汇添富货币市场基金

2008年第三季度报告

基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2008 年 10 月 21 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2008 年 10 月 17 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 2008 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	添富货币	
基金运作方式	契约型开放式基金	
基金合同生效日	2006年 3 月 23 日	
报告期末基金份额总额	4,896,198,472.49 份	
投资目标	力求在本金稳妥和基金资产高流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略,力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。	
业绩比较基准	银行一年期定期存款的税后利率:(1－利息税率)×银行一年期定期储蓄存款利率。	
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。	
基金管理人	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	添富货币 A 级	添富货币 B 级
下属两级基金的交易代码	519618	519617
报告期末下属两级基金的份额总额	376,215,974.27 份	4,519,982,498.22 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

1

主要财务指标	A级基金报告期(2008 年 7 月 1 日 –2008 年 9 月 30 日)	B级基金报告期(2008 年 7 月 1 日 –2008 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	1,603,582.85	13,133,090.69
2.本期利润	1,603,582.85	13,133,090.69
3.期末基金资产净值	376,215,974.27	4,519,982,498.22

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

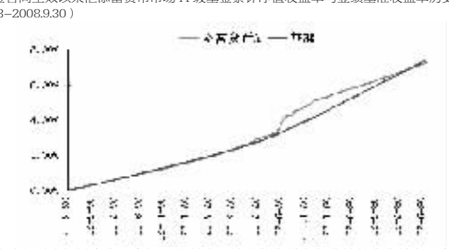
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

分级基金	阶段	净值收益率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
A级基金	本报告期	0.6878%	0.0015%	0.9886%	0.0000%	–0.3008%	0.0015%
B级基金	本报告期	0.7482%	0.0015%	0.9886%	0.0000%	–0.2404%	0.0015%

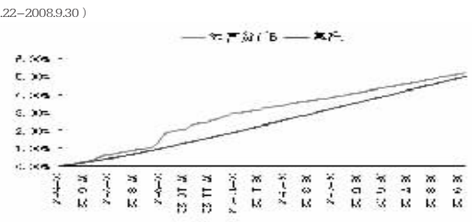
注:本基金收益分配按月结转份额

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

自基金合同生效以来汇添富货币市场 A 级基金累计净值收益率与业绩基准收益率历史走势对比图(2006.3.23–2008.9.30)



自基金分级以来汇添富货币市场 B 级基金累计净值收益率与业绩基准收益率历史走势对比图(2007.5.22–2008.9.30)



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2006 年 3 月 23 日)起 6 个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王珏池	本基金的基金经理、汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。	2006年 3 月 23 日	–	14年	国籍:中国。学历:澳门科技大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任申银万国证券股份有限公司固定收益总部投资部经理。2005 年 4 月加入汇添富基金管理有限公司任交易主管,2006 年 3 月 23 日至今任汇添富货币市场基金的基金经理,2008 年 3 月 6 日至今任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

本基金为货币市场基金,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

报告期内,国际环境发生重大变化,美国次贷危机愈演愈烈,全球经济继续调整格局。受其影响,国内经济数据不容乐观,PPI 维持高位运行,而 CPI 则开始逐渐回落;新增贷款增长幅度下降,企业景气指数回落。总体而言,报告期内通胀压力有所缓解,经济景气程度进一步下降。

由于预期宏观调控有望放松、三季度债券市场投资环境明显转暖,特别是 9 月份央行宣布降低“双率”后,做多的情绪被彻底点燃,债券市场快速上涨,中长期品种上升幅度创近年之最,收益率曲线出现的明显的扁平化态势,甚至出现了收益率曲线的“倒挂”现象。债券市场的剧烈变化明显地影响了货币市场各期限的债券收益率变化。总体上,货币市场收益率曲线出现了以一年期央票为基准的扁平化趋势。

报告期内,本基金延长了组合久期,至报告期末,组合剩余期限为 172 天,同时,保持了企业短期融资券的比例稳定,维持在 20.67%。基于经济周期回落背景下控制信用风险的需要,我们提高了对企业短期融资券的信用标准,坚持选择高品质的企业债进行组合投资。

未来一定时间内国际环境仍处在剧烈动荡中,不确定因素很多。为保持经济平稳增长,预计宏观调控有望继续放松,存款准备金率仍有下调的空间,但央行仍将通过公开市场操作维持必要的流动性调节,以控制货币供应量的合理增长。对于货币市场而言,预计四季度将保持相对平稳的态势,一年期央票收益率的变化是主导市场利率定位的主要因素。而四季度以银行为主的金融机构在年末进行资金头寸调节的因素可能导致资金面呈现稳中趋紧的变化趋势,并给货币市场收益率带来一定的波动。短期融资券可能继续保持较大的发行量,其中,优质的企业短期融资券将得到市场青睐。

基金管理人将在四季度保持较高的组合剩余期限,以子弹型组合配置为宜,提高一年期债券的投资比例,同时继续选择优质的企业短期融资券进行投资,以提高组合收益。

§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	固定收益投资	4,779,126,397.27	93.60
	其中:债券	4,779,126,397.27	93.60
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	300,000,810.00	5.88
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	12,592,850.94	0.25
4	其他资产	14,029,569.95	0.27
5	合计	5,105,749,628.16	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	2,772,793,113.80	1.16
	其中:买断式回购融资	–	–
2	报告期末债券回购融资余额	197,999,583.00	4.04
	其中:买断式回购融资	–	–

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	172
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	179
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	106

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	8.60	4.04
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.58	–
2	30天(含)—60 天	16.90	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90 天	2.84	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.61	–
4	90天(含)—180 天	35.58	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
5	180天(含)—397 天(含)	40.07	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
	合计	103.99	4.04

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	3,112,870,134.66	63.58
3	金融债券	615,656,991.83	12.57
	其中:政策性金融债	615,656,991.83	12.57
4	企业债券	28,635,957.74	0.58
5	企业短期融资券	1,011,975,014.67	20.67
6	其他	9,988,298.37	0.20
7	合计	4,779,126,397.27	97.61
8	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	58,352,318.88	1.19

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801031	08央票 31	5400000	530,439,847.93	10.83
2	0801093	08央票 93	3600000	358,578,165.41	7.32
3	0801016	08央票 16	3000000	295,863,653.80	6.04
4	0801025	08央票 25	2800000	275,574,859.41	5.63
5	080415	08农发 15	2700000	269,948,575.79	5.51
6	0801028	08央票 28	2500000	245,759,037.27	5.02
7	0801034	08央票 34	2300000	225,797,854.85	4.61
8	0881137	08鞍钢 CP01	2000000	200,878,782.65	4.10
9	0881176	08南电 CP01	2000000	200,761,660.64	4.10
10	0801088	08央票 88	2000000	199,464,653.66	4.07

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)–0.5%间的次数	–
报告期内偏离度的最高值	0.10%
报告期内偏离度的最低值	–0.21%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.09%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法计价,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.8.2 本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券,不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

5.8.3 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、处罚的情况。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	13,779,569.95
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	14,029,569.95

§6 开放式基金份额变动

单位:份

分级基金	A级基金	B级基金
报告期期初基金份额总额	249,624,017.13	467,991,597.56
报告期期间基金总申购份额	545,796,408.61	5,830,204,167.91
报告期期间基金总赎回份额	419,204,451.47	1,778,213,267.25
报告期期末基金份额总额	376,215,974.27	4,519,982,498.22

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富货币市场基金募集的文件;

2、《汇添富货币市场基金基金合同》;

3、《汇添富货币市场基金托管协议》;

4、《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、报告期内汇添富货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告;

7、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
2008 年 10 月 21 日

汇添富增强收益债券型证券投资基金

2008年第三季度报告

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:2008 年 10 月 21 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 2008 年 10 月 20 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 2008 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	添富增收
交易代码	519078
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年 3 月 6 日
报告期末基金份额总额	4,100,912,663.25 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

§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(2008 年 07 月 1 日 –2008 年 09 月 30 日)
1.本期利润	91,939,809.53
2.本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	45,476,606.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.0233
4.期末基金资产净值	4,237,678,322.21
5.期末基金份额净值	1.033

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。

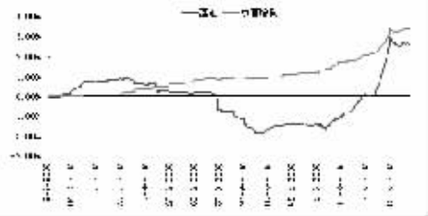
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.38%	0.09%	4.25%	0.19%	–1.87%	–0.10%

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:本基金的《基金合同》生效日为 2008 年 3 月 6 日,截至本报告期末,基金成立未满 1 年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 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		
王珏池	本基金的基金经理、汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。	2008年 3 月 6 日	–	14年	国籍:中国。学历:澳门科技大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任申银万国证券股份有限公司固定收益总部投资部经理。2005 年 4 月加入汇添富基金管理有限公司任交易主管,2006 年 3 月 23 日至今任汇添富货币市场基金的基金经理,2008 年 3 月 6 日至今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	本基金的基金经理。	2008年 3 月 6 日	–	6年	国籍:中国。学历:华东师范大学金融学硕士。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宏观经济、固定收益资深高级分析师。2007 年 8 月加入汇添富基金管理有限公司,任固定收益高级经理,2008 年 3 月 6 日至今任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

本基金为债券型基金,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

三季度债券市场的投资环境明显转暖,7 月份债券市场以小幅盘整为主,8 月份以后出现了 2006 年以来最大的一轮上涨行情,与二季度末相比,国债和金融债收益率曲线都大幅下移,总体来看,中长端收益率下降幅度大于短端,收益率曲线平坦化特征明显。截止 9 月末,中债总指数比 6 月份大幅上涨了 4.25%。

8 月份以来债券市场大幅上涨的原因主要是三个方面:第一,受美国次贷危机不断蔓延和全球经济继续下滑的影响,国际原油价格 8 月份创下历史新高后出现大幅回落,输入型通胀压力明显缓解,8 月份 CPI 涨幅也回落至 4.9%,同样显示通胀压力正在减轻;第二,二季度 GDP 增长率为 10.1%,比一季度回落 0.5 个百分点,在经济降温的背景下,宏观调控的基调也改为“一保一控”,二季度以来货币政策开始出现结构性放松的迹象,央行资金回笼力度亦有所减弱,9 月 15 日央行宣布同时下调存款准备金率和贷款利率,使市场对降息周期即将来临的预期日益强烈;第三,三季度央行公开市场操作出现明显变化,不仅停止了 3 年期央行票据的发行,而且 1 年期央行票据发行利率也开始稳步下降,这为债券收益率曲线的全面下降提供了空间。

本报告期内,本基金在遵守基金合同、控制风险的前提下,较好地应对了三季度债券市场基本面的重大变化,及时对组合进行了调整,8 月份以后增加了对 3 年期央票和长期国债、金融债的投资比重,提高了债券组合的久期,以便更好地分享债券市场上涨的收益,同时,为规避股票市场大幅调整的风险,本基金主动减少了参与股票和分离式债券网下申购的频率。在审慎研究的基础上,本基金三季度继续加大对信用资质较好、收益率较高的企业债和公司债的投资比重。报告期内,本基金净值增长 2.38%。

三季度债券市场的大幅上涨预示着债券市场有望迎来牛市格局,在经济周期面临进一步回落的背景下,中长期内债券市场有望继续走牛。具体从四季度来看,尽管前期债券收益率下降幅度已经较大,但由于当前国际金融市场动荡剧烈、国内经济增长速度面临加速回落以及通胀压力明显缓解,因此,四季度货币政策有望继续放松,无论是存贷款利率还是准备金率都存在进一步下调的空间,基本面支持债券市场继续稳步上涨,但与三季度相比,四季度债券市场上涨的速度可能会有所放缓。相比于国债、金融债等债券品种,四季度高等级信用债的投资前景更值得期待。

本基金将密切关注通胀和市场流动性的变动趋势,对组合久期和券种配置进行灵活调整,一方面控制市场流动性风险,另一方面做好有中长期投资价值的战略品种配置,争取为基金持有人创造稳健收益。

§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	权益类投资	11,841,765.75	0.28
	其中:股票	11,841,765.75	0.28
2	固定收益类投资	3,775,295,060.90	88.76
	其中:债券	3,775,295,060.90	88.76
	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	62,894,713.18	1.48
6	其他资产	403,293,301.26	9.48
7	合计	4,253,324,841.09	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	–	–
C	制造业	10,207,959.75	0.24
C0	食品、饮料	–	–
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	–	–
C5	电子	–	–
C6	金属、非金属	–	–
C7	机械、设备、仪表	9,617,643.00	0.23
C8	医药、生物制品	590,316.75	0.01
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	113,700.00	0.00
H	批发和零售贸易	1,520,106.00	0.04
I	金融、保险业	–	–
J	房地产业	–	–
K	社会服务业	–	–
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	11,841,765.75	0.28

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	601766	中国南车	2,747,898	9,617,643.00	0.23
2	002269	美邦服饰	59,612	1,520,106.00	0.04
3	002252	上海莱士	27,141	590,316.75	0.01
4	002268	卫士通	7,500	113,700.00	0.00
5	–	–	–	–	–
6	–	–	–	–	–
7	–	–	–	–	–
8	–	–	–	–	–
9	–	–	–	–	–
10	–	–	–	–	–

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	329,531,314.20	7.78
2	央行票据	2,076,309,000.00	49.00
3	金融债券	469,665,000.00	11.08
	其中:政策性金融债	469,665,000.00	11.08
4	企业债券	887,523,564.65	20.94
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	12,266,182.05	0.29
7	其他	–	–
8	合计	3,775,295,060.90	89.09

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	08央票 44	08央票 44	7,100,000	719,159,000.00	16.97
2	08央票 65	08央票 65	5,000,000	506,700,000.00	11.96
3	08央票 17	08央票 17	3,000,000	303,630,000.00	7.17
4	08国开 14	08国开 14	2,000,000	212,800,000.00	5.02
5	08兵器装备债	08兵器装备债	1,900,000	189,069,000.00	4.46

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公开谴责、处罚的情况。

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	250,000.00
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	52,089,728.03
5	应收申购款	350,953,573.23
6	其他应收款	–
7	其他	–
8	合计	403,293,301.26

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601766	中国南车	9,617,643.00	0.2269	新股待上市
2	002269	美邦服饰	1,520,106.00	0.0359	新股待上市

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,390,749,228.23
报告期期间基金总申购份额	809,989,301.32
报告期期间基金总赎回份额	1,099,825,866.30
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	4,100,912,663.25

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富增强收益债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富增强收益债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富增强收益债券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、报告期内汇添富增强收益债券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。

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
2008 年 10 月 21 日

汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金

2008年第三季度报告

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:2008 年 10 月 21 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 2008 年 10 月 17 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 2008 年 7 月 8 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	添富蓝筹
交易代码	519066
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年 7 月 8 日
报告期末基金份额总额	747,431,228.92 份
投资目标	通过投资于价值相对低估的蓝筹公司股票,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为灵活配置混合型基金,属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
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(2008 年 7 月 8 日 –2008 年 9 月 30 日)
1.本期利润	–3,458,743.38
2.本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	–2,728,428.40
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0047
4.期末基金资产净值	743,956,630.78
5.期末基金份额净值	0.995

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、本基金的《基金合同》生效日为 2008 年 7 月 8 日,报告期不足一季度。

3、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	–0.50%	0.10%	–12.22%	1.75%	11.72%	–1.65%

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:本基金的《基金合同》生效日为 2008 年 7 月 8 日,截至本报告期末,基金成立未满 1 年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 6 个月,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

§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		
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、汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理。	2008年 7 月 8 日	–	5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 10 月 9 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 19 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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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