双降的局面。值得关注的是从10月份开始外汇占款出现07年12月以来的首次下降,综合市场各方面因素,央行迅速调整了货币政策,11月底下调了存款准备金率,释放了部分流动性。随着情况的明朗,市场出现了一定幅度的反弹。四季度本基金的业绩基准上升了3.48%。

本基金在报告期内进行了加仓行为,在9月30日转债跌入历史罕见的最低会时,本基金坚决地增加转债仓位。我们认为:第一,由于综合因素,转债市场出现了史无前例地下跌,其中一些原因是具有持续性的,而有一些原因是短期的、可以改变的,而且已经在转债价格中反映出来了。第二,由于转债具有债性保护,很多品种在大幅下跌后,其债券价值与普通债券品种的价值所差不多,其期权价值明显低估。第三,一些转债受条款限制,已经出现回售和下修转股价等对于投资者有利的举措,其转债价值也得到了提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

四季度本基金A级净值收益率为3.80%,C级净值收益率为3.70%,同期业绩比较基准收益率为3.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于明年一季度的经济形势,我们相对乐观。首先,CPI的回落为放松货币政策、增加信贷供给提高了良好的环境;其次、由于前面一段时期的严格控制,无论是利率、汇率或准备金率都具有很好的弹性以应对经济的下滑,并且银行盈利情况良好,房地产泡沫液得到了很好的控制,宏观经济面的风险完全处于可控范围内,同时能够刺激经济增长的政策众多;最后,中国仍处于工业化、城市化进程中,经济增长动力依然强劲。因此,无论是转债市场还是股票市场都有可能出现一定幅度的反弹。我们将利用这一有利时机,积极进取,选择优质公司进行投资,以期获得良好回报。

§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	25,623,059.35	4.10
	其中:股票	25,623,059.35	4.10
2	固定收益投资	575,249,734.88	92.13
	其中:债券	575,249,734.88	92.13
	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	20,915,078.41	3.35
6	其他资产	2,574,674.76	0.41
7	合计	624,362,547.40	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	16,875,628.70	2.71
C0	食品、饮料	4,489,673.70	0.72
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	12,385,955.00	1.99
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	5,070,000.00	0.81
H	批发和零售贸易	3,677,430.65	0.59
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	25,623,059.35	4.11

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	000423	东阿阿胶	165,000	7,086,750.00	1.14
2	000538	云南白药	99,985	5,299,205.00	0.85
3	000063	中兴通讯	300,000	5,070,000.00	0.81
4	600519	贵州茅台	15,989	3,090,673.70	0.50
5	601933	永辉超市	100,671	3,035,230.65	0.49
6	000895	双汇发展	20,000	1,399,000.00	0.22
7	600859	王府井	20,000	642,200.00	0.10

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	28,992,000.00	4.66
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	82,611,000.00	13.27
7	可转债	463,646,734.88	74.45
8	其他	-	-
9	合计	575,249,734.88	92.38

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	110015	石化转债	2,543,750	255,672,312.50	41.06
2	113001	中行转债	1,097,740	103,824,249.20	16.67
3	1182282	11三一MTN2	500,000	52,455,000.00	8.42
4	110018	国电转债	401,370	42,541,206.30	6.83
5	1182351	11中石油MTN6	300,000	30,156,000.00	4.84

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	383,581.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,188,801.41
5	应收申购款	2,291.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,574,674.76

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	110015	石化转债	255,672,312.50	41.06
2	113001	中行转债	103,824,249.20	16.67
3	110011	歌华转债	24,980,400.00	4.01
4	125887	中期转债	13,239,370.03	2.13
5	110003	新钢转债	3,146,532.00	0.51
6	125709	唐钢转债	2,607,906.95	0.42
7	110016	川投转债	1,843,200.00	0.30
8	110012	海运转债	1,152,631.20	0.19

5.8.5 报告期末前十名股票中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

项目	汇添富可转换债券A	汇添富可转换债券C
本报告期期初基金份额总额	374,604,863.20	357,249,161.10
本报告期基金总申购份额	88,626,418.81	4,956,272.44
减:本报告期基金总赎回份额	129,978,925.77	62,029,888.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	333,252,356.24	300,175,544.91

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准汇添富可转换债券债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富可转换债券债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富可转换债券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、报告期内汇添富可转换债券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
2012年1月20日

华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)

2011 第四季度 报告

2011年12月31日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2012年1月20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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年1月13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2011年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝油气
基金主代码	162411
交易代码	162411
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2011年9月29日
报告期末基金份额总额	115,245,049.84份
投资目标	通过严格的指数化投资策略,实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪,力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过5%(以美元资产计价)。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将使用其他合理方法进行适当的替代,追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标的指数相关的公募基金、上市交易型基金,以优化投资组合的建立,达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普石油天然气上游股票指数(伦敦收益指数)
风险收益特征	本基金是一只美国股票指数型证券投资基金,风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金,属于预期风险较高的产品。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公