汇添富货币市场基金

【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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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	汇添富货币	
交易代码	519518	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年3月23日	
报告期末基金份额总额	5,277,507,474.60份	
投资目标	力求在本金稳妥和基金资产高流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略,力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。	
业绩比较基准	税后活期存款利率(即活期存款利率×(1-利息税率))。	
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。	
基金管理人	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	汇添富货币A	汇添富货币B
下属两级基金的交易代码	519518	519517
报告期末下属两级基金的份额总额	1,548,350,446.70份	3,729,157,027.90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)	
	汇添富货币A	汇添富货币B
1. 本期已实现收益	13,321,964.82	46,566,337.66
2.本期利润	13,321,964.82	46,566,337.66
3.期末基金资产净值	1,548,350,446.70	3,729,157,027.90

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9174%	0.0065%	0.0880%	0.00%	0.8294%	0.0065%

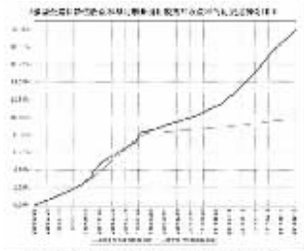
注:本基金收益分配按日结转份额。

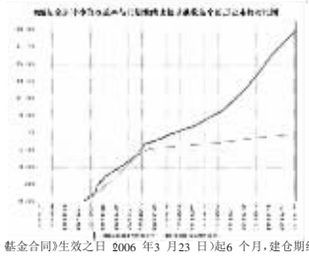
汇添富货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9782%	0.0065%	0.0880%	0.00%	0.8902%	0.0065%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日2006年3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。

2、本基从本《基金合同》生效之日起至2009年2月15日采用的业绩比较基准为同期税后一年定期存款利率。从2009年2月16日起,本基金业绩比较基准为同期税后活期存款利率。

§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,汇添富货币债券型证券投资基金的基金经理,汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理。	2006年3月23日	-	18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投资部经理。2005年4月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5月6日至2011年6月21日任汇添富强院益债券型证券投资基金的基金经理。2011年6月17日至今任汇添富可转换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

四季度以来国内经济弱势复苏态势逐渐得到确认,拉动经济的热点快速变化,各分项经济数据表明当前经济处于以库存周期为代表的短周期企稳过程中。尽管经济增长尚未找到新的增长引擎,新一轮经济周期还未展开,但以年度论,未来中性的货币政策环境,城镇化有望成为经济发力点,基础设施投资持续,房地产投资低位企稳,投资仍是拉动经济增长的主要动力。

四季度在公开市场操作投放资金、财政存款投放、外汇占款改善等因素的推动下,货币市场呈现相对宽松的局面,12月虽然适逢年末,资金面都较往年期间紧俏。短融品种收益率在四季度经历了先降后升的过程,年末收益率水平基本与季初基本持平。

本基金在报告期内保持较低组合剩余期限,精选优质短融进行配置,并且努力把握年底资金较为紧张的阶段性机会,通过较高收益的同业存款获取收益。

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0.92%,B级净值收益率为0.98%,同期业绩比较基准收益率为0.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四季度以来国内经济弱势复苏态势逐渐得到确认,拉动经济的热点快速变化,各分项经济数据表明当前经济处于以库存周期为代表的短周期企稳过程中。尽管经济增长尚未找到新的增长引擎,新一轮经济周期还未展开,但以年度论,未来中性的货币政策环境,城镇化有望成为经济发力点,基础设施投资持续,房地产投资低位企稳,投资仍是拉动经济增长的主要动力。

四季度在食品价格,尤其是蔬菜价格的带动下,从11月开始CPI同比出现季节性回升,回升幅度与历史同期相近,未来一个季度通胀将迎来季节性智慧日的高峰,但食品供给较历史同期充足,经济弱势拖累非食品价格上涨,一季度通胀温和反弹,不构成主要风险因素。

货币市场流动性方面,一季度将经历新年与春节智慧日叠加,尤其是春节期间取现需求大幅上升,可能带来春节前流动性的紧张,届时将完全需要央行逆回购操作进行维持从央行当前的货币政策取向上,在经济仍处低位,企业资本回报率仍低于融资成本,主动投资意愿并不强的背景下,预计央行将维持中性偏松的货币环境,不排除大量释放逆回购和降准的可能性。在流动性维持相对宽裕的背景下,短融等短期债券品种仍具有较高价值。

本基金在未来一个季度内将适度增加组合剩余期限,增加短期融资券的投资比例,延长存款的期限,以期锁定收益。

§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	固定收益投资	2,914,456,768.09	46.85
	其中:债券	2,894,456,768.09	46.52
	资产支持证券	20,000,000.00	0.32
2	买入返售金融资产	333,420,001.00	5.36
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,746,437,098.58	44.15
4	其他资产	227,009,519.46	3.65
5	合计	6,221,323,387.13	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		6.94
	其中:买断式回购融资		0.05
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	610,090,564.86	11.56
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	97
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	140
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	66

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	54.45	17.80
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.65	-
2	30天(含)-60天	10.61	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.70	-
3	60天(含)-90天	7.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.40	-
4	90天(含)-180天	11.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.75	-
5	180天(含)-397天(含)	29.19	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	113.59	17.80

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	摊余成本(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	781,787,093.81	14.81
	其中:政策性金融债	781,787,093.81	14.81
4	企业债券	110,862,213.50	2.1
5	企业短期融资券	2,001,807,460.78	37.93
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	2,894,456,768.09	54.85
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	501,710,144.41	9.51

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120228	12国开28	2,300,000	229,760,092.79	4.35
2	041252038	12中铝业CP002	1,800,000	179,847,196.44	3.41
3	011217001	12华电SCP001	1,600,000	160,017,338.53	3.03
4	120227	12国开27	1,500,000	149,654,223.03	2.84
5	041253028	12中粮CP002	1,400,000	140,201,264.88	2.66
6	090213	09国开13	1,300,000	131,343,396.30	2.49
7	080213	08国开13	1,100,000	111,246,215.54	2.11
8	041260037	12陕延油CP001	1,000,000	100,119,637.85	1.90
9	041251030	12电网CP003	1,000,000	100,098,725.02	1.90
10	041252023	12大唐集CP001	1,000,000	100,038,569.79	1.90

5.6 影子定价与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	
报告期内偏离度的最高值	0.03%
报告期内偏离度的最低值	-0.05%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.02%

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	119017	宁公控1	200,000	20,000,000.00	0.38

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金估值采用摊余成本法计价,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.8.2

本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	59,678,546.31
4	应收申购款	167,080,973.15
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	227,009,519.46

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富货币A	汇添富货币B
本报告期期初基金份额总额	1,381,034,908.98	2,952,989,405.67
本报告期基金总申购份额	1,958,567,052.25	8,528,368,395.01
减:本报告期基金总赎回份额	1,791,251,514.53	7,752,200,772.78
本报告期期末基金份额总额	1,548,350,446.70	3,729,157,027.90

§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货币市场基金募集的文件;

2、汇添富货币市场基金基金合同);

3、汇添富货币市场基金托管协议);

4、上海浦东发展银行证券交易资金结算协议);

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、报告期内汇添富货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告;

7、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

汇添富均衡增长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	汇添富均衡增长股票
交易代码	519018
前端交易代码	519018
后端交易代码	519010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年8月7日
报告期末基金份额总额	22,017,510,841.74份
投资目标	本基金应用“由上而下”和“自下而上”相结合的投资策略,通过行业的相对均衡配置和投资布局于具有持续增长潜质的企业,在有效控制风险的前提下,分享中国经济的持续增长,以持续稳定地获取较高的投资回报。
投资策略	本基金采用“由上而下”和“自下而上”相结合的投资方法,适度动态调整资产配置,行业保持相对均衡配置,同时通过三级过滤模型(Tri-Filtering Model)来构建核心股票池,深入剖析核心股票池企业的增长逻辑和增长战略,以达到审慎精选,并对投资组合进行积极而有效的风险管理。
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	本基金是主动型的股票基金,属于证券投资基金中风险偏上的品种。
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	-193,193,640.26
2.本期利润	40,783,665.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0018
4.期末基金资产净值	13,665,562,893.59
5.期末基金份额净值	0.6207

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	0.40%	0.90%	8.17%	1.02%	-7.77%	-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2006年8月7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		
苏竞	本基金的基金经理,汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理。汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2007年12月17日	-	9年	国籍:中国。学历:上海海事大学经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任北京中国运载火箭技术研究院助理工程师、上海申银万国证券研究所高级研究员、上投摩根基金管理有限公司高级行业研究员、博时基金管理有限公司高级行业研究员。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10月7日任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理助理。2007年10月8日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理。2007年12月17日至今任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理。2008年7月8日至今任汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2012年7月10日至今任汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理。
韩贤旺	本基金的基金经理,研究总监	2012年3月2日	-	14年	国籍:中国。学历:复旦大学经济学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任君安证券有限责任公司分析师、天同证券有限责任公司研究所所长助理、行业部经理、国联安基金管理有限公司研究主管、平安资产管理有限公司股票研究主管。2007年5月加入汇添富基金管理有限公司任研究总监。2012年3月2日至今任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理。
叶从飞	本基金的基金经理	2012年3月2日	-	8年	国籍:中国。学历:南京大学经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任中原证券股份有限公司资产管理部交易员、投资经理助理。2005年10月加入汇添富基金管理有限公司任交易主管。2010年9月21日至2012年3月1日任汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理助理。2012年3月2日至今任汇添富均衡增长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年四季度A股市场呈现先抑后仰走势,在经济弱复苏和改革预期的共振下,价值股出现一轮估值修复行情,从而带动股指在12月份大幅反弹,上证指数本季度累计上涨8.77%。四季度本基金继续坚持精选个股的投资策略,重点配置增长确定的成长性股票,同时适当提高了股票仓位,增加了金融、地产等低估值蓝筹股的配置比例。由于对经济复苏的持续性和企业基本面改善程度有所担忧,因此周期性板块配置比例总体偏低,而超配的消费类板块在大盘反弹过程中表现落后,导致本季度基金净值跑输业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

四季度本基金净值上涨0.4%,同期业绩比较基准下跌7.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望一季度,我们对市场保持谨慎乐观。首先,从近期公布的经济数据看,经济温和复苏的态势仍将延续,虽然消费和出口难有起色,但是固定资产投资增速将出现一定程度的回升。其次,从政策方面看,货币政策将保持稳健,但财政政策有望更加积极,尤其是新一届政府释放出来的改革信号将继续改善市场的政策预期。再次,一季度流动性相对宽裕,IPO重启时间推迟也缓解了市场资金压力。当然,股指大幅反弹后短期或有调整压力,同时大非减持时间窗口开启会对市场造成一定冲击,因此一季度的市场仍会以结构性行情为主。

本基金将在均衡配置的前提下,坚持精选个股的投资策略。我们继续看好稳定增长的消费、医药板块的投资机会,同时重点关注金融地产等低估值蓝筹股,以及盈利能力回升的部分中游制造业,并积极寻找新型城镇化主题下的投资机会。

§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	10,963,608,288.60	78.92
	其中:股票	10,963,608,288.60	78.92
2	固定收益投资	745,926,411.50	5.37
	其中:债券	745,926,411.50	5.37
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	869,782,834.67	6.26
	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	1,293,327,386.88	9.31
6	其他资产	19,572,936.25	0.14
7	合计	13,892,217,857.90	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	298,472,242.87	2.18
C	制造业	5,005,789,672.13	36.63
C0	食品、饮料	1,187,024,494.23	8.69
C1	纺织、服装、皮毛	45,040,000.00	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	55,601,484.61	0.41
C5	电子	1,154,038,948.82	8.44
C6	金属、非金属	97,800,000.00	0.72
C7	机械、设备、仪表	536,481,529.29	3.93
C8	医药、生物制品	1,855,149,705.18	13.58
C99	其他制造业	74,653,510.00	0.55
D	电力、煤气及水的生产和供应业	297,365,589.38	2.18
E	建筑业	1,374,819,108.78	10.06
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	516,160,816.64	3.78
H	批发和零售贸易	1,031,327,979.49	7.55
I	金融、保险业	1,052,295,376.76	7.70
J	房地产业	940,027,901.12	6.88
K	社会服务业	361,849,601.43	2.65
L	传播与文化产业	85,500,000.00	0.63
M	综合类	-	-
	合计	10,963,608,288.60	80.23

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	600519	贵州茅台	2,004,036	418,883,604.72	3.07
2	002081	金螳螂	9,296,014	409,210,536.28	2.99
3	002236	大华股份	8,601,869	398,696,628.15	2.92
4	002241	歌尔声学	9,741,048	367,237,509.60	2.69
5	601318	中国平安	7,499,794	339,665,670.26	2.49
6	600594	益佰制药	16,935,493	338,879,214.93	2.48
7	000961	中南建设	22,239,539	305,126,475.08	2.23
8	600048	保利地产	21,999,983	299,199,768.80	2.19
9	002325	洪涛股份	18,860,820	288,570,546.00	2.11
10	600000	浦发银行	26,455,300	262,436,576.00	1.92

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	19,646,000.00	0.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,770,000.00	0.73
	其中:政策性金融债	99,770,000.00	0.73
4	企业债券	16,999,870.70	0.12
5	企业短期融资券	601,393,000.00	4.40
6	中期票据	-	-
7	可转债	8,117,540.80	0.06
8	其他	-	-
9	合计	745,926,411.50	5.46

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	041251014	12国电集CP001	1,000,000	100,430,000.00	0.73
2	041252023	12大唐集CP001	1,000,000	99,930,000.00	0.73
3	120228	12国开28	1,000,000	99,770,000.00	0.73
4	041252013	12美的CP001	900,000	90,648,000.00	0.66
5	041251015	12铁道CP001	800,000	80,144,000.00	0.59

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	4,900,103.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,513,012.36
5	应收申购款	159,820.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,572,936.25

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	8,117,540.80	0.06

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	22,352,825,737.71
本报告期基金总申购份额	183,006,909.16
减:本报告期基金总赎回份额	518,321,805.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	22,017,510,841.74

§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均衡增长股票型证券投资基金募集的文件;

2、汇添富均衡增长股票型证券投资基金基金合同);

3、汇添富均衡增长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、报告期内汇添富均衡增长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

汇添富优势精选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	汇添富优势精选混合