

汇添富增强收益债券型证券投资基金 2010 年年度报告

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。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	20
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.....	20
§6 审计报告	20
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
8.7 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.....	55
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.....	55
8.9 投资组合报告附注.....	55
§9 基金份额持有人信息	56

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
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	56
§10 开放式基金份额变动.....	57
§11 重大事件揭示.....	57
11.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8 其他重大事件	59
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富增强收益债券型证券投资基金	
基金简称	汇添富增强收益债券	
基金主代码	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	
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	1,787,365,914.91 份	
基金合同存续期	不定期	
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	1,756,317,886.07 份	31,048,028.84 份

2.2 基金产品说明

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。

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
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95588
传真	021-28932998	010-66105798
注册地址	上海市黄浦区大沽路 288 号 6 幢 538 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140

法定代表人	桂水发	姜建清
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 22 层

§ 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 03 月 06 日(基金合同生效日)至 2008 年 12 月 31 日	
	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C
本期已实现收益	151,349,610.09	4,440,488.83	115,250,270.52	6,776.73	280,316,124.60	-
本期利润	145,455,812.91	9,735,404.73	12,344,525.55	21,548.27	405,885,993.10	-
加权平均基金份额本期利润	0.0755	0.1523	0.0054	0.0158	0.0918	-
本期加权平均净值利润率	6.98%	14.07%	0.51%	1.49%	8.95%	-
本期基金份额净值增长率	7.14%	6.77%	1.83%	1.53%	9.55%	-
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末		2009 年末		2008 年末	
	汇添富增强收益债	汇添富增强收益债	汇添富增强收益债	汇添富增强收益债	汇添富增强收益债	汇添富增强收益债

	券 A	券 C	券 A	券 C	券 A	券 C
期末可供分配利润	153,540,966.68	2,555,965.41	82,836,461.77	112,402.69	142,937,020.65	-
期末可供分配基金份额利润	0.0874	0.0823	0.0579	0.0567	0.0333	-
期末基金资产净值	1,911,732,793.52	33,635,692.03	1,522,185,981.70	2,106,433.84	4,564,675,602.21	-
期末基金份额净值	1.088	1.083	1.064	1.063	1.065	-
3.1.3 累计期末指标	2010 年末		2009 年末		2008 年末	
	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C
基金份额累计净值增长率	19.53%	8.40%	11.56%	1.53%	9.55%	-

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。

5、本基金的《基金合同》生效日为 2008 年 3 月 6 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 2010 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

汇添富增强收益债券 A

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	1.02%	0.31%	-2.98%	0.15%	4.00%	0.16%
过去六个月	4.21%	0.24%	-2.83%	0.11%	7.04%	0.13%
过去一年	7.14%	0.19%	-0.87%	0.10%	8.01%	0.09%
自基金合同生效起至今	19.53%	0.15%	3.28%	0.15%	16.25%	0.00%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2008 年 3 月 6 日，至本报告期末未满三年。

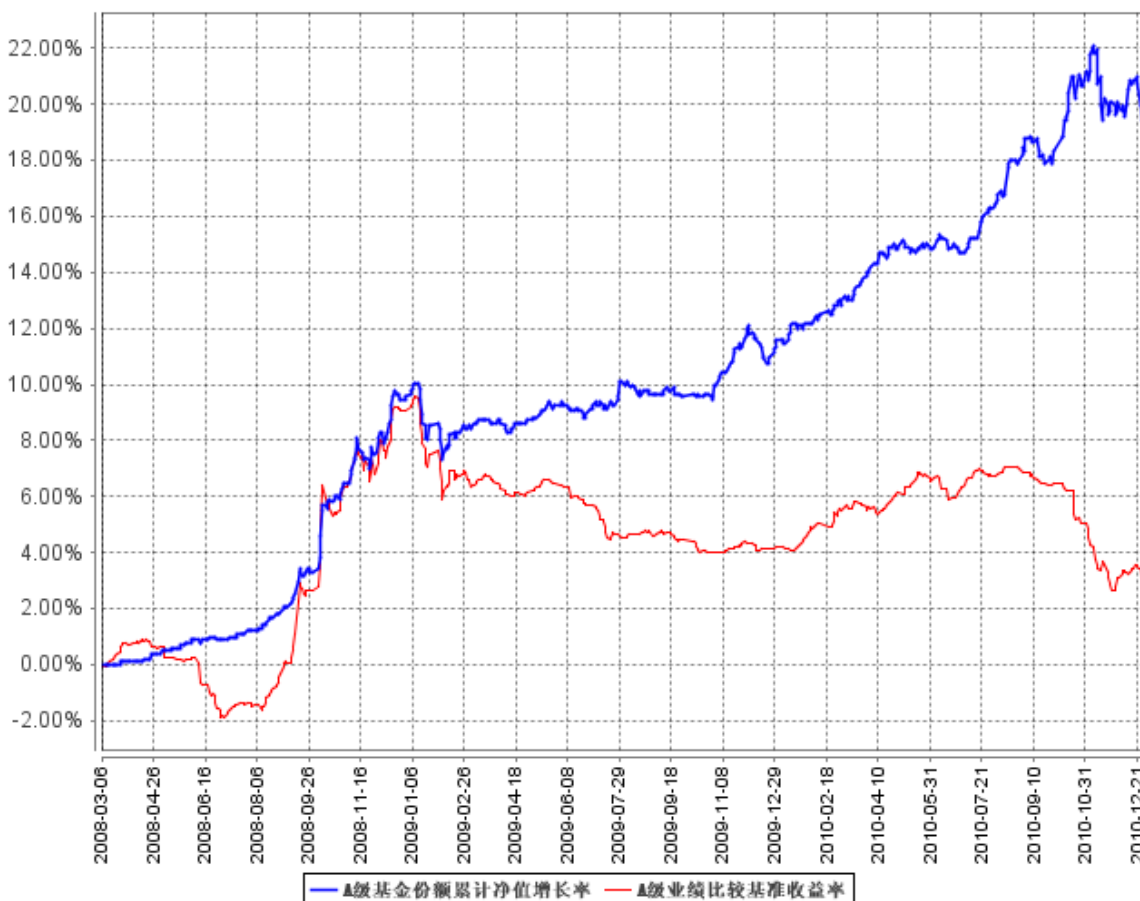
汇添富增强收益债券 C

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	1.03%	0.31%	-2.98%	0.15%	4.01%	0.16%
过去六个月	4.03%	0.24%	-2.83%	0.11%	6.86%	0.13%
过去一年	6.77%	0.19%	-0.87%	0.10%	7.64%	0.09%
自基金合同生效起至今	8.40%	0.17%	-1.39%	0.09%	9.79%	0.08%

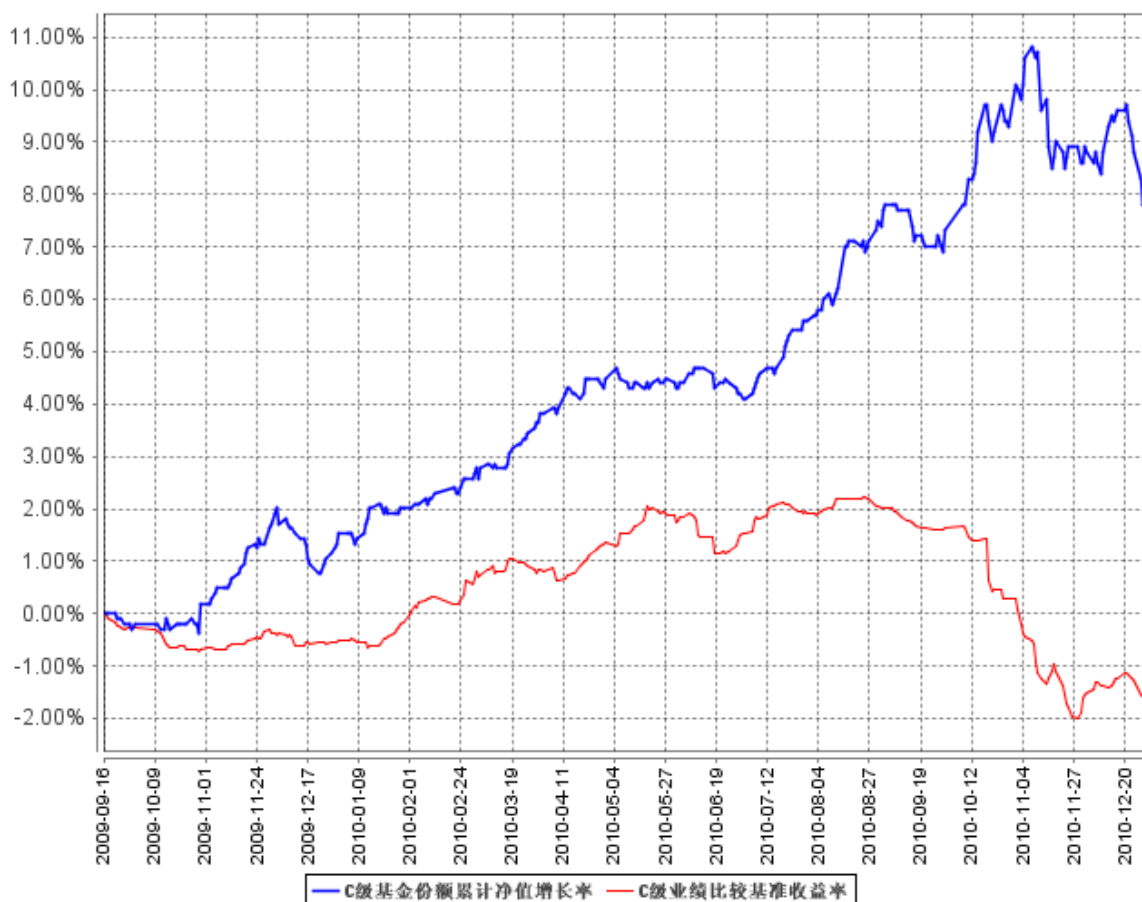
注：汇添富增强收益 C 类基金的基金分级日为 2009 年 9 月 15 日，至本报告期末未满三年。

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

A 级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



C级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

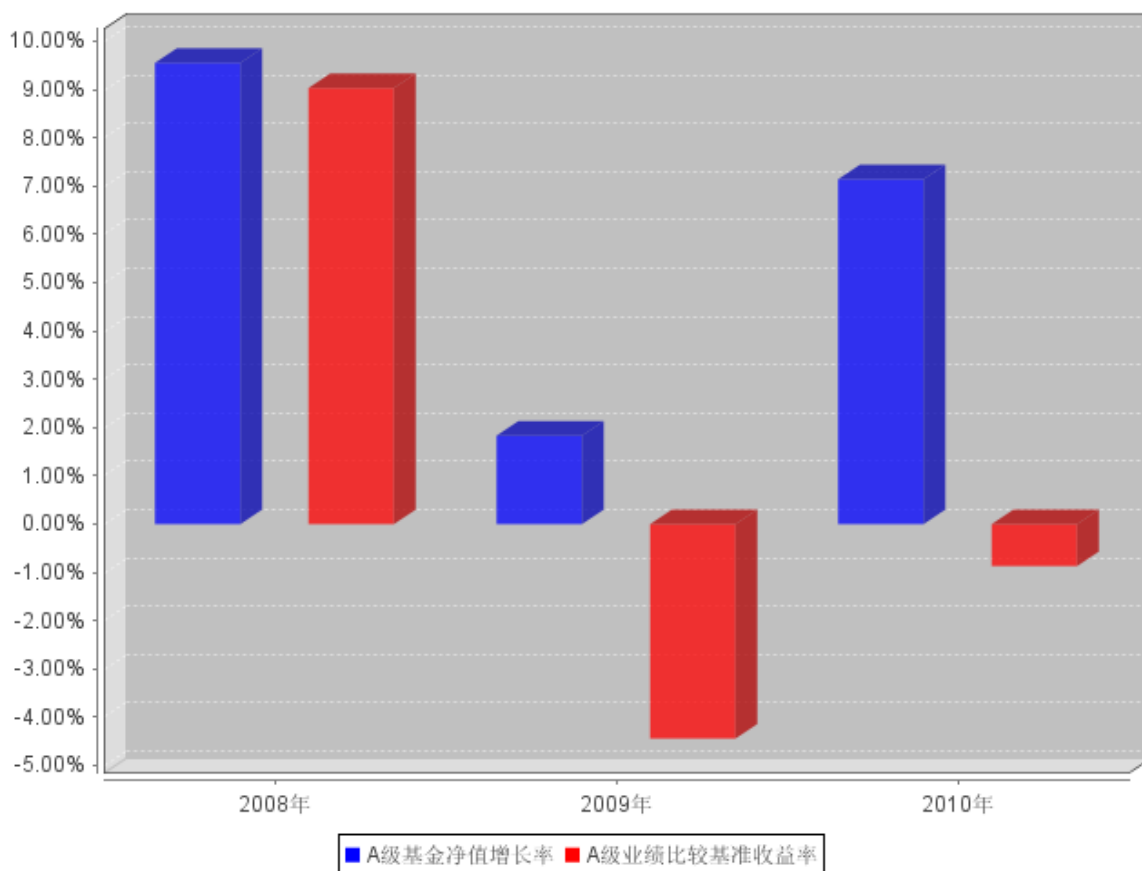


注：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2008年3月6日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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基准收益率自2009年9月15日起计算。

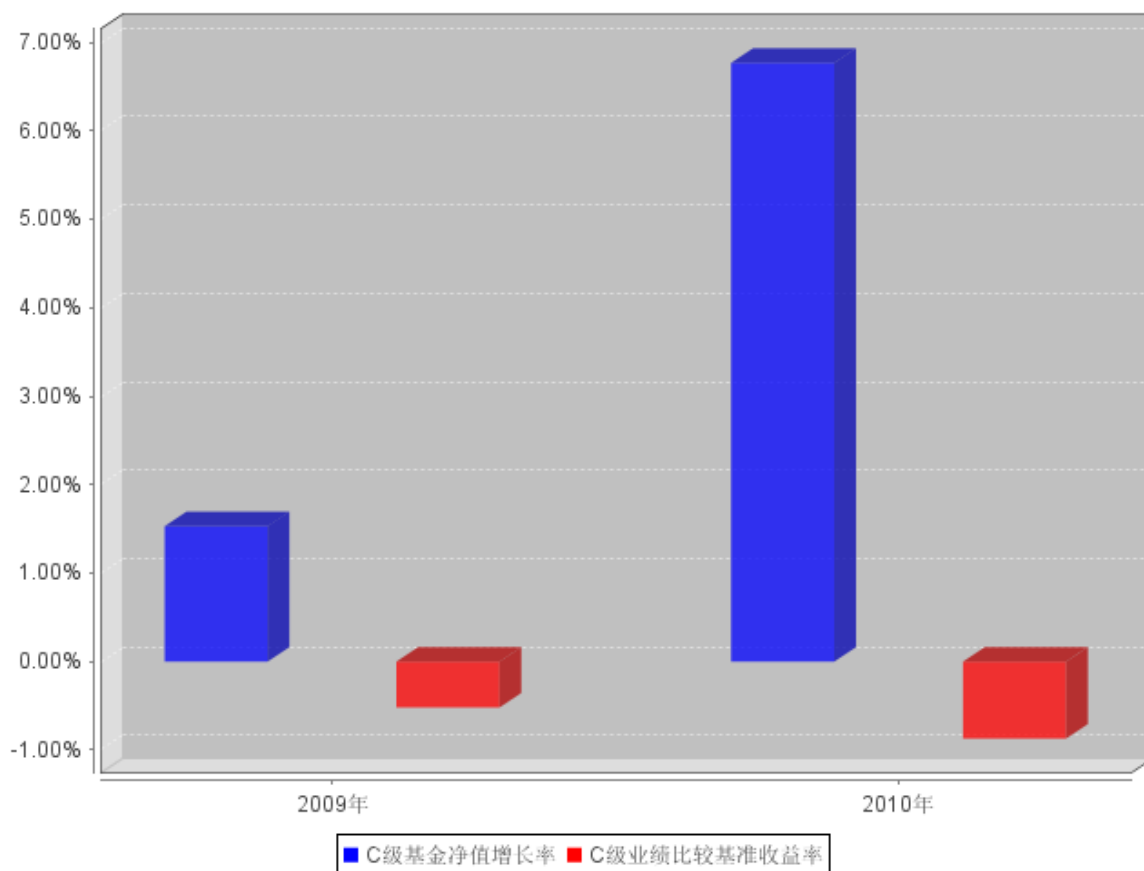
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级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：本基金的《基金合同》生效之日为 2008 年 3 月 6 日，至本报告期末未满五年。

C级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、汇添富增强收益C类基金的基金分级日为2009年9月15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

汇添富增强收益债券 A					
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年	0.500	79,544,919.62	25,399,470.82	104,944,390.44	-
2009年	0.200	31,523,991.48	13,946,423.66	45,470,415.14	-
2008年	0.300	88,150,327.21	47,109,483.95	135,259,811.16	-
合计	1.000	199,219,238.31	86,455,378.43	285,674,616.74	-

汇添富增强收益债券 C					
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年	0.500	1,012,369.03	236,872.89	1,249,241.92	-
2009年	-	-	-	-	-
合计	0.500	1,012,369.03	236,872.89	1,249,241.92	-

§ 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有效地贯彻和执行。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多贡献。

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		

<p>王珏池</p>	<p>本基金的基金经理，汇添富货币市场基金的基金经理。</p>	<p>2008 年 3 月 6 日</p>	<p>-</p>	<p>16 年</p>	<p>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。</p>
------------	---------------------------------	-----------------------	----------	-------------	--

陆文磊	本基金的基金经理，汇添富货币市场基金的基金经理。	2008 年 3 月 6 日	-	8 年	<p>国籍：中国。学历：华东师范大学金融学博士。</p> <p>相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。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，2009 年 1 月 21 日至今任汇添富货币市场基金的基金经理。</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 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 年宏观经济继续稳步回升，全年 GDP 增长率达到 10.3%，经济已经完全摆脱了金融危机的影响，步入了新一轮增长的轨道。经济运行层面值得关注的变化主要体现在三个方面：首先，2010 年出口增速超过 30%，明显超预期，投资增速比 09 年有所回落，消费继续保持较快增长，内外需对经济增长的拉动更加均衡，经济内生增长的动力逐渐增强，对积极经济政策的依赖程度下降；其次，通胀压力明显上升，2010 年通胀前低后高，四季度以后 CPI 涨幅明显扩大，最高突破 5%，创 09 年以来的新高；最后，宏观调控政策开始转向，宏观流动性明显收紧。为避免出现过度刺激导致经济过热的风险，2010 年二季度以来宏观调控政策开始出现转变，对房地产市场、地方融资平台和金融机构信贷投放的节奏等方面调控力度明显加大。四季度以后随着通胀压力上升，央行更是连续出台紧缩政策，短时间内 3 次加息、3 次上调准备金率，导致流动性明显收紧，2010 年四季度以来整个金融市场流动性处于非常紧张的状态。

2010 年债券市场呈前高后低走势，上半年由于资金面相对宽松以及二季度宏观调控政策开始收紧导致市场对经济回落的预期加强，债券市场震荡上行，下半年随着资金面趋于紧张和央行启

动加息，债券市场开始回落，四季度以后市场更是出现大幅下跌的走势。全年中债总指数上涨 1.92%。从不同类别债券看，信用债券全年持有期收益明显高于利率品种。可转债市场呈先抑后扬走势，上半年由于大幅扩容和股票市场下跌，可转债以下跌为主，下半年以后随着股票市场转暖，可转债出现较大幅度上涨。

本基金在 2010 年上半年采取了较为积极的投资策略，较高比例配置了高票息的企业债和公司债，低配可转债，三季度我们大比例提高了可转债的配置比例，并且考虑到信用品种利率水平已经偏低、信用利差偏窄，我们大幅降低了信用债配置比例，全年较好地把握住了债券品种的主要投资机会。此外，2010 年新股发行速度明显加快，新股投资非常活跃，我们在新股申购上采取了较为积极的策略，新股投资为本基金提供了较为丰厚的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，汇添富增强收益债券 A 净值增长 7.14%，汇添富增强收益债券 C 净值增长 6.77%，均跑赢业绩基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年宏观经济有望保持平稳增长，全年 GDP 增长率有望达到 9.5%-10%，出口在全球继续复苏的背景下仍将保持较快增长，但受基数提高的影响增速可能有所回落。考虑到 2010 年下半年以来政府对房地产市场、地方融资平台的调控力度持续加大，对信贷资金投向和信贷投放节奏的要求不断提高，2011 年投资增长速度将比 2010 年有所放缓。消费将继续保持较快增长。2011 年通胀仍面临一定的上行压力，推动通胀上行的因素主要包括全球大宗商品上涨、劳动力成本上升等，但我们认为通胀形势总体可控，CPI 有望呈现前高后低的走势，全年涨幅在 4% 左右，下半年以后随着基数的提高，CPI 涨幅有望逐渐回落。2011 年货币政策的基调是“稳健”，央行确定的调控目标为 M2 增长 16% 左右，为实现调控目标，央行可能继续通过上调准备金率、出台动态差别准备金率政策等手段严格控制流动性投放，以此平滑贷款投放总量和节奏，全年市场流动性可能持续偏紧。目前实际存款利率仍然为负，居民通胀预期较强，2011 年仍有进一步加息的空间，但大幅加息的可能性较小，预计 1 年期定期存款利率有望上调至 3.5% 左右。

考虑到 2011 年偏紧的货币政策环境和流动性环境，债券市场暂时难以出现明显的投资机会，债券收益率仍存在继续上升的空间，但经历了较大幅度调整以后，目前债券收益率曲线已经对未来的加息作出了较为充分的预期，因此收益率曲线继续大幅上升的可能性也不大。本基金管理人将密切跟踪通胀、货币政策、流动性等核心因素的变化，对债券组合的久期和品种结构进行灵活的调整。2011 年我们将更加注重票息收益，精细布局高票息的信用债券进行投资，以获取较高的

利息收益，利率产品主要关注阶段性的投资机会。同时，在做好基本面分析的基础上有选择地参与新股申购和可转债投资，继续为投资者创造持续稳定的收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司以维护基金份额持有人利益为宗旨，有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则，认真履行职责，通过常规稽核、专项检查 and 系统监控等方式方法积极开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，促进内部控制和风险管理的不断改进，并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

（一）完善规章制度，健全内部控制体系

在本报告期内，督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估，并根据各项业务特点、业务发展实际，建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程，进一步明确了内部控制和风险管理责任，公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善，为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

（二）加强稽核监察，确保基金运作和公司经营合法合规

本报告期内，督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察，包括对基金投资交易行为、投资指标的监控，对投资组合的风险度量、评估和建议，对基金信息披露的审核、监督，对基金销售、营销的稽核、控制，对基金营运、技术系统的稽核、评估，切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

（三）强化培训教育，提高全员合规意识

本报告期内，督察长和稽核监察部门积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险意识、合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强内部控制和风险管理，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

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、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。

4.8 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 12 次，A 类基金全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 25%，C 类基金每次分配比例不得低于可供分配收益的 25%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本报告期内，本基金于 2010 年 6 月 29 日对基金份额持有人进行了一次利润分配，其中汇添富增强收益债券 A 每份基金份额分红 0.05 元，分配金额为 104,944,390.44 元；汇添富增强收益债券 C 每份基金份额分红 0.05 元，分配金额为 1,249,241.92 元。

§ 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增强收益债券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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010 年，汇添富增强收益债券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增强收益债券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，汇添富增强收益债券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 106,193,632.36 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增强收益债券型证券投资基金 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

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富增强收益债券型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的汇添富增强收益债券型证券投资基金（以下简称“添富增收债券基金”）的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是添富增收债券基金的基金管理人汇添富基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露

	<p>的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了添富增收债券基金 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。</p>
注册会计师的姓名	徐 艳 方 侃
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2011 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富增强收益债券型证券投资基金

报告截止日： 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	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	7.4.7.1	51,292,752.90	206,377,533.29
结算备付金		511,113.05	1,913,591.22
存出保证金		250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	1,865,622,557.66	1,472,055,430.28
其中：股票投资		225,039,614.78	137,472,690.46
基金投资		-	-
债券投资		1,640,582,942.88	1,334,582,739.82
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	92,000,000.00
应收利息	7.4.7.5	20,413,387.84	14,674,753.70
应收股利		-	-
应收申购款		9,450,812.78	147,230.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,947,540,624.23	1,787,418,539.10
负债和所有者权益	附注号	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		-	260,299,547.55
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		142,818.17	1,033,774.23
应付管理人报酬		993,971.44	840,366.31
应付托管费		331,323.84	280,122.11
应付销售服务费		7,089.75	684.05
应付交易费用	7.4.7.7	46,908.52	13,831.30
应交税费		-	-
应付利息		-	7,349.95
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	650,026.96	650,448.06
负债合计		2,172,138.68	263,126,123.56
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,787,365,914.91	1,432,245,307.23
未分配利润	7.4.7.10	158,002,570.64	92,047,108.31
所有者权益合计		1,945,368,485.55	1,524,292,415.54
负债和所有者权益总计		1,947,540,624.23	1,787,418,539.10

注：1、报告截止日 2010 年 12 月 31 日，添富增收（A 类）基金份额净值 1.088 元，添富增收（C 类）基金份额净值 1.083 元；添富增收基金份额总额 1,787,365,914.91 份（其中 A 类 1,756,317,886.07 份，C 类 31,048,028.84 份）。

2、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、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

7.2 利润表

会计主体：汇添富增强收益债券型证券投资基金

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	附注号	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		177,801,418.47	35,229,848.65
1. 利息收入		57,155,108.91	74,697,139.34
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,724,235.76	2,341,912.89
债券利息收入		55,350,791.19	72,355,226.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		80,081.96	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		120,624,997.16	62,149,449.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	72,536,607.16	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	47,952,302.44	60,370,880.52
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	1,730,005.79
股利收益	7.4.7.15	136,087.56	48,562.72
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-598,881.28	-102,890,973.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	620,193.68	1,274,233.71
减：二、费用		22,610,200.83	22,863,774.83
1. 管理人报酬		12,910,017.24	14,567,358.40
2. 托管费		4,303,339.05	4,855,786.08
3. 销售服务费		284,910.95	1,671.69
4. 交易费用	7.4.7.18	862,795.41	83,822.89
5. 利息支出		3,794,178.84	2,909,259.70
其中：卖出回购金融资产支出		3,794,178.84	2,909,259.70
6. 其他费用	7.4.7.19	454,959.34	445,876.07
三、利润总额		155,191,217.64	12,366,073.82

注：1、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。

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富增强收益债券型证券投资基金

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）	1,432,245,307.23	92,047,108.31	1,524,292,415.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	155,191,217.64	155,191,217.64
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）	355,120,607.68	16,957,877.05	372,078,484.73
其中：1. 基金申购款	1,971,440,425.55	151,694,370.14	2,123,134,795.69
2. 基金赎回款	-1,616,319,817.87	-134,736,493.09	-1,751,056,310.96
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）	-	-106,193,632.36	-106,193,632.36
五、期末所有者权益（基金净值）	1,787,365,914.91	158,002,570.64	1,945,368,485.55
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）	4,287,722,486.16	276,953,116.05	4,564,675,602.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,366,073.82	12,366,073.82
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）	-2,855,477,178.93	-151,801,666.42	-3,007,278,845.35
其中：1. 基金申购款	1,973,412,910.15	89,202,139.65	2,062,615,049.80
2. 基金赎回款	-4,828,890,089.08	-241,003,806.07	-5,069,893,895.15
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）	-	-45,470,415.14	-45,470,415.14

五、期末所有者权益（基金净值）	1,432,245,307.23	92,047,108.31	1,524,292,415.54
-----------------	------------------	---------------	------------------

注：1、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。

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

汇添富增强收益债券型证券投资基金(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[2007]346 号文《关于核准汇添富增强收益债券型证券投资基金募集的批复》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 2008 年 3 月 6 日正式生效,首次设立募集规模为 5,049,981,789.51 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公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司和汇添富基金管理公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金 C 类收费模式的推出时间为 2009 年 9 月 15 日。自该日起,投资人可选择按照原有前端收取申购费和赎回费的 A 类模式,亦可选择按照不收取前端申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的 C 类收费模式申购本基金份额,但 C 类基金份额不能通过上海证券交易所开放式基金销售系统进行场内申购,只能通过场外销售机构购买。

本基金对债券等固定收益类品种的投资比例为基金资产的 80%-100%,现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,股票(由认购新股所得,不在二级市场买入)等权益类品种的投资比例为基金资产的 0-20%。本基金建立了自上而下和自下而上两方面的研究流程,自上而下的研究包含宏观基本面分析、资金技术面分析,自下而上的研究包含信用分析、个券分析、创新金融工具和交易策略分析,由此形成宏观和微观层面相配套的研究决策体系,最后形成具体的投资策略。本基金的业绩比较基准为:中债总指数。

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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债)，并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资)；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和

其他金融负债；本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债；

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益；每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资；股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益；卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资；债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资；权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益；卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购)，以成本列示，按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以使用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日

的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

C. 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

D. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理。

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交

易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入

“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以使用合同利率)，在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.60%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提；

(3) 对于 A 类基金份额，不收取销售服务费；对于 C 类基金份额，基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40%的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率

差异较小时，也可以使用合同利率)在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本系列基金旗下各基金的收益分配由各基金分别、独立进行。由于汇添富增强收益债券基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。汇添富增强收益债券基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权；

(2) 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，A 类基金全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 25%，C 类基金每次分配比例不得低于可供分配收益的 25%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(3) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式，选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的分红资金将按红利发放日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(4) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(5) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

(6) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	51,292,752.90	206,377,533.29
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	51,292,752.90	206,377,533.29

注：本基金 2010 年度未投资于定期存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	201,622,202.02	225,039,614.78	23,417,412.76	
债券	交易所市场	869,807,301.16	875,136,942.88	5,329,641.72
	银行间市场	772,113,040.69	765,446,000.00	-6,667,040.69
	合计	1,641,920,341.85	1,640,582,942.88	-1,337,398.97
资产支持证券	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,843,542,543.87	1,865,622,557.66	22,080,013.79	
项目	上年度末 2009 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	108,342,483.61	137,472,690.46	29,130,206.85	
债券	交易所市场	850,224,024.89	844,103,739.82	-6,120,285.07
	银行间市场	490,810,026.71	490,479,000.00	-331,026.71
	合计	1,341,034,051.60	1,334,582,739.82	-6,451,311.78
资产支持证券	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,449,376,535.21	1,472,055,430.28	22,678,895.07	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末和上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末和上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末和上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	33,683.79	75,031.40
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,951.39	1,025.92
应收债券利息	20,377,752.66	14,598,696.38
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	20,413,387.84	14,674,753.70

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末和上年度期末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	30,273.82	-
银行间市场应付交易费用	16,634.70	13,831.30
合计	46,908.52	13,831.30

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	26.96	448.06
预提审计费用	80,000.00	80,000.00
预提信息披露费	320,000.00	320,000.00
合计	650,026.96	650,448.06

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富增强收益债券 A		
项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,430,263,827.01	1,430,263,827.01
本期申购	1,481,007,479.82	1,481,007,479.82
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,154,953,420.76	-1,154,953,420.76
本期末	1,756,317,886.07	1,756,317,886.07

汇添富增强收益债券 C		
项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,981,480.22	1,981,480.22
本期申购	490,432,945.73	490,432,945.73
本期赎回 (以“-”号填列)	-461,366,397.11	-461,366,397.11
本期末	31,048,028.84	31,048,028.84

注：1、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。

2、表中“本期申购”包含红利再投、转换入份额，“本期赎回”包含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇添富增强收益债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	82,836,461.77	9,085,692.92	91,922,154.69
本期利润	151,349,610.09	-5,893,797.18	145,455,812.91
本期基金份额交易产生的变动数	24,299,285.26	-1,317,954.97	22,981,330.29
其中：基金申购款	99,477,674.36	16,824,078.62	116,301,752.98
基金赎回款	-75,178,389.10	-18,142,033.59	-93,320,422.69
本期已分配利润	-104,944,390.44	-	-104,944,390.44
本期末	153,540,966.68	1,873,940.77	155,414,907.45

汇添富增强收益债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	112,402.69	12,550.93	124,953.62
本期利润	4,440,488.83	5,294,915.90	9,735,404.73
本期基金份额交易产生的变动数	-747,684.19	-5,275,769.05	-6,023,453.24
其中：基金申购款	26,678,261.81	8,714,355.35	35,392,617.16
基金赎回款	-27,425,946.00	-13,990,124.40	-41,416,070.40

本期已分配利润	-1,249,241.92	-	-1,249,241.92
本期末	2,555,965.41	31,697.78	2,587,663.19

注：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。

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	1,638,446.21	2,277,636.22
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	25,151.92	18,390.98
其他	60,637.63	45,885.69
合计	1,724,235.76	2,341,912.89

注：表中“其他”指直销申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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
卖出股票成交总额	377,676,369.79	-
减：卖出股票成本总额	305,139,762.63	-
买卖股票差价收入	72,536,607.16	-

7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成交总额	4,943,858,041.54	9,267,397,021.20
减：卖出债券（、债转股及债 券到期兑付）成本总额	4,831,594,158.70	9,052,327,205.75
减：应收利息总额	64,311,580.40	154,698,934.93
债券投资收益	47,952,302.44	60,370,880.52

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

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
卖出权证成交总额	-	4,625,210.22
减：卖出权证成本总额	-	2,895,204.43
买卖权证差价收入	-	1,730,005.79

7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	136,087.56	48,562.72
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	136,087.56	48,562.72

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-598,881.28	-102,890,973.43
——股票投资	-5,712,794.09	29,130,206.85
——债券投资	5,113,912.81	-132,021,180.28
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-598,881.28	-102,890,973.43

7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	620,056.50	1,274,233.71
其他	137.18	

合计	620,193.68	1,274,233.71
----	------------	--------------

注：本基金本期其他收入中的“其他”是指根据上海证券交易所发布的有关规定返还的 2008 年券商印花税。

7.4.7.18 交易费用

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
交易所市场交易费用	798,145.41	16,935.39
银行间市场交易费用	64,650.00	66,887.50
合计	862,795.41	83,822.89

7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	320,000.00	320,000.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行划款费用	36,959.34	27,876.07
合计	454,959.34	445,876.07

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须做披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须做披露的日后事项。

7.4.9 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、基金注册登记机构、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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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	377,676,369.79	100.00	-	-

7.4.10.1.2 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	1,798,497,939.46	100.00	1,613,513,045.42	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

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	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例(%)	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例(%)
东方证券股份有限公司	2,917,000,000.00	100.00	3,686,700,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

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	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	-	-	4,625,210.22	100.00

7.4.10.1.3 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	313,196.75	100.00	30,273.82	100.00
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	-	-	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

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
	当期发生的基金应支付的管理费	12,910,017.24
其中：支付给销售机构的客户维护费	868,588.96	1,414,062.23

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.6%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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。

7.4.10.2.2 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	4,303,339.05	4,855,786.08

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

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、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	汇添富增强收益债券 C
汇添富基金管理有限公司	254,225.47
中国工商银行股份有限公司	9,431.97
东方证券股份有限公司	-
合计	263,657.44
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	汇添富增强收益债券 C
汇添富基金管理有限公司	119.51

中国工商银行股份有限公司	454.54
东方证券股份有限公司	13.15
合计	587.20

注：1、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。本基金 A 类模式不收取销售服务费。

2、支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇添富基金管理有限公司，再由汇添富基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。

3、基金销售服务费的计算公式为：每日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 0.4% / 当年天数。

7.4.10.3 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
中国工商银行股份 有限公司	50,674,966.43	51,033,054.79	-	-	-	-
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	0.00	185,548,789.47	-	-	861,300,000.00	170,605.48

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人 2010 年度及 2009 年度均未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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	51,292,752.90	1,638,446.21	206,377,533.29	2,277,636.22

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。

7.4.10.6 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。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

汇添富增强收益债券A

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配 合计	备注
1	2010-6-29	2010-6-29	0.500	79,544,919.62	25,399,470.82	104,944,390.44	-
合计	-	-	0.500	79,544,919.62	25,399,470.82	104,944,390.44	-

汇添富增强收益债券 C

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配 合计	备注
1	2010-6-29	2010-6-29	0.500	1,012,369.03	236,872.89	1,249,241.92	-
合计	-	-	0.500	1,012,369.03	236,872.89	1,249,241.92	-

7.4.12 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名	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

	称									
002523	天桥起重	2010-12-03	2011-03-10	网下新股锁定期	19.50	21.15	1,600,000	31,200,000.00	33,840,000.00	-
002506	超日太阳	2010-11-10	2011-02-18	网下新股锁定期	36.00	44.51	327,580	11,792,880.00	14,580,585.80	-
002497	雅化集团	2010-10-29	2011-02-09	网下新股锁定期	30.50	42.30	166,805	5,087,552.50	7,055,851.50	-
002498	汉缆股份	2010-10-29	2011-02-09	网下新股锁定期	36.00	44.87	111,731	4,022,316.00	5,013,369.97	-
300138	晨光生物	2010-10-27	2011-02-09	网下新股锁定期	30.00	34.44	82,932	2,487,960.00	2,856,178.08	-
002495	佳隆股份	2010-10-22	2011-02-09	网下新股锁定期	32.00	31.57	80,745	2,583,840.00	2,549,119.65	-
300127	银河磁体	2010-09-27	2011-01-13	网下新股锁定期	18.00	27.90	84,461	1,520,298.00	2,356,461.90	-
300128	锦富新材	2010-09-27	2011-01-13	网下新股锁定期	35.00	47.19	46,540	1,628,900.00	2,196,222.60	-
300125	易世达	2010-09-27	2011-01-13	网下新股锁定期	55.00	83.49	25,115	1,381,325.00	2,096,851.35	-
601126	四方股份	2010-12-28	2011-03-31	网下新股锁定期	23.00	31.11	59,361	1,365,303.00	1,846,720.71	-
601933	永辉超	2010-12-09	2011-03-15	网下新股锁定	23.98	31.24	54,412	1,304,799.76	1,699,830.88	-

	市			期						
002504	东光 微电	2010-11-10	2011-02-18	网下 新股 锁定期	16.00	26.85	46,110	737,760.00	1,238,053.50	-
601098	中南 传媒	2010-10-22	2011-01-28	网下 新股 锁定期	10.66	11.98	91,148	971,637.68	1,091,953.04	-
600998	九州 通	2010-10-27	2011-02-09	网下 新股 锁定期	13.00	14.55	53,420	694,460.00	777,261.00	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
122863	10 榆城投债	2010-12-30	2011-01-19	新债未上市	99.95	99.95	200,000	19,990,531.51	19,990,531.51	-
122941	10 镇城投债	2010-12-21	-	新债未上市	99.93	99.93	300,000	29,977,775.34	29,977,775.34	流通日尚未公布
1080169	10 湖州城投债	2010-12-23	2011-01-05	新债未上市	99.97	100.79	100,000	9,996,922.74	10,079,000.00	-
1080172	10 渝南岸债	2010-12-30	2011-01-05	新债未上市	99.92	99.33	300,000	29,975,184.66	29,799,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行，另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
A-1	79,788,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	159,798,000.00	497,270,000.00
合计	239,586,000.00	497,270,000.00

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
AAA	241,976,349.20	91,474,962.60
AAA 以下	752,781,593.68	544,927,777.22
未评级	406,239,000.00	200,910,000.00

合计	1,400,996,942.88	837,312,739.82
----	------------------	----------------

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于年末持有的流通受限证券外，本年末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、部分应收申购款及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	51,292,752.90	-	-	-	-	-	51,292,752.90
结算备付金	511,113.05	-	-	-	-	-	511,113.05
存出保证金	-	-	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	-	50,495,000.00	380,299,000.00	642,966,420.21	566,822,522.67	225,039,614.78	1,865,622,557.66
应收利息	-	-	-	-	-	20,413,387.84	20,413,387.84

应收申购款	9,940.36	-	-	-	-	9,440,872.42	9,450,812.78
资产总计	51,813,806.31	50,495,000.00	380,299,000.00	642,966,420.21	566,822,522.67	255,143,875.04	1,947,540,624.23
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	142,818.17	142,818.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	993,971.44	993,971.44
应付托管费	-	-	-	-	-	331,323.84	331,323.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,089.75	7,089.75
应付交易费用	-	-	-	-	-	46,908.52	46,908.52
其他负债	-	-	-	-	-	650,026.96	650,026.96
负债总计	-	-	-	-	-	2,172,138.68	2,172,138.68
利率敏感度缺口	51,813,806.31	50,495,000.00	380,299,000.00	642,966,420.21	566,822,522.67	252,971,736.36	1,945,368,485.55
上年度末 2009年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	206,377,533.29	-	-	-	-	-	206,377,533.29
结算备付金	1,913,591.22	-	-	-	-	-	1,913,591.22
存出保证金	-	-	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	299,130,000.00	-	437,810,000.00	206,221,119.82	391,421,620.00	137,472,690.46	1,472,055,430.28
应收利息	-	-	-	-	-	14,674,753.70	14,674,753.70
应收申购款	-	-	-	-	-	147,230.61	147,230.61
应收证券清算款	-	-	-	-	-	92,000,000.00	92,000,000.00
资产总计	507,421,124.51	-	437,810,000.00	206,221,119.82	391,421,620.00	244,544,674.77	1,787,418,539.10
负债							
卖出回购金融资产款	260,299,547.55	-	-	-	-	-	260,299,547.55
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,033,774.23	1,033,774.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	840,366.31	840,366.31
应付托管费	-	-	-	-	-	280,122.11	280,122.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-	684.05	684.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	13,831.30	13,831.30
应付利息	-	-	-	-	-	7,349.95	7,349.95
其他负债	-	-	-	-	-	650,448.06	650,448.06
负债总计	260,299,547.55	-	-	-	-	2,826,576.01	263,126,123.56
利率敏感度缺口	247,121,576.96	-	437,810,000.00	206,221,119.82	391,421,620.00	241,718,098.76	1,524,292,415.54

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	4. 银行存款、结算备付金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2010 年 12 月 31 日）	上年度末（2009 年 12 月 31 日）
	0.25%	-3,597,492.38	-4,804,849.87
	-0.25%	3,630,741.46	4,869,830.67

7.4.13.4.2 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。于 2010 年 12 月 31 日，本基金主要投资于证券交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大市场价格风险。

7.4.14 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	225,039,614.78	11.56
	其中：股票	225,039,614.78	11.56
2	固定收益投资	1,640,582,942.88	84.24
	其中：债券	1,640,582,942.88	84.24
	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	51,803,865.95	2.66
	其他各项资产	30,114,200.62	1.55
	合计	1,947,540,624.23	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	3,352,680.30	0.17
B	采掘业	-	-
C	制造业	127,659,735.37	6.56
C0	食品、饮料	4,048,584.65	0.21
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	7,055,851.50	0.36
C5	电子	34,915,284.16	1.79
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	72,291,396.84	3.72
C8	医药、生物制品	9,348,618.22	0.48
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	69,775,530.24	3.59
G	信息技术业	3,780,520.60	0.19
H	批发和零售贸易	4,532,962.12	0.23
I	金融、保险业	12,749,381.76	0.66
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	2,096,851.35	0.11
L	传播与文化产业	1,091,953.04	0.06
M	综合类	-	-
	合计	225,039,614.78	11.57

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601018	宁波港	22,363,952	69,775,530.24	3.59
2	002523	天桥起重	1,600,000	33,840,000.00	1.74
3	002506	超日太阳	327,580	14,580,585.80	0.75
4	601717	郑煤机	319,088	13,535,712.96	0.70
5	601288	农业银行	4,757,232	12,749,381.76	0.66
6	300118	东方日升	184,868	11,221,487.60	0.58
7	002497	雅化集团	166,805	7,055,851.50	0.36
8	300105	龙源技术	43,179	5,263,520.10	0.27
9	002498	汉缆股份	111,731	5,013,369.97	0.26
10	300124	汇川技术	33,149	4,636,882.12	0.24
11	002454	松芝股份	128,474	3,918,457.00	0.20
12	300119	瑞普生物	51,262	3,615,508.86	0.19
13	002477	雏鹰农牧	58,511	3,352,680.30	0.17
14	300122	智飞生物	81,086	2,876,931.28	0.15
15	300138	晨光生物	82,932	2,856,178.08	0.15
16	300103	达刚路机	62,816	2,718,676.48	0.14
17	002495	佳隆股份	80,745	2,549,119.65	0.13
18	300127	银河磁体	84,461	2,356,461.90	0.12
19	300128	锦富新材	46,540	2,196,222.60	0.11
20	002465	海格通信	53,636	2,186,203.36	0.11
21	300125	易世达	25,115	2,096,851.35	0.11
22	002462	嘉事堂	91,129	2,055,870.24	0.11
23	300111	向日葵	78,813	1,893,088.26	0.10
24	601126	四方股份	59,361	1,846,720.71	0.09
25	601933	永辉超市	54,412	1,699,830.88	0.09
26	300101	国腾电子	14,754	1,594,317.24	0.08
27	300123	太阳鸟	35,719	1,518,057.50	0.08
28	002481	双塔食品	30,140	1,499,465.00	0.08
29	300114	中航电测	40,050	1,429,384.50	0.07
30	002504	东光微电	46,110	1,238,053.50	0.06
31	601098	中南传媒	91,148	1,091,953.04	0.06
32	600998	九州通	53,420	777,261.00	0.04

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	601018	宁波港	82,746,622.40	5.43
2	002523	天桥起重	31,200,000.00	2.05
3	601106	中国一重	29,837,459.40	1.96
4	000559	万向钱潮	27,902,319.91	1.83
5	601288	农业银行	26,149,381.76	1.72
6	601718	际华集团	19,365,405.50	1.27
7	002422	科伦药业	13,615,939.04	0.89
8	002506	超日太阳	11,792,880.00	0.77
9	601818	光大银行	9,324,000.20	0.61
10	002454	松芝股份	9,254,226.80	0.61
11	300118	东方日升	7,764,456.00	0.51
12	600227	赤天化	7,012,200.00	0.46
13	300082	奥克股份	6,471,475.00	0.42
14	601717	郑煤机	6,381,760.00	0.42
15	002434	万里扬	5,516,490.00	0.36
16	601179	中国西电	5,320,800.10	0.35
17	002497	雅化集团	5,087,552.50	0.33
18	002399	海普瑞	4,876,304.00	0.32
19	002465	海格通信	4,318,168.00	0.28
20	300077	国民技术	4,025,612.50	0.26

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	000559	万向钱潮	32,494,954.52	2.13
2	601668	中国建筑	29,830,504.16	1.96
3	601106	中国一重	28,190,582.42	1.85
4	601718	际华集团	25,314,573.09	1.66
5	002422	科伦药业	23,737,148.10	1.56
6	300002	神州泰岳	16,009,814.03	1.05
7	601288	农业银行	13,100,000.00	0.86
8	002454	松芝股份	11,475,169.94	0.75
9	601818	光大银行	11,392,246.85	0.75
10	601618	中国中冶	9,714,231.10	0.64

11	002154	报喜鸟	9,577,806.22	0.63
12	601989	中国重工	8,485,395.92	0.56
13	600227	赤天化	8,277,403.04	0.54
14	600999	招商证券	7,733,161.40	0.51
15	601299	中国北车	7,250,725.00	0.48
16	002434	万里扬	5,886,863.20	0.39
17	300077	国民技术	5,839,310.83	0.38
18	300082	奥克股份	5,685,112.66	0.37
19	002304	洋河股份	4,575,129.60	0.30
20	601179	中国西电	4,459,846.41	0.29

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	398,419,481.04
卖出股票收入（成交）总额	377,676,369.79

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	159,798,000.00	8.21
2	央行票据	217,857,000.00	11.20
3	金融债券	188,382,000.00	9.68
	其中：政策性金融债	188,382,000.00	9.68
4	企业债券	719,144,030.67	36.97
5	企业短期融资券	79,788,000.00	4.10
6	可转债	275,613,912.21	14.17
	其他	-	-
	合计	1,640,582,942.88	84.33

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	113001	中行转债	1,384,620	152,114,353.20	7.82
2	090310	09 进出 10	1,100,000	108,625,000.00	5.58

3	019011	10 国债 11	1,000,000	99,840,000.00	5.13
4	110003	新钢转债	794,560	91,557,148.80	4.71
5	019021	10 国债 21	600,000	59,958,000.00	3.08

8.7 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

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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,413,387.84
5	应收申购款	9,450,812.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,114,200.62

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113001	中行转债	152,114,353.20	7.82
2	110003	新钢转债	91,557,148.80	4.71
3	110007	博汇转债	4,249,545.60	0.22

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002523	天桥起重	33,840,000.00	1.74	网下新股锁定期
2	002506	超日太阳	14,580,585.80	0.75	网下新股锁定期
3	002497	雅化集团	7,055,851.50	0.36	网下新股锁定期
4	002498	汉缆股份	5,013,369.97	0.26	网下新股锁定期

§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

份额级别	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 (%)
汇添富增强收益债券 A	27,307	64,317.50	1,254,224,139.36	71.41	502,093,746.71	28.59
汇添富增强收益债券 C	661	46,971.30	13,334,135.99	42.95	17,713,892.85	57.05
合计	27,968	63,907.53	1,267,558,275.35	70.92	519,807,639.56	29.08

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	份额级别	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	汇添富增强收益债券 A	1,301,012.73	0.07
	汇添富增强收益债券 C	181.82	0.00
	合计	1,301,194.55	0.07

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C
基金合同生效日(2008年3月6日)基金份额总额	5,049,981,789.51	-
本报告期期初基金份额总额	1,430,263,827.01	1,981,480.22
本报告期基金总申购份额	1,481,007,479.82	490,432,945.73
减:本报告期基金总赎回份额	1,154,953,420.76	461,366,397.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,756,317,886.07	31,048,028.84

注：1、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。

2、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（2008年3月6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	377,676,369.79	100.00	313,196.75	100.00	-

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		债券回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
东方证券	1,798,497,939.46	100.00	2,917,000,000.00	100.00

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

(1) 基金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或退租交易单元。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金 2009 年年度资产净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 1 月 4 日
2	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华夏银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 1 月 13 日
3	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行开通基金定投业务并参加定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 1 月 14 日
4	汇添富基金管理有限公司关	中国证券报、上海证	2010 年 1 月 16 日

	于旗下部分基金参加深圳发展银行电子渠道申购费率优惠活动及基金定投申购费率优惠活动的公告	券报、证券时报、管理人网站	
5	汇添富增强收益债券型证券投资基金 2009 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 1 月 21 日
6	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金增加平安银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 1 月 21 日
7	汇添富基金管理有限公司关于设立汇添富资产管理(香港)有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 2 月 22 日
8	汇添富基金管理有限公司关于调整旗下基金转换业务规则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 3 月 11 日
9	汇添富基金管理有限公司关于调整旗下基金转换业务规则的提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 3 月 30 日
10	汇添富增强收益债券型证券投资基金 2009 年年度报告	管理人网站	2010 年 3 月 30 日
11	汇添富增强收益债券型证券投资基金 2009 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 3 月 30 日
12	汇添富基金管理有限公司关于增加江苏银行为代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 4 月 1 日
13	汇添富基金管理有限公司关	中国证券报、上海证	2010 年 4 月 7 日

	于调整旗下基金在上海浦东发展银行定期定额投资起点金额的公告	券报、证券时报、管理人网站	
14	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金增加民生银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 4 月 12 日
15	汇添富基金管理有限公司关于增加英大证券为代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 4 月 14 日
16	汇添富增强收益债券型证券投资基金招募说明书摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 4 月 19 日
17	汇添富增强收益债券型证券投资基金招募说明书	管理人网站	2010 年 4 月 19 日
18	汇添富增强收益债券型证券投资基金 2010 年第一季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 4 月 20 日
19	关于增加厦门证券为代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 4 月 29 日
20	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金继续参与深圳发展银行开展的基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 4 月 30 日
21	汇添富基金管理有限公司关于增加江海证券为代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 5 月 21 日
22	汇添富基金管理有限公司关	中国证券报、上海证	2010 年 5 月 21 日

	于开通网上直销一户多卡功能的公告	券报、证券时报、管理人网站	
23	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信银行个人网银申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 5 月 31 日
24	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 6 月 3 日
25	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与中投证券网上申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 6 月 28 日
26	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与安信证券网上申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 6 月 28 日
27	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金继续参与交通银行开展的网上银行申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 6 月 30 日
28	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金 2010 年上半年度资产净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 7 月 1 日
29	汇添富增强收益债券型证券投资基金 2010 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 7 月 21 日
30	汇添富基金管理有限公司关	中国证券报、上海证	2010 年 7 月 27 日

	于旗下基金增加中原证券为 代销机构的公告	券报、证券时报、管 理人网站	
31	汇添富基金管理有限公司关 于旗下基金增加西南证券为 代销机构的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2010 年 7 月 27 日
32	汇添富基金管理有限公司关 于旗下基金参与日信证券网 上基金申购费率优惠活动的 公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2010 年 8 月 3 日
33	汇添富基金管理有限公司关 于聘任副总经理的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2010 年 8 月 5 日
34	汇添富基金管理有限公司关 于旗下基金在国信证券开通 基金定投业务的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2010 年 8 月 6 日
35	汇添富基金管理有限公司关 于旗下基金参与海通证券开 展的基金定投申购费率优惠 活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2010 年 8 月 6 日
36	汇添富基金管理有限公司关 于直销网上交易使用农行金 穗卡申购基金费率优惠的公 告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2010 年 8 月 20 日
37	汇添富基金管理有限公司关 于增加方正证券为代销机构 的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2010 年 8 月 25 日
38	汇添富增强收益债券型证券 投资基金 2010 年半年度报告	管理人网站	2010 年 8 月 26 日
39	汇添富增强收益债券型证券	中国证券报、上海证	2010 年 8 月 26 日

	投资基金 2010 年半年度报告摘要	券报、证券时报、管理人网站	
40	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与齐鲁证券开展的网上交易系统申购和定投基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 8 月 27 日
41	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金在中投证券开通基金定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 9 月 30 日
42	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金在长江证券开通基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 10 月 20 日
43	汇添富增强收益债券型证券投资基金招募说明书摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 10 月 20 日
44	汇添富增强收益债券型证券投资基金招募说明书	管理人网站	2010 年 10 月 20 日
45	汇添富增强收益债券型证券投资基金 2010 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 10 月 27 日
46	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金增加国联证券为代销机构及国联证券网上交易基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 11 月 19 日
47	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销机构开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 12 月 1 日

48	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金在代销机构开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 12 月 8 日
49	汇添富基金管理有限公司关于直销网上交易系统开通“定期不定额”基金交易业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 12 月 10 日
50	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金增加浙商证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 12 月 15 日
51	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 12 月 30 日
52	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 12 月 30 日
53	汇添富基金管理有限公司关于调整旗下基金在交通银行定投申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 12 月 31 日
54	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 12 月 31 日
55	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与深圳发展银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 12 月 31 日

56	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行 2011 倾心回馈基金定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 12 月 31 日
----	--	------------------------	------------------

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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

12.3 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
2011 年 3 月 28 日