汇添富优势精选混合型证券投资基金
2011 年年度报告

2011 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

送出日期：**2012 年 3 月 30 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 2012 年 3 月 20 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 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 6
3.3 过去三年基金的利润分配情况 8
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
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
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 15
§6 审计报告 15
§7 年度财务报表 16
7.1 资产负债表 16
7.2 利润表 17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 18
7.4 报表附注 19
§8 投资组合报告 40
8.1 期末基金资产组合情况 40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 40
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 41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 43
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 44
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 45
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 45
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 45
8.9 投资组合报告附注 45
§9 基金份额持有人信息 46

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46
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 46
§10 开放式基金份额变动 46
§11 重大事件揭示 46
11.1 基金份额持有人大会决议 46
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 47
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
11.4 基金投资策略的改变 47
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 48
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 48
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 48
11.8 其他重大事件 50
§12 备查文件目录 54
12.1 备查文件目录 54
12.2 存放地点 54
12.3 查阅方式 54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富优势精选混合型证券投资基金
基金简称	汇添富优势精选混合
基金主代码	519008
前端交易代码	519008
后端交易代码	519009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 8 月 25 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	1,460,843,104.93 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	投资具有持续竞争优势的企业，分享其在中国经济持续高速成长背景下的长期优异业绩，为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采用适度动态资产配置策略，同时运用汇添富持续竞争优势企业评估系统自下而上精选个股，并对投资组合进行积极而有效的风险管理。
业绩比较基准	70%×沪深 300 指数收益率+30%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金是精选股票、并且进行积极风险控制的混合型基金，本基金的风险和预期收益比较均衡，在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。

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	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 楼 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	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-192,678,760.00	286,403,368.66	1,430,936,520.17
本期利润	-945,844,660.15	318,211,125.54	2,028,188,222.08
加权平均基金份额本期利润	-0.6276	0.1785	1.0364
本期加权平均净值利润率	-27.17%	6.95%	39.89%
本期基金份额净值增长率	-24.32%	8.05%	52.07%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	-163,327,922.42	273,249,378.17	897,770,457.36
期末可供分配基金份额利润	-0.1118	0.1717	0.4681
期末基金资产净值	2,835,784,517.79	4,330,420,098.70	5,777,075,321.59
期末基金份额净值	1.9412	2.7207	3.0123
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	324.38%	460.72%	418.97%

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。

3.2 基金净值表现

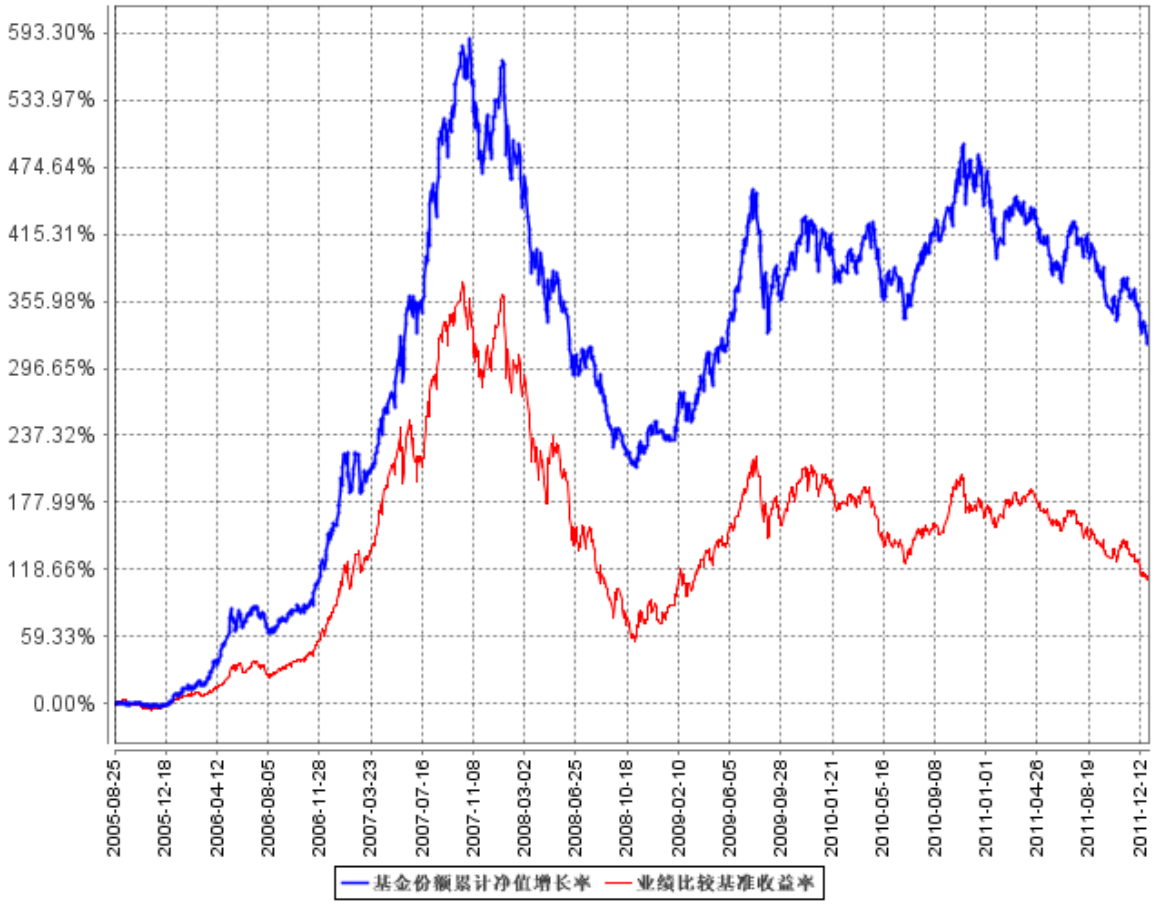
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-6.22%	1.06%	-6.02%	0.98%	-0.20%	0.08%
过去六个月	-15.27%	1.04%	-15.40%	0.95%	0.13%	0.09%
过去一年	-24.32%	1.08%	-16.30%	0.91%	-8.02%	0.17%
过去三年	24.36%	1.33%	22.83%	1.17%	1.53%	0.16%
过去五年	63.82%	1.55%	15.84%	1.50%	47.98%	0.05%
自基金合同生效日起至今	324.38%	1.48%	113.11%	1.40%	211.27%	0.08%

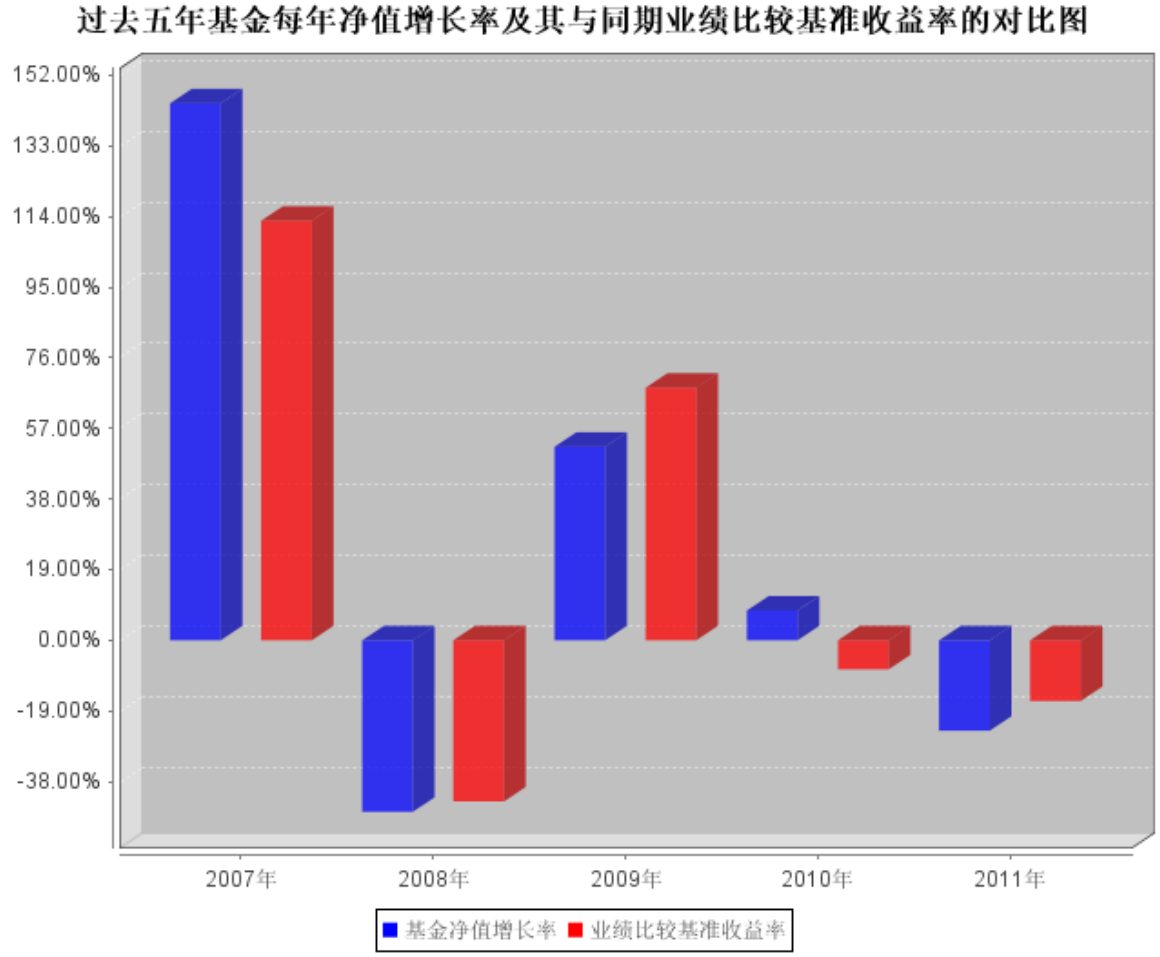
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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：本基金建仓期为本基金的《基金合同》生效之日（2005 年 8 月 25 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。

3.2.3 过去五年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



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
2011	1.500	101,471,877.12	134,935,861.04	236,407,738.16	
2010	4.700	440,647,443.86	399,519,460.37	840,166,904.23	
2009	-	-	-	-	
合计	6.200	542,119,320.98	534,455,321.41	1,076,574,642.39	

§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，总部设在上海陆家嘴，公司旗下设立了北京分公司、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)。

截至 2011 年 12 月，汇添富资产管理规模接近 600 亿元人民币，是业内最早一批获得 QDII 资格、

最早一批开展专户业务、首批获得 RQFII 资格的基金管理公司，同时也是全国社会保障基金的投资管理人。经过七年的发展，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。

2011 年，汇添富大力发展公募基金业务，全年新发 7 只基金，分别是汇添富保本混合基金、汇添富社会责任股票型基金，汇添富可转换债券基金、汇添富黄金及贵金属基金、汇添富深证 300ETF 基金及其联接基金，汇添富信用债债券基金。目前，公司共管理 19 只证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征的产品线。

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。2011 年，汇添富整体投资业绩继续保持行业优秀。

2011 年，汇添富专户业务快速发展，在全年市场大幅下跌的背景下， 13 只专户组合当年实现了正收益，专户业务综合实力和竞争力进一步提升。

2011 年，汇添富国际业务取得重大突破，成为业内第一批获得 RQFII 资格、第一批获得 RQFII 外汇额度、第一批获得香港证监会产品批文、第一家在港正式发行 RQFII 产品的基金公司。

2011 年，汇添富正式开展社保组合管理，是业内少数几家在权益类和固定收益类产品上同时和社保展开合作的基金公司之一。

2011 年，汇添富电子商务业务实现跨越式发展，公司推出全国首张货币市场基金直接支付消费账单的信用卡——“添富信用卡”。该卡集信用卡消费信贷功能和基金投资功能于一体，开创了“货币基金支付消费账单”的新模式，在 “2012 WORLD 营销大会”中， “添富信用卡”营销项目获得 2011 年度金赢销奖中的最佳互动创新奖。

2011 年，汇添富着力实现贴心的客户服务与投资者教育工作。公司积极开展 “添富通行证升级”、“定投计算器”等活动，得到广大客户的大力支持和踊跃参与。同时，公司进一步大力开展“投资者见面会”、“添富之约”客户沙龙、投资者“走进汇添富”和“走进上市公司”等全方位的投资者服务与教育活动。

2011 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形式，不断丰富公益活动新内容，持续推进公益项目长期建设。在上海汇添富公益基金会的整体平台下，汇添富积极与社会组织、企业团体合作，举办了众多有影响力的活动，提升了基金业的整体社会形象。

展望 2012 年，基金行业仍将面临巨大的压力和挑战。汇添富全体员工将进一步发扬 “正直、激情、团队、客户第一、感恩”的企业价值观，不畏挑战，不惧困难，以更加积极的心态，大力深化变革，全面提升公司核心竞争力，为实现汇添富基金中长期发展目标打下更加坚实的基础，为中国基金业的繁荣发展做出贡献。

2011 年，汇添富凭借稳健的经营管理和优秀业绩，荣获权威机构评选的多个奖项：

1、汇添富优势精选混合基金荣获《中国证券报》评选的“2010 五年持续优胜混合型金牛基金”。

2、汇添富基金荣获《上海证券报》评选的 2010 年度“金基金•创新公司奖”。

3、汇添富策略回报股票基金荣获《上海证券报》评选的 2010 年度一年期“金基金•主动型股票基金奖”。

4、汇添富基金荣获《证券时报》评选的“2010 年度十大明星基金公司奖”。

5、汇添富策略回报股票基金荣获《证券时报》评选的“2010 年度股票型明星基金奖”。

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		
苏竞	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、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2007 年 10 月 8 日	-	8 年	国籍：中国。学历：上海海事大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任北京中国运载火箭技术研究院助理工程师、上海申银万国证券研究所高级研究员、上投摩根基金管理有限公司高级行业研究员、博时基金管理有限公司高级行业研究员。2006 年 9 月加入汇添富基金管理有限公司，任高级行业分析师，2007 年 3 月 6 日至 2007 年 10 月 7 日任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理助理，2007 年 10 月 8 日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理，2007 年 12 月 17 日至今任汇添富均衡增长股

					票型证券投资基金的基金经理，2008 年 7 月 8 日至今任汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
王栩	本基金的基金经理、汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理	2010 年 2 月 5 日	-	9 年	国籍：中国。学历：同济大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历：曾任上海永嘉投资管理有限公司研究员。2004 年 11 月加入汇添富基金管理有限公司任高级行业研究员，2009 年 11 月 30 日至 2010 年 2 月 4 日任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理助理，2010 年 2 月 5 日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理，2010 年 9 月 21 日至今任汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

□2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

□3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、

违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 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

注：本基金为混合型基金，股票投资对象主要是“持续竞争优势企业”，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

2011 年对于 A 股投资者而言是非常困难的一年。宏观方面，国内经济增速见顶回落，GDP 增速由 2010 年的 10.4%下降至 9.2%，而且呈逐季下滑的态势。居高不下的通胀压力迫使国内货币政策进一步紧缩，M2 增速由 2010 年的 19.7%降至 13.6%，存、贷款基准利率三次上调。国际方面，欧债危机由希腊、爱尔兰、葡萄牙等欧元区外围国家向意大利、西班牙等核心国家蔓延，并对全球的风险资产价格都产生显著的负面影响。与此同时，A 股市场仍继续大规模扩容，2011 年的融资总额达到 6818 亿元，对市场整体的估值水平造成进一步的压力。在多重压力之下，A 股市场 2011 年大幅下跌，沪深 300 指数下跌了 25.0%，中证 500 指数下跌 33.8%，有色金属、机械、汽车、建材等强周期性行业以及 IT、农业、医药等估值泡沫严重的成长性行业是下跌的重灾区。

回顾 2011 年的基金运作，本基金在资产配置和行业配置上都存在较多不足之处。首先是股票资产比例基本上保持在中等偏高的水平，四个季度的仓位分别是 90.8%、81.5%、79.3%、77.7%，尤其是二季度欧债危机升级之后减仓力度不足。其次是股票资产中中小盘成长股的总体比例偏高，对于 IT、医药、化工等行业中部分估值明显偏高的个股没有及时卖出。2011 年比较成功的操作是：一季度大幅增持金融行业；二季度增持煤炭、食品饮料行业，减持有色金属行业；三、四季度减持煤炭行业。总结 2011 年，本基金较好地贯彻了基金契约和原有的投资理念，致力于自下而上精选具有持续竞争优势的企业做中长期布局，但对于国内外经济、金融环境以及 A 股市场估值体系所发生的变化应对不足，对

基金持有人造成较大亏损，在此深表歉意。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年本基金的年收益率为-24.32%，同期业绩比较基准收益率-16.30%。

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 2012 年，本基金的观点如下：第一，2012 年投资者将面临比 2011 年更为困难的经济环境。中国经济转型势在必行，其困难和持续时间都不可低估，经济增速将从 9%以上下降一个台阶，在某些时期内甚至存在向下超调的可能性。第二，政府在财政政策上会趋于积极，但沉重的地方政府债务限制了政府的扩张能力，而货币政策和产业政策的放松程度可能成为 A 股市场的关键变量。第三，A 股市场在经历持续 5 年的快速扩容之后其估值体系可能会向成熟市场靠拢，目前盛行的追逐基本面趋势的成长股投资方法将面临挑战。综合上述因素，A 股市场 2012 年依然比较困难，但其中蕴含着的投资机会可能会多于 2011 年。本基金主要关注以下方面的投资机会。

第一，经济波动是企业的试金石，优秀的企业能够利用经济调整期大幅提高自身的竞争力，从而实现更可持续的长期高增长，正在到来的经济转型为投资者提供了发掘这类成长型企业的绝好机会。第二，目前 A 股市场整体估值水平并不高，货币政策和产业政策如果能够有较大程度放松，价值股有望获得估值提升的机会。第三，经济转型一般意味着会有新的支柱性产业出现，这将为投资者带来板块性的投资机会。

秉承过去六年多的投资理念，本基金在新的投资年度将继续遵循挑选可持续、有质量增长个股的一贯原则，为持有人创造价值，期待交出一份令投资者满意的答卷。

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、专项检查和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、固定收益部、集中交易室、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根据《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少一次，最多为 6 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 80%。若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金于 2011 年 3 月 14 日实施利润分配，每份基金份额派发红利 0.15 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

2011 年，本基金托管人在对汇添富优势精选混合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

2011 年，汇添富优势精选混合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优势精选混合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，汇添富优势精选混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 236,407,738.16 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优势精选混合型证券投资基金 2011 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

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富优势精选混合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优势精选混合型证券投资基金财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 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汇添富优势精选混合型证券投资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

	或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	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。 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。 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。
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，公允反映了汇添富优势精选混合型证券投资基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	郭杭翔 汤骏
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	2012 年 3 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富优势精选混合型证券投资基金

报告截止日： 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	395,870,674.33	243,403,879.16
结算备付金		1,825,510.08	7,638,610.27
存出保证金		1,345,021.31	2,339,412.56
交易性金融资产	7.4.7.2	2,428,682,449.91	4,124,897,707.13
其中：股票投资		2,208,137,449.91	4,025,267,707.13
基金投资		-	-
债券投资		220,545,000.00	99,630,000.00
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		12,651,985.82	-
应收利息	7.4.7.5	3,237,270.31	1,279,541.33
应收股利		-	-

应收申购款		175,543.33	3,681,108.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,843,788,455.09	4,383,240,259.09
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2011 年 12 月 31 日**	**上年度末 2010 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	38,515,024.45
应付赎回款		181,246.78	1,030,577.31
应付管理人报酬		3,757,515.17	5,620,715.24
应付托管费		626,252.55	936,785.90
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	598,683.64	3,785,927.73
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	2,840,239.16	2,931,129.76
负债合计		8,003,937.30	52,820,160.39
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,460,843,104.93	1,591,681,941.35
未分配利润	7.4.7.10	1,374,941,412.86	2,738,738,157.35
所有者权益合计		2,835,784,517.79	4,330,420,098.70
负债和所有者权益总计		2,843,788,455.09	4,383,240,259.09

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

□2、报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9412 元，基金份额总额 1,460,843,104.93 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富优势精选混合型证券投资基金

本报告期： 2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	**附注号**	**本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日**	**上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日**
一、收入		-873,081,061.11	422,752,824.44
1.利息收入		6,812,717.81	6,667,814.00
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,676,089.12	3,997,422.50

债券利息收入		2,932,457.93	2,144,442.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,204,170.76	525,949.21
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-127,031,920.20	382,496,671.15
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-153,881,794.11	350,654,693.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	939,284.60	9,529,624.07
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.14	25,910,589.31	22,312,353.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-753,165,900.15	31,807,756.88
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	304,041.43	1,780,582.41
减：二、费用		72,763,599.04	104,541,698.90
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	52,379,784.09	68,770,421.64
2．托管费	7.4.10.2.2	8,729,964.05	11,461,736.88
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.17	11,202,256.40	23,829,729.05
5．利息支出		-	27,653.30
其中：卖出回购金融资产支出		-	27,653.30
6．其他费用	7.4.7.18	451,594.50	452,158.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-945,844,660.15	318,211,125.54

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：汇添富优势精选混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	1,591,681,941.35	2,738,738,157.35	4,330,420,098.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-945,844,660.15	-945,844,660.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-130,838,836.42	-181,544,346.18	-312,383,182.60

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	150,516,546.76	209,004,817.51	359,521,364.27
2.基金赎回款	-281,355,383.18	-390,549,163.69	-671,904,546.87
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）	-	-236,407,738.16	-236,407,738.16
五、期末所有者权益（基金净值）	1,460,843,104.93	1,374,941,412.86	2,835,784,517.79
项目	**上年度可比期间 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）	1,917,819,766.71	3,859,255,554.88	5,777,075,321.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	318,211,125.54	318,211,125.54
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）	-326,137,825.36	-598,561,618.84	-924,699,444.20
其中：1.基金申购款	519,527,428.72	822,337,787.65	1,341,865,216.37
2.基金赎回款	-845,665,254.08	-1,420,899,406.49	-2,266,564,660.57
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）	-	-840,166,904.23	-840,166,904.23
五、期末所有者权益（基金净值）	1,591,681,941.35	2,738,738,157.35	4,330,420,098.70

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：

林利军	陈灿辉	王小练
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

汇添富优势精选混合型证券投资基金(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[2005]105 号文《关于同意汇添富优势精选混合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 2005 年 8 月 25 日正式生效，首次设立募集规模为 1,025,106,827.47 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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市的股票、债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。本基金的股票投资对象主要是“持续竞争优势企业”。所谓持续竞争优势企业是指公司治理结构完善、管理层优秀，并在生产、技术、市场、政策环境等经营层面上具有一方面或多方面难以被竞争对手在短时间所模仿或超越的竞争优势的企业。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%。

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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 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

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

卖出股票于成交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成交日结转；

（2）债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资；债券投资成本，按成交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；

卖出债券于成交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

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

卖出权证于成交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成交日结转；

（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。估值日无交易的但且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的，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；

C.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；

D.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的初始取得成本时，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的初始取得成本时，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。估值日无交易的但且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的，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。估值日无交易的且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的，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。估值日无交易的但且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的，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少一次，最多为 6 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 80%，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红利发放日前一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》，对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入，由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴 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 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	395,870,674.33	243,403,879.16
定期存款	-	-

其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	395,870,674.33	243,403,879.16

注：本基金 2011 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 2011 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,550,823,229.59	2,208,137,449.91	-342,685,779.68
债券	交易所市场	79,389,145.02	80,408,000.00	1,018,854.98
	银行间市场	139,463,002.46	140,137,000.00	673,997.54
	合计	218,852,147.48	220,545,000.00	1,692,852.52
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,769,675,377.07	2,428,682,449.91	-340,992,927.16
项目		上年度末 2010 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,613,181,934.14	4,025,267,707.13	412,085,772.99
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	99,542,800.00	99,630,000.00	87,200.00
	合计	99,542,800.00	99,630,000.00	87,200.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,712,724,734.14	4,124,897,707.13	412,172,972.99

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度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 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	68,788.73	37,398.68
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	821.40	2,673.50
应收债券利息	3,167,638.18	1,239,452.05
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	22.00	17.10
合计	3,237,270.31	1,279,541.33

注：其中“其他”指权证保证金利息。

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 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	598,458.64	3,785,927.73
银行间市场应付交易费用	225.00	-
合计	598,683.64	3,785,927.73

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	2,500,000.00	2,500,000.00
应付赎回费	239.16	1,129.76
预提信息披露费	340,000.00	340,000.00
预提审计费用	-	90,000.00
合计	2,840,239.16	2,931,129.76

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,591,681,941.35	1,591,681,941.35
本期申购	150,516,546.76	150,516,546.76
本期赎回（以“-”号填列）	-281,355,383.18	-281,355,383.18

本期末	1,460,843,104.93	1,460,843,104.93

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	273,249,378.17	2,465,488,779.18	2,738,738,157.35
本期利润	-192,678,760.00	-753,165,900.15	-945,844,660.15
本期基金份额交易产生的变动数	-7,490,802.43	-174,053,543.75	-181,544,346.18
其中：基金申购款	5,455,342.23	203,549,475.28	209,004,817.51
基金赎回款	-12,946,144.66	-377,603,019.03	-390,549,163.69
本期已分配利润	-236,407,738.16	-	-236,407,738.16
本期末	-163,327,922.42	1,538,269,335.28	1,374,941,412.86

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,609,659.43	3,901,174.16
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	767.10	623.17
结算备付金利息收入	65,330.41	92,233.04
其他	332.18	3,392.13
合计	2,676,089.12	3,997,422.50

注：表中“其他”指直销申购款利息收入；“其他存款利息收入”指保证金利息收入。

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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	3,983,903,285.83	8,487,348,782.00
减：卖出股票成本总额	4,137,785,079.94	8,136,694,088.38
买卖股票差价收入	-153,881,794.11	350,654,693.62

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31

	月31日	日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	336,650,186.00	329,544,872.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	332,671,508.89	317,781,525.62
减：应收利息总额	3,039,392.51	2,233,722.31
债券投资收益	939,284.60	9,529,624.07

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	25,910,589.31	22,312,353.46
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	25,910,589.31	22,312,353.46

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-753,165,900.15	31,807,756.88
——股票投资	-754,771,552.67	31,720,556.88
——债券投资	1,605,652.52	87,200.00
——资产支持证券投资	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	-753,165,900.15	31,807,756.88

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	304,041.43	1,748,672.61
印花税返还	-	31,909.80
合计	304,041.43	1,780,582.41

7.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月

	31 日	31 日
交易所市场交易费用	11,200,506.40	23,828,929.05
银行间市场交易费用	1,750.00	800.00
合计	11,202,256.40	23,829,729.05

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00	90,000.00
信息披露费	340,000.00	340,000.00
银行划款费用	3,594.50	4,158.03
帐户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	451,594.50	452,158.03

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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的日后事项。

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
东航金戎控股有限责任公司	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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	1,564,302,934.28	22.18%	3,195,049,303.75	21.09%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东方证券股份有限公司	38,727,477.00	27.00%	43,228,229.90	21.39%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券股份有限公司	750,000,000.00	27.17%	-	-

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011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	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	1,304,257.72	22.19%	150,355.11	25.12%
关联方名称	上年度可比期间 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	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	2,627,195.51	20.87%	-	-

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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	52,379,784.09	68,770,421.64
其中：支付销售机构的客户维护费	5,421,700.91	6,331,668.51

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×1.5％÷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

□基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,729,964.05	11,461,736.88

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×0.25%÷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付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，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 2011 年度和 2010 年度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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	51,118,833.51	51,118,833.51
期间申购/买入总份额	-	-
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	51,118,833.51	51,118,833.51
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.50%	3.21%

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

本年度末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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	395,870,674.33	2,609,659.43	243,403,879.16	3,901,174.16

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 2011 年度及 2010 年度在承销期内均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	权益登记日	除息日	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	本期利润分配合计	备注

1	2011 年 3 月 14 日	2011 年 3 月 14 日	1.500	101,471,877.12	134,935,861.04	236,407,738.16	
合计	-	-	1.500	101,471,877.12	134,935,861.04	236,407,738.16	

7.4.12 期末（ 2011 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

本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家化	2011 年 12 月 30 日	重大事项停牌	34.09	2012 年 1 月 4 日	34.75	520,000	14,015,054.55	17,726,800.00	-

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发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金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 2011 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	395,870,674.33	-	-	-	-	-	395,870,674.33
结算备付金	1,825,510.08	-	-	-	-	-	1,825,510.08
存出保证金	48,780.49	-	-	-	-	1,296,240.82	1,345,021.31
交易性金融资	-	30,093,000.00	110,044,000.00	-	80,408,000.00	2,208,137,449.91	2,428,682,449.91

产							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	12,651,985.82	12,651,985.82
应收利息	-	-	-	-	-	3,237,270.31	3,237,270.31
应收申购款	10,048.53	-	-	-	-	165,494.80	175,543.33
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	397,755,013.43	30,093,000.00	110,044,000.00	-	80,408,000.00	2,225,488,441.66	2,843,788,455.09
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	181,246.78	181,246.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,757,515.17	3,757,515.17
应付托管费	-	-	-	-	-	626,252.55	626,252.55
应付交易费用	-	-	-	-	-	598,683.64	598,683.64
其他负债	-	-	-	-	-	2,840,239.16	2,840,239.16
负债总计	-	-	-	-	-	8,003,937.30	8,003,937.30
利率敏感度缺口	397,755,013.43	30,093,000.00	110,044,000.00	-	80,408,000.00	2,217,484,504.36	2,835,784,517.79
上年度末 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	243,403,879.16	-	-	-	-	-	243,403,879.16
结算备付金	7,638,610.27	-	-	-	-	-	7,638,610.27
存出保证金	48,780.49	-	-	-	-	2,290,632.07	2,339,412.56
交易性金融资产	-	99,630,000.00	-	-	-	4,025,267,707.13	4,124,897,707.13
应收利息	-	-	-	-	-	1,279,541.33	1,279,541.33
应收申购款	3,778.53	-	-	-	-	3,677,330.11	3,681,108.64
资产总计	251,095,048.45	99,630,000.00	-	-	-	4,032,515,210.64	4,383,240,259.09
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	38,515,024.45	38,515,024.45
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,030,577.31	1,030,577.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,620,715.24	5,620,715.24
应付托管费	-	-	-	-	-	936,785.90	936,785.90
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,785,927.73	3,785,927.73
其他负债	-	-	-	-	-	2,931,129.76	2,931,129.76
负债总计	-	-	-	-	-	52,820,160.39	52,820,160.39
利率敏感度缺口	251,095,048.45	99,630,000.00	-	-	-	3,979,695,050.25	4,330,420,098.70

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。		
	5.该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券。		
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（ 2011 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2010 年 12 月 31 日 ）
	0.25%	-153,103.16	-52,122.56
	-0.25%	153,460.50	52,176.46

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	2,208,137,449.91	77.87	4,025,267,707.13	92.95
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	220,545,000.00	7.78	99,630,000.00	2.30
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,428,682,449.91	85.64	4,124,897,707.13	95.25

注：本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 40%-95%；债券为 0%-50%；权证为 0%-3%；现金类资产不低于 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所示。

7.4.13.4.2.2 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，即与基金所投资证券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（ 2011 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2010 年 12 月 31 日 ）
	5%	95,230,581.56	170,945,068.99
	-5%	-95,230,581.56	-170,945,068.99

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	2,208,137,449.91	77.65
	其中：股票	2,208,137,449.91	77.65
2	固定收益投资	220,545,000.00	7.76
	其中：债券	220,545,000.00	7.76
	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	397,696,184.41	13.98
6	其他各项资产	17,409,820.77	0.61
7	合计	2,843,788,455.09	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	-	-

B	采掘业	175,248,246.32	6.18
C	制造业	966,645,056.59	34.09
C0	食品、饮料	448,025,089.47	15.80
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	39,019,496.11	1.38
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	33,267,915.00	1.17
C7	机械、设备、仪表	82,822,004.19	2.92
C8	医药、生物制品	363,510,551.82	12.82
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	219,447,623.68	7.74
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	76,807,409.60	2.71
H	批发和零售贸易	245,361,807.44	8.65
I	金融、保险业	393,406,556.04	13.87
J	房地产业	80,078,597.64	2.82
K	社会服务业	51,142,152.60	1.80
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,208,137,449.91	77.87

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	000869	张　裕A	1,416,323	152,821,251.70	5.39
2	002081	金 螳 螂	3,720,826	131,307,949.54	4.63
3	000858	五 粮 液	3,699,784	121,352,915.20	4.28
4	600036	招商银行	9,446,912	112,134,845.44	3.95
5	600519	贵州茅台	493,354	95,365,328.20	3.36
6	600079	人福医药	4,202,219	80,976,760.13	2.86
7	000001	深发展A	4,575,261	71,328,318.99	2.52
8	300039	上海凯宝	3,265,305	67,853,037.90	2.39
9	600887	伊利股份	3,091,699	63,163,410.57	2.23
10	601601	中国太保	3,099,957	59,550,173.97	2.10
11	002230	科大讯飞	1,491,700	52,209,500.00	1.84
12	002159	三特索道	3,479,058	51,142,152.60	1.80

13	600280	南京中商	1,900,019	47,557,475.57	1.68
14	000501	鄂武商 A	3,079,337	46,959,889.25	1.66
15	601318	中国平安	1,349,826	46,488,007.44	1.64
16	002004	华邦制药	1,300,000	44,200,000.00	1.56
17	002007	华兰生物	1,707,113	42,694,896.13	1.51
18	601699	潞安环能	2,000,000	42,320,000.00	1.49
19	600000	浦发银行	4,882,000	41,448,180.00	1.46
20	000581	威孚高科	1,153,683	41,405,682.87	1.46
21	600208	新湖中宝	11,985,610	40,990,786.20	1.45
22	002140	东华科技	1,749,669	40,242,387.00	1.42
23	000718	苏宁环球	7,459,506	39,087,811.44	1.38
24	600327	大东方	5,383,405	38,868,184.10	1.37
25	600276	恒瑞医药	1,306,159	38,453,320.96	1.36
26	601166	兴业银行	2,957,758	37,031,130.16	1.31
27	601899	紫金矿业	9,687,459	37,006,093.38	1.30
28	002353	杰瑞股份	524,800	36,736,000.00	1.30
29	600970	中材国际	2,239,900	35,300,824.00	1.24
30	600997	开滦股份	3,166,741	35,277,494.74	1.24
31	600697	欧亚集团	1,249,934	33,310,741.10	1.17
32	000708	大冶特钢	3,422,625	33,267,915.00	1.17
33	600729	重庆百货	826,607	26,401,827.58	0.93
34	601288	农业银行	9,704,542	25,425,900.04	0.90
35	000590	紫光古汉	2,699,395	25,023,391.65	0.88
36	000516	开元投资	4,500,000	22,185,000.00	0.78
37	600704	物产中大	2,714,521	21,281,844.64	0.75
38	600315	上海家化	520,000	17,726,800.00	0.63
39	000538	云南白药	324,409	17,193,677.00	0.61
40	600690	青岛海尔	1,877,656	16,767,468.08	0.59
41	600406	国电南瑞	499,933	15,597,909.60	0.55
42	600809	山西汾酒	242,670	15,322,183.80	0.54
43	600267	海正药业	443,260	14,082,370.20	0.50
44	002099	海翔药业	735,718	13,757,926.60	0.49
45	000968	煤 气 化	888,000	12,654,000.00	0.45
46	000961	中南建设	1,496,017	12,596,463.14	0.44
47	601717	郑煤机	500,000	12,435,000.00	0.44
48	600141	兴发集团	708,704	12,111,751.36	0.43
49	000983	西山煤电	770,867	11,254,658.20	0.40
50	600521	华海药业	1,000,000	11,000,000.00	0.39
51	600588	用友软件	500,000	9,000,000.00	0.32

52	600778	友好集团	908,765	8,796,845.20	0.31
53	002349	精华制药	382,225	8,275,171.25	0.29
54	002126	银轮股份	596,124	8,143,053.84	0.29
55	600688	S 上石化	1,225,705	7,292,944.75	0.26
56	300124	汇川技术	75,107	4,070,799.40	0.14
57	002250	联化科技	100,000	1,888,000.00	0.07

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	601288	农业银行	137,208,258.18	3.17
2	601699	潞安环能	105,875,641.72	2.44
3	600016	民生银行	104,096,282.00	2.40
4	600970	中材国际	100,184,462.30	2.31
5	601166	兴业银行	99,759,202.82	2.30
6	600720	祁连山	98,835,587.87	2.28
7	601899	紫金矿业	86,897,265.64	2.01
8	300039	上海凯宝	84,163,189.83	1.94
9	600000	浦发银行	80,134,311.65	1.85
10	000629	攀钢钒钛	77,281,600.50	1.78
11	600688	S 上石化	76,157,261.63	1.76
12	000968	煤气化	72,029,469.50	1.66
13	600805	悦达投资	69,549,323.06	1.61
14	601601	中国太保	68,759,620.62	1.59
15	600887	伊利股份	66,929,198.72	1.55
16	600208	新湖中宝	66,865,259.37	1.54
17	000718	苏宁环球	64,455,866.51	1.49
18	600809	山西汾酒	61,831,544.03	1.43
19	000937	冀中能源	61,537,874.44	1.42
20	000708	大冶特钢	59,690,034.77	1.38

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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比

				例（%）
1	000629	攀钢钒钛	217,363,151.24	5.02
2	000937	冀中能源	165,381,009.08	3.82
3	601288	农业银行	113,869,708.54	2.63
4	600016	民生银行	112,120,000.00	2.59
5	600720	祁连山	94,483,339.37	2.18
6	002007	华兰生物	90,297,028.07	2.09
7	600575	芜湖港	89,826,706.84	2.07
8	002215	诺普信	84,937,733.81	1.96
9	002415	海康威视	80,933,757.37	1.87
10	000961	中南建设	73,719,471.57	1.70
11	601808	中海油服	72,205,765.17	1.67
12	600000	浦发银行	69,372,259.02	1.60
13	002326	永太科技	69,115,491.04	1.60
14	600395	盘江股份	67,788,075.68	1.57
15	002128	露天煤业	67,500,037.97	1.56
16	002081	金螳螂	67,387,636.19	1.56
17	600805	悦达投资	63,238,024.92	1.46
18	600251	冠农股份	62,970,435.82	1.45
19	600050	中国联通	59,612,163.82	1.38
20	600688	S 上石化	59,201,343.72	1.37

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	3,075,426,375.39
卖出股票收入（成交）总额	3,983,903,285.83

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	-	-
3	金融债券	110,044,000.00	3.88
	其中：政策性金融债	110,044,000.00	3.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,093,000.00	1.06
6	中期票据	-	-

7	可转债	80,408,000.00	2.84
8	其他	-	-
9	合计	220,545,000.00	7.78

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	110015	石化转债	800,000	80,408,000.00	2.84
2	020206	02 国开 06	600,000	59,934,000.00	2.11
3	110242	11 国开 42	500,000	50,110,000.00	1.77
4	1181133	11 汉江 CP01	300,000	30,093,000.00	1.06

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 本基金投资前十名证券五粮液（000858）于 2011 年 5 月 27 日受到证监会行政处罚,该上市公司于 2009 年 9 月被证监会立案调查之初，我司即对其可能产生的影响进行过研究评估，认为此事件并不影响其经营业绩，不会对其投资价值造成较大影响。本基金一直重仓持有该股，并经过合理的投资决策授权审批。

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	1,345,021.31
2	应收证券清算款	12,651,985.82
3	应收股利	-
4	应收利息	3,237,270.31
5	应收申购款	175,543.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,409,820.77

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	80,408,000.00	2.84

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(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
164,227	8,895.27	256,514,594.60	17.56%	1,204,328,510.33	82.44%

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	942,356.40	0.06%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2005 年 8 月 25 日 ）基金份额总额	1,025,106,827.47
本报告期期初基金份额总额	1,591,681,941.35
本报告期基金总申购份额	150,516,546.76
减:本报告期基金总赎回份额	281,355,383.18
本报告期期末基金份额总额	1,460,843,104.93

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、《汇添富保本混合型证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 26 日正式生效，陆文磊先生任该基金的基金经理。

2、《汇添富社会责任股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 3 月 29 日正式生效，欧阳沁春先生任该基金的基金经理。

3、《汇添富可转换债券债券型证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 17 日正式生效，王珏池先生任该基金的基金经理。

4、基金管理人 2011 年 6 月 22 日公告，王珏池先生不再担任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理，陆文磊先生继续担任该基金的基金经理。

5、基金管理人 2011 年 6 月 22 日公告，陆文磊先生不再担任汇添富货币市场基金的基金经理，王珏池先生继续担任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2011 年 8 月 13 日公告，经汇添富基金管理有限公司第二届董事会第二十六次会议审议决定，因工作变动，解聘于东升先生公司副总经理职务。

7、《汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）基金合同》于 2011 年 8 月 31 日正式生效，刘子龙先生任该基金的基金经理。

8、《深证 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 16 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

9、《汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2011 年 9 月 28 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

10、基金管理人 2011 年 11 月 26 日公告，何仁科先生不再担任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理，吴振翔先生继续担任该基金的基金经理。

11、《汇添富信用债债券型证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 20 日正式生效，王珏池先生任该基金的基金经理。

12、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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（2005 年 8 月 25 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内已支付当期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	1,564,302,934.28	22.18%	1,304,257.72	22.19%	-
长江证券	1	725,797,034.72	10.29%	616,923.89	10.50%	-
中信证券	1	579,451,516.59	8.22%	470,807.98	8.01%	-
东吴证券	1	480,693,505.37	6.82%	408,588.45	6.95%	-
国泰君安	1	405,627,619.96	5.75%	329,574.60	5.61%	-
平安证券	1	385,687,500.23	5.47%	313,372.96	5.33%	-
齐鲁证券	1	377,312,940.56	5.35%	306,570.09	5.22%	-
中投证券	1	354,314,693.46	5.02%	301,165.54	5.12%	-
东北证券	2	278,458,514.37	3.95%	226,249.00	3.85%	-
湘财证券	1	275,565,109.90	3.91%	234,228.09	3.99%	-
中信建投	1	246,848,123.90	3.50%	209,819.59	3.57%	-
银河证券	1	231,647,677.84	3.28%	196,900.33	3.35%	-
恒泰证券	1	212,940,789.93	3.02%	173,015.70	2.94%	-
华宝证券	1	157,416,786.33	2.23%	133,804.29	2.28%	-
广发证券	1	151,320,063.04	2.15%	128,619.89	2.19%	-
海通证券	1	134,232,944.90	1.90%	114,097.82	1.94%	-
国信证券	2	124,161,683.41	1.76%	100,882.44	1.72%	-
国金证券	2	92,987,934.12	1.32%	75,553.40	1.29%	-
中银国际	1	86,981,276.23	1.23%	73,933.71	1.26%	-
申银万国	1	85,325,145.27	1.21%	72,525.43	1.23%	-
长城证券	1	43,228,724.26	0.61%	36,744.17	0.63%	-
联合证券	1	42,790,272.67	0.61%	36,371.54	0.62%	-
中金公司	2	16,021,923.00	0.23%	13,017.90	0.22%	-

兴业证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

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		债券回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券	38,727,477.00	27.00%	750,000,000.00	27.17%
长江证券	-	-	500,000,000.00	18.12%
中信证券	-	-	-	-
东吴证券	28,713,294.30	20.02%	760,000,000.00	27.54%
国泰君安	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-
湘财证券	-	-	300,000,000.00	10.87%
中信建投	6,376,891.70	4.45%	-	-
银河证券	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-
广发证券	-	-	250,000,000.00	9.06%
海通证券	69,608,254.60	48.53%	200,000,000.00	7.25%
国信证券	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-

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、 报告期内未新增和退租证券公司交易单元。

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 2010 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	2011 年 1 月 4 日
2	汇添富优势精选混合型证券投资基金 2010 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 1 月 21 日
3	汇添富基金管理有限公司关于增加杭州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	2011 年 2 月 17 日
4	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与杭州银行开展的网上银行申购和定投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	2011 年 3 月 8 日
5	汇添富优势精选混合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	2011 年 3 月 10 日
6	汇添富基金管理有限公司关于开通汇付天天盈账户进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 3 月 17 日
7	汇添富优势精选混合型证券投资基金 2010 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	2011 年 3 月 28 日
8	汇添富优势精选混合型证券投资基金 2011 年年度报告	管理人网站	2011 年 3 月 28 日
9	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金继续参与中国工商银行个	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网	2011 年 3 月 30 日

	人电子银行申购基金费率优惠活动的公告	站	
10	汇添富基金管理有限公司关于开通通联支付进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 3 月 30 日
11	汇添富优势精选混合型证券投资基金更新招募说明书	管理人网站	2011 年 3 月 31 日
12	汇添富优势精选混合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	2011 年 4 月 1 日
13	汇添富优势精选混合型证券投资基金 2011 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 4 月 22 日
14	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 4 月 25 日
15	汇添富基金管理有限公司关于开通招商银行 i 理财进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 4 月 27 日
16	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与江苏银行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	2011 年 4 月 29 日
17	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金在中信证券开通基金定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 4 月 29 日
18	汇添富基金管理有限公司关于增加上海农商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	2011 年 5 月 9 日
19	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海农商银行开展的网上银行申购和定投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	2011 年 5 月 16 日
20	汇添富基金管理有限公司关于增加恒泰长财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	2011 年 5 月 17 日
21	汇添富基金管理有限公司关于增加中航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	2011 年 5 月 27 日
22	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	2011 年 5 月 28 日
23	汇添富基金管理有限公司关于开通上海银行借记卡进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 5 月 30 日

24	汇添富基金管理有限公司关于增加财通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	2011 年 6 月 7 日
25	汇添富基金管理有限公司关于调整旗下基金持有的“鄂武商 A”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	2011 年 6 月 10 日
26	添富基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行电子渠道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	2011 年 6 月 29 日
27	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与中信银行电子渠道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	2011 年 6 月 29 日
28	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商证券开展的电子交易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	2011 年 6 月 29 日
29	关于招商银行 i 理财账户持有人通过汇添富网上直销系统申购基金费率调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 6 月 30 日
30	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金 2011 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	2011 年 7 月 1 日
31	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与厦门证券开展的网上交易系统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	2011 年 7 月 11 日
32	汇添富基金管理有限公司关于南方分公司办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 14 日
33	汇添富基金管理有限公司关于增加长城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	2011 年 7 月 15 日
34	汇添富基金管理有限公司关于香港子公司办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 19 日
35	汇添富优势精选混合型证券投资基金 2011 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	2011 年 7 月 20 日
36	汇添富基金管理有限公司关于投资者利益保护的温馨提示	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 21 日
37	汇添富基金管理有限公司关于增加南京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	2011 年 8 月 12 日

38	汇添富基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 8 月 13 日
39	汇添富优势精选混合型证券投资基金 2010 年半年度报告	管理人网站	2011 年 8 月 24 日
40	汇添富优势精选混合型证券投资基金 2011 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 8 月 24 日
41	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华宝证券开展的网上交易系统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	2011 年 8 月 30 日
42	添富基金管理有限公司关于网上直销系统使用中国农业银行借记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	2011 年 8 月 31 日
43	汇添富基金管理有限公司关于增加红塔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	2011 年 9 月 26 日
44	汇添富优势精选混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2011 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 10 月 10 日
45	汇添富优势精选混合型证券投资基金更新招募说明书（2011 年第 2 号）	管理人网站	2011 年 10 月 10 日
46	汇添富基金管理有限公司关于增加五矿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	2011 年 10 月 14 日
47	汇添富基金管理有限公司关于增加天源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	2011 年 10 月 14 日
48	汇添富优势精选混合型证券投资基金 2011 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 10 月 26 日
49	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券开展的网上交易系统申购和定投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	2011 年 11 月 4 日
50	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与江苏银行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	2011 年 11 月 29 日
51	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与中国民族证券网上交易系统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	2011 年 11 月 29 日

52	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开展的电子渠道申购和定投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	2011 年 11 月 29 日
53	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行 2012 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	2011 年 11 月 29 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优势精选混合型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富优势精选混合型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富优势精选混合型证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富优势精选混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

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 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
2012 年 3 月 30 日