汇添富策略回报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	汇添富策略回报股票
交易代码	470008
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月22日
报告期末基金份额总额	1,076,666,954.63份
投资目标	本基金采用"自上而下"的投资方式,灵活运用资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略,构建有效的投资组合,并在科学严格的投资风险管理前提下,力求为基金份额持有人实现持续稳健的较高投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金,以股票投资为主。股票投资的主要策略包括资产配置策略、行业轮动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,行业轮动策略用于把握行业基本面变化以精选优势行业,个股精选策略用于挖掘各行业中的优质股票以获取超额收益。
业绩比较基准	沪深300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风险较高预期收益的品种。
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	-37,419,196.31
2.本期利润	11,976,257.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0111
4.期末基金资产净值	997,187,673.88
5.期末基金份额净值	0.926

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。

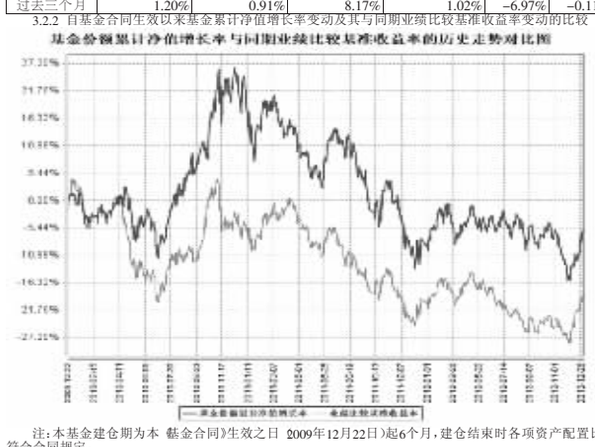
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.20%	0.91%	8.17%	1.02%	-6.97%	-0.11%

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(2009年12月22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		
顾耀强	本基金的基金经理,汇添富逆向投资股票型证券投资基金的基金经理。	2009年12月22日	-	8年	国籍:中国。学历:清华大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、中海优质成长基金经理助理、中海能源策略基金经理助理。2009年3月加入汇添富基金管理有限公司任高级行业分析师,2009年7月7日至2011年3月13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,2009年12月22日至今任汇添富策略回报股票型证券投资基金的基金经理,2012年3月9日至今任汇添富逆向投资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

2012年4季度市场先抑后扬,上证指数先是创出1949.46的多年低点,然后在12月实现大逆转并将年线一举收红。整个四季度沪深300指数上涨10.02%,房地产、金融等行业涨幅领先,医药、食品饮料、TMT等行业落后市场。

四季度前期本基金较好的回避了市场调整的风险,但是没有抓住12月份市场逆转的机会,同时部分持仓受创黑天鹅事件,导致整体表现落后市场。本基金仍然重点持有优质成长股,并适度增加了低估值行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2012年12月31日,本基金净值0.9260,累积净值0.9460元,四季度期间收益率为1.20%,落后业绩基准。自2009年12月22日成立以来,本基金累计收益率为-5.40%。

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1季度,本基金认为:虽然经济转型、供求关系等压制市场的中长期问题尚未得到实质性解决,但市场短期仍有望继续保持活跃。一是十八大后新领导层的言行激发了市场对再改革红利的预期;二是近期经济数据出现企稳回升的倾向,包括PMI、工业企业盈利、房地产销售等数据都出现一些积极的信号。从投资方向上来看,本基金建议重点关注两类投资机会:一是优质成长股在市场风格转换中给出的增配机会;二是增长确定性强、估值仍有修复空间的行业龙头股。

§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	842,167,724.58	84.09
	其中:股票	842,167,724.58	84.09
2	固定收益投资	31,435,577.60	3.14
	其中:债券	31,435,577.60	3.14
	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	126,431,106.28	12.62
6	其他资产	1,442,042.95	0.14
7	合计	1,001,476,451.41	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	498,294,142.62	49.97
C0	食品、饮料	112,523,830.83	11.28
C1	纺织、服装、皮毛	13,099,254.50	1.31
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	54,616,809.67	5.48
C5	电子	85,870,317.70	8.61
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	36,021,410.04	3.61
C8	医药、生物制品	196,162,519.88	19.67
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	70,358,250.87	7.06
E	建筑业	67,344,816.58	6.75
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	69,309,699.59	6.95
I	金融、保险业	65,295,233.69	6.55
J	房地产业	35,640,418.53	3.57
K	社会服务业	33,075,162.70	3.32
L	传播与文化产业	2,850,000.00	0.29
M	综合类	-	-
	合计	842,167,724.58	84.45

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	000538	云南白药	937,000	63,716,000.00	6.39
2	002236	大华股份	1,365,530	63,292,315.50	6.35
3	600535	天士力	1,053,026	58,200,747.02	5.84
4	600422	昆明制药	2,000,000	38,940,000.00	3.90
5	600315	上海家化	717,333	36,576,809.67	3.67
6	600795	国电电力	13,667,885	35,946,537.55	3.60
7	600519	贵州茅台	159,802	33,401,814.04	3.35
8	600809	山西汾酒	796,131	33,166,817.46	3.33
9	000888	峨眉山A	1,713,739	33,075,162.70	3.32
10	601318	中国平安	699,961	31,701,233.69	3.18

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	-	-
	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	-	-
7	可转债	31,435,577.60	3.15
8	其他	-	-
9	合计	31,435,577.60	3.15

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	300,000	30,873,000.00	3.10
2	110022	同仁转债	4,810	562,577.60	0.06

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	1,253,973.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	168,291.06
5	应收申购款	19,778.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,442,042.95

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	30,873,000.00	3.10

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	1,092,347,912.45
本报告期基金总申购份额	8,760,238.64
减:本报告期基金总赎回份额	24,441,196.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,076,666,954.63

§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策略回报股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富策略回报股票型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富策略回报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、报告期内汇添富策略回报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

汇添富价值精选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。

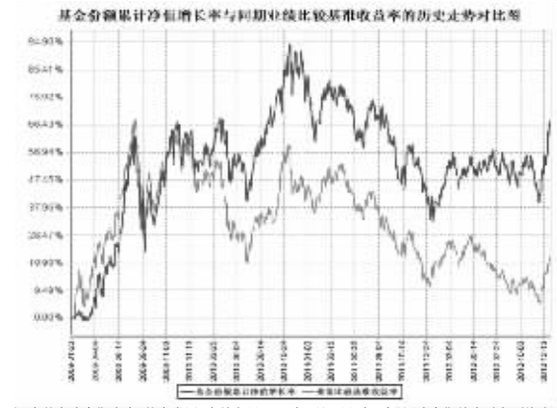
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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



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:曾任宁波中粮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股市场出现迎来了久违的强劲反弹。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居跌幅榜前列。

添富价值在本季度延续了此前的投资策略,一方面保持了估值处于历史低位的金融、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

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	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

汇添富上证综合指数证券投资基金

【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	汇添富上证综合指数
交易代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月1日
报告期末基金份额总额	5,989,415,010.04份
投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于6%,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性,主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%且年化跟踪误差小于6%的投资目标。
业绩比较基准	上证综合指数收益率×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	-177,690,895.60
2.本期利润	381,891,383.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0634
4.期末基金资产净值	4,550,559,670.25
5.期末基金份额净值	0.760

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。

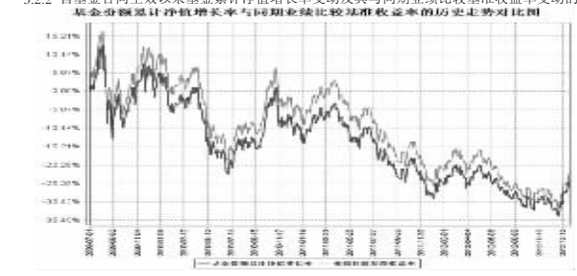
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	9.04%	1.06%	8.34%	1.04%	0.70%	0.02%

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(2009年7月1日)起3个月,建仓期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		
吴振翔	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的基金经理,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。	2010年2月5日	-	6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