汇添富保本混合型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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	汇添富保本混合
交易代码	470018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月26日
报告期末基金份额总额	1,427,428,351.72份
投资目标	本基金主要通过投资组合保险技术来运作,在保证本金安全的前提下,力争在保本周期内实现基金财产的稳健增值。
投资策略	本基金将按照投资组合保险技术的要求动态调整保本资产与风险资产的投资比例,以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值,从而实现基金资产在保本基础上的保值增值目的;在此基础上将通过严谨的量化分析和翔实的实地调研,精选优质股票和债券进行投资布局,以实现基金资产最大限度的增值。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金,在证券投资基金中属于低风险品种。
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
基金保证人	中国投资担保有限公司

§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	-410,926.70
2.本期利润	15,455,372.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0104
4.期末基金资产净值	1,498,338,376.15
5.期末基金份额净值	1.050

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。

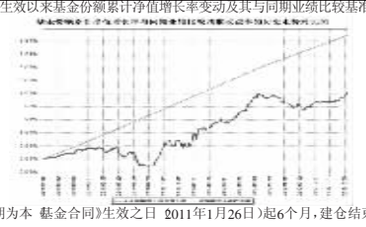
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.06%	0.05%	1.00%	0.01%	0.06%	0.04%

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:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2011年1月26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		
陆文磊	本基金的基金经理,汇添富增强收益债券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。	2011年1月26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,央行主要以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。

四季度股票市场先抑后扬,上证指数在屡创年内新低之后,12月份出现大幅反弹走势,月度反弹幅度接近15%,金融、地产等板块领涨。债券市场四季度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。本基金四季度根据CPPI策略,在保本资产上主要配置与剩余保本期基本匹配的债券品种,12月份以来增加了对股票资产的配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内净值增长率为1.06%,业绩比较基准增长率为1.00%。

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。

随着经济基本面稳步回升和企业盈利增速反弹,股票市场反弹的趋势有望延续,市场活跃度提高将带来较多主动投资机会,债券市场暂时难以出现趋势性的机会,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,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,短期债券的交易性机会较为明显。本基金管理人将严格遵守CPPI策略,积极调整保本资产结构,提高保本资产收益,同时积极把握股票和可转债的投资机会进行灵活操作,争取为投资者创造稳健的收益。

§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	77,170,924.59	5.14
	其中:股票	77,170,924.59	5.14
2	固定收益投资	1,377,636,368.70	91.75
	其中:债券	1,353,777,368.70	90.16
	资产支持证券	23,859,000.00	1.59
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	15,619,396.22	1.04
6	其他资产	31,020,317.17	2.07
7	合计	1,501,447,006.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	5,094,818.82	0.34
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	5,094,818.82	0.34
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,088,644.74	1.01
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	1,881,531.75	0.13
I	金融、保险业	11,248,402.50	0.75
J	房地产业	38,068,684.78	2.54
K	社会服务业	5,788,842.00	0.39
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	77,170,924.59	5.15

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	000002	万 科A	1,588,438	16,074,992.56	1.07
2	601669	中国水电	3,949,907	15,088,644.74	1.01
3	600048	保利地产	1,000,000	13,600,000.00	0.91
4	601601	中国太保	499,929	11,248,402.50	0.75
5	002146	荣盛发展	599,978	8,393,692.22	0.56
6	000888	峨眉山A	299,940	5,788,842.00	0.39
7	600315	上海家化	99,918	5,094,818.82	0.34
8	600697	欧亚集团	84,945	1,881,531.75	0.13

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	3.33
3	金融债券	29,931,000.00	2.00
	其中:政策性金融债	29,931,000.00	2.00
4	企业债券	477,815,050.90	31.89
5	企业短期融资券	220,946,000.00	14.75
6	中期票据	554,272,000.00	36.99
7	可转债	20,878,317.80	1.39
8	其他	-	-
9	合计	1,353,777,368.70	90.35

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	1182024	11苏国资MTN1	800,000	81,248,000.00	5.42
2	122065	11上港01	610,480	61,157,886.40	4.08
3	0982040	09沪电力MTN2	600,000	59,760,000.00	3.99
4	1082178	10山水MTN1	600,000	59,724,000.00	3.99
5	122102	11广汇01	500,000	51,500,000.00	3.44

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	N00847	12上元1A	300,000	23,859,000.00	1.59

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	202,074.69
2	应收证券清算款	3,561,306.93
3	应收股利	-
4	应收利息	27,244,063.80
5	应收申购款	12,871.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,020,317.17

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	17,666,317.80	1.18

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	16,074,992.56	1.07	重大事项停牌

§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	1,548,206,005.49
本报告期基金总申购份额	1,940,162.58
减:本报告期基金总赎回份额	122,717,816.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,427,428,351.72

§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保本混合型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富保本混合型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富保本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、报告期内汇添富保本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
2013年1月21日

汇添富社会责任股票型证券投资基金

【2012】第四季度报告

基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	汇添富社会责任股票
交易代码	470028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月29日
报告期末基金份额总额	3,198,148,074.76份
投资目标	精选积极履行社会责任,并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司,谋求基金资产的稳健增值。
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积极履行社会责任的优质上市公司,以谋求基金资产稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80% + 中证全债指数收益率×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	中国农业银行股份有限公司

§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	-129,914,919.49
2.本期利润	24,610,854.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.0075
4.期末基金资产净值	2,757,280,944.16
5.期末基金份额净值	0.862

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。

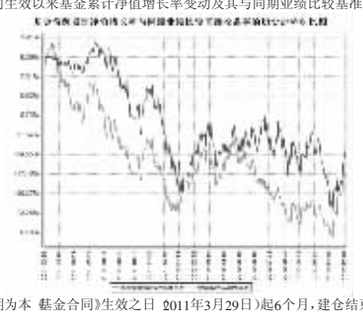
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.94%	0.98%	8.13%	1.02%	-7.19%	-0.04%

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3月29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		
欧阳沁春	本基金的基金经理。	2011年3月29日	-	11年	国籍:中国。学历:卫生部武汉生物制品研究所医学硕士,中欧国际工商学院工商管理硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任卫生部武汉生物制品研究所助理研究员,中国网络(百兆大)有限公司项目经理,大成基金管理有限公司行业研究员,国联安基金管理有限公司行业研究员,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6月17日任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理助理,2007年6月18日至2012年3月2日任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理,2011年3月29日至今任汇添富社会责任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

四季度的A股市场先抑后扬,12月份在银行股的带动下,市场大幅反弹,三方面因素促发了市场的大幅反弹:从经济数据来看,市场已经出现了一定程度的弱复苏;欧美延续宽松货币政策,对国内流动性产生了积极的影响;A股市场的估值处于非常低的水平,表现比较好的行业主要是以银行为代表的周期类股票。

由于我们对四季度投资持惯性的谨慎态度,对于市场流动性的改善以及经济数据的弱复苏比较迟钝,仓位保持在中低的水平,在一定程度上错失了反弹的机会。在行业配置方面,我们一直用企图用非周期与成长性来降低市场风险,我们在增长潜力较大的消费品行业进行了中长期的布局,我们也进行了部分中盘成长股的投资,主要集中在电子行业与医药行业。但是由于四季度某些消费品出现了产品质量问题,大幅削弱了整体成长股的估值水平,部分成长股跌幅巨大,本基金承受了比较大的损失,另一方面我们重仓了地产股,表现不错,但是我们在整体上周期股的配置依然比较单薄,综合下来,本期本基金收益率十分不理想。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2012年四季度本基金收益率0.94%,同期业绩比较基准收益率8.13%。

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,美国经济复苏已经是大概率事件,欧洲经济持续在低位徘徊。国内的经济处于逐步复苏的状态。在宏观和流动性向好的背景下,我们认为市场有可能震荡向上,但是经济还是处于弱复苏状态;另一方面市场的扩容依然是大概率事件。A股市场依然以板块的阶段性表现和个股分化为其主要特征。我们会在行业配置方面适度均衡,个股适度集中,聚焦成长比较迅速,确定性强的个股进行中长期投资。

§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	2,285,439,780.89	81.68
	其中:股票	2,285,439,780.89	81.68
2	固定收益投资	102,955,296.80	3.68
	其中:债券	102,955,296.80	3.68
	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	404,270,588.03	14.45
6	其他资产	5,476,132.41	0.20
7	合计	2,798,141,798.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	1,356,602,508.09	49.20
C0	食品、饮料	404,800,902.17	14.68
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	461,621,026.12	16.74
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	112,944,483.24	4.10
C8	医药、生物制品	331,261,671.36	12.01
C99	其他制造业	45,974,425.20	1.67
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	190,326,852.18	6.90
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	153,834,909.00	5.58
H	批发和零售贸易	34,525,523.67	1.25
I	金融、保险业	135,864,927.52	4.93
J	房地产业	362,928,746.43	13.16
K	社会服务业	51,356,314.00	1.86
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,285,439,780.89	82.89

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	002236	大华股份	3,901,632	180,840,643.20	6.56
2	002241	歌尔声学	4,199,360	158,315,872.00	5.74
3	601318	中国平安	2,999,888	135,864,927.52	4.93
4	000671	阳 光 城	8,659,503	134,222,296.50	4.87
5	600519	贵州茅台	576,606	120,522,186.12	4.37
6	002353	杰瑞股份	2,370,791	112,944,483.24	4.10
7	600702	沱牌舍得	3,356,541	96,701,946.21	3.51
8	000538	云南白药	1,351,848	91,925,664.00	3.33
9	000961	中南建设	6,038,496	82,848,165.12	3.00
10	002007	华兰生物	3,852,885	81,064,700.40	2.94

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	100,040,000.00	3.63
	其中:政策性金融债	100,040,000.00	3.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,915,296.80	0.11
8	其他	-	-
9	合计	102,955,296.80	3.73

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	120305	12进出05	1,000,000	100,040,000.00	3.63
2	113003	重工转债	27,560	2,915,296.80	0.11

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	3,000,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,449,114.40
5	应收申购款	27,018.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,476,132.41

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	2,915,296.80	0.11

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	3,326,742,473.29
本报告期基金总申购份额	3,562,184.49
减:本报告期基金总赎回份额	132,156,583.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,198,148,074.76

§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社会责任股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富社会责任股票型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富社会责任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、报告期内汇添富社会责任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

汇添富可转换债券债券型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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	294,785,548.76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	153,960,184.46份 / 140,825,364.30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)	
	汇添富可转换债券A	汇添富可转换债券C
1.本期已实现收益	-3,615,581.74	-3,713,353.52
2.本期利润	6,178,343.40	5,782,917.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.0420	0.0397
4.期末基金资产净值	152,853,206.56	138,930,390.98
5.期末基金份额净值	0.993	0.987

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