
汇添富均衡增长股票型证券投资基金 2010 年年度报告摘要

2010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

报告送出日期：2011年3月28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 2011 年 3 月 23 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 2010 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	汇添富均衡增长股票
基金主代码	519018
前端交易代码	519018
后端交易代码	519010
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
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	24,127,691,465.11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。

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	http://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 层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	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	1,497,089,673.26	2,351,740,840.39	-8,829,791,713.81
本期利润	896,563,555.49	8,966,504,888.66	-15,955,084,354.81
加权平均基金份额本期利润	0.0348	0.3201	-0.5076
本期基金份额净值增长率	4.92%	53.27%	-45.57%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1327	0.1517	0.0624
期末基金资产净值	20,858,225,671.29	23,418,787,856.55	17,657,198,928.90
期末基金份额净值	0.8645	0.9103	0.5939

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

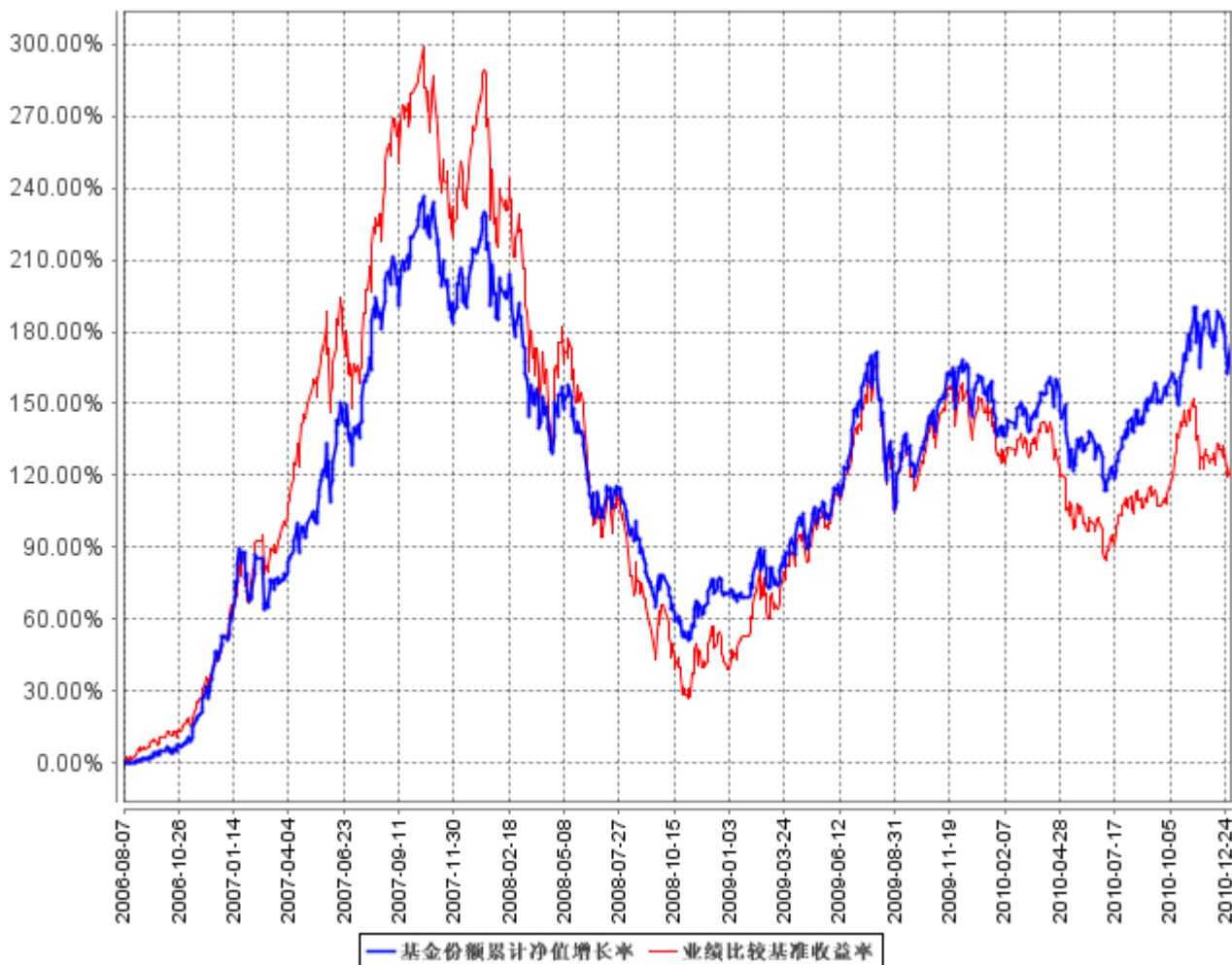
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	6.94%	1.73%	5.19%	1.42%	1.75%	0.31%
过去六个月	25.13%	1.44%	17.74%	1.24%	7.39%	0.20%
过去一年	4.92%	1.40%	-9.37%	1.26%	14.29%	0.14%
过去三年	-12.48%	1.64%	-30.34%	1.85%	17.86%	-0.21%
自基金合同生效日起至	174.90%	1.68%	124.55%	1.79%	50.35%	-0.11%

今						
---	--	--	--	--	--	--

注：本基金的《基金合同》生效日为 2006 年 8 月 7 日，至本报告期末未满五年。

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

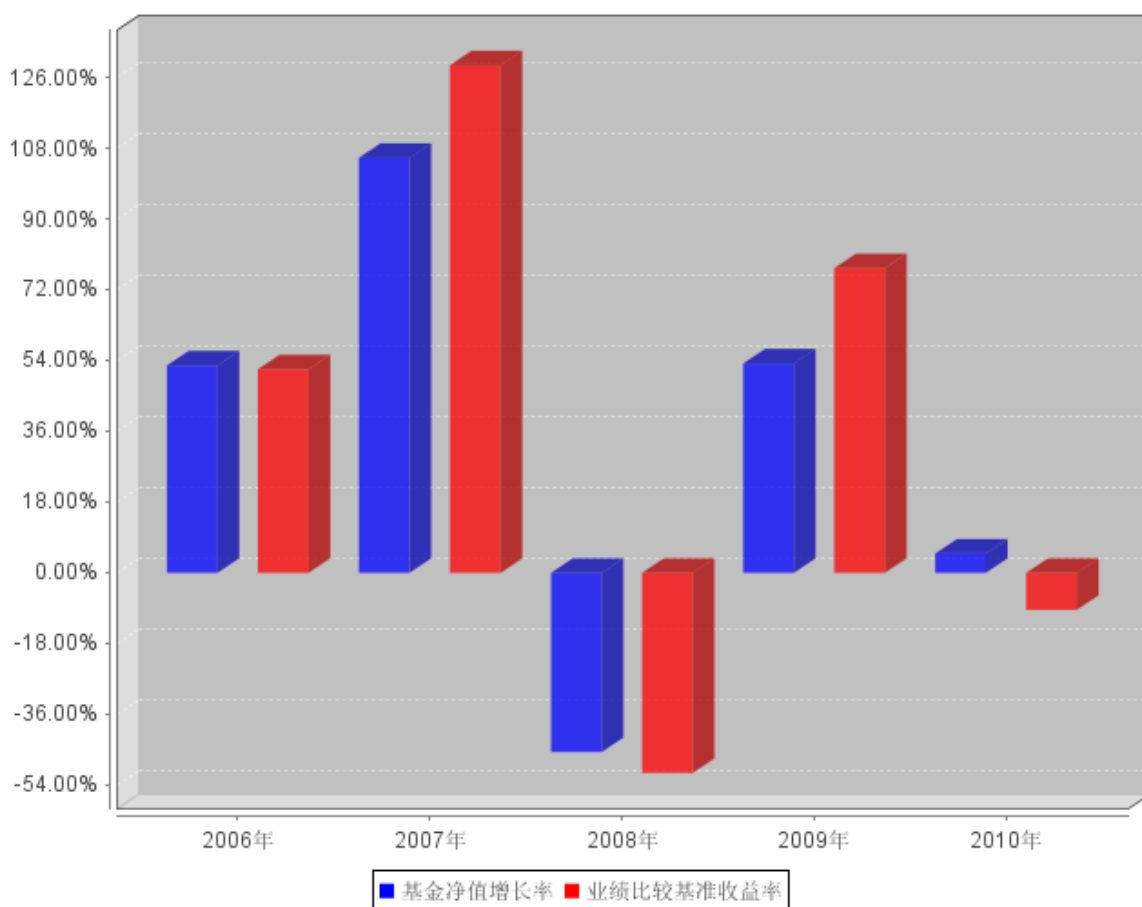
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本基金的《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。

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 2006 年 8 月 7 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

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
2010	0.800	1,032,593,498.74	1,004,024,197.72	2,036,617,696.46	-
2009	-	-	-	-	-
2008	-	-	-	-	-
合计	0.800	1,032,593,498.74	1,004,024,197.72	2,036,617,696.46	

§ 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, 公司总部设在上海陆家嘴。经过六年的发展,

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。公司业务覆盖公募基金管理、特定客户资产管理、QDII 业务、社保委托投资管理等，并设立有北京分公司、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)。

2010 年汇添富稳步推进公募基金业务，成功发行中国首只民营企业投资基金——汇添富民营活力股票型证券投资基金，中国首只医药行业基金——汇添富医药保健股票型证券投资基金，以及公司首只 QDII 产品——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。截至 2010 年 12 月 31 日，汇添富管理 12 只公募基金，资产管理规模达 569 亿，位居全行业第 12 位。

同时，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。2010 年，汇添富取得了较为优秀的投资业绩。

2010 年汇添富专户业务快速发展，专户业务团队实力进一步增强，工作模式持续优化，并率先在业内推出了“添富牛专户”专属品牌。截至本报告期末，汇添富管理的专户产品数量、专户资产规模与业绩回报居行业前列。

2010 年汇添富国际业务取得重大突破。汇添富资产管理(香港)有限公司完成注册登记手续，成为业内少数几家正式设立并运作海外机构的基金管理公司之一。8 月，香港子公司成功发行首只对冲基金——汇添富大中华绝对收益基金。

2010 年汇添富在积极推进既有业务的同时，锐意进取，大力创新，经过长期艰苦的努力，获得社保境内委托投资管理人资格。

在稳步推进各项业务的同时，汇添富更着力实现贴心的客户服务与投资者教育工作。公司在行业内首推基于 SNS 平台的“添富空间”，倡导“理财+生活”的理念，并通过“汇添富微博”、“感恩五周年”、理财教育讲座、“添富之约”等活动，进一步拓展客户服务新渠道，为客户提供实惠、便利的理财生活服务。

企业的发展离不开社会各界的支持，资源来自于社会更要服务于社会，2010 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模式，有效推进长期公益项目建设。在报告期内，公司发起成立上海汇添富公益基金会，并开展青海玉树地震救灾、援建 100 所“添富幸福书屋”、支持孤残儿童寄养、关怀癌症患者等具有影响力的公益活动。同时，公司深入推进“河流·孩子”公益项目，启动开展“河流·孩子——汇添富黄河两岸助学计划”，在宁夏捐资新建第三所“添富小学”。

2011 年，中国资本市场环境将更加复杂多变，基金行业的竞争将更为激烈，汇添富将以更积极的心态拥抱变革，为实现“经过长期努力发展成为中国最优秀的资产管理公司之一”的目标，进一步发扬公司“正直、激情、团队、客户第一、感恩”的文化优势，完善战略布局，夯实长远发展基础，开拓创新，持续提升公司的核心竞争力，力争为中国基金业的繁荣做出更大贡献。

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		
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、投资研究总部基金投资部副总监。	2006 年 8 月 7 日	2010 年 1 月 8 日	10 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:曾任浙大网新科技股份有限公司项目经理、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, 2005 年 8 月 25 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, 2006 年 8 月 7 日至 2010 年 1 月 7 日任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理。2009 年 12 月任投资研究总部基金投资部副总监。

<p>欧阳沁春</p>	<p>本基金的基金经理</p>	<p>2007 年 6 月 18 日</p>	<p>-</p>	<p>9 年</p> <p>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，2007 年 3 月 6 日至 2007 年 6 月 17 日任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。</p>
-------------	-----------------	------------------------	----------	--

<p>苏竞</p>	<p>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。</p>	<p>2007 年 12 月 17 日</p>	<p>-</p>	<p>7 年</p> <p>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。</p>
-----------	--	-------------------------	----------	--

陈晓翔	本基金的基金经理，汇添富价值精选股票型证券投资基金的基金经理	2010 年 1 月 8 日	-	9 年	国籍:中国。学历:南京理工大学产业经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任宁波中粮国际仓储运输有限公司业务员、华泰证券有限责任公司行业研究员、上海申银万国研究所有限责任公司行业研究员、建信基金管理有限公司行业研究员。2007 年 4 月加入汇添富基金管理有限公司任行业研究员,2009 年 1 月 23 日至今任汇添富价值精选股票型证券投资基金的基金经理,2010 年 1 月 8 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。
顾耀强	本基金的基金经理助理，汇添富策略回报股票型证券投资基金的基金经理。	2009 年 7 月 7 日	-	6 年	国籍:中国。学历:清华大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、中海优质成长基金经理助理、中海能源策略基金经理助理。2009 年 3 月加入汇添富基金管理有限公司任高级行业分析师,2009 年 7 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助理,2009 年 12 月 22 日至今任汇添富策略回报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。

4.3 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 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

2010 的 A 股市场总体表现是先抑后扬，中国经济刺激政策的淡出、加大的房地产调控力度，欧债危机、美国的二次量化宽松政策深刻地影响着 A 股市场和 A 股投资者，上证指数表现比较疲软，但是中小板综指与创业板指数屡创新高。以消费品、电子信息、产业结构升级等为代表的股票远远战胜了大盘股票，新型战略产业表现最为出色。

根据宏观与产业环境的变化，我们在行业配置与个股选择上重点考虑了非周期与成长性，对于内需在未来经济转型中的作用充满信心，加大了传统消费与新兴产业股票的投资力度，重点选

择了成长性好以及符合国家产业政策的股票进行配置，及时降低了部分周期股的投资比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值增长率为 4.92%，业绩比较基准收益率为-9.37%，本基金在本报告期大幅战胜比较基准。

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 2011 年，美国经济在逐步走出低谷，欧洲依然会比较低迷，欧债危机阴霾远远没有消除，新兴经济体面临巨大的不确定性。中国经济依然是世界经济最亮的色彩，但是持续的宏观与房地产调控成为 A 股市场最大制约因素，另一方面，A 股市场估值比较低，很多企业增长明确，市场大幅下探可能性也不大。因此，今年 A 股市场很有可能上下两难。但结构性和阶段性机会依然存在，我们比较看好以下投资机会：1、受益于国家产业政策拉动而超预期增长行业；2、业绩增长明确的大消费板块；3、高端装备为代表的先进制造业；4、真正有业绩支撑的新兴战略产业。

本基金在未来依然采用“由上而下”和“自下而上”相结合的投资策略，在行业适度均衡适度的情况下，阶段性把握部分低估值的周期性股票投资机会；重点投资于消费、服务和科技创新等利润增长明朗的行业；个股选择方面，选择有持续增长潜质的中盘成长股做中长期的布局。

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、产品创新部、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签订了《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：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 12 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 50%。

本基金于 2010 年 2 月 22 日实施利润分配，每份基金份额派发红利 0.08 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

2010 年，本基金托管人在对汇添富均衡增长股票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

2010 年，汇添富均衡增长股票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均衡增长股票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，汇添富均衡增长股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 2,036,617,696.46 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均衡增长股票型证券投资基金 2010 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、方侃于 2011 年 3 月 25 日签字出具了安永华明(2011)审字第 60466941_B04 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：汇添富均衡增长股票型证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	1,113,740,786.13	1,195,224,573.70
结算备付金	39,075,732.82	45,336,628.63
存出保证金	11,262,443.72	24,923,983.73
交易性金融资产	19,527,650,035.28	22,232,192,553.57
其中：股票投资	18,929,594,035.28	21,612,407,833.57
基金投资	-	-
债券投资	598,056,000.00	619,784,720.00
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	212,367,740.82	160,920,731.12
应收利息	7,864,379.17	3,731,902.76
应收股利	-	-
应收申购款	1,169,297.13	547,029.68
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	20,913,130,415.07	23,662,877,403.19
负债和所有者权益	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 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	-	166,456,641.75
应付赎回款	4,393,271.98	20,829,635.28
应付管理人报酬	27,073,564.12	29,748,413.47
应付托管费	4,512,260.68	4,958,068.92
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	15,994,182.31	19,152,650.73
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,931,464.69	2,944,136.49
负债合计	54,904,743.78	244,089,546.64
所有者权益：		
实收基金	9,288,770,307.65	9,904,118,503.65
未分配利润	11,569,455,363.64	13,514,669,352.90
所有者权益合计	20,858,225,671.29	23,418,787,856.55
负债和所有者权益总计	20,913,130,415.07	23,662,877,403.19

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8645 元，基金份额总额 24,127,691,465.11 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富均衡增长股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
一、收入	1,381,282,943.20	9,510,031,791.12
1. 利息收入	33,107,735.61	58,591,018.31
其中：存款利息收入	16,081,446.61	10,231,740.31
债券利息收入	14,538,520.67	48,353,105.86
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,487,768.33	6,172.14
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,948,189,728.85	2,834,841,056.88
其中：股票投资收益	1,825,706,176.46	2,606,436,288.79
基金投资收益	-	-
债券投资收益	34,443,094.56	98,182,581.32
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	88,040,457.83	130,222,186.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-600,526,117.77	6,614,764,048.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	511,596.51	1,835,667.66
减：二、费用	484,719,387.71	543,526,902.46
1. 管理人报酬	307,930,260.39	317,326,311.24
2. 托管费	51,321,710.15	52,887,718.63
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	124,583,224.74	172,507,584.73

5. 利息支出	419,957.84	350,267.15
其中：卖出回购金融资产支出	419,957.84	350,267.15
6. 其他费用	464,234.59	455,020.71
三、利润总额	896,563,555.49	8,966,504,888.66

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富均衡增长股票型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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）	9,904,118,503.65	13,514,669,352.90	23,418,787,856.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	896,563,555.49	896,563,555.49
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）	-615,348,196.00	-805,159,848.29	-1,420,508,044.29
其中：1. 基金申购款	655,002,364.75	648,617,497.54	1,303,619,862.29
2. 基金赎回款	-1,270,350,560.75	-1,453,777,345.83	-2,724,127,906.58
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）	-	-2,036,617,696.46	-2,036,617,696.46
五、期末所有者权益（基金净值）	9,288,770,307.65	11,569,455,363.64	20,858,225,671.29
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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）	11,445,592,316.24	6,211,606,612.66	17,657,198,928.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,966,504,888.66	8,966,504,888.66
三、本期基金份额交易产	-1,541,473,812.59	-1,663,442,148.42	-3,204,915,961.01

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	326,285,154.39	346,523,336.73	672,808,491.12
2. 基金赎回款	-1,867,758,966.98	-2,009,965,485.15	-3,877,724,452.13
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)	9,904,118,503.65	13,514,669,352.90	23,418,787,856.55

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
基金管理人负责人	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

汇添富均衡增长股票型证券投资基金(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[2006]125 号文《关于同意汇添富均衡增长股票型证券投资基金的批复》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 2006 年 8 月 7 日正式生效，首次设立募集规模为 4,935,775,576.48 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，包括国内依法发行、上市的股票、债券、权证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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

2007 年 8 月 15 日(拆分日)，本基金管理人汇添富基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分前，本基金的基金份额净值为人民币 2.5975 元，根据基金份额拆分公式，计算精确到小数点后第 9 位(第 9 位以后舍去)为人民币 2.597500910 元。本基金管理人于拆分日，按照 1:2.597500910 的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后，基金份额净值为人民币 1.0000 元，基金份额面值为人民币 0.3850 元。

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 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 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》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 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
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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	21,648,370,091.17	26.82	18,841,844,020.57	16.60

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	5,098,389.85	1.42	-	-

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 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	17,770,257.31	26.49	1,513,211.35	9.46
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	15,660,549.08	16.51	4,503,355.96	23.52

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	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	307,930,260.39	317,326,311.24
其中：支付给销售机构的客户维护费	71,313,868.54	72,892,015.41

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：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	51,321,710.15	52,887,718.63

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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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取。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

单位：人民币元

本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	309,884,198.64	-	-	-	-

注：本基金 2010 年末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 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2006 年 8 月 7 日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	37,391,200.70	7,628,905.94
期间申购/买入总份额	-	29,762,294.76
期间因拆分变动的份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	37,391,200.70	37,391,200.70
期末持有的基金份额占基金总份额比例(%)	0.15	0.15

注：1、其中“申购/买入”含红利再投、转换入份额；“赎回/卖出”含转换出份额。

2、本公司于 2009 年 6 月 10 日运用自有资金 10,000,000 元申购本基金份额 13,324,893.39 份，申购费用 1000 元；于 2009 年 9 月 3 日运用自有资金 12,500,000 元申购本基金份额 16,437,401.37 份，申购费用 1000 元。符合招募说明书规定的申购费率。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于 2010 年年末及 2009 年年末均未投资本基金。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 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	1,113,740,786.13	15,655,671.04	1,195,224,573.70	9,669,118.08

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 2010 年度及 2009 年度在承销期内未参与关联方承销证券。

7.4.9 期末（2010 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

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002215	诺普信	2010-3-17	2011-3-18	非公开发行流通受限	31.00	34.12	2,450,000	75,950,000.00	83,594,000.00	
601377	兴业证券	2010-9-29	2011-1-13	网下新股锁定期	10.00	16.20	2,519,157	25,191,570.00	40,810,343.40	
300140	启源装备	2010-11-3	2011-2-14	网下新股锁定期	39.98	45.50	91,090	3,641,778.20	4,144,595.00	
600998	九州通	2010-10-27	2011-2-9	网下新股锁定期	13.00	14.55	267,102	3,472,326.00	3,886,334.10	
300125	易世达	2010-9-27	2011-1-13	网下新股锁定期	55.00	83.49	37,672	2,071,960.00	3,145,235.28	

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
600518	康美药业	2010-12-28	配股停牌	19.71	2011-1-6	17.29	5,000,000	83,281,038.33	98,550,000.00	
600315	上海家化	2010-12-6	重组停牌	37.13			1,000,000	14,375,652.48	37,130,000.00	
300113	顺网科技	2010-12-13	重组停牌	69.40	2011-1-31	75.98	320,949	20,386,403.86	22,273,860.60	

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

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，因此没有作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金未从事交易所市场债券正回购交易，因此没有作为抵押的债券。

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	18,929,594,035.28	90.52
	其中：股票	18,929,594,035.28	90.52
2	固定收益投资	598,056,000.00	2.86
	其中：债券	598,056,000.00	2.86
	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	1,152,816,518.95	5.51
6	其他各项资产	232,663,860.84	1.11
7	合计	20,913,130,415.07	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	376,504,666.99	1.81
B	采掘业	902,179,432.60	4.33
C	制造业	9,969,286,315.83	47.80
C0	食品、饮料	2,175,872,504.78	10.43
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	152,142,679.56	0.73
C4	石油、化学、塑胶、塑料	450,921,342.22	2.16
C5	电子	1,273,696,606.47	6.11
C6	金属、非金属	1,864,755,954.36	8.94
C7	机械、设备、仪表	1,364,184,725.27	6.54
C8	医药、生物制品	2,442,157,536.90	11.71

C99	其他制造业	245,554,966.27	1.18
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	820,615,044.53	3.93
F	交通运输、仓储业	704,566,886.55	3.38
G	信息技术业	2,100,707,799.33	10.07
H	批发和零售贸易	1,583,656,438.99	7.59
I	金融、保险业	1,018,463,587.35	4.88
J	房地产业	221,571,125.04	1.06
K	社会服务业	611,989,731.77	2.93
L	传播与文化产业	58,740,000.00	0.28
M	综合类	561,313,006.30	2.69
	合计	18,929,594,035.28	90.75

8.3 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

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	002007	华兰生物	24,467,524	1,183,983,486.36	5.68
2	000012	南玻A	39,360,517	777,370,210.75	3.73
3	600415	小商品城	16,018,938	561,303,587.52	2.69
4	002230	科大讯飞	6,716,241	530,583,039.00	2.54
5	601318	中国平安	8,999,868	505,432,586.88	2.42
6	002081	金螳螂	7,000,000	481,460,000.00	2.31
7	000858	五粮液	13,000,648	450,212,440.24	2.16
8	002304	洋河股份	1,960,698	439,196,352.00	2.11
9	601111	中国国航	30,899,809	422,709,387.12	2.03
10	000501	鄂武商A	21,684,477	398,777,532.03	1.91

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 网站的年度报告正文。

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	601111	中国国航	886,753,346.28	3.79
2	000012	南玻A	848,784,027.14	3.62

3	002007	华兰生物	718,822,166.99	3.07
4	000568	泸州老窖	654,903,479.63	2.80
5	600395	盘江股份	621,945,764.53	2.66
6	600415	小商品城	553,717,098.06	2.36
7	000729	燕京啤酒	534,081,533.66	2.28
8	000858	五 粮 液	509,256,179.40	2.17
9	601288	农业银行	474,545,941.76	2.03
10	000501	鄂武商 A	442,414,769.37	1.89
11	600221	海南航空	399,020,847.28	1.70
12	000338	潍柴动力	370,898,573.65	1.58
13	600519	贵州茅台	367,792,315.46	1.57
14	002123	荣信股份	335,043,816.81	1.43
15	600016	民生银行	332,922,138.01	1.42
16	002415	海康威视	332,406,145.79	1.42
17	300070	碧水源	329,525,677.86	1.41
18	600575	芜湖港	328,581,638.47	1.40
19	600036	招商银行	315,991,935.27	1.35
20	002230	科大讯飞	299,622,072.08	1.28

注：本项“买入金额”按成交金额填列，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	601166	兴业银行	1,162,231,951.71	4.96
2	600519	贵州茅台	993,426,499.65	4.24
3	000858	五 粮 液	757,636,235.05	3.24
4	601001	大同煤业	703,328,565.08	3.00
5	601601	中国太保	671,794,821.38	2.87
6	600395	盘江股份	586,617,887.31	2.50
7	601318	中国平安	555,524,682.82	2.37
8	000338	潍柴动力	533,156,686.85	2.28
9	000895	双汇发展	515,305,637.00	2.20
10	600546	山煤国际	508,691,730.09	2.17
11	000729	燕京啤酒	508,180,155.40	2.17
12	600016	民生银行	477,501,643.26	2.04
13	600348	国阳新能	477,273,512.73	2.04

14	601288	农业银行	470,956,321.98	2.01
15	002024	苏宁电器	452,156,172.48	1.93
16	601169	北京银行	434,261,276.60	1.85
17	600418	江淮汽车	424,679,974.53	1.81
18	601111	中国国航	404,585,411.06	1.73
19	000001	深发展 A	402,116,693.55	1.72
20	600298	安琪酵母	381,490,733.92	1.63

注：本项“卖出金额”按成交金额填列，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	38,681,614,287.08
卖出股票收入（成交）总额	42,600,045,462.83

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	206,356,000.00	0.99
2	央行票据	391,700,000.00	1.88
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	-	-
	其他	-	-
	合计	598,056,000.00	2.87

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	1001095	10 央票 95	2,000,000	193,600,000.00	0.93
2	0801035	08 央票 35	1,000,000	100,290,000.00	0.48
3	109907	10 贴现国债 07	1,000,000	98,290,000.00	0.47
4	1001021	10 央票 21	1,000,000	97,810,000.00	0.47
5	109909	10 贴现国债	900,000	89,118,000.00	0.43

		09			
--	--	----	--	--	--

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	11,262,443.72
2	应收证券清算款	212,367,740.82
3	应收股利	-
4	应收利息	7,864,379.17
5	应收申购款	1,169,297.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	232,663,860.84

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

本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限股票。

§ 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 (%)
1, 129, 526	21, 360. 90	149, 745, 366. 54	0. 62	23, 977, 946, 098. 57	99. 38

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	2, 110, 273. 59	0. 01

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2006 年 8 月 7 日) 基金份额总额	4, 935, 775, 576. 48
本报告期期初基金份额总额	25, 726, 028, 595. 96
本报告期基金总申购份额	1, 701, 410, 945. 70
减: 本报告期基金总赎回份额	3, 299, 748, 076. 55
本报告期期末基金份额总额	24, 127, 691, 465. 11

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、基金管理人 2010 年 1 月 9 日公告，增聘陈晓翔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，庞飒先生不再担任该基金的基金经理。

2、基金管理人 2010 年 2 月 6 日公告，增聘吴振翔先生担任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。增聘王栩先生担任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理，庞飒先生不再担任该基金的基金经理。

3、《汇添富民营活力股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 5 月 5 日正式生效，齐东超先生任该基金的基金经理。

4、《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基金合同》于 2010 年 6 月 25 日正式生效，刘子龙先生、王致人先生任该基金的基金经理。

5、基金管理人 2010 年 8 月 5 日公告，经汇添富基金管理有限公司第二届董事会第八次会议

决议，并经中国证监会审核批准（证监许可[2010]1013 号文），公司聘任陈灿辉先生为公司副总经理。

6、《汇添富医药保健股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 9 月 21 日正式生效，王栩先生任该基金的基金经理，周睿先生、叶从飞先生任该基金的基金经理助理。

7、基金托管人中国工商银行经证监会审批任命晏秋生为资产托管部副总经理。

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自本基金合同生效日（2006 年 8 月 7 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期末，应付未付的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	21,648,370,091.17	26.82	17,770,257.31	26.49	-
申银万国	2	7,487,066,459.05	9.28	6,113,345.27	9.11	-
中信建投	1	6,261,823,610.41	7.76	5,322,535.15	7.93	-
安信证券	2	5,608,583,706.89	6.95	4,599,184.15	6.86	-
国泰君安	2	4,188,327,695.18	5.19	3,403,052.80	5.07	-
中金公司	2	4,149,538,453.10	5.14	3,441,036.09	5.13	-
国金证券	1	3,556,614,514.06	4.41	2,889,771.08	4.31	-
上海证券	1	2,924,895,553.17	3.62	2,486,156.60	3.71	-
招商证券	1	2,620,001,060.42	3.25	2,226,991.04	3.32	-
渤海证券	1	2,423,783,661.96	3.00	2,060,208.66	3.07	-
广发证券	1	2,222,662,479.82	2.75	1,889,251.77	2.82	-
长江证券	1	2,096,484,027.57	2.60	1,782,004.63	2.66	-
光大证券	1	1,785,628,425.28	2.21	1,517,779.88	2.26	-

中银国际	1	1,732,193,367.90	2.15	1,472,359.81	2.19	-
海通证券	1	1,672,210,026.46	2.07	1,421,370.16	2.12	-
湘财证券	1	1,604,859,021.84	1.99	1,364,119.74	2.03	-
平安证券	1	1,410,138,409.67	1.75	1,145,746.86	1.71	-
国元证券	1	1,277,826,814.79	1.58	1,086,150.38	1.62	-
德邦证券	1	1,135,617,857.90	1.41	965,273.14	1.44	-
西南证券	1	1,123,074,632.44	1.39	954,610.16	1.42	-
中信证券	2	1,085,693,609.20	1.35	922,837.06	1.38	-
高华证券	1	555,806,584.71	0.69	451,597.43	0.67	-
信达证券	1	423,097,020.02	0.52	359,628.79	0.54	-
宏源证券	1	412,514,960.99	0.51	350,635.49	0.52	-
国联证券	1	403,121,105.80	0.50	327,537.90	0.49	-
第一创业	1	315,392,403.33	0.39	268,083.28	0.40	-
西部证券	1	246,342,873.18	0.31	209,389.02	0.31	-
兴业证券	2	232,515,130.74	0.29	197,638.46	0.29	-
瑞银证券	1	77,481,719.11	0.10	65,859.21	0.10	-
首创证券	1	27,777,795.56	0.03	23,611.17	0.04	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
合计	41	80,709,443,071.72	100.00	67,088,022.49	100.00	-

注：此处的佣金指基金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	5,098,389.85	1.42
申银万国	-	-
中信建投	117,578,751.30	32.77
安信证券	-	-
国泰君安	-	-
中金公司	16,869,113.69	4.70
国金证券	-	-
上海证券	-	-
招商证券	53,018,507.80	14.78
渤海证券	6,645,417.40	1.85
广发证券	100,377,156.40	27.98

长江证券	-	-
光大证券	53,368,426.00	14.87
中银国际	-	-
海通证券	-	-
湘财证券	-	-
平安证券	5,837,005.54	1.63
国元证券	-	-
德邦证券	-	-
西南证券	1,102.80	0.00
中信证券	-	-
高华证券	-	-
信达证券	-	-
宏源证券	-	-
国联证券	-	-
第一创业	-	-
西部证券	-	-
兴业证券	-	-
瑞银证券	-	-
首创证券	-	-
国信证券	-	-
华泰联合证券	-	-
新时代证券	-	-
浙商证券	-	-
合计	358,793,870.78	100.00

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:

本报告期新增 8 家证券公司的 8 个交易单元:首创证券(上交所交易单元)、华泰联合证券(上交所交易单元)、信达证券(上交所交易单元)、第一创业证券(上交所交易单元)、广发证券(上交所交易单元)、西南证券(上交所交易单元)、浙商证券(深交所交易单元)、国联证券(深交所交易单元)。

汇添富基金管理有限公司
2011 年 3 月 28 日