汇添富策略回报股票型证券投资基金

【2014】第一季度报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22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2014年4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2014年1月1日起至3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
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	577,795,793.00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,行业轮动策略用于根据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	汇添富基金管理股份有限公司
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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	88,289,290.59
2.本期利润	22,082,253.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.0380
4.期末基金资产净值	597,265,156.88
5.期末基金份额净值	1.034

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。

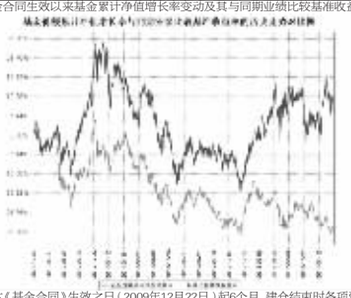
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.95%	1.42%	-6.16%	0.95%	9.11%	0.47%

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	汇添富策略回报股票基金、汇添富逆向投资股票基金的基金经理。	2009年12月22日	-	10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股份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。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合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%的交易次数为1次,原因为对冲专户采取指数化策略投资导致,经检查和分析未发现异常情况。

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

一季度,中国经济延续了增速稳中有降的格局,PMI指数、发电量、工业增加值等指标都表现较弱,房地产市场量价齐跌,人民币兑美元也出现近年较为罕见的连续贬值的走势。A股市场总体呈弱势震荡走势,当季沪深300指数下跌7.9%,而创业板指数则先抑后扬,季度累计上涨1.8%。分行业看,信息服务、信息设备、机械设备等行业涨幅居前,而采掘、农林牧渔、家电、黑色金属等跌幅居前。

添富价值在本季度延续了以自下而上选股为主的投资策略,并在市场波动过程中增持了部分具有较大安全边际且有较强改革预期的价值股,以及年初以来持续下跌、估值重新具备吸引力、成长性较为确定的成长股,同时减持了组合中受互联网金融、京津冀经济圈等主题刺激而出现较大涨幅的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年一季度,添富价值收益率为-3.05%,同期沪深300指数收益率为-7.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度及全年,我们认为中国经济正处于关键的调结构过程中,随着改革力度的进一步加大,中国经济的结构转型和长期前景趋于乐观,但由于短期以重化工业为代表的周期性行业还处在下行阶段,因此预计宏观经济仍将出现各种反复。我们认为对经济和市场前景过度乐观或过度悲观的态度都是不可取的。结合当前各行业的基本面和估值水平,我们认为传统行业蓝筹股估值已经具备较好的性价比和安全边际。在组合管理方面,我们将继续保持独立客观的判断和充分的耐心,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“基本面良好而估值较低的蓝筹股”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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	534,523,743.79	89.07
	其中:股票	534,523,743.79	89.07
2	固定收益投资	20,020,000.00	3.34
	其中:债券	20,020,000.00	3.34
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	18,503,798.76	3.08
7	其他资产	27,080,599.74	4.51
8	合计	600,128,142.29	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	429,713,136.47	71.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	35,005,321.30	5.86
G	交通运输、仓储和邮政业	1,856,000.00	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,815,491.33	4.32
J	金融业	6,054,000.00	1.01
K	房地产业	36,079,794.69	6.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	534,523,743.79	89.50

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	600352	浙江龙盛	2,859,389	46,493,665.14	7.78
2	000860	顺鑫农业	2,573,711	37,885,025.92	6.34
3	002019	鑫富药业	1,282,930	36,884,237.50	6.18
4	600517	置信电气	1,977,832	35,521,862.72	5.95
5	600535	天士力	771,895	30,096,186.05	5.04
6	600305	恒顺醋业	1,680,222	27,774,069.66	4.65
7	002249	大洋电机	1,999,912	26,698,825.20	4.47
8	600486	扬农化工	769,978	26,556,541.22	4.45
9	600998	九州通	1,390,000	22,240,000.00	3.72
10	000671	阳光城	1,999,991	18,899,914.95	3.16

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	20,020,000.00	3.35
	其中:政策性金融债	20,020,000.00	3.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	20,020,000.00	3.35

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	130248	13国开48	200,000	20,020,000.00	3.35

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

注: 本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的其他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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	406,956.03
2	应收证券清算款	26,205,672.64
3	应收股利	-
4	应收利息	369,946.36
5	应收申购款	98,024.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,080,599.74

5.11.4 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。

5.11.5 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	002019	鑫富药业	36,884,237.50	6.18	重大资产重组停牌
2	600998	九州通	22,240,000.00	3.72	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	574,920,801.23
报告期期间基金总申购份额	162,115,567.10
减:报告期期间基金总赎回份额	159,240,575.33
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	577,795,793.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理的基金。

§8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理股份有限公司

8.3 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。

汇添富基金管理股份有限公司
2014年4月22日

汇添富价值精选股票型证券投资基金

【2014】第一季度报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22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2014年4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2014年1月1日起至3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	2,814,167,952.01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	汇添富基金管理股份有限公司
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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	69,249,100.77
2.本期利润	-134,350,092.73
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0377
4.期末基金资产净值	3,529,015,977.39
5.期末基金份额净值	1.254

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	-3.05%	1.19%	-6.16%	0.95%	3.11%	0.24%

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	汇添富价值精选股票基金的基金经理,股票投资副总监。	2009年1月23日	-	13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:曾任宁波中银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股份有限公司任行业研究员,现任股票投资副总监。2009年1月23日至今任汇添富价值精选股票基金的基金经理,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。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合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%的交易次数为1次,原因为对冲专户采取指数化策略投资导致,经检查和分析未发现异常情况。

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

一季度,中国经济延续了增速稳中有降的格局,PMI指数、发电量、工业增加值等指标都表现较弱,房地产市场量价齐跌,人民币兑美元也出现近年较为罕见的连续贬值的走势。A股市场总体呈弱势震荡走势,当季沪深300指数下跌7.9%,而创业板指数则先抑后扬,季度累计上涨1.8%。分行业看,信息服务、信息设备、机械设备等行业涨幅居前,而采掘、农林牧渔、家电、黑色金属等跌幅居前。

添富价值在本季度延续了以自下而上选股为主的投资策略,并在市场波动过程中增持了部分具有较大安全边际且有较强改革预期的价值股,以及年初以来持续下跌、估值重新具备吸引力、成长性较为确定的成长股,同时减持了组合中受互联网金融、京津冀经济圈等主题刺激而出现较大涨幅的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年一季度,添富价值收益率为-3.05%,同期沪深300指数收益率为-7.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度及全年,我们认为中国经济正处于关键的调结构过程中,随着改革力度的进一步加大,中国经济的结构转型和长期前景趋于乐观,但由于短期以重化工业为代表的周期性行业还处在下行阶段,因此预计宏观经济仍将出现各种反复。我们认为对经济和市场前景过度乐观或过度悲观的态度都是不可取的。结合当前各行业的基本面和估值水平,我们认为传统行业蓝筹股估值已经具备较好的性价比和安全边际。在组合管理方面,我们将继续保持独立客观的判断和充分的耐心,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“基本面良好而估值较低的蓝筹股”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	3,000,957,207.31	82.37
	其中:股票	3,000,957,207.31	82.37
2	固定收益投资	488,146,741.80	13.40
	其中:债券	488,146,741.80	13.40
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	145,861,170.68	4.00
7	其他资产	8,227,842.57	0.23
8	合计	3,643,192,962.36	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	采矿业	130,780,000.00	3.71
C	制造业	1,390,947,340.00	39.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,683,130.35	0.22
F	批发和零售业	235,554,461.33	6.67
G	交通运输、仓储和邮政业	7,699,235.28	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,760,124.35	1.78
J	金融业	378,680,506.92	10.73
K	房地产业	530,008,348.26	15.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	167,397,971.62	4.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	89,446,089.20	2.53
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,000,957,207.31	85.04

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	000915	山大华特	7,000,000	189,980,000.00	5.38
2	600352	浙江龙盛	11,000,000	178,860,000.00	5.07
3	600000	浦发银行	18,000,000	174,960,000.00	4.96
4	000002	万 科A	20,800,000	168,272,000.00	4.77
5	600028	中国石化	26,000,000	130,780,000.00	3.71
6	600697	欧亚集团	7,898,007	127,868,733.33	3.62
7	002415	海康威视	6,999,930	122,148,778.50	3.46
8	601166	兴业银行	12,000,000	114,240,000.00	3.24
9	600048	保利地产	13,800,000	105,018,000.00	2.98
10	002159	三特索道	5,800,000	100,340,000.00	2.84

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	169,772,000.00	4.81
	其中:政策性金融债	169,772,000.00	4.81
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	318,374,741.80	9.02
8	其他	-	-
9	合计	488,146,741.80	13.83

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	113005	平安转债	2,663,380	263,275,113.00	7.46
2	110015	石化转债	538,240	55,099,628.80	1.56
3	130243	13国开43	500,000	49,935,000.00	1.41
4	130227	13国开27	500,000	49,925,000.00	1.41
5	130236	13国开36	400,000	39,956,000.00	1.13

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

本基金投资的前十名股票,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,310,165.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,816,092.57
5	应收申购款	1,101,584.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,227,842.57

5.11.4 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	55,099,628.80	1.56

5.11.5 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

报告期期初基金份额总额	3,931,593,257.97
报告期期间基金总申购份额	290,848,848.70
减:报告期期间基金总赎回份额	1,408,274,154.66
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,814,167,952.01

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理的基金。

§8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理股份有限公司

8.3 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。

汇添富基金管理股份有限公司
2014年4月22日

汇添富上证综合指数证券投资基金

【2014】第一季度报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2014年4月22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2014年4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2014年1月1日起至3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	5,272,082,047.97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	汇添富基金管理股份有限公司
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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-133,900,265.63
2.本期利润	-147,543,263.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0267
4.期末基金资产净值	3,643,993,866.10
5.期末基金份额净值	0.691

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