

# 汇添富价值精选股票型证券投资基金 2010 年年度报告

2010年12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

报告送出日期：2011年3月28日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2011 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b> .....                     | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b> .....                        | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....        | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b> .....                       | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 12        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 13        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 14        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 15        |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                       | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 15        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 15        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....       | 15        |
| <b>§ 6 审计报告</b> .....                        | <b>15</b> |
| 6.1 审计报告的基本内容.....                           | 15        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b> .....                      | <b>16</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 16        |
| 7.2 利润表.....                                 | 18        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 18        |
| 7.4 报表附注.....                                | 20        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b> .....                      | <b>41</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 41        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 42        |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 43        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 44        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 48        |
| 8.6 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.....      | 48        |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....   | 49        |
| 8.8 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.....      | 49        |
| 8.9 投资组合报告附注.....                            | 49        |

|                                       |           |
|---------------------------------------|-----------|
| <b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....            | <b>49</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....            | 49        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....      | 50        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....           | <b>50</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示</b> .....              | <b>50</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                 | 50        |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 50        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....      | 51        |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                   | 51        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....            | 51        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....    | 51        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....           | 51        |
| 11.8 其他重大事件.....                      | 53        |
| <b>§ 12 备查文件目录</b> .....              | <b>58</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                      | 58        |
| 12.2 存放地点.....                        | 59        |
| 12.3 查阅方式.....                        | 59        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 汇添富价值精选股票型证券投资基金   |
| 基金简称       | 汇添富价值精选股票          |
| 基金主代码      | 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    |
| 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       |
| 报告期末基金份额总额 | 1,420,314,069.90 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 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。                |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                     | 基金托管人               |
|---------|------|---------------------------|---------------------|
| 名称      |      | 汇添富基金管理有限公司               | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李文                        | 赵会军                 |
|         | 联系电话 | 021-28932888              | 010-66105799        |
|         | 电子邮箱 | service@99fund.com        | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-888-9918              | 95588               |
| 传真      |      | 021-28932998              | 010-66105798        |
| 注册地址    |      | 上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 办公地址    |      | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层    | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 邮政编码    |      | 200120                    | 100140              |
| 法定代表人   |      | 桂水发                       | 姜建清                 |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                   |
|---------------------|-----------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》            |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.99fund.com             |
| 基金年度报告备置地点          | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层汇添富基金管理有限公司 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址                             |
|--------|----------------|----------------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所     | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京西城区金融大街 27 号投资广场 22 层          |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2010 年           | 2009 年 01 月 23 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|---|
| 本期已实现收益       | 188,282,634.19   | 411,255,952.36                              |
| 本期利润          | 251,032,932.02   | 528,523,866.23                              |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2195           | 0.5299                                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 13.93%           | 41.24%                                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 10.29%           | 63.60%                                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2010 年末          | 2009 年末                                     |
| 期末可供分配利润      | 788,095,031.96   | 426,255,584.83                              |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.5549           | 0.4755                                      |
| 期末基金资产净值      | 2,431,698,180.49 | 1,466,835,629.77                            |
| 期末基金份额净值      | 1.712            | 1.636                                       |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2010 年末          | 2009 年末                                     |
| 基金份额累计净值增长率   | 80.43%           | 63.60%                                      |

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、上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（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金的《基金合同》生效日为 2009 年 1 月 23 日，至本报告期末未满三年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日数据，特此说明。

### 3.2 基金净值表现

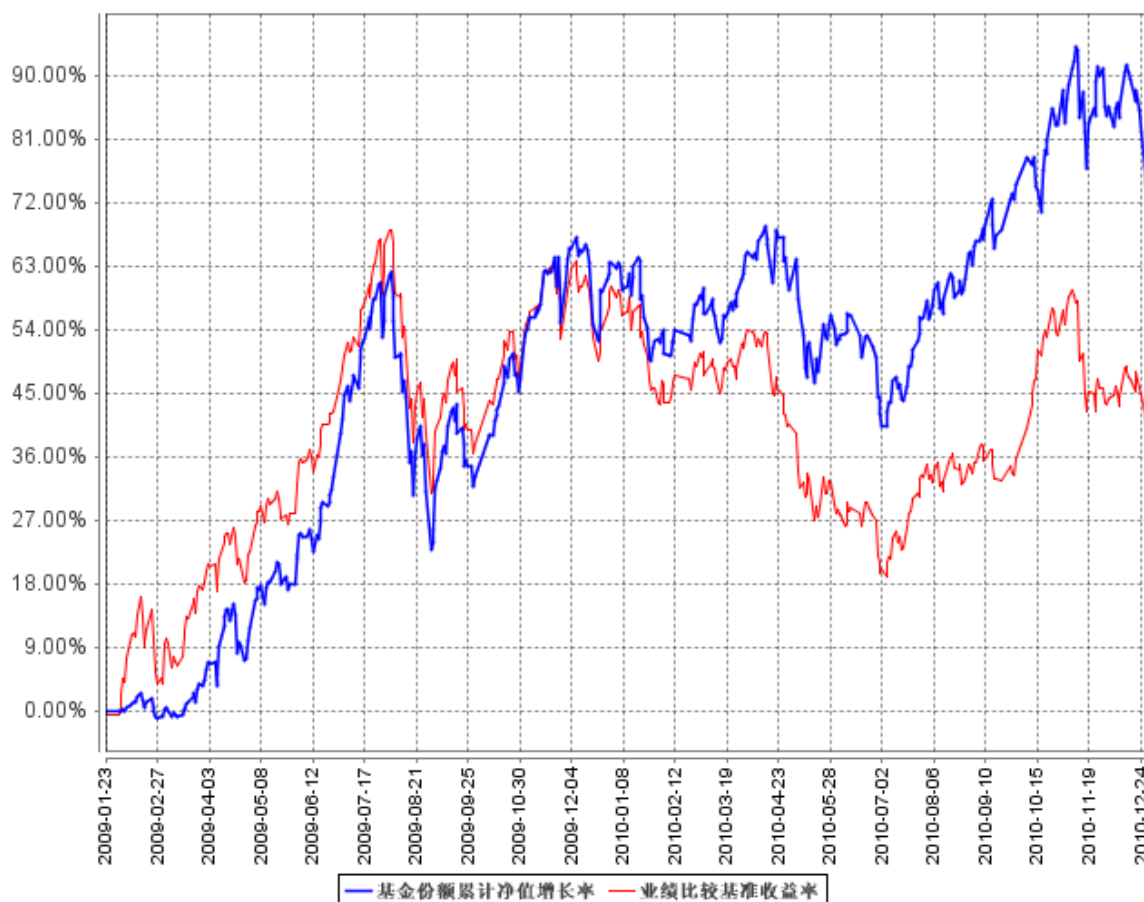
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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      | 3.38%    | 1.65%       | 5.19%      | 1.42%         | -1.81% | 0.23% |
| 过去六个月      | 24.96%   | 1.41%       | 17.74%     | 1.24%         | 7.22%  | 0.17% |
| 过去一年       | 10.29%   | 1.40%       | -9.37%     | 1.26%         | 19.66% | 0.14% |
| 自基金合同生效起至今 | 80.43%   | 1.53%       | 43.33%     | 1.46%         | 37.10% | 0.07% |

注：本基金的《基金合同》生效日为 2009 年 1 月 23 日，至本报告期末未满五年。

#### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

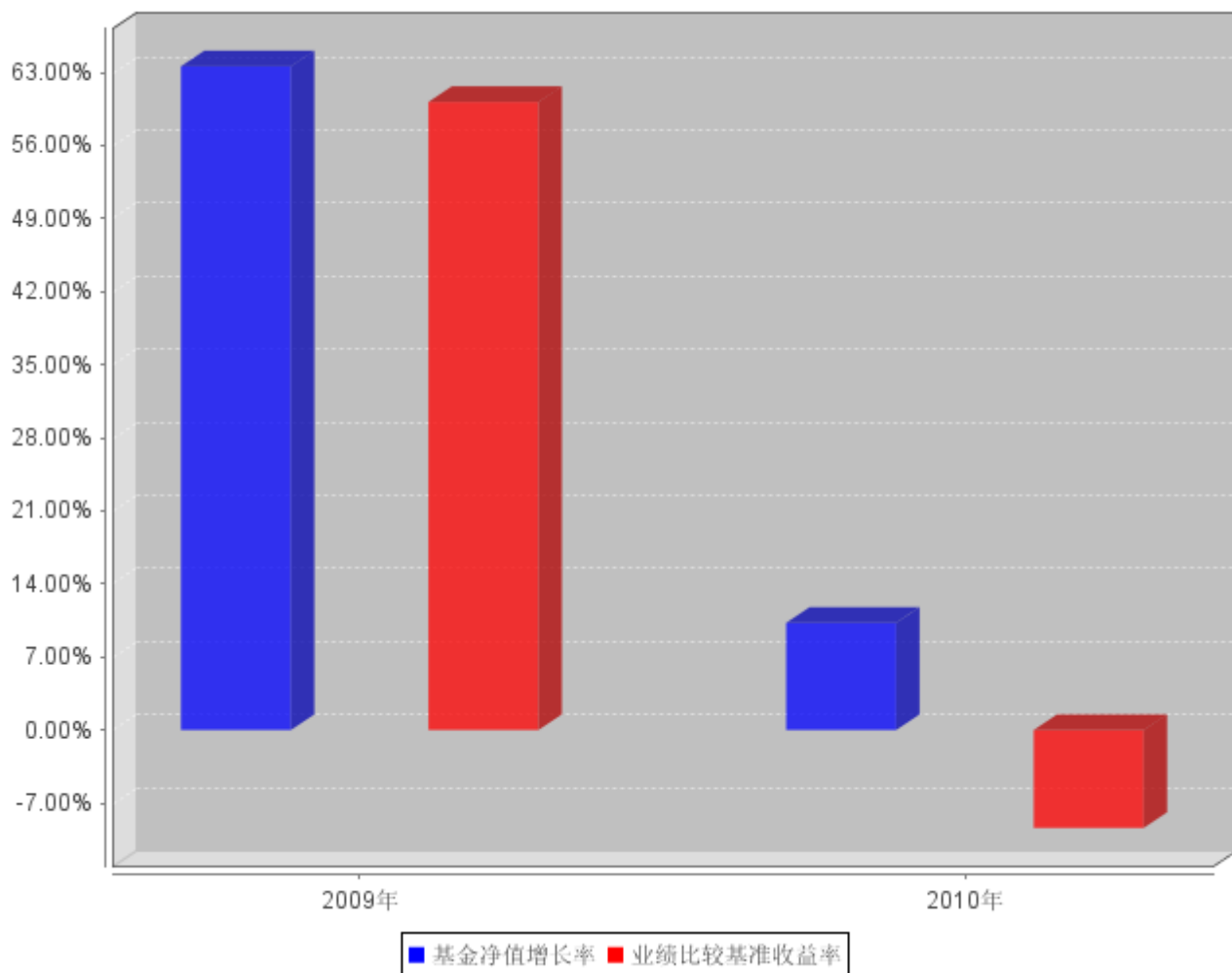


注：本基金的《基金合同》生效日为 2009 年 1 月 23 日，截至本报告期末，基金成立未满五年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2009 年 1 月 23 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金的《基金合同》生效日为 2009 年 1 月 23 日，至本报告期末未满五年。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度   | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额     | 年度利润分配合计      | 备注 |
|------|-------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 2010 | 0.800       | 41,606,743.02 | 27,153,572.79 | 68,760,315.81 |    |
| 2009 | -           | -             | -             | -             |    |
| 合计   | 0.800       | 41,606,743.02 | 27,153,572.79 | 68,760,315.81 |    |

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理有限公司成立于 2005 年 2 月，公司总部设在上海陆家嘴。经过六年的发展，公司已成为业务布局完善、管理体系严谨、团队稳定优秀、文化优势突出、品牌日益确立，具有较强综合竞争实力的资产管理公司。公司业务覆盖公募基金管理、特定客户资产管理、QDII 业务、社保委托投资管理等，并设立有北京分公司、南方分公司和汇添富资产管理(香港)有限公司(China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited)。

2010 年汇添富稳步推进公募基金业务，成功发行中国首只民营企业投资基金——汇添富民营活力股票型证券投资基金，中国首只医药行业基金——汇添富医药保健股票型证券投资基金，以及公司首只 QDII 产品——汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金。截至 2010 年 12 月 31 日，汇添富管理 12 只公募基金，资产管理规模达 569 亿，位居全行业第 12 位。

同时，汇添富始终坚持“以企业基本分析为立足点，挑选高质量的证券，把握市场脉络，做中长期投资布局，以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益”这一长期价值投资理念，并在投资研究中坚定有效地贯彻和执行。2010 年，汇添富取得了较为优秀的投资业绩。

2010 年汇添富专户业务快速发展，专户业务团队实力进一步增强，工作模式持续优化，并率先在业内推出了“添富牛专户”专属品牌。截至本报告期末，汇添富管理的专户产品数量、专户资产规模与业绩回报居行业前列。

2010 年汇添富国际业务取得重大突破。汇添富资产管理(香港)有限公司完成注册登记手续，成为业内少数几家正式设立并运作海外机构的基金管理公司之一。8 月，香港子公司成功发行首只对冲基金——汇添富大中华绝对收益基金。

2010 年汇添富在积极推进既有业务的同时，锐意进取，大力创新，经过长期艰苦的努力，获得社保境内委托投资管理人资格。

在稳步推进各项业务的同时，汇添富更着力实现贴心的客户服务与投资者教育工作。公司在行业内首推基于 SNS 平台的“添富空间”，倡导“理财+生活”的理念，并通过“汇添富微博”、“感恩五周年”、理财教育讲座、“添富之约”等活动，进一步拓展客户服务新渠道，为客户提供实惠、便利的理财生活服务。

企业的发展离不开社会各界的支持，资源来自于社会更要服务于社会，2010 年，汇添富持续

推进社会慈善事业，积极探索企业慈善公益事业新模式，有效推进长期公益项目建设。在报告期内，公司发起成立上海汇添富公益基金会，并开展青海玉树地震救灾、援建 100 所“添富幸福书屋”、支持孤残儿童寄养、关怀癌症患者等具有影响力的公益活动。同时，公司深入推进“河流·孩子”公益项目，启动开展“河流·孩子——汇添富黄河两岸助学计划”，在宁夏捐资新建第三所“添富小学”。

2011 年，中国资本市场环境将更加复杂多变，基金行业的竞争将更为激烈，汇添富将以更积极的心态拥抱变革，为实现“经过长期努力发展成为中国最优秀的资产管理公司之一”的目标，进一步发扬公司“正直、激情、团队、客户第一、感恩”的文化优势，完善战略布局，夯实长远发展基础，开拓创新，持续提升公司的核心竞争力，力争为中国基金业的繁荣做出更多贡献。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务                              | 任本基金的基金经理（助理）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，汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理。 | 2009 年 1 月 23 日 | -    | 9 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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易机制，涵盖了各投资组合、各投资市场、各投资标的，贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程，并通过分析报告、监控、稽核保证制度流程的有效执行。

##### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为股票型基金，股票投资对象主要是“价值相对低估的优质公司股票”，与本基金管理人旗下其他基金投资组合风格不同。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司公平交易制度执行情况良好，未发生任何异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年全球经济在遭受金融危机重创后开始缓慢复苏，而中国经济在四万亿财政投资拉动下率先摆脱危机影响重新回到较快增长的轨道上来。在加快经济结构调整、发展战略新兴产业以及通胀预期逐步抬头、政府不断加大宏观调控力度等背景下，A 股市场表现出大盘宽幅震荡、个股两极分化的特征。

添富价值在 2010 年坚持了自下而上精选个股的风格，超配受宏观经济影响小、增长确定的医药、消费、TMT 类行业，取得了较好的效果，尤其是一些具有前瞻性、经过深入研究、重仓持有的个股，为基金业绩贡献了显著的超额收益。但在资产配置、行业选择层面，也有很多值得反思

和改进的不足之处。我们期望在新的一年里充分吸取这些经验教训，为持有人创造更好的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010 年，添富价值收益为 10.29%，同期比较基准收益为-9.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于 2011 年宏观经济和股市的大体走势，我们认为以美欧日为代表的发达国家经济将延续缓慢复苏的态势，而国内经济经过 2009-2010 年的过渡期后，2011 年有望成为中国下一轮经济周期的起点。我们对国内经济增长和上市公司利润增速并不担忧，站在一个中期或更长时间的角度看，我们认为股市震荡向上将是大趋势。

当然，由于通胀水平在 2011 年上半年很可能居高不下，新股和再融资压力大、国际板可能推出、大小非大量减持、中小市值股票估值过高的问题较为突出，以及全球地缘政治不稳定因素的存在，因此我们认为市场震荡上涨过程中将出现很多反复，指数波动性将进一步加大。

2011 年，我们将继续围绕居民收入提高与消费升级、经济结构调整与发展战略新兴产业、城镇化进程不断推进、装备制造业升级等主线构建相对均衡的投资组合，重点关注以下投资机会：一是受益于内需增长的消费品企业，尤其是受益于中西部和农村消费水平提高的企业；二是背靠巨大的国内市场，具备产业集群优势和内需相关的制造类企业；三是在经济结构调整中受益的公司，如新能源、节能环保型企业；四是具备较强外延式扩张能力或具有较大资产注入空间的公司。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司以维护基金份额持有人利益为宗旨，有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则，认真履行职责，通过常规稽核、专项检查 and 系统监控等方式方法积极开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，促进内部控制和风险管理的不断改进，并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

##### （一）完善规章制度，健全内部控制体系

在本报告期内，督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估，并根据各项业务特点、业务发展实际，建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程，进一步明确了内部控制和风险管理责任，公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善，为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

## （二）加强稽核监察，确保基金运作和公司经营合法合规

本报告期内，督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察，包括对基金投资交易行为、投资指标的监控，对投资组合的风险度量、评估和建议，对基金信息披露的审核、监督，对基金销售、营销的稽核、控制，对基金营运、技术系统的稽核、评估，切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

## （三）强化培训教育，提高全员合规意识

本报告期内，督察长和稽核监察部门积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险意识、合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强内部控制和风险管理，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、产品创新部、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司签订了《中债收益率曲线和中债估值最

终用户服务协议》而取得中债估值服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 15%。

本基金于 2010 年 3 月 22 日实施利润分配，每份基金份额派发红利 0.08 元人民币。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2010 年，本基金托管人在对汇添富价值精选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010 年，汇添富价值精选股票型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富价值精选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富价值精选股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 68,760,315.81 元。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理有限公司编制和披露的汇添富价值精选股票型证券投资基金 2010 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告的基本内容

| 审计报告标题  | 审计报告  |
|---------|---|
| 审计报告收件人 | 汇添富价值精选股票型证券投资基金全体基金份额持有人：  |
| 引言段     | 我们审计了后附的汇添富价值精选股票型证券投资基金（以下简称“添富价值精选股票基金”）的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。 |

|              |  |
|--------------|--|
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是添富价值精选股票基金的基金管理人汇添富基金管理有限公司的责任。这种责任包括：(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。   |
| 注册会计师的责任段    | <p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> |
| 审计意见段        | 我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了添富价值精选股票基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和净值变动情况。   |
| 注册会计师的姓名     | 徐艳 方侃  |
| 会计师事务所的名称    | 安永华明会计师事务所   |
| 会计师事务所的地址    | 中国 北京  |
| 审计报告日期       | 2011 年 3 月 25 日  |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：汇添富价值精选股票型证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2010 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2009 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 209,802,370.62          | 45,985,682.00            |
| 结算备付金      |         | 6,104,009.23            | 5,619,660.33             |
| 存出保证金      |         | 2,156,052.24            | 2,792,027.18             |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 2,236,427,749.01        | 1,413,355,708.81         |



|                 |            |                             |                             |
|-----------------|------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 其中：股票投资         |            | 2,186,212,749.01            | 1,363,520,708.81            |
| 基金投资            |            | -                           | -                           |
| 债券投资            |            | 50,215,000.00               | 49,835,000.00               |
| 资产支持证券投资        |            | -                           | -                           |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                           | -                           |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                           | -                           |
| 应收证券清算款         |            | -                           | 19,535,410.30               |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 1,512,340.74                | 47,818.54                   |
| 应收股利            |            | -                           | -                           |
| 应收申购款           |            | 26,087,878.83               | 491,061.27                  |
| 递延所得税资产         |            | -                           | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                           | -                           |
| 资产总计            |            | 2,482,090,400.67            | 1,487,827,368.43            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期期末<br/>2010年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2009年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                             |                             |
| 短期借款            |            | -                           | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                           | -                           |
| 衍生金融负债          |            | -                           | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                           | -                           |
| 应付证券清算款         |            | 44,889,917.48               | 13,529,604.66               |
| 应付赎回款           |            | 95,683.43                   | 2,493,095.13                |
| 应付管理人报酬         |            | 2,840,212.54                | 1,765,874.89                |
| 应付托管费           |            | 473,368.75                  | 294,312.48                  |
| 应付销售服务费         |            | -                           | -                           |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 1,662,725.73                | 2,459,455.47                |
| 应交税费            |            | -                           | -                           |
| 应付利息            |            | -                           | -                           |
| 应付利润            |            | -                           | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                           | -                           |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 430,312.25                  | 449,396.03                  |
| 负债合计            |            | 50,392,220.18               | 20,991,738.66               |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                             |                             |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 1,420,314,069.90            | 896,451,468.30              |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | 1,011,384,110.59            | 570,384,161.47              |
| 所有者权益合计         |            | 2,431,698,180.49            | 1,466,835,629.77            |
| 负债和所有者权益总计      |            | 2,482,090,400.67            | 1,487,827,368.43            |

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、报告截止 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.712 元，基金份额总额 1,420,314,069.90 份。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富价值精选股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2010 年 1 月 1 日至<br>2010 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2009 年 1 月 23 日<br>(基金合同生效<br>日) 至 2009 年 12<br>月 31 日 |
|------------------------|------------|---|---|
| <b>一、收入</b>            |            | 299,810,098.85                            | 568,245,380.63  |
| 1. 利息收入                |            | 2,887,085.59                              | 4,858,770.05  |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 1,416,285.58                              | 1,597,556.01  |
| 债券利息收入                 |            | 1,470,800.01                              | 3,261,214.04  |
| 资产支持证券利息收入             |            | -   | -   |
| 买入返售金融资产收入             |            | -   | -   |
| 其他利息收入                 |            | -   | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 231,483,705.04                            | 443,272,612.34  |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | 222,568,101.78                            | 439,139,529.90  |
| 基金投资收益                 |            | -   | -   |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | 1,077,429.41                              | -1,846,208.95   |
| 资产支持证券投资收益             |            | -   | -   |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.14   | -   | -   |
| 股利收益                   | 7.4.7.15   | 7,838,173.85                              | 5,979,291.39  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16   | 62,750,297.83                             | 117,267,913.87  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -   | -   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17   | 2,689,010.39                              | 2,846,084.37  |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 48,777,166.83                             | 39,721,514.40   |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 26,974,485.70                             | 17,982,226.47   |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 4,495,747.68                              | 2,997,037.77  |
| 3. 销售服务费               |            | -   | -   |
| 4. 交易费用                | 7.4.7.18   | 16,765,096.29                             | 18,122,254.79   |
| 5. 利息支出                |            | 90,417.15                                 | 163,301.37  |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 90,417.15                                 | 163,301.37  |
| 6. 其他费用                | 7.4.7.19   | 451,420.01                                | 456,694.00  |
| <b>三、利润总额</b>          |            | 251,032,932.02                            | 528,523,866.23  |

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富价值精选股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日       |                  |                   |
|--|--|------------------|-------------------|
|  | 实收基金   | 未分配利润            | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 896,451,468.30                               | 570,384,161.47   | 1,466,835,629.77  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 251,032,932.02   | 251,032,932.02    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 523,862,601.60                               | 258,727,332.91   | 782,589,934.51    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,901,706,350.99                             | 1,163,627,351.12 | 3,065,333,702.11  |
| 2. 基金赎回款                               | -1,377,843,749.39                            | -904,900,018.21  | -2,282,743,767.60 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -68,760,315.81   | -68,760,315.81    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,420,314,069.90                             | 1,011,384,110.59 | 2,431,698,180.49  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2009 年 1 月 23 日至 2009 年 12 月 31 日 |                  |                   |
|  | 实收基金   | 未分配利润            | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,512,522,680.68                             | -                | 1,512,522,680.68  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 528,523,866.23   | 528,523,866.23    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -616,071,212.38                              | 41,860,295.24    | -574,210,917.14   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,197,947,885.36                             | 496,726,170.06   | 1,694,674,055.42  |
| 2. 基金赎回款                               | -1,814,019,097.74                            | -454,865,874.82  | -2,268,884,972.56 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -                | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 896,451,468.30                               | 570,384,161.47   | 1,466,835,629.77  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| <u>林利军</u> | <u>陈灿辉</u> | <u>王小练</u> |
| 基金管理公司负责人  | 主管会计工作负责人  | 会计机构负责人    |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇添富价值精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2008]1317 号文《关于同意汇添富价值精选股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由汇添富基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于 2009 年 1 月 23 日生效,首次设立募集规模为 1,512,522,680.68 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金坚持长期价值投资的理念,采用深入的“自下而上”的公司基本面分析方法,精选价值相对低估的优质公司进行投资布局,通过科学的组合管理,实现投资目标。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。添富价值精选基金采用灵活积极的资产配置和股票投资策略。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、证监会公告[2010]5

号关于发布《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债)，并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资)；

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债；本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债；

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效

套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益；每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### （1）股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资；股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益；卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

#### （2）债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资；债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### （3）权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资；权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益；卖出权证的成本按移动加权平均法于交易日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购)，以成本列示，按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### 1) 股票投资

##### (1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

##### (2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同

一 证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况



况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行机构代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行机构代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 15%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益

分配方式是现金分红；

- (3) 本基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- (4) 本基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- (5) 本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- (6) 每一基金份额享有同等分配权；
- (7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2010 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2009 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 209,802,370.62          | 45,985,682.00            |
| 定期存款           | -                       | -                        |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                       | -                        |
| 其他存款           | -                       | -                        |
| 合计：            | 209,802,370.62          | 45,985,682.00            |

注：本基金 2010 年度未投资于定期存款。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2010 年 12 月 31 日 |                  |                |
|----|-------------------------|------------------|----------------|
|    | 成本                      | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票 | 2,005,502,737.31        | 2,186,212,749.01 | 180,710,011.70 |
| 债券 | 交易所市场                   | -                | -              |
|    | 银行间市场                   | 50,906,800.00    | 50,215,000.00  |

|        |       |                     |                  |                |
|--------|-------|---------------------|------------------|----------------|
|        | 合计    | 50,906,800.00       | 50,215,000.00    | -691,800.00    |
| 资产支持证券 |       | -                   | -                | -              |
| 基金     |       | -                   | -                | -              |
| 其他     |       | -                   | -                | -              |
| 合计     |       | 2,056,409,537.31    | 2,236,427,749.01 | 180,018,211.70 |
| 项目     |       | 上年度末<br>2009年12月31日 |                  |                |
|        |       | 成本                  | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票     |       | 1,246,252,794.94    | 1,363,520,708.81 | 117,267,913.87 |
| 债券     | 交易所市场 | -                   | -                | -              |
|        | 银行间市场 | 49,835,000.00       | 49,835,000.00    | -              |
|        | 合计    | 49,835,000.00       | 49,835,000.00    | -              |
| 资产支持证券 |       | -                   | -                | -              |
| 基金     |       | -                   | -                | -              |
| 其他     |       | -                   | -                | -              |
| 合计     |       | 1,296,087,794.94    | 1,413,355,708.81 | 117,267,913.87 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末和上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末和上年末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末和上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2010年12月31日 | 上年度末<br>2009年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 29,765.98          | 7,774.72            |
| 应收定期存款利息   | -                  | -                   |
| 应收其他存款利息   | -                  | -                   |
| 应收结算备付金利息  | 2,136.40           | 1,966.90            |
| 应收债券利息     | 1,480,438.36       | 38,076.92           |
| 应收买入返售证券利息 | -                  | -                   |
| 应收申购款利息    | -                  | -                   |
| 其他         | -                  | -                   |
| 合计         | 1,512,340.74       | 47,818.54           |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末和上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2010年12月31日 | 上年度末<br>2009年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,662,112.08       | 2,458,423.22        |
| 银行间市场应付交易费用 | 613.65             | 1,032.25            |
| 合计          | 1,662,725.73       | 2,459,455.47        |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2010年12月31日 | 上年度末<br>2009年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 312.25             | 9,396.03            |
| 预提信息披露费     | 340,000.00         | 360,000.00          |
| 预提审计费       | 90,000.00          | 80,000.00           |
| 合计          | 430,312.25         | 449,396.03          |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 |                   |
|---------------|-----------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额              |
| 上年度末          | 896,451,468.30              | 896,451,468.30    |
| 本期申购          | 1,901,706,350.99            | 1,901,706,350.99  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,377,843,749.39           | -1,377,843,749.39 |
| 本期末           | 1,420,314,069.90            | 1,420,314,069.90  |

注：表中“本期申购”包含红利再投、转换入份额，“本期赎回”包含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目   | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 426,255,584.83 | 144,128,576.64 | 570,384,161.47 |
| 本期利润 | 188,282,634.19 | 62,750,297.83  | 251,032,932.02 |

|                |                 |                 |                  |
|----------------|-----------------|-----------------|------------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 242,317,128.75  | 16,410,204.16   | 258,727,332.91   |
| 其中：基金申购款       | 881,939,047.32  | 281,688,303.80  | 1,163,627,351.12 |
| 基金赎回款          | -639,621,918.57 | -265,278,099.64 | -904,900,018.21  |
| 本期已分配利润        | -68,760,315.81  | -               | -68,760,315.81   |
| 本期末            | 788,095,031.96  | 223,289,078.63  | 1,011,384,110.59 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

| 项目        | 本期                    | 上年度可比期间                         |
|-----------|-----------------------|---------------------------------|
|           | 2010年1月1日至2010年12月31日 | 2009年1月23日(基金合同生效日)至2009年12月31日 |
| 活期存款利息收入  | 1,279,048.85          | 1,502,291.16                    |
| 定期存款利息收入  | -                     | -                               |
| 其他存款利息收入  | -                     | -                               |
| 结算备付金利息收入 | 60,565.71             | 61,611.34                       |
| 其他        | 76,671.02             | 33,653.51                       |
| 合计        | 1,416,285.58          | 1,597,556.01                    |

注：表中“其他”指直销申购款利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期                    | 上年度可比期间                         |
|----------|-----------------------|---------------------------------|
|          | 2010年1月1日至2010年12月31日 | 2009年1月23日(基金合同生效日)至2009年12月31日 |
| 卖出股票成交总额 | 5,353,327,807.84      | 5,680,030,630.74                |
| 卖出股票成本总额 | 5,130,759,706.06      | 5,240,891,100.84                |
| 买卖股票差价收入 | 222,568,101.78        | 439,139,529.90                  |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                    | 上年度可比期间                         |
|-------------------------|-----------------------|---------------------------------|
|                         | 2010年1月1日至2010年12月31日 | 2009年1月23日(基金合同生效日)至2009年12月31日 |
| 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额   | 103,878,996.75        | 548,448,148.04                  |
| 减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额 | 102,460,800.00        | 537,119,840.97                  |
| 减：应收利息总额                | 340,767.34            | 13,174,516.02                   |
| 债券投资收益                  | 1,077,429.41          | -1,846,208.95                   |

### 7.4.7.14 衍生工具收益

#### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本期未有衍生工具收益。

### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间<br>2009年1月23日（基金合同生效日）至2009年12月31日 |
|-------------|-----------------------------|--|
| 股票投资产生的股利收益 | 7,838,173.85                | 5,979,291.39                               |
| 基金投资产生的股利收益 | -                           | -  |
| 合计          | 7,838,173.85                | 5,979,291.39                               |

### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间<br>2009年1月23日（基金合同生效日）至2009年12月31日 |
|------------|-----------------------------|--|
| 1. 交易性金融资产 | 62,750,297.83               | 117,267,913.87                             |
| ——股票投资     | 63,442,097.83               | 117,267,913.87                             |
| ——债券投资     | -691,800.00                 | -  |
| 2. 衍生工具    |                             |  |
| ——权证投资     |                             |  |
| 3. 其他      |                             |  |
| 合计         | 62,750,297.83               | 117,267,913.87                             |

### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间<br>2009年1月23日（基金合同生效日）至2009年12月31日 |
|---------|-----------------------------|--|
| 基金赎回费收入 | 2,689,010.39                | 2,836,106.41                               |
| 其他      | -                           | 9,977.96                                   |
| 合计      | 2,689,010.39                | 2,846,084.37                               |

注：本项中的“其他”是指认购期利息差额。

### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间<br>2009年1月23日（基金合同生效日） |
|----|-----------------------------|--------------------------------|
|----|-----------------------------|--------------------------------|



|           | 日             | 至 2009 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------------|--------------------|
| 交易所市场交易费用 | 16,764,546.29 | 18,117,829.79      |
| 银行间市场交易费用 | 550.00        | 4,425.00           |
| 合计        | 16,765,096.29 | 18,122,254.79      |

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2009 年 1 月 23 日(基金合同生效日)<br>至 2009 年 12 月 31 日 |
|--------|---|---|
| 审计费用   | 90,000.00                                 | 80,000.00   |
| 信息披露费  | 340,000.00                                | 360,000.00  |
| 银行划款费用 | 3,420.01                                  | 3,794.00  |
| 帐户维护费  | 18,000.00                                 | 12,000.00   |
| 其他     | -   | 900.00  |
| 合计     | 451,420.01                                | 456,694.00  |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日之后、年度报告批准报出日之前批准、公告和实施的利润分配的情况如下：

本基金于 2011 年 3 月 18 日（权益登记日、除息日）每份基金份额派发红利 0.09 元，共分配收益 135,836,174.67 元，其中红利再投资方式为 49,831,391.87 元，现金红利为 86,004,782.80 元。

除以上情况外，无其他需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称           | 与本基金的关系         |
|-----------------|-----------------|
| 汇添富基金管理有限公司     | 基金管理人、基金销售机构    |
| 中国工商银行股份有限公司    | 基金托管人、基金代销机构    |
| 东方证券股份有限公司      | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 东航金控控股有限责任公司    | 基金管理人的股东        |
| 文汇新民联合报业集团      | 基金管理人的股东        |
| 汇添富资产管理(香港)有限公司 | 基金管理人的子公司       |

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 上海汇添富公益基金会 | 与基金管理人同一批关键管理人员 |
|------------|-----------------|

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1. 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日 |                 | 上年度可比期间<br>2009年1月23日（基金合同生效日）至2009年12月31日 |                 |
|------------|-----------------------------|-----------------|--|-----------------|
|            | 成交金额                        | 占当期股票成交总额的比例(%) | 成交金额                                       | 占当期股票成交总额的比例(%) |
| 东方证券股份有限公司 | 5,364,680,782.78            | 47.84           | 4,294,580,999.81                           | 35.32           |

##### 7.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2010年1月1日至2010年12月31日                |               |            |                 |
|------------|--|---------------|------------|-----------------|
|            | 当期佣金                                       | 占当期佣金总量的比例(%) | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金总量的比例(%) |
| 东方证券股份有限公司 | 4,476,384.81                               | 47.98         | 492,892.57 | 29.65           |
| 关联方名称      | 上年度可比期间<br>2009年1月23日（基金合同生效日）至2009年12月31日 |               |            |                 |
|            | 当期佣金                                       | 占当期佣金总量的比例(%) | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金总量的比例(%) |
| 东方证券股份有限公司 | 3,596,970.85                               | 35.45         | 302,886.24 | 12.32           |

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                   | 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 | 2009 年 1 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2009 年 12 月 31 日 |
|-------------------|----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费    | 26,974,485.70                    | 17,982,226.47                                |
| 其中: 支付给销售机构的客户维护费 | 1,836,616.57                     | 1,249,605.41                                 |

注: 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等, 支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

| 项目             | 本期<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2009 年 1 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2009 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,495,747.68                           | 2,997,037.77  |

注: 基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金 2010 年和 2009 年均未与关联方进行银行间同业市场债券(回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位: 份

| 项目 | 本期<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 | 上年度可比期间<br>2009 年 1 月 23 日 (基金合同生效日) |
|----|------------------------------|--------------------------------------|
|----|------------------------------|--------------------------------------|

|                                 | 12 月 31 日     | 至 2009 年 12 月 31 日 |
|---------------------------------|---------------|--------------------|
| 基金合同生效日（2009 年 1 月 23 日）持有的基金份额 |               | 30,035,750.00      |
| 期初持有的基金份额                       | 47,480,912.67 | -                  |
| 期间申购/买入总份额                      | -             | 17,445,162.67      |
| 期间因拆分变动份额                       | -             | -                  |
| 减：期间赎回/卖出总份额                    | -             | -                  |
| 期末持有的基金份额                       | 47,480,912.67 | 47,480,912.67      |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例               | 3.34%         | 5.30%              |

注：1、其中“申购/买入”含红利再投、转换入份额；“赎回/卖出”含转换出份额。

2、本基金于 2009 年 1 月 23 日成立。本公司于 2009 年 6 月 10 日运用自有资金 10,000,000 元申购本基金份额 7,954,653.94 份，申购费用 1000 元；于 2009 年 9 月 3 日运用自有资金 12,500,000 元申购本基金份额 9,490,508.73 份，申购费用 1000 元。符合招募说明书规定的申购费率。

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于 2010 年年末及 2009 年年末均未投资本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |              | 上年度可比期间<br>2009 年 1 月 23 日（基金合同生效日）<br>至 2009 年 12 月 31 日 |              |
|--------------|--|--------------|---|--------------|
|              | 期末余额                                   | 当期利息收入       | 期末余额  | 当期利息收入       |
| 中国工商银行股份有限公司 | 209,802,370.62                         | 1,279,048.85 | 45,985,682.00   | 1,502,291.16 |

注：由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入包含了关联方保管的银行存款期末余额、除了最低备付金以外的结算备付金期末余额及当期产生的利息收入。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日 | 除息日       | 每 10 份<br>基金份额分<br>红数 | 现金形式<br>发放总额  | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分配<br>合计  | 备注 |
|----|-----------|-----------|-----------------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 1  | 2010-3-22 | 2010-3-22 | 0.800                 | 41,606,743.02 | 27,153,572.79 | 68,760,315.81 |    |

#### 7.4.12 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |          |           |           |               |          |            |              |               |               |    |
|----------------------|----------|-----------|-----------|---------------|----------|------------|--------------|---------------|---------------|----|
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日 | 可流<br>通日  | 流通受限<br>类型    | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末<br>成本总额    | 期末估值总额        | 备注 |
| 002215               | 诺普信      | 2010-3-17 | 2011-3-18 | 非公开发行<br>流通受限 | 31.00    | 34.12      | 350,000      | 10,850,000.00 | 11,942,000.00 | -  |

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代<br>码 | 股票<br>名称 | 停牌日期       | 停牌<br>原因 | 期末<br>估值单价 | 复牌日<br>期 | 复牌<br>开盘单价 | 数量（股）     | 期末<br>成本总额    | 期末估值总额        | 备注 |
|----------|----------|------------|----------|------------|----------|------------|-----------|---------------|---------------|----|
| 600518   | 康美<br>药业 | 2010-12-28 | 配股<br>停牌 | 19.71      | 2011-1-6 | 17.29      | 1,199,985 | 22,688,897.88 | 23,651,704.35 | -  |

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行，另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于年末持有的流通受限证券外，本年末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、部分应收申购款及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2010年12月31日  | 1个月以内          | 1-3个月         | 3个月-1年        | 1-5年 | 5年以上 | 不计息              | 合计               |
|---------------------|----------------|---------------|---------------|------|------|------------------|------------------|
| 资产                  |                |               |               |      |      |                  |                  |
| 银行存款                | 209,802,370.62 | -             | -             | -    | -    | -                | 209,802,370.62   |
| 结算备付金               | 6,104,009.23   | -             | -             | -    | -    | -                | 6,104,009.23     |
| 存出保证金               | -              | -             | -             | -    | -    | 2,156,052.24     | 2,156,052.24     |
| 交易性金融资产             | -              | -             | 50,215,000.00 | -    | -    | 2,186,212,749.01 | 2,236,427,749.01 |
| 应收利息                | -              | -             | -             | -    | -    | 1,512,340.74     | 1,512,340.74     |
| 应收申购款               | 25,176,007.49  | -             | -             | -    | -    | 911,871.34       | 26,087,878.83    |
| 资产总计                | 241,082,387.34 | -             | 50,215,000.00 | -    | -    | 2,190,793,013.33 | 2,482,090,400.67 |
| 负债                  |                |               |               |      |      |                  |                  |
| 应付证券清算款             | -              | -             | -             | -    | -    | 44,889,917.48    | 44,889,917.48    |
| 应付赎回款               | -              | -             | -             | -    | -    | 95,683.43        | 95,683.43        |
| 应付管理人报酬             | -              | -             | -             | -    | -    | 2,840,212.54     | 2,840,212.54     |
| 应付托管费               | -              | -             | -             | -    | -    | 473,368.75       | 473,368.75       |
| 应付交易费用              | -              | -             | -             | -    | -    | 1,662,725.73     | 1,662,725.73     |
| 其他负债                | -              | -             | -             | -    | -    | 430,312.25       | 430,312.25       |
| 负债总计                | -              | -             | -             | -    | -    | 50,392,220.18    | 50,392,220.18    |
| 利率敏感度缺口             | 241,082,387.34 | -             | 50,215,000.00 | -    | -    | 2,140,400,793.15 | 2,431,698,180.49 |
| 上年度末<br>2009年12月31日 | 1个月以内          | 1-3个月         | 3个月-1年        | 1-5年 | 5年以上 | 不计息              | 合计               |
| 资产                  |                |               |               |      |      |                  |                  |
| 银行存款                | 45,985,682.00  | -             | -             | -    | -    | -                | 45,985,682.00    |
| 结算备付金               | 5,619,660.33   | -             | -             | -    | -    | -                | 5,619,660.33     |
| 存出保证金               | -              | -             | -             | -    | -    | 2,792,027.18     | 2,792,027.18     |
| 交易性金融资产             | -              | 49,835,000.00 | -             | -    | -    | 1,363,520,708.81 | 1,413,355,708.81 |
| 应收证券清算款             | -              | -             | -             | -    | -    | 19,535,410.30    | 19,535,410.30    |
| 应收利息                | -              | -             | -             | -    | -    | 47,818.54        | 47,818.54        |
| 应收申购款               | 25,971.45      | -             | -             | -    | -    | 465,089.82       | 491,061.27       |
| 资产总计                | 51,631,313.78  | 49,835,000.00 | -             | -    | -    | 1,386,361,054.65 | 1,487,827,368.43 |
| 负债                  |                |               |               |      |      |                  |                  |
| 应付证券清算款             | -              | -             | -             | -    | -    | 13,529,604.66    | 13,529,604.66    |
| 应付赎回款               | -              | -             | -             | -    | -    | 2,493,095.13     | 2,493,095.13     |
| 应付管理人报酬             | -              | -             | -             | -    | -    | 1,765,874.89     | 1,765,874.89     |

|         |               |               |   |   |                  |                  |
|---------|---------------|---------------|---|---|------------------|------------------|
| 应付托管费   | -             | -             | - | - | 294,312.48       | 294,312.48       |
| 应付交易费用  | -             | -             | - | - | 2,459,455.47     | 2,459,455.47     |
| 其他负债    | -             | -             | - | - | 449,396.03       | 449,396.03       |
| 负债总计    | -             | -             | - | - | 20,991,738.66    | 20,991,738.66    |
| 利率敏感度缺口 | 51,631,313.78 | 49,835,000.00 | - | - | 1,365,369,315.99 | 1,466,835,629.77 |

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |   |                             |                   |
|----|---|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；                                     |                             |                   |
|    | 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；               |                             |                   |
|    | 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；                              |                             |                   |
|    | 4. 银行存款、结算备付金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响。 |                             |                   |
| 分析 | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |   | 本期末（2010年12月31日）            | 上年度末（2009年12月31日） |
|    | 0.25%   | -45,116.52                  | -24,176.71        |
|    | -0.25%  | 45,195.42                   | 24,200.18         |

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2010年12月31日 |        | 上年度末<br>2009年12月31日 |          |
|----|--------------------|--------|---------------------|----------|
|    | 公允价值               | 占基金资产净 | 公允价值                | 占基金资产净值比 |
|    |                    |        |                     |          |



|              |                  | 值比例<br>(%) |                  | 例 (%) |
|--------------|------------------|------------|------------------|-------|
| 交易性金融资产-股票投资 | 2,186,212,749.01 | 89.90      | 1,363,520,708.81 | 92.96 |
| 交易性金融资产-债券投资 | 50,215,000.00    | 2.07       | 49,835,000.00    | 3.40  |
| 衍生金融资产-权证投资  | -                | -          | -                | -     |
| 其他           | -                | -          | -                | -     |
| 合计           | 2,236,427,749.01 | 91.97      | 1,413,355,708.81 | 96.36 |

注：本基金股票投资占基金资产的比例为 60-95%，现金、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5-40%，其中，基金持有权证的市场价值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |  |                             |                   |
|----|--|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合的贝塔系数紧密相关； |                             |                   |
|    | 2. 对于上市时间不足一年的股票，使用申银万国行业指数替代股票价格计算其贝塔系数；      |                             |                   |
|    | 3. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。        |                             |                   |
| 分析 | 相关风险变量的变动                                      | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |  | 本期末（2010年12月31日）            | 上年度末（2009年12月31日） |
|    | 5%   | 96,152,916.02               | 64,837,454.98     |
|    | -5%  | -96,152,916.02              | -64,837,454.98    |

注：本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目    | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资  | 2,186,212,749.01 | 88.08         |
|    | 其中：股票 | 2,186,212,749.01 | 88.08         |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 2 | 固定收益投资            | 50,215,000.00    | 2.02   |
|   | 其中：债券             | 50,215,000.00    | 2.02   |
|   | 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      | 215,906,379.85   | 8.70   |
| 6 | 其他各项资产            | 29,756,271.81    | 1.20   |
| 7 | 合计                | 2,482,090,400.67 | 100.00 |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码  | 行业类别           | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|-----|----------------|------------------|--------------|
| A   | 农、林、牧、渔业       | 37,902,878.95    | 1.56         |
| B   | 采掘业            | 81,758,401.89    | 3.36         |
| C   | 制造业            | 911,948,523.78   | 37.50        |
| C0  | 食品、饮料          | 201,867,864.20   | 8.30         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 7,897,960.51     | 0.32         |
| C2  | 木材、家具          | -                | -            |
| C3  | 造纸、印刷          | -                | -            |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 11,942,000.00    | 0.49         |
| C5  | 电子             | -                | -            |
| C6  | 金属、非金属         | 161,480,000.00   | 6.64         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 152,911,285.76   | 6.29         |
| C8  | 医药、生物制品        | 357,601,937.94   | 14.71        |
| C99 | 其他制造业          | 18,247,475.37    | 0.75         |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -                | -            |
| E   | 建筑业            | 34,290,457.20    | 1.41         |
| F   | 交通运输、仓储业       | 88,168,724.64    | 3.63         |
| G   | 信息技术业          | 324,271,195.94   | 13.34        |
| H   | 批发和零售贸易        | 176,083,818.90   | 7.24         |
| I   | 金融、保险业         | 299,035,313.94   | 12.30        |
| J   | 房地产业           | -                | -            |
| K   | 社会服务业          | 180,196,236.97   | 7.41         |
| L   | 传播与文化产业        | -                | -            |
| M   | 综合类            | 52,557,196.80    | 2.16         |
|     | 合计             | 2,186,212,749.01 | 89.90        |

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量（股）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 601318 | 中国平安  | 3,499,938 | 196,556,518.08 | 8.08         |
| 2  | 000669 | 领先科技  | 4,599,917 | 147,427,339.85 | 6.06         |
| 3  | 002159 | 三特索道  | 5,810,051 | 105,859,129.22 | 4.35         |
| 4  | 600036 | 招商银行  | 7,999,906 | 102,478,795.86 | 4.21         |
| 5  | 300039 | 上海凯宝  | 2,086,835 | 99,124,662.50  | 4.08         |
| 6  | 002007 | 华兰生物  | 2,000,000 | 96,780,000.00  | 3.98         |
| 7  | 000012 | 南玻A   | 4,800,000 | 94,800,000.00  | 3.90         |
| 8  | 300124 | 汇川技术  | 549,952   | 76,927,285.76  | 3.16         |
| 9  | 000858 | 五粮液   | 2,200,000 | 76,186,000.00  | 3.13         |
| 10 | 000876 | 新希望   | 2,843,290 | 59,566,925.50  | 2.45         |
| 11 | 601111 | 中国国航  | 4,200,000 | 57,456,000.00  | 2.36         |
| 12 | 002230 | 科大讯飞  | 699,992   | 55,299,368.00  | 2.27         |
| 13 | 600415 | 小商品城  | 1,499,920 | 52,557,196.80  | 2.16         |
| 14 | 000568 | 泸州老窖  | 1,199,853 | 49,073,987.70  | 2.02         |
| 15 | 000501 | 鄂武商A  | 2,599,941 | 47,812,914.99  | 1.97         |
| 16 | 600706 | ST长信  | 2,427,083 | 47,255,306.01  | 1.94         |
| 17 | 600403 | 欣网视讯  | 1,362,299 | 46,209,182.08  | 1.90         |
| 18 | 000629 | *ST钒钛 | 4,000,000 | 46,160,000.00  | 1.90         |
| 19 | 000527 | 美的电器  | 2,600,000 | 45,240,000.00  | 1.86         |
| 20 | 000888 | 峨眉山A  | 2,279,999 | 39,329,982.75  | 1.62         |
| 21 | 600276 | 恒瑞医药  | 600,000   | 35,736,000.00  | 1.47         |
| 22 | 300070 | 碧水源   | 280,057   | 35,007,125.00  | 1.44         |
| 23 | 000861 | 海印股份  | 2,080,451 | 34,535,486.60  | 1.42         |
| 24 | 000961 | 中南建设  | 3,000,040 | 34,290,457.20  | 1.41         |
| 25 | 600575 | 芜湖港   | 1,458,344 | 30,712,724.64  | 1.26         |
| 26 | 601808 | 中海油服  | 1,200,000 | 30,648,000.00  | 1.26         |
| 27 | 600446 | 金证股份  | 2,000,000 | 28,080,000.00  | 1.15         |
| 28 | 002004 | 华邦制药  | 500,000   | 26,370,000.00  | 1.08         |
| 29 | 600583 | 海油工程  | 2,999,938 | 24,299,497.80  | 1.00         |
| 30 | 600778 | 友好集团  | 1,800,000 | 23,976,000.00  | 0.99         |
| 31 | 600518 | 康美药业  | 1,199,985 | 23,651,704.35  | 0.97         |
| 32 | 000590 | 紫光古汉  | 1,499,867 | 22,902,969.09  | 0.94         |
| 33 | 300068 | 南都电源  | 750,000   | 22,200,000.00  | 0.91         |
| 34 | 002299 | 圣农发展  | 599,941   | 21,567,878.95  | 0.89         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 35 | 600729 | 重庆百货 | 489,080   | 21,519,520.00 | 0.88 |
| 36 | 601607 | 上海医药 | 963,300   | 21,038,472.00 | 0.87 |
| 37 | 600660 | 福耀玻璃 | 2,000,000 | 20,520,000.00 | 0.84 |
| 38 | 300022 | 吉峰农机 | 599,920   | 19,197,440.00 | 0.79 |
| 39 | 600327 | 大厦股份 | 1,567,669 | 18,796,351.31 | 0.77 |
| 40 | 600525 | 长园集团 | 799,977   | 18,247,475.37 | 0.75 |
| 41 | 002038 | 双鹭药业 | 298,070   | 17,586,130.00 | 0.72 |
| 42 | 000895 | 双汇发展 | 195,873   | 17,040,951.00 | 0.70 |
| 43 | 600354 | 敦煌种业 | 450,000   | 16,335,000.00 | 0.67 |
| 44 | 600546 | 山煤国际 | 425,892   | 14,735,863.20 | 0.61 |
| 45 | 600750 | 江中药业 | 400,000   | 14,412,000.00 | 0.59 |
| 46 | 600997 | 开滦股份 | 599,853   | 12,075,040.89 | 0.50 |
| 47 | 002215 | 诺普信  | 350,000   | 11,942,000.00 | 0.49 |
| 48 | 600697 | 欧亚集团 | 403,390   | 10,246,106.00 | 0.42 |
| 49 | 600038 | 哈飞股份 | 300,000   | 8,544,000.00  | 0.35 |
| 50 | 002327 | 富安娜  | 199,999   | 7,897,960.51  | 0.32 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额       | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 187,443,747.97 | 12.78           |
| 2  | 601111 | 中国国航 | 183,460,892.78 | 12.51           |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 168,106,247.27 | 11.46           |
| 4  | 000012 | 南玻A  | 133,906,961.56 | 9.13            |
| 5  | 002007 | 华兰生物 | 126,245,247.44 | 8.61            |
| 6  | 000858 | 五粮液  | 106,845,538.81 | 7.28            |
| 7  | 000729 | 燕京啤酒 | 101,828,567.02 | 6.94            |
| 8  | 000669 | 领先科技 | 100,865,228.46 | 6.88            |
| 9  | 300124 | 汇川技术 | 82,179,986.29  | 5.60            |
| 10 | 000568 | 泸州老窖 | 78,159,325.48  | 5.33            |
| 11 | 300039 | 上海凯宝 | 75,573,723.42  | 5.15            |
| 12 | 600446 | 金证股份 | 74,982,515.75  | 5.11            |
| 13 | 600415 | 小商品城 | 70,973,258.98  | 4.84            |
| 14 | 600016 | 民生银行 | 70,638,684.42  | 4.82            |

|    |        |        |               |      |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 15 | 002159 | 三特索道   | 64,210,372.27 | 4.38 |
| 16 | 000811 | 烟台冰轮   | 61,779,963.86 | 4.21 |
| 17 | 600518 | 康美药业   | 61,710,150.44 | 4.21 |
| 18 | 000501 | 鄂武商A   | 60,883,595.31 | 4.15 |
| 19 | 601288 | 农业银行   | 60,187,100.00 | 4.10 |
| 20 | 600525 | 长园集团   | 59,728,843.46 | 4.07 |
| 21 | 600575 | 芜湖港    | 59,345,053.63 | 4.05 |
| 22 | 600660 | 福耀玻璃   | 58,691,690.69 | 4.00 |
| 23 | 000527 | 美的电器   | 56,946,586.38 | 3.88 |
| 24 | 600221 | 海南航空   | 56,520,483.67 | 3.85 |
| 25 | 000876 | 新希望    | 55,185,387.61 | 3.76 |
| 26 | 000933 | 神火股份   | 53,968,414.20 | 3.68 |
| 27 | 600750 | 江中药业   | 53,571,347.06 | 3.65 |
| 28 | 002225 | 濮耐股份   | 52,610,721.05 | 3.59 |
| 29 | 300070 | 碧水源    | 51,329,346.16 | 3.50 |
| 30 | 000961 | 中南建设   | 51,039,276.27 | 3.48 |
| 31 | 000861 | 海印股份   | 49,981,407.42 | 3.41 |
| 32 | 600327 | 大厦股份   | 48,963,418.05 | 3.34 |
| 33 | 600805 | 悦达投资   | 48,892,611.49 | 3.33 |
| 34 | 002296 | 辉煌科技   | 48,013,009.89 | 3.27 |
| 35 | 000960 | 锡业股份   | 47,539,943.54 | 3.24 |
| 36 | 000888 | 峨眉山A   | 47,417,326.73 | 3.23 |
| 37 | 002230 | 科大讯飞   | 47,247,843.14 | 3.22 |
| 38 | 601808 | 中海油服   | 46,611,089.61 | 3.18 |
| 39 | 600403 | 欣网视讯   | 46,141,972.65 | 3.15 |
| 40 | 000629 | *ST 钒钛 | 45,683,984.00 | 3.11 |
| 41 | 002106 | 莱宝高科   | 45,534,645.65 | 3.10 |
| 42 | 601939 | 建设银行   | 45,002,545.00 | 3.07 |
| 43 | 002038 | 双鹭药业   | 44,396,021.22 | 3.03 |
| 44 | 600546 | 山煤国际   | 43,028,389.26 | 2.93 |
| 45 | 600276 | 恒瑞医药   | 42,953,970.04 | 2.93 |
| 46 | 002155 | 辰州矿业   | 42,910,068.54 | 2.93 |
| 47 | 002309 | 中利科技   | 42,763,217.43 | 2.92 |
| 48 | 600054 | 黄山旅游   | 41,585,696.31 | 2.84 |
| 49 | 002215 | 诺普信    | 40,545,654.45 | 2.76 |
| 50 | 600497 | 驰宏锌锗   | 39,598,971.38 | 2.70 |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 51 | 600706 | ST 长信 | 39,146,405.06 | 2.67 |
| 52 | 600779 | 水井坊   | 37,567,219.19 | 2.56 |
| 53 | 600141 | 兴发集团  | 37,322,318.76 | 2.54 |
| 54 | 600354 | 敦煌种业  | 36,966,992.58 | 2.52 |
| 55 | 601166 | 兴业银行  | 36,052,153.87 | 2.46 |
| 56 | 000895 | 双汇发展  | 35,979,258.80 | 2.45 |
| 57 | 600997 | 开滦股份  | 35,836,194.60 | 2.44 |
| 58 | 600859 | 王府井   | 35,645,101.33 | 2.43 |
| 59 | 600079 | 人福医药  | 35,076,757.20 | 2.39 |
| 60 | 600331 | 宏达股份  | 35,059,382.03 | 2.39 |
| 61 | 600352 | 浙江龙盛  | 33,652,970.03 | 2.29 |
| 62 | 600570 | 恒生电子  | 33,260,248.97 | 2.27 |
| 63 | 600066 | 宇通客车  | 32,477,545.32 | 2.21 |
| 64 | 300072 | 三聚环保  | 32,229,336.82 | 2.20 |
| 65 | 300068 | 南都电源  | 32,089,887.85 | 2.19 |
| 66 | 002214 | 大立科技  | 31,006,841.00 | 2.11 |
| 67 | 002315 | 焦点科技  | 30,835,088.15 | 2.10 |
| 68 | 002123 | 荣信股份  | 30,472,878.89 | 2.08 |
| 69 | 000338 | 潍柴动力  | 29,889,871.37 | 2.04 |
| 70 | 002261 | 拓维信息  | 29,571,488.83 | 2.02 |

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额       | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1  | 601111 | 中国国航 | 113,848,372.31 | 7.76            |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 112,843,006.52 | 7.69            |
| 3  | 000729 | 燕京啤酒 | 98,370,780.24  | 6.71            |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 86,818,993.43  | 5.92            |
| 5  | 600570 | 恒生电子 | 80,109,382.36  | 5.46            |
| 6  | 600519 | 贵州茅台 | 75,765,847.66  | 5.17            |
| 7  | 000858 | 五粮液  | 75,438,833.08  | 5.14            |
| 8  | 601318 | 中国平安 | 74,661,966.95  | 5.09            |
| 9  | 002296 | 辉煌科技 | 71,122,596.82  | 4.85            |
| 10 | 002106 | 莱宝高科 | 67,864,778.69  | 4.63            |
| 11 | 000417 | 合肥百货 | 65,325,532.00  | 4.45            |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 12 | 002241 | 歌尔声学  | 64,905,500.99 | 4.42 |
| 13 | 000811 | 烟台冰轮  | 64,128,220.43 | 4.37 |
| 14 | 002007 | 华兰生物  | 62,708,746.24 | 4.28 |
| 15 | 600016 | 民生银行  | 61,754,419.75 | 4.21 |
| 16 | 601169 | 北京银行  | 60,912,970.38 | 4.15 |
| 17 | 601288 | 农业银行  | 59,053,737.51 | 4.03 |
| 18 | 002214 | 大立科技  | 58,955,406.68 | 4.02 |
| 19 | 002155 | 辰州矿业  | 58,428,085.97 | 3.98 |
| 20 | 000960 | 锡业股份  | 56,681,926.79 | 3.86 |
| 21 | 000001 | 深发展 A | 55,985,019.42 | 3.82 |
| 22 | 002179 | 中航光电  | 53,351,598.82 | 3.64 |
| 23 | 600079 | 人福医药  | 52,023,430.56 | 3.55 |
| 24 | 000933 | 神火股份  | 50,928,703.10 | 3.47 |
| 25 | 600750 | 江中药业  | 50,677,063.29 | 3.45 |
| 26 | 600221 | 海南航空  | 50,156,854.43 | 3.42 |
| 27 | 002225 | 濮耐股份  | 49,733,624.86 | 3.39 |
| 28 | 000983 | 西山煤电  | 48,918,721.06 | 3.33 |
| 29 | 600805 | 悦达投资  | 48,572,138.69 | 3.31 |
| 30 | 600395 | 盘江股份  | 48,526,582.71 | 3.31 |
| 31 | 000961 | 中南建设  | 47,530,862.37 | 3.24 |
| 32 | 600859 | 王府井   | 46,939,722.37 | 3.20 |
| 33 | 601001 | 大同煤业  | 45,754,191.00 | 3.12 |
| 34 | 600518 | 康美药业  | 45,427,963.79 | 3.10 |
| 35 | 600497 | 驰宏锌锗  | 45,124,411.55 | 3.08 |
| 36 | 600446 | 金证股份  | 43,185,698.92 | 2.94 |
| 37 | 601939 | 建设银行  | 43,107,442.34 | 2.94 |
| 38 | 600141 | 兴发集团  | 43,071,955.75 | 2.94 |
| 39 | 002309 | 中利科技  | 42,559,913.71 | 2.90 |
| 40 | 601601 | 中国太保  | 42,124,402.67 | 2.87 |
| 41 | 600223 | 鲁商置业  | 40,609,984.94 | 2.77 |
| 42 | 000338 | 潍柴动力  | 40,078,021.70 | 2.73 |
| 43 | 600525 | 长园集团  | 39,998,567.35 | 2.73 |
| 44 | 600660 | 福耀玻璃  | 39,695,295.36 | 2.71 |
| 45 | 002123 | 荣信股份  | 39,512,125.24 | 2.69 |
| 46 | 600298 | 安琪酵母  | 39,020,338.24 | 2.66 |
| 47 | 600779 | 水井坊   | 38,635,151.64 | 2.63 |
| 48 | 600546 | 山煤国际  | 38,057,606.62 | 2.59 |
| 49 | 600054 | 黄山旅游  | 37,969,523.69 | 2.59 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 50 | 600331 | 宏达股份 | 36,160,191.72 | 2.47 |
| 51 | 600138 | 中青旅  | 35,760,100.31 | 2.44 |
| 52 | 600537 | 海通集团 | 35,044,542.05 | 2.39 |
| 53 | 002304 | 洋河股份 | 33,866,361.17 | 2.31 |
| 54 | 600352 | 浙江龙盛 | 33,816,765.62 | 2.31 |
| 55 | 002315 | 焦点科技 | 32,925,481.33 | 2.24 |
| 56 | 600479 | 千金药业 | 32,753,013.34 | 2.23 |
| 57 | 600066 | 宇通客车 | 32,736,354.19 | 2.23 |
| 58 | 600251 | 冠农股份 | 32,016,341.48 | 2.18 |
| 59 | 000895 | 双汇发展 | 31,733,548.60 | 2.16 |
| 60 | 600327 | 大厦股份 | 31,381,596.27 | 2.14 |
| 61 | 601328 | 交通银行 | 31,345,501.68 | 2.14 |
| 62 | 300124 | 汇川技术 | 31,297,130.50 | 2.13 |
| 63 | 000568 | 泸州老窖 | 30,910,904.76 | 2.11 |
| 64 | 002261 | 拓维信息 | 29,416,369.39 | 2.01 |

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 5,890,009,648.43 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 5,353,327,807.84 |

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | 50,215,000.00 | 2.07         |
| 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  | 可转债       | -             | -            |
|    | 其他        | -             | -            |
|    | 合计        | 50,215,000.00 | 2.07         |

### 8.6 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

金额单位：人民币元



| 序号 | 债券代码    | 债券名称     | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 0801053 | 08 央票 53 | 500,000 | 50,215,000.00 | 2.07         |

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期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、处罚的情形。

8.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 2,156,052.24  |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 1,512,340.74  |
| 5  | 应收申购款   | 26,087,878.83 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 29,756,271.81 |

### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构            |                   |                |                   |
|--------------|---------------|------------------|-------------------|----------------|-------------------|
|              |               | 机构投资者            |                   | 个人投资者          |                   |
|              |               | 持有份额             | 占总份<br>额比例<br>(%) | 持有份额           | 占总份<br>额比例<br>(%) |
| 36,881       | 38,510.73     | 1,075,329,810.43 | 75.71             | 344,984,259.47 | 24.29             |

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目                   | 持有份额总数 (份)    | 占基金总份额比例 (%) |
|----------------------|---------------|--------------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 12,379,932.81 | 0.87         |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2009年1月23日)基金份额总额 | 1,512,522,680.68 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 896,451,468.30   |
| 本报告期基金总申购份额               | 1,901,706,350.99 |
| 减:本报告期基金总赎回份额             | 1,377,843,749.39 |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -                |
| 本报告期末基金份额总额               | 1,420,314,069.90 |

注：表内“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有举行基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人 2010 年 1 月 9 日公告，增聘陈晓翔先生担任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，庞飒先生不再担任该基金的基金经理。

2、基金管理人 2010 年 2 月 6 日公告，增聘吴振翔先生担任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。增聘王栩先生担任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理，庞飒先生不再担任该基金的基金经理。

3、《汇添富民营活力股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 5 月 5 日正式生效，齐东超先

生任该基金的基金经理。

4、《汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 6 月 25 日正式生效，刘子龙先生、王致人先生任该基金的基金经理。

5、基金管理人 2010 年 8 月 5 日公告，经汇添富基金管理有限公司第二届董事会第八次会议决议，并经中国证监会审核批准（证监许可[2010]1013 号文），公司聘任陈灿辉先生为公司副总经理。

6、《汇添富医药保健股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 9 月 21 日正式生效，王栩先生任该基金的基金经理，周睿先生、叶从飞先生任该基金的基金经理助理。

7、基金托管人中国工商银行经证监会审批任命晏秋生为资产托管部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所自本基金合同生效日（2009 年 1 月 23 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期末，应付未付的审计费用为人民币玖万元整。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易             |                  | 应支付该券商的佣金    |                | 备注 |
|------|--------|------------------|------------------|--------------|----------------|----|
|      |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 东方证券 | 2      | 5,364,680,782.78 | 47.84            | 4,476,384.81 | 47.98          | -  |
| 中信证券 | 2      | 2,426,987,402.28 | 21.64            | 1,971,946.22 | 21.13          | -  |
| 国信证券 | 2      | 2,050,247,845.35 | 18.28            | 1,721,006.26 | 18.45          | -  |
| 中金公司 | 2      | 527,405,287.38   | 4.70             | 442,909.34   | 4.75           | -  |
| 国金证券 | 2      | 435,674,731.33   | 3.89             | 370,319.46   | 3.97           | -  |
| 广发证券 | 2      | 275,839,738.95   | 2.46             | 234,463.92   | 2.51           | -  |

|      |    |                   |        |              |        |   |
|------|----|-------------------|--------|--------------|--------|---|
| 德邦证券 | 1  | 132,343,943.10    | 1.18   | 112,491.89   | 1.21   | - |
| 合计数  | 13 | 11,213,179,731.17 | 100.00 | 9,329,521.90 | 100.00 | - |

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易         |                  |
|------|--------------|------------------|
|      | 成交金额         | 占当期债券成交总额的比例 (%) |
| 东方证券 | -            | -                |
| 中信证券 | -            | -                |
| 国信证券 | 3,878,996.75 | 100              |
| 中金公司 | -            | -                |
| 国金证券 | -            | -                |
| 广发证券 | -            | -                |
| 德邦证券 | -            | -                |
| 合计数  | 3,878,996.75 | 100              |

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个

月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本报告期新增 2 家证券公司的 3 个交易单元:广发证券(上交所和深交所交易单元)、德邦证券(上交所交易单元);

## 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式                 | 法定披露日期          |
|----|---|------------------------|-----------------|
| 1  | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金 2009 年年度资产净值的公告                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 1 月 4 日  |
| 2  | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参加浦发银行基金定投申购费率优惠活动的公告                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 1 月 7 日  |
| 3  | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行开通基金定投业务并参加定投申购费率优惠活动的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 1 月 14 日 |
| 4  | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳发展银行电子渠道申购费率优惠活动及基金定投申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 1 月 16 日 |
| 5  | 价值基金 2009 年 4 季报  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 1 月 21 日 |
| 6  | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金增加平安银行为代销机构的公告                         | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 1 月 21 日 |
| 7  | 汇添富基金管理有限公司关于设立汇添富资产管理(香港)有限公司的公告                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 2 月 22 日 |
| 8  | 汇添富价值精选股票型证券投资基金更新招募说明书摘要                               | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 3 月 8 日  |

|    |   |                        |                 |
|----|---|------------------------|-----------------|
| 9  | 汇添富价值精选股票型证券投资基金更新招募说明书                   | 管理人网站                  | 2010 年 3 月 8 日  |
| 10 | 汇添富基金管理有限公司关于调整旗下基金转换业务规则的公告              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 3 月 11 日 |
| 11 | 汇添富价值精选股票型证券投资基金收益分配公告                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 3 月 18 日 |
| 12 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金投资诺普信（002215）非公开发行股票的公告  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 3 月 18 日 |
| 13 | 汇添富基金管理有限公司关于调整旗下基金转换业务规则的提示公告            | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 3 月 30 日 |
| 14 | 汇添富价值精选股票型证券投资基金 2009 年年度报告               | 管理人网站                  | 2010 年 3 月 30 日 |
| 15 | 汇添富价值精选股票型证券投资基金 2009 年年度报告摘要             | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 3 月 30 日 |
| 16 | 关于旗下基金参与上海银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告             | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 3 月 31 日 |
| 17 | 汇添富基金管理有限公司关于增加江苏银行为代销机构并开通基金定投及转换业务的公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 4 月 1 日  |
| 18 | 汇添富基金管理有限公司关于调整旗下基金在上海浦东发展银行定期定额投资起点金额的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 4 月 7 日  |
| 19 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金增加民生银行为代销机构的公告           | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 4 月 12 日 |

|    |   |                        |            |
|----|---|------------------------|------------|
| 20 | 汇添富基金管理有限公司关于增加英大证券为代销机构并开通基金转换业务的公告            | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年4月14日 |
| 21 | 汇添富价值精选股票型证券投资基金2010年第一季度报告                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年4月20日 |
| 22 | 关于增加厦门证券为代销机构并开通基金定投及转换业务的公告                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年4月29日 |
| 23 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金继续参与深圳发展银行开展的基金申购及定投费率优惠活动的公告  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年4月30日 |
| 24 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告               | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年5月13日 |
| 25 | 汇添富基金管理有限公司关于增加江海证券为代销机构并开通基金定投及转换业务的公告         | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年5月21日 |
| 26 | 汇添富基金管理有限公司关于开通网上直销一户多卡功能的公告                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年5月21日 |
| 27 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信银行个人网银申购基金费率优惠活动的公告      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年5月31日 |
| 28 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年6月3日  |
| 29 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与中投证券网上申购基金费率优惠活动的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年6月28日 |
| 30 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与安信证券网上申购基金费率优惠活动的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年6月28日 |
| 31 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金继续参与中国邮政储蓄银行开展的网上申购基金费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年6月30日 |
| 32 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金继续参与交通银行开展的网上银行申购基金费率优惠活动的公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年6月30日 |

|    |  |                        |            |
|----|--|------------------------|------------|
| 33 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金2010年上半年度资产净值的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年7月1日  |
| 34 | 汇添富价值精选股票型证券投资基金2010年第2季度报告                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年7月21日 |
| 35 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金增加中原证券为代销机构的公告            | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年7月27日 |
| 36 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金增加西南证券为代销机构的公告            | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年7月27日 |
| 37 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年7月29日 |
| 38 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金继续参与上海银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年7月30日 |
| 39 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与日信证券网上基金申购费率优惠活动的公告     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年8月3日  |
| 40 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年8月3日  |
| 41 | 汇添富基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年8月5日  |
| 42 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金在国信证券开通基金定投业务的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年8月6日  |
| 43 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与海通证券开展的基金定投申购费率优惠活动的公告  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年8月6日  |
| 44 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金在交通银行开展后端收费业务的公告        | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年8月10日 |
| 45 | 汇添富基金管理有限公司关于直销网上交易使用农行金穗卡申购基金费率优惠的公告      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年8月20日 |
| 46 | 汇添富基金管理有限公司关于增加方正证券为代销机构的公告                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010年8月25日 |



|    |  |                                |                  |
|----|--|--------------------------------|------------------|
| 47 | 汇添富价值精选股票型证券投资基金<br>2010 年半年度报告                            | 管理人网站                          | 2010 年 8 月 26 日  |
| 48 | 汇添富价值精选股票型证券投资基金<br>2010 年半年度报告摘要                          | 中国证券报、上海证<br>券报、证券时报、管<br>理人网站 | 2010 年 8 月 26 日  |
| 49 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分<br>基金参与齐鲁证券开展的网上交易系统<br>申购和定投基金费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证<br>券报、证券时报、管<br>理人网站 | 2010 年 8 月 27 日  |
| 50 | 汇添富基金管理有限公司关于调整旗下<br>基金持有的深发展 A、中国平安股票估<br>值方法的提示性公告       | 中国证券报、上海证<br>券报、证券时报、管<br>理人网站 | 2010 年 9 月 4 日   |
| 51 | 汇添富价值精选股票型证券投资基更新<br>招募说明书摘要                               | 中国证券报、上海证<br>券报、证券时报、管<br>理人网站 | 2010 年 9 月 4 日   |
| 52 | 汇添富价值精选股票型证券投资基更新<br>招募说明书                                 | 管理人网站                          | 2010 年 9 月 4 日   |
| 53 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金<br>在中投证券开通基金定投业务并参加定<br>投费率优惠活动的公告       | 中国证券报、上海证<br>券报、证券时报、管<br>理人网站 | 2010 年 9 月 30 日  |
| 54 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分<br>基金在长江证券开通基金定投业务的公<br>告                | 中国证券报、上海证<br>券报、证券时报、管<br>理人网站 | 2010 年 10 月 20 日 |
| 55 | 汇添富价值精选股票型证券投资基金<br>2010 年第 3 季度报告                         | 中国证券报、上海证<br>券报、证券时报、管<br>理人网站 | 2010 年 10 月 27 日 |
| 56 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分<br>基金在直销网上交易平台开通后端收费<br>业务的公告            | 中国证券报、上海证<br>券报、证券时报、管<br>理人网站 | 2010 年 11 月 5 日  |
| 57 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金<br>增加国联证券为代销机构及国联证券网<br>上交易基金申购费率优惠的公告   | 中国证券报、上海证<br>券报、证券时报、管<br>理人网站 | 2010 年 11 月 19 日 |
| 58 | 汇添富基金管理有限公司关于调整旗下<br>基金持有的“双汇发展”股票估值方法<br>的提示性公告           | 中国证券报、上海证<br>券报、证券时报、管<br>理人网站 | 2010 年 12 月 3 日  |
| 59 | 汇添富基金管理有限公司关于直销网上<br>交易系统开通“定期不定额”基金交易<br>业务的公告            | 中国证券报、上海证<br>券报、证券时报、管<br>理人网站 | 2010 年 12 月 10 日 |
| 60 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分<br>基金在宁波银行开展后端收费业务的公<br>告                | 中国证券报、上海证<br>券报、证券时报、管<br>理人网站 | 2010 年 12 月 13 日 |

|    |  |                        |                  |
|----|--|------------------------|------------------|
| 61 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金增加浙商证券为代销机构的公告                        | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 12 月 15 日 |
| 62 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海银行网上银行申购费率优惠活动的公告               | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 12 月 30 日 |
| 63 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告           | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 12 月 30 日 |
| 64 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国邮政储蓄银行网上交易系统申购费率优惠活动的公告       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 12 月 30 日 |
| 65 | 汇添富基金管理有限公司关于调整旗下基金在交通银行定投申购金额下限的公告                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 12 月 31 日 |
| 66 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行基金申购费率优惠活动的公告                 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 12 月 31 日 |
| 67 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与深圳发展银行基金申购费率优惠活动的公告             | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 12 月 31 日 |
| 68 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行 2011 倾心回馈基金定投申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2010 年 12 月 31 日 |

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

## 12.2 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

## 12.3 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](http://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  
2011 年 3 月 28 日