

# 汇添富上证综合指数证券投资基金 2011 年年度报告摘要

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

### 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富上证综合指数
基金主代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 7 月 1 日
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	6,173,284,679.65 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%,且年化跟踪误差小于 6%,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性,主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35% 且年化跟踪误差小于 6% 的投资目标。
业绩比较基准	上证综合指数收益率×95% + 银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。

### 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

### 2.4 信息披露方式

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

### § 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 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-20,377,404.52	-124,968,393.97	136,435,477.21
本期利润	-1,048,848,625.33	-967,325,237.92	459,360,518.60
加权平均基金份额本期利润	-0.1641	-0.1395	0.0537
本期基金份额净值增长率	-20.11%	-14.37%	5.10%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2810	-0.1002	0.0174
期末基金资产净值	4,438,404,254.07	6,641,430,279.71	7,308,929,815.32
期末基金份额净值	0.719	0.900	1.051

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 7 月 1 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 2011 年 12 月 31 日数据，特此说明。

#### 3.2 基金净值表现

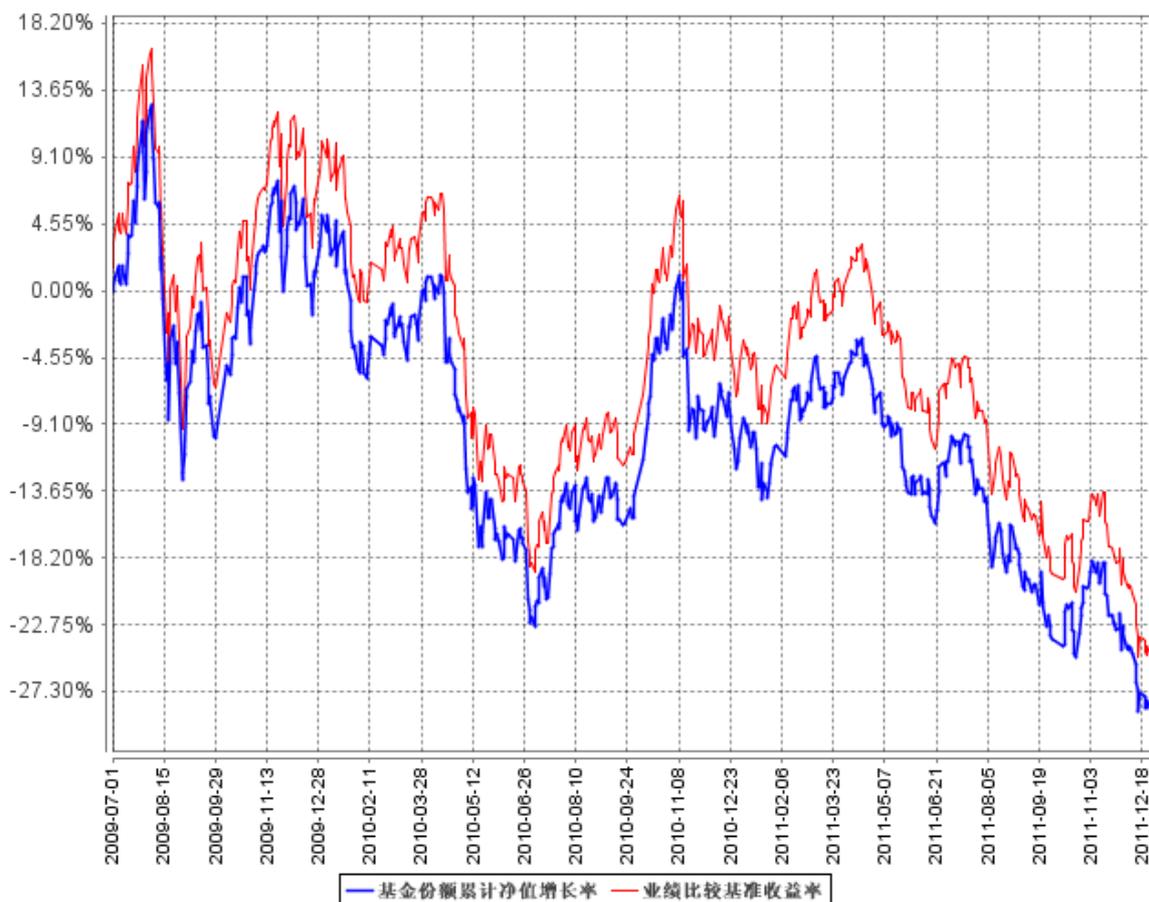
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.77%	1.18%	-6.43%	1.18%	0.66%	0.00%
过去六个月	-18.67%	1.16%	-19.34%	1.16%	0.67%	0.00%
过去一年	-20.11%	1.10%	-20.57%	1.10%	0.46%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	-28.10%	1.40%	-24.35%	1.39%	-3.75%	0.01%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2009 年 7 月 1 日，至本报告期末未满三年。

### 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

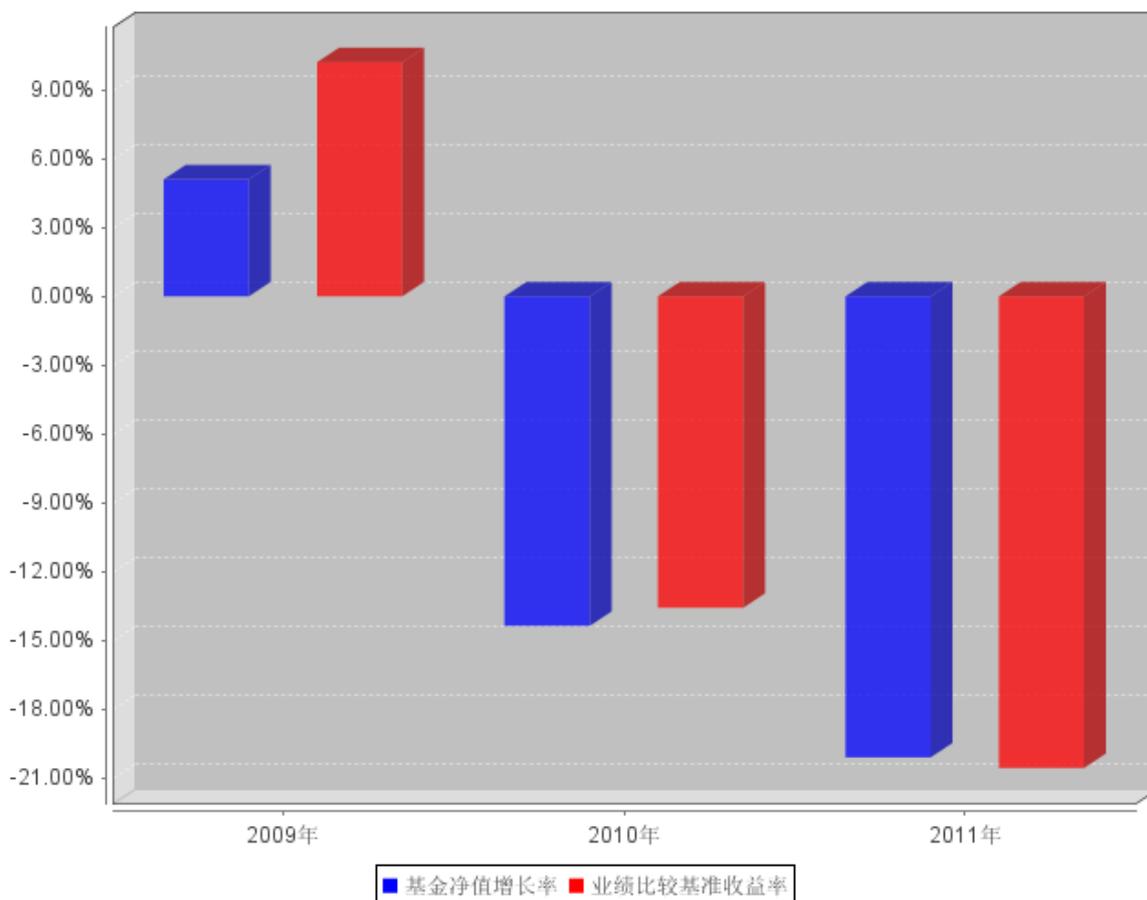
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2009年7月1日）起3个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

### 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 7 月 1 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

本基金成立于 2009 年 7 月 1 日，2009 年度、2010 年度和 2011 年度均未进行利润分配。

## § 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		
何仁科	本基金的基金经理，另类投资小组负责人。	2009 年 7 月 1 日	2011 年 11 月 25 日	10 年	国籍:中国。学历:华中科技大学数量经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任东方证券股份有限公司研究所高级经理。2004 年 12 月加入汇添富基金管理有限公司任产品与金融工程部副总监、产品创新部总监、另类投资小组负责人，2009 年 7 月 1 日至 2011 年 11 月 25 日任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。
吴振翔	本基金的基金经理，深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，汇添富深证 300 交易型	2010 年 2 月 5 日	-	5 年	国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理有限

	<p>开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p>			<p>公司任金融工程研究员，2010年1月8日至2010年2月4日任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理助理，2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理，2011年9月16日至今任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2011年9月28日至今任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p>
--	------------------------------	--	--	---

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

本基金为指数型基金，采用被动化投资跟踪上证综合指数的收益率，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 年上半年通货膨胀是市场关注的重点，也是政府工作的首要目标，央行在加息的同时也数次上调准备金率来控制通胀，这些工作在下半年出现了成效，三季度通胀基本得到遏制，四季度出现了回调，实现经济软着陆转而成为首要任务，货币政策则呈微调态势，为了对冲外汇占款数据的变化，存款准备金率在 4 季度也出现了一次下调，一定程度上反映了政府对通胀得到控制之后经济增长的回落担忧。A 股市场受制于政策调控和对经济增长的担忧，全年基本上呈现下跌的态势。本基金遵循了指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。本基金股票投资仓位在报告期内基本保持在 92%~95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

本基金对抽样复制组合继续采取缓冲式调整，以降低了冗余的交易量，报告期内抽样复制组合领先于上证综合指数中小盘股票的市场表现，我们将继续观察抽样复制方法在后续投资过程中的适用性。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

上证综合指数下跌了 21.68%，本基金在报告期内累计收益率为-20.11%，同期业绩比较基准收益率为-20.57%，收益领先业绩比较基准 0.46%。收益率的差异因素主要来源于托管行股票替代、申购赎回、小股票替代组合与实际组合差异等因素的综合作用。本基金日均跟踪误差为 0.085%，这一跟踪误差水平远低于 0.35%，在报告期达到了投资目标。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间，CPI 回落将是大概率事件，经济增长回落已成为政策和证券市场更加关注的问题，同时，企业盈利在经济增速和通胀回落的过程中可能出现较大幅度下滑。在此种大背景下，央行将在继续实行积极的财政政策和稳健的货币政的同时，货币政策操作上将趋于灵活，信贷宽松可能会逐步展开。同时进出口增速的下降和房地产市场的调整将是经济增长的两大风险。外围市场中，全球经济继续缓慢复苏，欧洲将继续面临严重问题，从而继续影响我国的外需，将可能导致外需继续下降。综合考虑政府的积极财政政策、稳健偏灵活的货币政策以及保障房的持续建设对房地产市场的对冲，经济实现软着陆将是大概率事件。

整体来看，2012 年 A 股市场将处于底部震荡，中枢逐步抬升的趋势。目前 A 股市场经过前期的大幅调整，估值水平已处于历史低位，下降空间相对有限。伴随着政策的缓步放松、流动性的改善，A 股市场的投资机会初现。

作为被动投资的指数型基金，汇添富上证综合指数基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的指数化投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。我们也非常期望添富上证能继续与投资者一起分享中国经济的美好未来。

#### 4.6 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。

#### 4.7 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：每年度 6 月和 12 月的最后一个交易日每份基金份额可供分配利润超过 0.02 元时，至少将期末可供分配利润的 20% 进行收益分配。本基金 2011 年 6 月 30 日可供分配基金份额利润为 -0.1160 元，2011 年 12 月 31 日可供分配基金份额利润为 -0.2810，未达到收益分配的基准，因此本年度本基金未进行利润分配。

## § 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上证综合指数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，汇添富上证综合指数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上证综合指数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，汇添富上证综合指数证券投资基金未进行利润分配。

### 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上证综合指数证券投资基金 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

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所审计，注册会计师徐艳、汤骏于 2012 年 3 月 29 日签字出具了安永华明(2012)审字第 60466941\_B09 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	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	331,664,602.79	155,284,697.55
结算备付金	-	126,941.53

存出保证金	300,000.00	583,333.31
交易性金融资产	4,110,133,446.45	6,475,938,084.01
其中：股票投资	4,107,465,833.45	6,278,778,084.01
基金投资	-	-
债券投资	2,667,613.00	197,160,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	12,159,627.62
应收利息	65,523.67	3,616,536.94
应收股利	-	-
应收申购款	228,055.58	1,878,397.89
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,442,391,628.49	6,649,587,618.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2011 年 12 月 31 日</b>	<b>2010 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	-	-
应付赎回款	204,397.26	1,765,145.50
应付管理人报酬	2,868,965.27	4,306,886.93
应付托管费	573,793.06	861,377.38
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	797,032.78
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	340,218.83	426,896.55
负债合计	3,987,374.42	8,157,339.14
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6,173,284,679.65	7,381,183,450.73
未分配利润	-1,734,880,425.58	-739,753,171.02
所有者权益合计	4,438,404,254.07	6,641,430,279.71
负债和所有者权益总计	4,442,391,628.49	6,649,587,618.85

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.719 元，基金份额总额 6,173,284,679.65 份。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

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	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-996,100,644.31	-903,789,412.56
1.利息收入	4,714,512.85	5,404,490.70
其中：存款利息收入	1,483,261.19	1,849,916.23
债券利息收入	3,231,251.66	3,554,574.47
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）	25,867,962.72	-69,031,973.39
其中：股票投资收益	-56,334,468.64	-147,451,967.07
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,563,052.89	2,393,862.36
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	76,639,378.47	76,026,131.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,028,471,220.81	-842,356,843.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,788,100.93	2,194,914.08
<b>二、费用</b>	52,747,981.02	63,535,825.36
1. 管理人报酬	41,206,201.14	47,394,335.77
2. 托管费	8,241,240.24	9,478,867.12
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,849,534.90	6,141,710.91
5. 利息支出	12,182.74	80,614.06
其中：卖出回购金融资产支出	12,182.74	80,614.06
6. 其他费用	438,822.00	440,297.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-1,048,848,625.33	-967,325,237.92

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

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）	7,381,183,450.73	-739,753,171.02	6,641,430,279.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,048,848,625.33	-1,048,848,625.33
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）	-1,207,898,771.08	53,721,370.77	-1,154,177,400.31
其中：1.基金申购款	770,508,856.59	-109,928,699.87	660,580,156.72
2.基金赎回款	-1,978,407,627.67	163,650,070.64	-1,814,757,557.03
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）	6,173,284,679.65	-1,734,880,425.58	4,438,404,254.07
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）	6,956,558,846.35	352,370,968.97	7,308,929,815.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-967,325,237.92	-967,325,237.92
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）	424,624,604.38	-124,798,902.07	299,825,702.31
其中：1.基金申购款	2,613,850,079.11	-220,104,634.67	2,393,745,444.44
2.基金赎回款	-2,189,225,474.73	95,305,732.60	-2,093,919,742.13
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）	7,381,183,450.73	-739,753,171.02	6,641,430,279.71

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

汇添富上证综合指数证券投资基金(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”)证监许可[2009]371号文《关于核准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人汇添富基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2009年7月1日正式生效,首次设立募集规模为9,097,758,651.47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与注册登记机构均为汇添富基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要包括上海证券交易所上市交易的所有股票、新股(如一级市场初次发行或增发)等。如以后法律法规及中国证监会允许基金投资其他金融工具,如股指期货、ETF等,本基金可以依照法律法规或监管机构的规定,将其纳入投资范围。本基金为被动式指数基金,原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性,主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%且年化跟踪误差小于6%的投资目标。本基金的业绩比较基准为:上证综合指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

### 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 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 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、基金注册登记机构
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

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 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	1,067,731,009.85	72.14%	639,100,039.10	15.86%

##### 7.4.8.1.2 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	2,626,092.50	2.90%	-	-

##### 7.4.8.1.3 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	907,572.63	72.14%	-	-
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	542,957.73	15.86%	-	-

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。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 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	41,206,201.14	47,394,335.77
其中：支付销售机构的客户维护费	8,150,414.38	14,323,084.65

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

□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。

#### 7.4.8.2.2 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	8,241,240.24	9,478,867.12

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

□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。

### 7.4.8.3 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。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 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	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	43,496,625.00	43,496,625.00
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	43,496,625.00	43,496,625.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.70%	0.59%

#### 7.4.8.4.2 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。

#### 7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		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	331,664,602.79	1,477,042.17	155,284,697.55	1,754,196.75

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。

#### 7.4.8.6 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。

### 7.4.9 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

#### 7.4.9.2 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	591,881	10,922,425.58	20,177,223.29	-
600820	隧道股份	2011 年 12 月 27 日	重组停牌	7.87	2012 年 1 月 4 日	8.15	1,156,017	14,412,723.05	9,097,853.79	-
600132	重庆啤酒	2011 年 12 月 23 日	重大事项停牌	28.45	2012 年 1 月 10 日	25.61	135,697	2,782,114.28	3,860,579.65	-

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 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。

##### 7.4.9.3.2 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。

#### 7.4.10 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	4,107,465,833.45	92.46
	其中：股票	4,107,465,833.45	92.46
2	固定收益投资	2,667,613.00	0.06
	其中：债券	2,667,613.00	0.06
	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	331,664,602.79	7.47
6	其他各项资产	593,579.25	0.01

7	合计	4,442,391,628.49	100.00
---	----	------------------	--------

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 指数投资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	21,201,202.14	0.48
B	采掘业	907,458,392.14	20.45
C	制造业	989,466,243.11	22.29
C0	食品、饮料	136,085,455.61	3.07
C1	纺织、服装、皮毛	18,521,560.37	0.42
C2	木材、家具	6,456,466.70	0.15
C3	造纸、印刷	6,234,605.85	0.14
C4	石油、化学、塑胶、塑料	105,175,947.02	2.37
C5	电子	43,502,528.93	0.98
C6	金属、非金属	197,563,716.77	4.45
C7	机械、设备、仪表	348,031,233.28	7.84
C8	医药、生物制品	117,497,505.74	2.65
C99	其他制造业	10,397,222.84	0.23
D	电力、煤气及水的生产和供应业	160,098,284.72	3.61
E	建筑业	95,424,629.98	2.15
F	交通运输、仓储业	190,421,962.98	4.29
G	信息技术业	110,861,227.20	2.50
H	批发和零售贸易	87,912,988.56	1.98
I	金融、保险业	1,315,694,888.75	29.64
J	房地产业	122,158,633.01	2.75
K	社会服务业	47,548,056.21	1.07
L	传播与文化产业	19,578,307.41	0.44
M	综合类	39,641,017.24	0.89
	合计	4,107,465,833.45	92.54

### 8.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未进行积极投资。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601857	中国石油	45,440,035	442,585,940.90	9.97

2	601288	农业银行	83,788,153	219,524,960.86	4.95
3	601988	中国银行	59,802,100	174,622,132.00	3.93
4	600028	中国石化	19,850,786	142,528,643.48	3.21
5	601088	中国神华	4,681,746	118,588,626.18	2.67
6	600036	招商银行	9,214,871	109,380,518.77	2.46
7	600016	民生银行	18,349,549	108,078,843.61	2.44
8	601628	中国人寿	5,911,754	104,283,340.56	2.35
9	601328	交通银行	21,466,227	96,168,696.96	2.17
10	601939	建设银行	15,941,065	72,372,435.10	1.63

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 网站的年度报告正文。

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未进行积极投资。

## 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	601558	华锐风电	18,940,158.23	0.29
2	601118	海南橡胶	15,370,758.00	0.23
3	601992	金隅股份	14,692,091.87	0.22
4	601258	庞大集团	9,718,985.06	0.15
5	601933	永辉超市	7,186,085.05	0.11
6	601098	中南传媒	6,884,990.30	0.10
7	600015	华夏银行	6,483,497.00	0.10
8	601216	内蒙君正	5,966,021.02	0.09
9	600016	民生银行	5,924,276.52	0.09
10	601857	中国石油	5,914,278.00	0.09
11	601998	中信银行	5,434,607.61	0.08
12	601519	大智慧	5,369,567.89	0.08
13	600827	友谊股份	5,113,204.00	0.08
14	600028	中国石化	3,736,272.02	0.06
15	600376	首开股份	3,431,296.67	0.05
16	601088	中国神华	3,167,572.28	0.05
17	600005	武钢股份	2,987,190.20	0.04

18	601989	中国重工	2,857,148.81	0.04
19	600309	烟台万华	2,627,011.95	0.04
20	601628	中国人寿	2,583,039.44	0.04

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	601857	中国石油	146,622,127.01	2.21
2	601988	中国银行	62,355,239.78	0.94
3	601288	农业银行	58,907,212.25	0.89
4	600028	中国石化	46,510,532.66	0.70
5	600036	招商银行	45,114,289.74	0.68
6	601088	中国神华	37,518,558.91	0.56
7	601628	中国人寿	35,356,697.26	0.53
8	600050	中国联通	30,482,856.16	0.46
9	601328	交通银行	27,174,866.69	0.41
10	601166	兴业银行	27,075,730.77	0.41
11	600000	浦发银行	23,884,863.16	0.36
12	601318	中国平安	19,265,950.52	0.29
13	600519	贵州茅台	14,386,202.87	0.22
14	601818	光大银行	12,158,989.77	0.18
15	601111	中国国航	11,792,318.36	0.18
16	600132	重庆啤酒	11,708,899.55	0.18
17	600311	荣华实业	11,257,206.69	0.17
18	600031	三一重工	11,149,076.19	0.17
19	601998	中信银行	11,044,933.88	0.17
20	601601	中国太保	11,000,369.91	0.17

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	209,770,687.50
卖出股票收入（成交）总额	1,294,040,535.61

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,667,613.00	0.06
8	其他	-	-
9	合计	2,667,613.00	0.06

### 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	110018	国电转债	15,600	1,653,444.00	0.04
2	110017	中海转债	11,050	1,014,169.00	0.02

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

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	300,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	65,523.67
5	应收申购款	228,055.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	593,579.25
---	----	------------

### 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

#### 8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未进行积极投资，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
122,302	50,475.75	878,095,081.58	14.22%	5,295,189,598.07	85.78%

### 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	394,782.52	0.01%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年7月1日）基金份额总额	9,097,758,651.47
本报告期期初基金份额总额	7,381,183,450.73
本报告期基金总申购份额	770,508,856.59
减：本报告期基金总赎回份额	1,978,407,627.67
本报告期末基金份额总额	6,173,284,679.65

注：表内“总申购份额”含转换入份额；“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（2009 年 7 月 1 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捌万元整。

### 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	1,067,731,009.85	72.14%	907,572.63	72.14%	-
长江证券	1	208,417,573.60	14.08%	177,153.88	14.08%	-
中投证券	1	114,367,023.26	7.73%	97,212.10	7.73%	-
中信建投	1	61,415,331.29	4.15%	52,202.55	4.15%	-
银河证券	1	28,105,685.99	1.90%	23,889.71	1.90%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

联合证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东方证券	2,626,092.50	2.90%
长江证券	-	-
中投证券	-	-
中信建投	87,961,466.40	97.10%
银河证券	-	-
中金公司	-	-
东北证券	-	-
兴业证券	-	-
东吴证券	-	-
长城证券	-	-
国金证券	-	-
申银万国	-	-
国信证券	-	-
华宝证券	-	-
湘财证券	-	-
中银国际	-	-
联合证券	-	-
广发证券	-	-
海通证券	-	-
平安证券	-	-
江海证券	-	-

恒泰证券		
中信证券		
国泰君安		
齐鲁证券		

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、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

此 30 个交易单元与汇添富优势精选混合型证券投资基金共用。本基金本报告期内未新增和退租证券公司交易单元。

汇添富基金管理有限公司  
2012 年 3 月 30 日