

汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF) 2012 年年度报告摘要

2012 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：2013 年 3 月 28 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 2013 年 3 月 26 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 2012 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	汇添富黄金及贵金属（QDII-LOF-FOF）
基金主代码	164701
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 8 月 31 日
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	441,175,671.66 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 3 月 1 日

注：本基金为 LOF 基金，在深交所的简称为“添富贵金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	深入研究影响黄金及其他贵金属(如白银、铂金、钯金等)价格的主要因素，把握不同品种贵金属的长期价格趋势和短期市场波动，通过主动投资于有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF)，在严格控制风险的前提下，力争基金收益率超越同期黄金价格走势。
投资策略	综合考虑国际政治、经济、汇市、战争、主要国家货币和利率政策、贵金属市场供求等多方面因素，本基金重点投资于境外上市有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF)，长期持有结合动态调整。 本基金主要投资策略包括贵金属资产配置策略、交易所交易基金(ETF)投资策略、货币市场工具投资策略以及金融衍生工具投资策略。
业绩比较基准	伦敦金价格折成人民币后的收益率 (伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix)，人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。)
风险收益特征	本基金为基金中基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，主要投资于境外有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF)，其预期风险收益水平与黄金价格相似。

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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		NY 10005

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 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	2012 年	2011 年 8 月 31 日(基金合同生效日)-2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-26,192,304.72	-3,491,235.95
本期利润	20,710,403.90	-78,560,759.74
加权平均基金份额本期利润	0.0432	-0.1398
本期基金份额净值增长率	4.53%	-14.00%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1011	-0.1402
期末基金资产净值	396,579,563.11	453,034,222.61
期末基金份额净值	0.899	0.860

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 2011 年 8 月 31 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 2012 年 12 月 31 日数据，特此说明。

3.2 基金净值表现

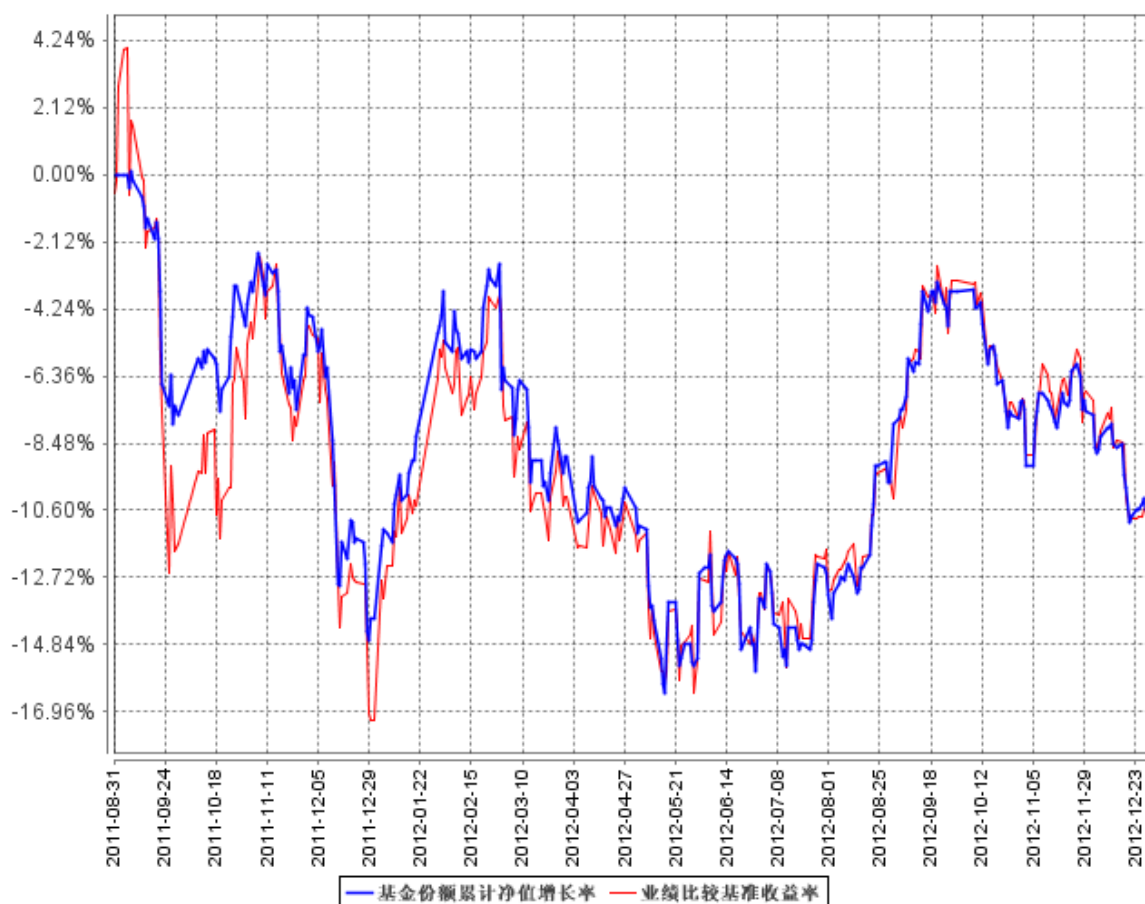
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-6.65%	0.61%	-7.49%	0.71%	0.84%	-0.10%
过去六个月	3.81%	0.66%	3.05%	0.82%	0.76%	-0.16%
过去一年	4.53%	0.87%	8.00%	1.05%	-3.47%	-0.18%
自基金合同生效日起至今	-10.10%	0.91%	-10.59%	1.25%	0.49%	-0.34%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 8 月 31 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

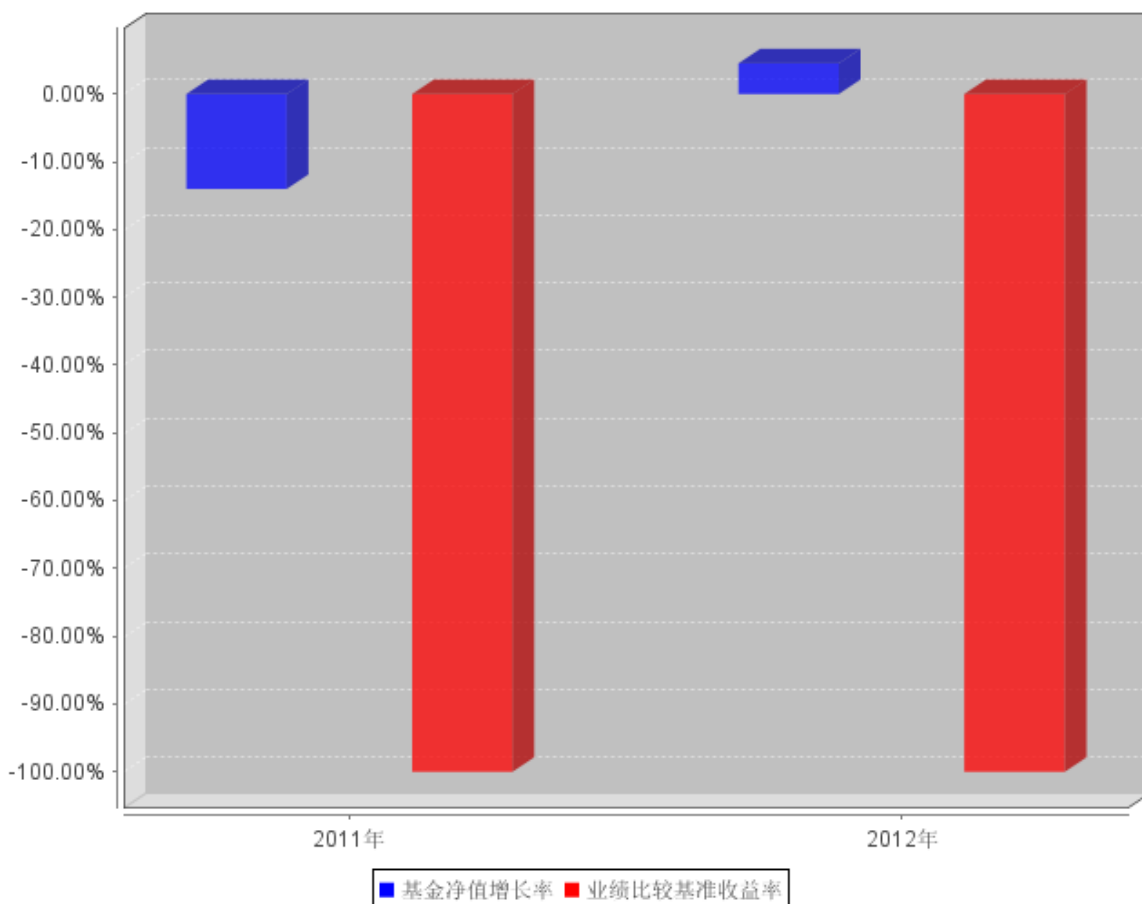
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011年8月31日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 8 月 31 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

注：本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 8 月 31 日，本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

§ 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、南方两个分公司，以及全资子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司 (China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited)。

汇添富是中国第一批获得 QDII 业务资格、专户业务资格、设立海外子公司并且获得 RQFII

业务资格的基金公司，同时是全国社会保障基金投资管理人。在投资管理领域，汇添富已形成公募、专户、国际、养老金四大块业务以及股票、固定收益、被动投资、海外投资、另类投资五大块投资领域协同发展的格局。

截止 2012 年末，汇添富共管理 27 只证券投资基金，涵盖股票、指数、QDII、债券、货币市场基金等不同风险收益特征的产品。报告期内，汇添富共发行八只基金产品，包括国内首创的系列短期理财基金——汇添富理财 30 天、60 天、14 天、28 天债券基金，国内首只实施场内实时申赎的货币基金——汇添富收益快线货币基金，以及汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富多元收益债券基金、汇添富逆向投资股票基金。

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地贯彻和执行。2012 年，汇添富取得优秀的投资业绩，在市场震荡起伏的背景下，公司旗下基金均获得正收益，切实为投资者赢得财富增长。

2012 年，汇添富专户业务快速发展，不仅开发出债券分级、大宗交易、期货对冲等专户产品，并且投资业绩持续表现优秀。公司获得《每日经济新闻》针对非公募及创新业务评选的“最佳口碑基金公司”、“最佳口碑产品”、“最佳创新产品”三项大奖。

2012 年，汇添富国际业务取得突破进展，不仅成功发行 RQFII 产品——汇添富人民币债券基金，并且与巴西证券交易所就指数等方面的业务合作签订了《合作备忘录》，成为国内首家与巴西证券交易所开展全面合作的资产管理公司。

2012 年，汇添富电子商务业务实现跨越式发展。公司推出的“添富信用卡”在行业内率先实现货币基金的支付功能，获得 2011 年度上海金融创新成果一等奖；10 月，公司在行业首家推出网上直销货币基金 T+0 赎回业务，极大地提升货币基金的理财便捷性。

2012 年，汇添富持续开展贴心的投资者服务与教育工作。公司围绕向“现代财富管理机构”转型的思路，从不同类型客户的切身需求出发，大力建设投顾式客户服务体系；同时，公司进一步着力开展“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。

2012 年，汇添富社会责任事业进一步深入开展。“河流·孩子”助学计划启动第五季活动，公司公益基金会捐资在贵州建设“古邦添富小学”；邀请客户、员工及员工家属参加“红色希望之旅”活动，先后走进甘肃大夏河、四川美姑、云南怒江的“添富小学”，开办“梦想课堂”，捐赠图书和设备；为优秀乡村教师提供国内外知名教育机构的师资培训。同时，汇添富还着力开展医疗救助、结对帮扶、国防拥军等社会公益活动。凭借慈善公益事业上的长期坚持和突出贡献，2012 年

4 月，汇添富基金荣获第二届上海慈善表彰大会颁发的“上海慈善奖爱心捐赠企业”奖，成为唯一一家获奖的基金管理公司。

展望 2013 年，新的《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规的颁布实施，将对中国基金业产生深远的影响，行业转型发展的大变革将进一步深化，整个财富管理行业进入大混业竞争时代。汇添富基金将始终保持积极的心态，大力创新、锐意进取，积极把握机会，切实以“客户至上，做好优质服务”为己任，推动各项业务战略布局有效落实，为中国基金业的繁荣发展做出积极贡献。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘子龙	本基金的基金经理，汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金的基金经理。	2011 年 8 月 31 日	2012 年 11 月 1 日	17 年	国籍：中国香港。 学历：英国剑桥大学工商管理硕士。 相关业务资格：证券投资基金从业资格、特许金融分析师（CFA）。 从业经历：曾任香港花旗银行业务经理，汇丰投资管理（香港）有限公司上海代表处首席代表，2000 年 11 月 20 日至 2005 年 11 月 30 日任花旗投资管理（香港）有限公司全球平衡组合的基金经理。2007 年 9 月加入汇添富基金管理有限公司任国际投资副总监。2010 年 6 月 25 日至 2012 年 11 月 1 日任汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金的基金经理，2011 年 8 月 31 日

					至 2012 年 11 月 1 日任汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）的基金经理。
赖中立	本基金的基金经理，汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理助理，深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理，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助理。	2012 年 11 月 1 日	-	5 年	国籍：中国，学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010 年 8 月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程部分分析师。2012 年 2 月 15 日至今任汇添富上证综合指数基金、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、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助理，2012 年 11 月 1 日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：

(1) 在研究环节，公司建立了统一的投研平台信息管理系统，公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时，通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。(2) 在投资环节，公司针对基金、专户、社保分别设立了投资决策委员会，各委员会根据各自议事规则分别召开会议，在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略，独立制定资产配置计划和组合调整方案，并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。(3) 在交易环节，公司实行集中交易，所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式，按照“时间优先、价格优先、比例分配”的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理，严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配，确保交易的公平性。(4) 在交易监控环节，公司通过日常监控、投资交易监控周报、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。(5) 在报告分析方面，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。当发生风格相似或同一投资经理管理的投资组合之间业绩表现差异超过 5% 等情形时，将进行专项分析。同时，投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

4.4.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。报告期内，本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度，进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易行为监控体系由集中交易室、投资研究部、稽核监察部和金融工程部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的监控，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3 日、5 日）同向交易的样本，对其进行了 95%的置信区间，假设差价率为 0 的分布检验以及差价率均值的分析。分析结果表明，不同时间窗口下，公司各组合间买卖价差并不显著，差价率均值小于 1%。

通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的交易次数为 2 次，分别是由于指数基金根据标的指数成份股调整而被动调仓、专户组合到期清算卖出证券所致。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

整个 2012 年，全球黄金价格经历了大幅波动，虽然全年美元计价黄金价格涨幅为 8.26%，但各季度均走出了不同的行情：一季度因 2011 年 12 月底欧洲出台 LTRO 增加流动性和美国联储局一月 FOMC 会议暗示 QE3 等，导致美元走弱，利好贵金属，包括黄金在内的贵金属大幅反弹，黄金价格亦从去 2011 年底的 1531 美元飙升至 2 月底的 1781 美元；随后二季度欧债问题恶化，希腊未能成功筹组联合政府，市场担心该国将脱离欧元区，欧元面临解体危机，并将引发巨大的经济收缩压力，使金银价格随美元之外的其他市场下跌，金价亦在 5 月底触及 1540 美元的年内低点，并一直在 1600 美元左右窄幅震荡；进入三季度，美国联储局终于推出 QE3，而欧洲及中国央行也先后推出不同的经济刺激措施，推动期内的金银价格急速回弹。这些措施加强了全球经济再膨胀的预期，并大大超越了收缩力量，投机资金蜂拥进入金银市场，金价终于在 9 月底 10 月初站上 1790 美元的年内高点；到四季度，黄金走势乏力，美联储 QE 的边际效用在逐渐减弱，人们关注

的焦点重新回到了欧洲经济复苏的艰难前景，再加上久悬在投资者头上的美国财政悬崖这一“达摩克利斯之剑”，对黄金价格产生了较大的压制，黄金价格亦一路走低。

本基金在一季度尚处于建仓期，整体仓位较低，未能充分享受金价上涨收益，但由于在一季度配置了较多数量白银，白银涨幅超越黄金弥补了总体部分仓位较低的影响。在 2 月底本基金将白银仓位大幅降低在 2.5%左右，较好避免了随后一季度白银大幅下挫的风险。在二季度本基金建仓完毕，在随后的三、四季度，考虑到宏观经济的不乐观和市场的波动加剧，本基金减持了部分贵金属基金，仓位水平基本保持在契约规定的下限，并且将白银的投资降低到 1 个百分点左右。同时考虑到在黄金走势承压下市场的流动性趋于紧张，本基金将一部分流动性较弱的基金替换为流动性较强的基金。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	超额收益
过去一个月	-2.81%	-4.03%	1.22%
过去三个月	-6.65%	-7.49%	0.84%
过去六个月	3.81%	3.05%	0.76%
过去一年	4.53%	8.00%	-3.47%
自基金合同生效日起至今	-10.10%	-10.59%	0.49%

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总的来看，2013 年全球经济将整体趋于稳定。首先是美国，在 2012 年的最后一天美国两党关于增税和削减支出达成一致协议，暂时避免了美国坠入财政悬崖的危机；欧债危机进入 2013 年亦得到缓解，例如重灾区希腊，标准普尔在 2012 年底将希腊长期主权信用评级从“选择性违约”连升六级，表明该机构认为希腊已从破产边缘逐渐恢复稳定；日本方面在新任首相上台后，持续动荡的政治压力也有所缓解，日本央行亦推出刺激国内信贷的市场流动性计划来提振日本经济；而作为世界经济增长重要引擎的中国，新任的领导人平稳交接，并发出新一轮经济改革的信号，我们认为改革制度红利将逐渐替代以往引以为傲的人口红利，并保障中国较快经济增长目标的实现。

从货币供应来看，美联储、欧洲和日本等全球重要央行继续行走在货币宽松的道路上。当前美国的失业率在 7.8%，仍远远高于美国的正常失业率水平，量化宽松的措施将不得不一再延续；而考虑到欧洲较为脆弱的经济平衡，欧洲央行将持续维持宽松的货币政策，欧洲央行行长德拉吉亦表示，欧元区有稳定迹象，但仍面临挑战，央行没有考虑退出策略；日本新任首相多次表示对

日本国内极低通胀率的不满，一再对日本央行施压，要求将日本短期通胀率目标设为 2%，我们预计日本央行势必将加大宽松政策来提升通胀预期。

温和而稳定的经济环境，宽松的货币政策与可能由此带来的通胀压力，上述的宏观大环境对黄金等贵金属是较为有利的。总的来说，我们对金价的长期信心没有改变，在货币基础被无限量放大与通胀压力并行的环境下，具有天然货币属性与抗通胀保值性的黄金将持续获得投资人的青睐，金价向上的长期走势将是大概率事件。

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验，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多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期和上年度可比期间均未进行利润分配。

§ 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

2012 年，本基金托管人在对汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）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

2012 年，汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）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，汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）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黄金及贵金属证券投资基金（LOF）2012 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 2013 年 3 月 28 日签字出具了安永华明（2013）审字第 60466941_B17 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： 汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	29,437,114.71	66,874,968.92

结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	367,877,711.49	396,556,060.37
其中：股票投资	-	-
基金投资	367,877,711.49	396,556,060.37
债券投资	-	-
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	496,311.73	-
应收利息	1,855.95	7,445.00
应收股利	-	-
应收申购款	239,175.79	121,011.50
递延所得税资产	-	-
其他资产	496,288.87	3,885,758.57
资产总计	398,548,458.54	467,445,244.36
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2012 年 12 月 31 日	2011 年 12 月 31 日
负 债：		
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	-	8,250,423.50
应付赎回款	830,231.84	1,638,053.41
应付管理人报酬	341,403.17	410,859.06
应付托管费	88,764.84	106,823.36
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	708,495.58	4,004,862.42
负债合计	1,968,895.43	14,411,021.75
所有者权益：		
实收基金	441,175,671.66	526,924,810.67
未分配利润	-44,596,108.55	-73,890,588.06
所有者权益合计	396,579,563.11	453,034,222.61
负债和所有者权益总计	398,548,458.54	467,445,244.36

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.899 元，基金份额总额 441,175,671.66 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012 年12月31日	上年度可比期间 2011年8月31日(基金合同生效日) 至2011年12月31日
一、收入	27,135,613.91	-75,412,902.89
1.利息收入	97,944.55	458,864.41
其中：存款利息收入	97,944.55	458,864.41
债券利息收入	-	-
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“-”号填列）	-19,882,596.87	-
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-19,882,596.87	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	46,902,708.62	-75,069,523.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-114,754.55	-914,838.62
5.其他收入（损失以“-”号填列）	132,312.16	112,595.11
减：二、费用	6,425,210.01	3,147,856.85
1. 管理人报酬	4,351,909.30	1,776,879.82
2. 托管费	1,131,496.48	461,988.74
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	431,562.23	688,914.79
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	510,242.00	220,073.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	20,710,403.90	-78,560,759.74

注：由于本基金于 2011 年 8 月 31 日成立，因此上年度可比期间只列示从基金合同生效日至 2011 年 12 月 31 日数据，特此说明。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	526,924,810.67	-73,890,588.06	453,034,222.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,710,403.90	20,710,403.90
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）	-85,749,139.01	8,584,075.61	-77,165,063.40
其中：1.基金申购款	45,112,398.12	-2,974,153.82	42,138,244.30
2.基金赎回款	-130,861,537.13	11,558,229.43	-119,303,307.70
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）	441,175,671.66	-44,596,108.55	396,579,563.11
项目	上年度可比期间 2011 年 8 月 31 日(基金合同生效日)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）	614,808,767.15	-	614,808,767.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-78,560,759.74	-78,560,759.74
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）	-87,883,956.48	4,670,171.68	-83,213,784.80
其中：1.基金申购款	7,099,901.45	-430,733.13	6,669,168.32
2.基金赎回款	-94,983,857.93	5,100,904.81	-89,882,953.12
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）	526,924,810.67	-73,890,588.06	453,034,222.61

注：由于本基金于 2011 年 8 月 31 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示从基金合同生效日至 2011 年 12 月 31 日数据，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF) (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[2011]838 号文《关于核准汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）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 2011 年 8 月 31 日正式生效，首次设立募集规模为 614,808,767.15 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。

本基金的投资范围主要包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金中有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF)、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金综合考虑国际政治、经济、汇市、战争、主要国家货币和利率政策、贵金属市场供求等多方面因素，重点投资于境外上市有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF)，长期持有结合动态调整。本基金的业绩比较基准为：伦敦金价格折成人民币后的收益率(伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix)，人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币中间价为准。)

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，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会制定的《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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税；
- (2) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税；
- (3) 基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

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
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
布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brothers Harriman & Co.）	基金境外托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

注：本基金本年度以及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的交易。

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 8 月 31 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,351,909.30	1,776,879.82
其中：支付销售机构的客户维护费	1,318,668.37	533,129.35

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，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 5 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 8 月 31 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,131,496.48	461,988.74

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.26% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.26\% \div \text{当年天数}$$

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

基金的托管费每日计算，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 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定

节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2011 年 8 月 31 日）持有的基金份额	-	30,007,100.00
期初持有的基金份额	30,007,100.00	-
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	30,007,100.00	30,007,100.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.80%	5.69%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		2011 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2011 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	8,017,453.30	96,301.50	34,880,952.69	458,845.89
布朗兄弟哈里曼银行	21,419,661.41	-	31,994,016.23	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按适用利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2012 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

注：本基金本报告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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

注：截至本报告期末 2012 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2012 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	367,877,711.49	92.30
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-

5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	29,437,114.71	7.39
8	其他各项资产	1,233,632.34	0.31
9	合计	398,548,458.54	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票以及其他权益投资。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票以及其他权益投资。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票以及其他权益投资。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票以及其他权益投资。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票以及其他权益投资。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	ETFSGOLD TRUST	ETF 基金	契约型开放式	ETFs Securities US (LLC)	74,977,724.43	18.91
2	ISHARES GOLD TRUST	ETF 基金	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors	74,786,456.66	18.86
3	UBS IS-GOLD CHF HEDG	ETF 基金	契约型开放式	UBS Fund Management(Switzerland) AG	74,173,239.56	18.70
4	SPROTT PHYSICAL GOLD	ETF 基金	契约型开放式	Sprott Asset Management LP	67,050,238.12	16.91
5	SPDR GOLD TRUST	ETF 基金	契约型开放式	State Street Bank and Trust Company	41,343,542.51	10.43
6	SPDR GOLD TRUST	ETF 基金	契约型开放式	State Street Bank and Trust Company	27,300,508.65	6.88
7	ISHARES SILVER TRUST	ETF 基金	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors	4,427,506.20	1.12
8	VALUE GOLD ETF	ETF 基金	契约型开放式	Sensible Asset Management HongKong	3,818,495.36	0.96

注：其中第五位 SPDR GOLD TRUST 在美国上市；第六位 SPDR GOLD TRUST 在香港上市。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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。

8.11.2

本基金投资的前十名标的没有超出基金合同规定的备选库。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-

2	应收证券清算款	496,311.73
3	应收股利	-
4	应收利息	1,855.95
5	应收申购款	239,175.79
6	其他应收款	496,288.87
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,233,632.34

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§ 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
10,773	40,951.98	31,001,909.79	7.03%	410,173,761.87	92.97%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	61,292.53	0.01%

注：1) 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

2) 该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 8 月 31 日）基金份额总额	614,808,767.15
本报告期期初基金份额总额	526,924,810.67
本报告期基金总申购份额	45,112,398.12

减：本报告期基金总赎回份额	130,861,537.13
本报告期期末基金份额总额	441,175,671.66

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人 2012 年 3 月 3 日公告，增聘周睿先生担任汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理。

2、基金管理人 2012 年 3 月 3 日公告，增聘韩贤旺先生、叶从飞先生担任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，陈晓翔先生、欧阳沁春先生不再担任该基金的基金经理。

3、《汇添富逆向投资股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 9 日正式生效，顾耀强先生任该基金的基金经理。

4、基金管理人 2012 年 3 月 14 日公告，经汇添富基金管理有限公司第三届董事会第一次会议决议，并经中国证监会审核批准（证监许可【2012】297 号），公司聘任雷继明先生为公司副总经理。

5、《汇添富理财 30 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 9 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2012 年 6 月 7 日公告，经汇添富基金管理有限公司 2012 年第一次临时股东会决议，并经中国证监会审核批准（证监许可【2012】757 号），公司董事会选举潘鑫军先生为公司董事长，桂水发先生不再担任本公司的董事长。

7、《汇添富理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 12 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

8、《汇添富理财 14 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 7 月 10 日正式生效，王栩先生任该基金的基金经理。

9、《汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 7 月 26 日正式生效，陆文磊先生任该基金的基金经理。

10、《汇添富多元收益债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 18 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

11、《汇添富理财 28 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 10 月 18 日正式生效，曾刚

先生任该基金的基金经理。

12、基金管理人 2012 年 11 月 2 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）的基金经理，刘子龙先生不再担任该基金的基金经理；同时，刘子龙先生也不再担任汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金的基金经理，王致人先生继续担任该基金的基金经理。

13、《汇添富收益快线货币市场基金基金合同》于 2012 年 12 月 21 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2011 年 8 月 31 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内尚未支付的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	基金交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期基金成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Morgan Stanley	1	266,886,828.01	100.00%	425,665.37	100.00%	-
建银国际	1	-	-	-	-	-
Credit Suisse	1	-	-	-	-	-
UBS	1	-	-	-	-	-
招商国际	1	-	-	-	-	-
德意志银行	1	-	-	-	-	-

KGI	1	-	-	-	-	-
麦格里	1	-	-	-	-	-
工银国际	1	-	-	-	-	-
海通大福	1	-	-	-	-	-
中金香港	1	-	-	-	-	-
平安香港	1	-	-	-	-	-
里昂	1	-	-	-	-	-
JP Morgan	1	-	-	-	-	-
GS	1	-	-	-	-	-
Nomura	1	-	-	-	-	-
Knight	1	-	-	-	-	-
东方香港	1	-	-	-	-	-
Merrill Lynch	1	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

（2）交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。

（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

（5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

（6）成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增和减少交易单元。

汇添富基金管理有限公司

2013 年 3 月 28 日