

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第一季度报告

2012年3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
报告期出日期:2012年4月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事及监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4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。

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。

本报告期:2012年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称 汇添富深证300ETF联接

交易代码 470006

契约型开放式

2011年1月12日

报告期末基金份额总额 122,365,835.89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 本基金主要采用“300交易型开放式指数证券投资基金”作为其主要投资标的，通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的同时，进行积极的资产配置和稳健的货币市场的操作，具体投资上会综合考虑更多的微观因素，在宽货币环境下可能会影响经济运行的因素，从而在宽货币环境下可能影响宏观经济的积极的财政政策、稳健的货币政策以及保值增值的策略对所投资项目的影响，从而实现本基金的投资目标。

业绩比较基准 上证综指×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，在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的同时，可以适时地通过二级市场买卖目标ETF的份额，积级采取攻防方式去严控风险并争取较高的超额回报。我们也将定期向客户就深证300ETF联接基金的净值表现、投资者一起分享中国经济的美好未来。

§3 投资组合报告

基金简称 汇添富深证300ETF联接

交易代码 470006

契约型开放式

2011年1月12日

报告期末基金份额总额 122,365,835.89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 本基金主要采用“300交易型开放式指数证券投资基金”作为其主要投资标的，通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的同时，可以适时地通过二级市场买卖目标ETF的份额，积级采取攻防方式去严控风险并争取较高的超额回报。我们也将定期向客户就深证300ETF联接基金的净值表现、投资者一起分享中国经济的美好未来。

§4 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日—2012年3月31日)

1.本期已实现收益 1,884,290.35

2.本期利润 14,998,256.91

3.加权平均基金份额本期利润 0.09456

4.期末基金份额净值 115,918,671.26

5.期末基金资产净值 115,918,671.26

注:1.本期已实现收益指基金本期收入减去所有必要的费用后的余额，本期利息收入即期利息收入加上本期公允价值变动收益。

2.所列基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值增长率

3.2.1 本基金同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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 3.79% 1.59% 4.12% 1.69% -0.39% -0.10%

3.2.2 本基金同期来深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 3.79% 1.59% 4.12% 1.69% -0.39% -0.10%

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日—2012年3月31日)

1.本期已实现收益 1,884,290.35

2.本期利润 14,998,256.91

3.加权平均基金份额本期利润 0.09456

4.期末基金份额净值 115,918,671.26

5.期末基金资产净值 115,918,671.26

注:本基金的封闭期出日期为2011年1月12日，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4月28日起6个月，建仓结束后各项资产配置比例符合基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)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

吴振翔 本基金的基金经理，其任职日期为基金合同生效之日起，其离职日期为根据公司确认的解聘日期；2011年9月28日 - 6年 国籍:中国，学历：中国科学院大学金融工程硕士，汇添富基金管理有限公司金融工程研究员，2008年9月加入汇添富基金管理有限公司金融工程研究员，2010年1月担任基金经理，2011年9月28日至今担任本基金的基金经理。本基金的基金经理，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。

本基金的基金经理，其任职日期为基金合同生效之日起，其离职日期为根据公司确认的解聘日期；2011年9月28日 - 6年 国籍:中国，学历：中国科学院大学金融工程硕士，汇添富基金管理有限公司金融工程研究员，2008年9月加入汇添富基金管理有限公司金融工程研究员，2010年1月担任基金经理，2011年9月28日至今担任本基金的基金经理。本基金的基金经理，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。

本基金的基金经理，其任职日期为基金合同生效之日起，其离职日期为根据公司确认的解聘日期；2011年9月28日 - 6年 国籍:中国，学历：中国科学院大学金融工程硕士，汇添富基金管理有限公司金融工程研究员，2008年9月加入汇添富基金管理有限公司金融工程研究员，2010年1月担任基金经理，2011年9月28日至今担任本基金的基金经理。本基金的基金经理，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。

4.2 对外披露的报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 平均交易量的执行情况

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.2 不同时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.3 相同基金经理管理的不同组合在同一时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.4 不同基金经理管理的不同组合在同一时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.5 不同时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.6 不同基金经理管理的不同组合在同一时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.7 不同时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.8 不同基金经理管理的不同组合在同一时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.9 不同时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.10 不同基金经理管理的不同组合在同一时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.11 不同时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.12 不同基金经理管理的不同组合在同一时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.13 不同时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.14 不同基金经理管理的不同组合在同一时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.15 不同时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.16 不同基金经理管理的不同组合在同一时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.17 不同时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.18 不同基金经理管理的不同组合在同一时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.19 不同时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.20 不同基金经理管理的不同组合在同一时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.21 不同时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.22 不同基金经理管理的不同组合在同一时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.23 不同时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.24 不同基金经理管理的不同组合在同一时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.25 不同时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.26 不同基金经理管理的不同组合在同一时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.27 不同时间窗口下交易的公平性分析

本基金在报告期内对公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面进行了公平交易制度的建立、完善和评估，研究公平交易制度、公平交易原则、交易行为、绩效评价、风险管理等方面的情况。

4.3.28 不同基金经理管理的不同组合在同一时间窗口