汇添富均衡增长股票型证券投资基金

2009年第三季度报告

2009年9月30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:2009年10月29日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年10月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富均衡增长股票
交易代码	519018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年8月7日
报告期末基金份额总额	27,109,595,253.72份
投资目标	本基金应用“由上而下”和“自下而上”相结合的投资策略,通过行业的相对均衡配置和投资布局于具有持续增长潜质的企业,在有效控制风险的前提下,分享中国经济的持续增长,以持续稳定地获取较高的投资回报。
投资策略	本基金采用“由上而下”和“自下而上”相结合的投资方法,适度动态调整资产配置,行业保持相对均衡配置,同时通过三级过滤模型(Tri-Filtering Model)来构建核心股票池,深入剖析核心股票池企业的增长逻辑和增长战略,以达到审慎精选,并对投资组合进行积极而有效的风险管理。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是主动型的股票基金,属于证券投资基金中风险偏上的品种。
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年07月01日至2009年09月30日)
1.本期已实现收益	1,647,969,299.89
2.本期利润	-1,051,915,000.03
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0382
4.期末基金资产净值	20,880,549,433.98
5.期末基金份额净值	0.7702

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

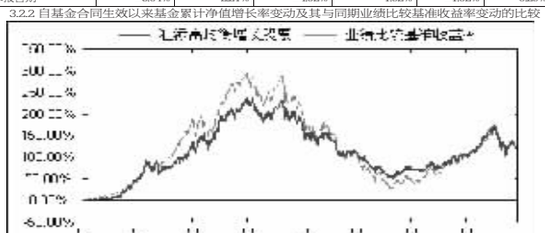
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
本报告期	-5.04%	2.21%	-4.02%	1.92%	-1.02%	0.29%

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



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2006年8月7日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
庞飒	本基金的基金经理、汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理。	2006年4月7日	-	9年	国籍:中国。学历:浙江大学生命科学院理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任申银万国证券研究所行业分析师、富国基金管理有限公司行业分析师及投资策略小组成员。2005年4月加入汇添富基金管理有限公司,2006年5月22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。2006年4月7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。
欧阳沁春	本基金的基金经理。	2007年6月18日	-	8年	国籍:中国。学历:卫生部武汉生物制品研究所医学硕士、中欧国际工商学院工商管理硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任卫生部武汉生物制品研究所助理研究员、中国网络(百慕大)有限公司项目经理、大成基金管理有限公司行业研究员、国联安基金管理有限公司行业研究员。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、汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理助理,2007年6月18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。
苏竞	本基金的基金经理、汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2007年12月17日	-	6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、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6月18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4月15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。

注:1、基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

2、基金经理的证券从业年限按其从事证券研究分析、投资管理等业务的年限计算。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已依据中国证监会《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

本基金注重周期、增长、稳定和能源四大类行业的相对均衡配置,是行业均衡配置风格的股票型基金,截止报告期,与本基金管理人旗下其他基金风格不同。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

一改前期单边上涨格局,三季度股票市场出现了大幅振荡行情。分析其原因,本基金认为:8月份开始,市场对货币政策的预期改变是市场调整的导火索。7月份本基金延续2季度的资产和行业配置,依然重配金融、地产、煤炭等大类行业,但是进入8月份对市场调整的幅度和方向偏差,没有第一时间降低股票仓位,减持与宏观经济相关的大类资产,给基金的净值造成了一定的损失。本基金迅速调整投资策略,在9月份加大了医药、商业贸易和食品饮料等稳定类行业的配置,并且在这些行业中精选个股,取得了不错的超额收益。

展望四季度,本基金持谨慎乐观的观点:随着宏观经济政策的刺激作用逐步发酵,企业盈利可望延续回升态势,业绩同比和环比增长率都将比较明显,只是短期内在流动性支持力度弱化的背景下,股票的整体估值水平将稳中有降,融资开闸也会制约股票市场的短期上升空间。因此,本基金预期股票市场4季度将呈震荡态势,企业业绩将取代政策和流动性成为四季度股票市场走势的关键驱动因素。另外,我们还要关注本轮国内外经济调整之后,经济增长来源的结构将发生很大变化,内需的消费和投资将成为中长期驱动经济增长的支点。具体到行业配置,本基金相对看好金融、商业零售、食品饮料、汽车、电力设备等增长相对确定的行业;与此同时,也将继续关注周期类行业在业绩恢复背景下的阶段性投资机会。本基金在保持投资组合适度均衡的前提下,积极寻找新的投资机会,为持有人继续创造收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	17,953,684,402.02	85.37
	其中:股票	17,953,684,402.02	85.37
2	固定收益投资	746,230,260.00	3.55
	其中:债券	746,230,260.00	3.55
	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	2,270,426,781.19	10.80
6	其他资产	60,135,157.11	0.29
7	合计	21,030,476,600.32	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	1,732,477,724.24	8.30
C	制造业	7,097,949,939.26	33.99
C0	食品、饮料	2,021,647,672.15	9.68
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	26,079,543.60	0.12
C3	造纸、印刷	182,554,135.38	0.87
C4	石油、化学、塑胶、塑料	568,833,543.90	2.72
C5	电子	46,510,000.00	0.22
C6	金属、非金属	920,655,177.23	4.41
C7	机械、设备、仪表	2,022,878,899.20	9.69
C8	医药、生物制品	1,308,790,967.80	6.27
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	97,147,286.52	0.47
E	建筑业	1,010,948,221.29	4.84
F	交通运输、仓储业	107,420,761.64	0.51
G	信息技术业	801,714,678.69	3.84
H	批发和零售贸易	1,228,243,526.91	5.88
I	金融、保险业	3,767,377,317.70	18.04
J	房地产业	777,882,956.51	3.73
K	社会服务业	162,657,147.50	0.78
L	传播与文化产业	293,916,140.67	1.41
M	综合类	875,948,701.09	4.20
	合计	17,953,684,402.02	85.98

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	6,705,355	1,105,444,825.30	5.29
2	601166	兴业银行	27,973,777	945,233,924.83	4.53
3	601318	中国平安	14,629,816	741,731,671.20	3.55
4	600000	浦发银行	27,741,591	545,122,263.15	2.61
5	002024	苏宁电器	32,965,736	540,308,413.04	2.59
6	600028	中国石化	38,400,305	433,923,446.50	2.08
7	000961	中南建设	24,449,832	420,781,608.72	2.02
8	601169	北京银行	23,287,979	401,251,878.17	1.92
9	600048	保利地产	15,639,455	377,536,443.70	1.81
10	600104	上海汽车	18,846,939	372,227,045.25	1.78

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	510,248,000.00	2.44
3	金融债券	229,978,000.00	1.10
	其中:政策性金融债	229,978,000.00	1.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	6,004,260.00	0.03
7	其他	-	-
8	合计	746,230,260.00	3.57

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0901037	09央票37	2,000,000	199,340,000.00	0.95
2	0901047	09央票47	2,000,000	199,340,000.00	0.95
3	060413	06农发13	1,300,000	130,208,000.00	0.62
4	090404	09农发04	1,000,000	99,770,000.00	0.48
5	0701085	07央票85	800,000	81,352,000.00	0.39

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	22,325,030.89
2	应收证券清算款	27,637,875.63
3	应收股利	3,515,068.33
4	应收利息	5,586,749.31
5	应收申购款	1,070,432.95
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	60,135,157.11

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告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未持有流通受限股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	28,128,790,956.04
报告期期间基金总申购份额	416,541,723.74
报告期期间基金总赎回份额	1,435,737,426.06
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	27,109,595,253.72

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

7.1.1 中国证监会批准汇添富均衡增长股票型证券投资基金募集的文件;
7.1.2《汇添富均衡增长股票型证券投资基金合同》;
7.1.3《汇添富均衡增长股票型证券投资基金托管协议》;
7.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照;
7.1.5 报告期内汇添富均衡增长股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;
7.1.6 中国证监会要求的其他文件。

7.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理有限公司

7.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,或登录基金管理人网站www.99fund.com查阅,还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-888-9918查询相关信息。

汇添富基金管理有限公司
2009年10月29日

汇添富成长焦点股票型证券投资基金

2009年第三季度报告

2009年9月30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:2009年10月29日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年10月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富成长焦点股票
交易代码	519068
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月12日
报告期末基金份额总额	10,269,007,900.35份
投资目标	本基金是主动股票型基金,精选成长性较高,且估值有吸引力的股票进行布局,在有效管理风险的前提下,追求中长期较高的投资回报。
投资策略	本基金采用积极的资产配置和股票投资策略。在资产配置中,通过资产战略配置和战术配置来确定每一阶段投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例;在股票投资中,采用“自下而上”的策略,精选出成长性较高,且估值有吸引力的股票,精心构建股票投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。
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	本基金为主动股票型基金,属于证券投资基金中风险偏上的品种。
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年07月01日至2009年09月30日)
1.本期已实现收益	1,338,454,266.46
2.本期利润	-406,896,167.58
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0379
4.期末基金资产净值	11,149,496,836.31
5.期末基金份额净值	1.0857

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

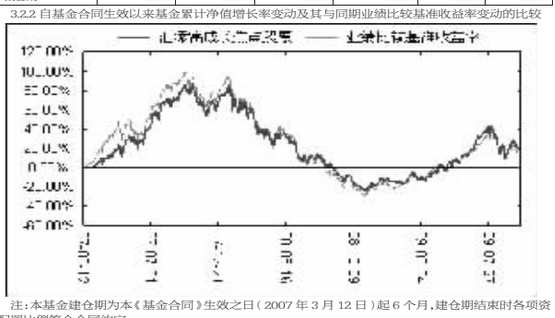
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
本报告期	-4.28%	2.23%	-4.02%	1.92%	-0.26%	0.31%

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



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2007年3月12日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁建军	本基金的基金经理。	2006年9月5日	2009年7月28日	12年	国籍:中国。学历:上海交通大学工学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任华夏证券研究所高级分析师,2005年4月加入汇添富基金管理有限公司,历任高级行业研究员、研究主管、投资决策委员会成员,2006年9月5日至2009年7月28日任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理。
齐东超	本基金的基金经理,投资研究总部研究总监助理。	2009年7月28日	-	5年	国籍:中国。学历:清华大学工学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任海通证券研究所证券分析师,2005年4月加入汇添富基金管理有限公司,任行业分析师、投资研究总部研究总监助理,2009年2月2日任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理助理,2009年7月28日至今任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理。

注:1、基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

2、基金经理的证券从业年限按其从事证券研究分析、投资管理等业务的年限计算。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已依据中国证监会《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

本基金为成长风格的股票型基金,截止报告期,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

支撑市场上半年单边上涨的流动性以及流动性预期在三季度出现了反复,引发指数大幅振荡。上半年的三大明星板块金融、地产和资源在三季度的调整幅度尤为明显,相当一部分的股票价格几乎回到二季度上涨前的水平。相应地,以医药、食品饮料和其他消费品为代表的稳定成长类资产在三季度表现出色。

本基金在三季度继续维持较高仓位运作,并严格遵照契约精神,增持了原有组合中传统的核心成长类标的,同时新增持了一批竞争优势突出、成长预期明确且估值合理的标的,并逐步减持了一批宏观经济关联度高的标的。我们认为,目前的资产组合自下而上的特征更趋明显,抗风险性和平衡性都有所加强。

如前所述,上半年的市场走势,主线就是周期类资产的重估。经过第三季度的泡沫化后的大幅调整,可以判断这轮建立在2008年过度恐慌基础上的重估已经告一段落。具体来看,如工程机械、家电、水泥、造船、造纸、纺织服装等行业,05-07年数量上的高增长必将难以为继,因而估值上升空间有限,未来股价上行推动力主要依赖于盈利的增长。

在流动性方面,随着各项经济指标趋于正常化(目前,仅存不正常的指标是过高的投资增速和货币增速),无论是货币政策还是财政政策,问题的核心已经不是退出与否,而是退出的时间窗口。上半年以流动性为主要脉络,自上而下大类资产波澜壮阔的系统性行情也必将告一段落。

相比而言,从更长的眼光来看,成长类资产的机会则显得更为清晰。虽然大类的周期资产数量上的故事告一段落,但经济转型意味着很多新的业态模式只是刚刚起步。一些新技术、新服务和新的商业模式等将迎来一轮蓬勃发展期,并有望获得高质量的高速成长。

因此,逐步降低自上而下的策略配置,以调结构为导向精选个股的自下而上的投资将会成为未来较长一段时间市场运行的主线。我们也将秉持这一思路,严守基金契约,加大自下而上选股力度,为持有人创造持续收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	9,900,257,502.15	88.39
	其中:股票	9,900,257,502.15	88.39
2	固定收益投资	199,340,000.00	1.78
	其中:债券	199,340,000.00	1.78
	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	1,089,987,559.28	9.73
6	其他资产	10,911,931.29	0.10
7	合计	11,200,496,992.72	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	1,369,637,796.08	12.28
C	制造业	2,949,448,283.88	26.45
C0	食品、饮料	1,181,425,314.69	10.60
C1	纺织、服装、皮毛	19,946,571.84	0.18
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	109,811,129.08	0.98
C4	石油、化学、塑胶、塑料	143,300,426.08	1.29
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	211,270,353.42	1.89
C7	机械、设备、仪表	398,434,982.80	3.57
C8	医药、生物制品	885,259,505.97	7.94
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	125,142,612.20	1.12
E	建筑业	455,927,107.16	4.09
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	517,954,931.66	4.65
H	批发和零售贸易	870,100,227.49	7.80
I	金融、保险业	2,376,356,086.75	21.31
J	房地产业	495,715,124.86	4.45
K	社会服务业	285,833,325.00	2.56
L	传播与文化产业	6,378,516.60	0.06
M	综合类	447,763,490.47	4.02
	合计	9,900,257,502.15	88.80

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	5,141,490	847,626,041.40	7.60
2	002024	苏宁电器	43,746,511	717,005,315.29	6.43
3	601318	中国平安	11,053,138	560,394,096.60	5.03
4	002007	华兰生物	9,568,347	497,554,044.00	4.46
5	601166	兴业银行	13,513,728	456,628,869.12	4.10
6	601939	建设银行	76,132,292	424,818,189.36	3.81
7	600000	浦发银行	21,573,259	423,914,539.35	3.80
8	600415	小商品城	9,446,141	374,067,183.60	3.36
9	600546	中油化建	12,836,531	296,010,404.86	2.65
10	000069	华侨城A	15,450,450	285,833,325.00	2.56

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	199,340,000.00	1.79
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	-	-
7	其他	-	-
8	合计	199,340,000.00	1.79

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0901047	09央票47	2,000,000	199,340,000.00	1.79

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,434,888.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,665,868.37
4	应收利息	204,005.96
5	应收申购款	1,607,168.07
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,911,931.29

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	11,342,677,671.48
报告期期间基金总申购份额	491,650,800.88
报告期期间基金总赎回份额	1,565,320,572.01
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	10,269,007,900.35

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

7.1.1 中国证监会批准汇添富成长焦点股票型证券投资基金募集的文件;
7.1.2《汇添富成长焦点股票型证券投资基金合同》;
7.1.3《汇添富成长焦点股票型证券投资基金托管协议》;
7.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照;
7.1.5 报告期内汇添富成长焦点股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;
7.1.6 中国证监会要求的其他文件。

7.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理有限公司

7.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,或登录基金管理人网站www.99fund.com查阅,还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-888-9918查询相关信息。

汇添富基金管理有限公司
2009年10月29日

汇添富增强收益债券型证券投资基金

2009年第三季度报告

2009年9月30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:2009年10月29日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年10月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富增强收益债券
基金运作方式	契约型开放式
交易代码	519078
基金合同生效日	2008年3月6日
报告期末基金份额总额	2,565,535,411.30份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,主要投资于债券等固定收益类品种和其他低风险品种,力求为基金份额持有人谋求持续稳定的投资收益。
投资策略	类属资产配置由本基金管理人根据宏观经济分析、债券基准收益率研究、不同类别债券利差水平研究,判断不同类别债券类属的相对投资价值,并确定不同债券类属在组合资产中的配置比例。
业绩比较基准	中债总指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。
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
下属两级基金的基金简称	汇添富增强收益债券A　汇添富增强收益债券C
下属两级基金的交易代码	519078　470078
报告期末下属两级基金的份额总额	2,564,511,119.47份　1,024,291.83份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	汇添富增强收益债券A 报告期(2009年07月01日至2009年09月30日)	汇添富增强收益债券C 报告期(2009年09月15日至2009年09月30日)
1.本期已实现收益	26,986,404.03	328.09
2.本期利润	9,849,899.03	-2,283.17
3.加权平均基金份额本期利润	0.0042	-0.0032
4.期末基金资产净值	2,679,697,924.66	1,069,881.28
5.期末基金份额净值	1.045	1.045

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、本基金自2009年9月15日起增加C类收费模式,该模式只收取赎回费和销售服务费,不收取申购费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富增强收益债券A:

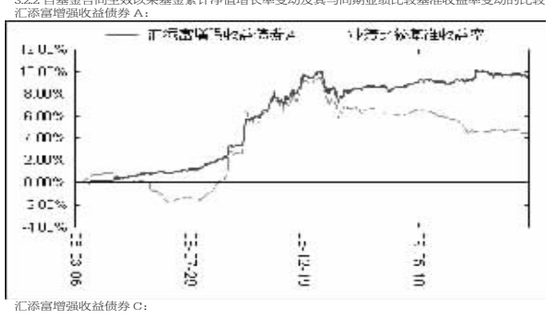
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
本报告期	0.48%	0.10%	-1.21%	0.06%	1.69%	0.04%

汇添富增强收益债券C:

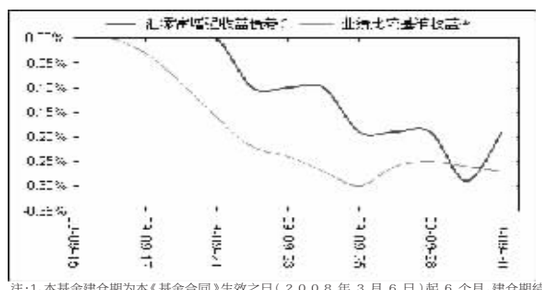
阶段	净值增长率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
本报告期	-0.19%	0.06%	-0.27%	0.03%	0.08%	0.03%

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

汇添富增强收益债券A:



汇添富增强收益债券C:



注:1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2008年3月6日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

2、本基金自2009年9月15日起增加C类收费模式,该类别基金的累计份额净值增长率和业绩比较