

# 汇添富上证综合指数证券投资基金 2011 年 半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2011 年 8 月 24 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。本半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 8 月 18 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告(未经审计)</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6 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.....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.8 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.....	43
7.9 投资组合报告附注.....	43
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	44
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>44</b>

<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	48
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>51</b>
11.1 备查文件目录.....	51
11.2 存放地点.....	51
11.3 查阅方式.....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富上证综合指数证券投资基金
基金简称	汇添富上证综合指数
基金主代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 7 月 1 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	6,091,434,876.59 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 6%，以实现对标指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。
业绩比较基准	上证综合指数收益率×95% + 银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。

### 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

注册地址	上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.99fund.com">http://www.99fund.com</a>
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	汇添富基金管理有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期( 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	-20,384,408.30
本期利润	-39,318,543.79
加权平均基金份额本期利润	-0.0059
本期加权平均净值利润率	-0.65%
本期基金份额净值增长率	-1.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2011 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	-706,874,274.19
期末可供分配基金份额利润	-0.1160
期末基金资产净值	5,384,560,602.40
期末基金份额净值	0.884
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2011 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	-11.60%

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

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(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

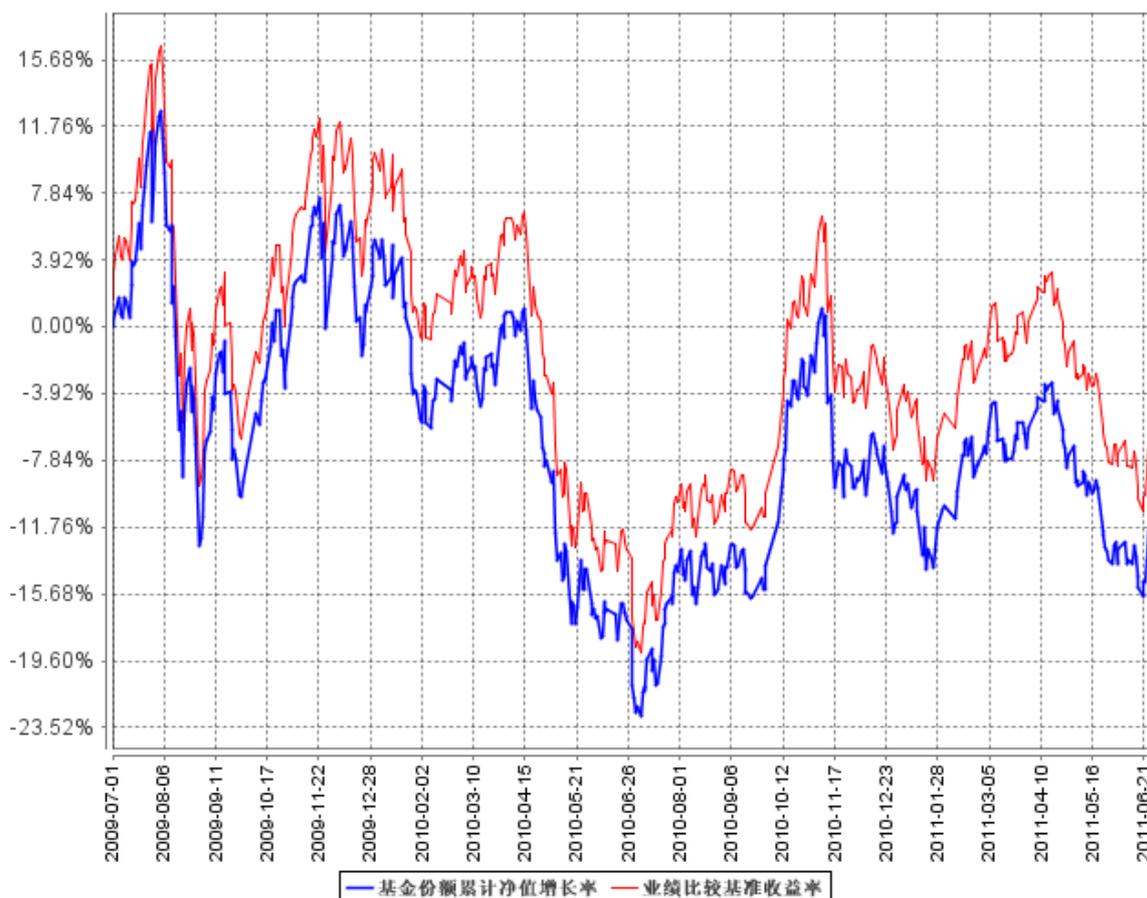
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	1.38%	0.99%	0.65%	1.00%	0.73%	-0.01%
过去三个月	-4.84%	0.95%	-5.38%	0.95%	0.54%	0.00%
过去六个月	-1.78%	1.02%	-1.55%	1.02%	-0.23%	0.00%
过去一年	13.04%	1.19%	14.42%	1.17%	-1.38%	0.02%
自基金合同生效日起至 今	-11.60%	1.45%	-6.30%	1.44%	-5.30%	0.01%

注:本基金的《基金合同》生效日为 2009 年 7 月 1 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（2009年7月1日）起3个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

## § 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由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金戎控股有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5号文批准，于2005年2月3日正式成立，注册资本金为1亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴。经过六年多的发展，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)。截止2011年6月30日，公司管理证券投资基金规模达到545亿元，基金份额持有人户数超过183万，资产管理规模在行业内名列前茅。本报告期末，公司管理15只开放式证券投资基金，包括汇添富优势精选混合型证券投资

基金、汇添富货币市场基金（A 级、B 级）、汇添富均衡增长股票型证券投资基金、汇添富成长焦点股票型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、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、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富保本混合型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金。

#### 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		
何仁科	本基金的基金经理，产品创新部总监	2009年7月1日	-	10年	国籍：中国。学历：华中科技大学数量经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任东方证券股份有限公司研究所高级经理。2004年12月加入汇添富基金管理有限公司任产品与金融工程部副总监、产品创新部总监，2009年7月1日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。
吴振翔	本基金的基金经理	2010年2月5日	-	5年	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金

					管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008年3月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程研究员，2010年1月8日至2010年2月4日任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理助理，2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数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遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 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

本基金为指数型基金，采用被动化投资跟踪上证综合指数的收益率，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

2011 年上半年通货膨胀呈持续攀升态势，控制通胀成为政府的首要任务，央行加息的同时并数次上调存款准备金率，A 股市场在 1 季度基本呈上涨态势，但随着 2 季度通胀的加剧，市场进入单边下跌的区间。本基金遵循了指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。本基金股票投资仓位在报告期内基本保持在 92%~95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

本基金对抽样复制组合采取缓冲式调整，有效的降低了冗余的交易量，报告期内抽样复制组合领先于上证综合指数中小盘股票的市场表现，我们将继续观察抽样复制方法在后续投资过程中的适用性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

上证综合指数在报告期内下跌了 1.64%，本基金在报告期内累计收益率为 -1.78%，同期业绩比较基准收益率为 -1.55%，收益率落后业绩比较基准 0.23%。收益率的差异因素主要来源于托管行股票替代、申购赎回、小股票替代组合与实际组合差异等因素的综合作用。本基金日均跟踪误差为 0.089%，这一跟踪误差水平远低于 0.35%，在报告期达到了投资目标。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间，在食品价格不发生大幅上涨的情况下，今年 6、7 月份 CPI 见顶的概率较大，政府控制通货膨胀的压力将在一定程度上减轻，可能将更加关注经济的增长。在这样的大环境下，继续收紧的货币政策有望结束，利率和存款准备金率继续上调的空间都很小，货币政策转而进入平稳期。从经济增长来看，投资的周期仍趋于向上，由于企业盈利能力上升引导的制造业投资周期向上，同时作为十二五的元年，来自保障房、水利和城市轨交等方面的地方政府主导投资将继续保持较高热情；实际消费方面，随着通胀高点的度过，以及政府关于收入分配政策的进一步落

实，消费有望保持平稳增长；外围市场的复苏有不确定性，外需也受影响，但是我们预计出口增速不至于出现较大幅度下降，经济在政策放松环境下仍将保持较好的发展。

A 股市场经过今年上半年的估值挤压，无论是与全球其他市场的相对估值来看，还是与历史估值水平相比来看，A 股市场估值水平都处于较低的状态，市场估值底部有望在政策观察期内得到进一步抬升，股票市场也可能出现较好的投资机会，同时考虑中国经济成长性因素，其对投资者而言仍是非常有吸引力的。需要关注因食品价格上涨引起的通货膨胀超预期风险，进而引发的政策再次超调给股市带来的压力。

作为被动投资的指数型基金，汇添富上证综合指数基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的指数化投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。我们也非正常期望添富上证能继续与投资者一起分享中国经济的美好未来。

#### 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，本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务。

#### 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：每年度 6 月和 12 月的最后一个交易日每份基金份额可供分配利润超过 0.02 元时，至少将期末可供分配利润的 20%进行收益分配。本基金本报告期末可供分配基金

份额利润为-0.1160 元，未达到收益分配的基准，因此本报告期本基金未进行利润分配。

## § 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

2011 年上半年，本基金托管人在对汇添富上证综合指数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

2011 年上半年，汇添富上证综合指数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上证综合指数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，汇添富上证综合指数证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对半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上证综合指数证券投资基金 2011 年半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 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	217,327,319.60	155,284,697.55
结算备付金		260,529.17	126,941.53
存出保证金		416,666.65	583,333.31
交易性金融资产	6.4.7.2	5,159,813,255.75	6,475,938,084.01
其中：股票投资		5,062,483,255.75	6,278,778,084.01
基金投资		-	-
债券投资		97,330,000.00	197,160,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	12,159,627.62
应收利息	6.4.7.5	1,508,843.90	3,616,536.94
应收股利		9,181,351.08	-
应收申购款		1,275,006.27	1,878,397.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,389,782,972.42	6,649,587,618.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年6月30日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		956,171.91	1,765,145.50
应付管理人报酬		3,249,374.52	4,306,886.93
应付托管费		649,874.92	861,377.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	157,628.37	797,032.78
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	209,320.30	426,896.55
负债合计		5,222,370.02	8,157,339.14
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	6,091,434,876.59	7,381,183,450.73
未分配利润	6.4.7.10	-706,874,274.19	-739,753,171.02
所有者权益合计		5,384,560,602.40	6,641,430,279.71
负债和所有者权益总计		5,389,782,972.42	6,649,587,618.85

注:1、报告截止日 2011 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.884 元,基金份额总额 6,091,434,876.59 份。

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## 6.2 利润表

会计主体: 汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期: 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月1日至	上年度可比期间 2010年1月1日至2010
-----	-----	------------------	---------------------------

		2011年6月30日	年6月30日
<b>一、收入</b>		-9,159,347.36	-1,764,308,065.96
1. 利息收入		3,090,732.94	1,745,760.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	630,765.29	961,339.52
债券利息收入		2,459,967.65	784,421.32
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“-”填列）		5,040,814.39	-15,446,216.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-58,349,171.76	-61,352,467.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,507,152.89	2,064,943.18
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	57,882,833.26	43,841,307.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-18,934,135.49	-1,751,922,880.85
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,643,240.80	1,315,270.57
<b>二、费用</b>		30,159,196.43	31,417,534.96
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	22,623,102.22	23,564,757.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,524,620.49	4,712,951.42
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,781,421.09	2,841,688.81
5. 利息支出		12,182.74	69,502.69
其中：卖出回购金融资产支出		12,182.74	69,502.69
6. 其他费用	6.4.7.19	217,869.89	228,634.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-39,318,543.79	-1,795,725,600.92
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-39,318,543.79	-1,795,725,600.92

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30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）	7,381,183,450.73	-739,753,171.02	6,641,430,279.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-39,318,543.79	-39,318,543.79
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）	-1,289,748,574.14	72,197,440.62	-1,217,551,133.52
其中：1. 基金申购款	370,372,296.93	-35,141,726.30	335,230,570.63
2. 基金赎回款	-1,660,120,871.07	107,339,166.92	-1,552,781,704.15
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	6,091,434,876.59	-706,874,274.19	5,384,560,602.40
	<b>上年度可比期间</b>		
	<b>2010年1月1日至2010年6月30日</b>		
项目	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）	6,956,558,846.35	352,370,968.97	7,308,929,815.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,795,725,600.92	-1,795,725,600.92
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）	-138,715,508.72	-42,619,555.79	-181,335,064.51
其中：1. 基金申购款	926,161,281.32	-55,227,090.26	870,934,191.06
2. 基金赎回款	-1,064,876,790.04	12,607,534.47	-1,052,269,255.57
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）	6,817,843,337.63	-1,485,974,187.74	5,331,869,149.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富上证综合指数证券投资基金（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”）证监许可[2009]371 号文《关于核准汇添富上证综合指数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募集，基金合同于 2009 年 7 月 1 日生效，首次设立募集规模为 9,097,758,651.47 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与注册登记机构为汇添富基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括上海证券交易所上市交易的所有股票、新股（如一级市场初次发行或增发）等。如以后法律法规及中国证监会允许基金投资其他金融工具，如股指期货、ETF 等，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定，将其纳入投资范围。本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。本基金的业绩比较基准为：上证综合指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	217,327,319.60
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	217,327,319.60

注：本基金本报告期末未投资定期存款。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
----	------------------------

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,600,475,093.80	5,062,483,255.75	-537,991,838.05
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	97,704,100.00	-374,100.00
	合计	97,704,100.00	-374,100.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	5,698,179,193.80	5,159,813,255.75	-538,365,938.05

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	35,861.71
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	105.48
应收债券利息	1,472,876.71
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	1,508,843.90

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	157,628.37
银行间市场应付交易费用	-
合计	157,628.37

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,045.41
预提审计费	39,671.58
预提信息披露费	168,603.31
合计	209,320.30

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,381,183,450.73	7,381,183,450.73
本期申购	370,372,296.93	370,372,296.93
本期赎回(以“-”号填列)	-1,660,120,871.07	-1,660,120,871.07
本期末	6,091,434,876.59	6,091,434,876.59

注：本期申购中包含红利再投、转换入份额，本期赎回中包含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,649,056.57	-734,104,114.45	-739,753,171.02
本期利润	-20,384,408.30	-18,934,135.49	-39,318,543.79
本期基金份额交易产生的变动数	7,008,269.83	65,189,170.79	72,197,440.62
其中：基金申购款	-2,328,094.31	-32,813,631.99	-35,141,726.30
基金赎回款	9,336,364.14	98,002,802.78	107,339,166.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,025,195.04	-687,849,079.15	-706,874,274.19

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	628,586.12
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	1,457.76
其他	721.41
合计	630,765.29

注：表中“其他”指直销申购款利息收入。

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,283,001,536.62
减：卖出股票成本总额	1,341,350,708.38
买卖股票差价收入	-58,349,171.76

### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	195,147,558.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	185,068,000.00
减：应收利息总额	4,572,406.01
债券投资收益	5,507,152.89

### 6.4.7.14 衍生工具收益

#### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本期未投资衍生工具。

### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	57,882,833.26
合计	57,882,833.26

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-18,934,135.49
——股票投资	-20,794,135.49
——债券投资	1,860,000.00
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-18,934,135.49

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	1,643,240.80
合计	1,643,240.80

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	2,781,421.09
银行间市场交易费用	-
合计	2,781,421.09

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	168,603.31
银行划款费用	595.00

帐户维护费	9,000.00
合计	217,869.89

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金注册登记机构
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

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	1,043,178,934.95	73.42%	516,633,411.18	28.71%

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	2,626,092.50	2.90%	-	-

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30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	886,703.37	73.42%	80,949.24	51.35%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	438,861.17	28.70%	167,796.80	20.77%

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。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6 月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30 日
	当期发生的基金应支付 的管理费	22,623,102.22
其中：支付销售机构的客 户维护费	4,544,504.01	7,241,669.45

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.75%的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.75\% /$   
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。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,524,620.49	4,712,951.42

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金与关联方本期和上年度可比期间未通过银行间同业市场进行债券（回购）交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2009 年 7 月 1 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	43,496,625.00	43,496,625.00
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	43,496,625.00	43,496,625.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.71%	0.64%

**6.4.10.4.2 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**

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	217,327,319.60	628,586.12	174,071,801.06	927,718.65

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 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
601998	中信银行	2011年6月29日	配股停牌	4.75	2011年7月7日	4.59	7,471,086	44,666,781.85	35,487,658.50	-
600315	上海家化	2010年12月6日	重组停牌	36.88	-	-	591,881	10,922,425.58	21,828,571.28	-
600021	上海电力	2011年5月31日	重大事项停牌	5.76	2011年7月28日	6.34	2,267,169	12,177,329.96	13,058,893.44	-
600098	广州控股	2011年6月20日	重大事项未公告	6.79	2011年7月8日	7.47	1,816,549	12,336,138.71	12,334,367.71	-

600170	上海建工	2011 年 6 月 29 日	重组停牌	15.59	2011 年 7 月 4 日	16.25	635,017	8,873,719.12	9,899,915.03	-
600369	西南证券	2011 年 3 月 1 日	重组停牌	11.87	2011 年 8 月 16 日	12.49	796,163	13,262,295.42	9,450,454.81	-
600216	浙江医药	2011 年 6 月 27 日	重大事项停牌	31.39	2011 年 7 月 4 日	32.60	125,538	3,427,270.32	3,940,637.82	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。

#### 6.4.13.3 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 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30 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	217,327,319.60	-	-	-	-	-	217,327,319.60
结算备付金	260,529.17	-	-	-	-	-	260,529.17
存出保证金	-	-	-	-	-	416,666.65	416,666.65
交易性金融资产	-	-	97,330,000.00	-	-	5,062,483,255.75	5,159,813,255.75
应收利息	-	-	-	-	-	1,508,843.90	1,508,843.90
应收股利	-	-	-	-	-	9,181,351.08	9,181,351.08
应收申购款	19,107.21	-	-	-	-	1,255,899.06	1,275,006.27
资产总计	217,606,955.98	-	97,330,000.00	-	-	5,074,846,016.44	5,389,782,972.42
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	956,171.91	956,171.91

应付管理人报酬						3,249,374.52	3,249,374.52
应付托管费						649,874.92	649,874.92
应付交易费用						157,628.37	157,628.37
其他负债						209,320.30	209,320.30
负债总计						5,222,370.02	5,222,370.02
利率敏感度缺口	217,606,955.98		97,330,000.00			5,069,623,646.42	5,384,560,602.40
上年度末 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	155,284,697.55						155,284,697.55
结算备付金	126,941.53						126,941.53
存出保证金						583,333.31	583,333.31
交易性金融资产			197,160,000.00			6,278,778,084.01	6,475,938,084.01
应收证券清算款						12,159,627.62	12,159,627.62
应收利息						3,616,536.94	3,616,536.94
应收申购款	27,532.45					1,850,865.44	1,878,397.89
资产总计	155,439,171.53		197,160,000.00			6,296,988,447.32	6,649,587,618.85
负债							
应付赎回款						1,765,145.50	1,765,145.50
应付管理人报酬						4,306,886.93	4,306,886.93
应付托管费						861,377.38	861,377.38
应付交易费用						797,032.78	797,032.78
其他负债						426,896.55	426,896.55
负债总计						8,157,339.14	8,157,339.14
利率敏感度缺口	155,439,171.53		197,160,000.00			6,288,831,108.18	6,641,430,279.71

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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（2011年6月30日）	上年度末（2010年12月31日）
	0.25%	-84,182.34	-273,941.60
-0.25%	84,325.97	274,863.89	

#### 6.4.13.4.2 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	5,062,483,255.75	94.02	6,278,778,084.01	94.54
交易性金融资产-债券投资	97,330,000.00	1.81	197,160,000.00	2.97
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,159,813,255.75	95.83	6,475,938,084.01	97.51

注：本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 90%-95%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；投资于标的指数成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%。

##### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合的贝塔系数紧密相关；
	2、对于上市时间不足一年的股票，使用申银万国行业指数替代股票价格计算其贝塔系数；

	3、以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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（2011年6月30日）	上年度末（2010年12月31日）
	5%	253,124,162.79	313,938,904.20
	-5%	-253,124,162.79	-313,938,904.20

注：本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 6.4.14 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	5,062,483,255.75	93.93
	其中：股票	5,062,483,255.75	93.93
2	固定收益投资	97,330,000.00	1.81
	其中：债券	97,330,000.00	1.81
	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	217,587,848.77	4.04
6	其他各项资产	12,381,867.90	0.23
7	合计	5,389,782,972.42	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 指数投资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	49,200,493.52	0.91
B	采掘业	1,070,904,952.52	19.89
C	制造业	1,370,841,198.62	25.46
C0	食品、饮料	135,307,748.08	2.51
C1	纺织、服装、皮毛	24,652,032.09	0.46
C2	木材、家具	9,789,399.51	0.18
C3	造纸、印刷	9,786,090.46	0.18
C4	石油、化学、塑胶、塑料	152,426,915.13	2.83
C5	电子	46,429,547.69	0.86
C6	金属、非金属	313,447,198.80	5.82
C7	机械、设备、仪表	500,693,818.29	9.30
C8	医药、生物制品	143,291,778.85	2.66
C99	其他制造业	35,016,669.72	0.65
D	电力、煤气及水的生产和供应业	180,886,646.15	3.36
E	建筑业	150,873,489.61	2.80
F	交通运输、仓储业	255,952,341.82	4.75
G	信息技术业	125,903,266.52	2.34
H	批发和零售贸易	112,822,598.53	2.10
I	金融、保险业	1,465,202,902.85	27.21
J	房地产业	137,197,153.08	2.55
K	社会服务业	56,663,427.73	1.05
L	传播与文化产业	22,874,915.38	0.42
M	综合类	63,159,869.42	1.17
	合计	5,062,483,255.75	94.02

### 7.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未进行积极投资。

### 7.3 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

#### 7.3.1 期末指数投资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	601857	中国石油	45,440,035	494,841,981.15	9.19
2	601288	农业银行	83,788,153	234,606,828.40	4.36
3	601988	中国银行	59,802,100	187,778,594.00	3.49
4	600028	中国石化	19,622,090	161,489,800.70	3.00
5	601088	中国神华	4,627,846	139,483,278.44	2.59
6	600036	招商银行	9,214,871	119,977,620.42	2.23

7	601628	中国人寿	5,843,667	109,568,756.25	2.03
8	601328	交通银行	19,514,752	108,111,726.08	2.01
9	600016	民生银行	18,349,549	105,142,915.77	1.95
10	600000	浦发银行	8,296,090	81,633,525.60	1.52
11	601939	建设银行	15,941,065	78,748,861.10	1.46
12	601166	兴业银行	4,964,448	66,920,759.04	1.24
13	601318	中国平安	1,343,243	64,838,339.61	1.20
14	600519	贵州茅台	264,812	56,306,975.56	1.05
15	600104	上海汽车	2,593,702	48,605,975.48	0.90
16	601601	中国太保	1,763,608	39,487,183.12	0.73
17	601818	光大银行	11,347,207	38,013,143.45	0.71
18	600031	三一重工	2,104,897	37,972,341.88	0.71
19	600030	中信证券	2,736,169	35,789,090.52	0.66
20	601989	中国重工	2,574,735	35,505,595.65	0.66
21	601998	中信银行	7,471,086	35,487,658.50	0.66
22	601006	大秦铁路	4,160,420	34,073,839.80	0.63
23	601668	中国建筑	8,315,680	33,512,190.40	0.62
24	600900	长江电力	4,539,332	32,728,583.72	0.61
25	600050	中国联通	5,875,473	30,846,233.25	0.57
26	600585	海螺水泥	1,110,515	30,827,896.40	0.57
27	600019	宝钢股份	4,912,717	29,623,683.51	0.55
28	600406	国电南瑞	812,484	29,493,169.20	0.55
29	601600	中国铝业	2,655,622	29,238,398.22	0.54
30	600188	兖州煤业	826,833	29,187,204.90	0.54
31	601898	中煤能源	2,536,838	25,368,380.00	0.47
32	600018	上港集团	6,367,875	24,834,712.50	0.46
33	600111	包钢稀土	335,683	23,977,836.69	0.45
34	600143	金发科技	1,400,370	23,050,090.20	0.43
35	601111	中国国航	2,330,888	22,353,215.92	0.42
36	600315	上海家化	591,881	21,828,571.28	0.41
37	601899	紫金矿业	2,920,431	21,143,920.44	0.39
38	601699	潞安环能	637,836	20,927,399.16	0.39
39	600015	华夏银行	1,921,534	20,887,074.58	0.39
40	600837	海通证券	2,308,167	20,819,666.34	0.39
41	600362	江西铜业	575,236	20,386,363.84	0.38
42	600079	人福医药	907,201	20,012,854.06	0.37
43	600690	青岛海尔	703,908	19,674,228.60	0.37
44	601766	中国南车	2,756,887	19,629,035.44	0.36
45	600582	天地科技	881,355	19,513,199.70	0.36

46	601688	华泰证券	1,570,959	19,401,343.65	0.36
47	601390	中国中铁	4,737,863	18,904,073.37	0.35
48	601727	上海电气	2,730,513	18,895,149.96	0.35
49	600999	招商证券	1,005,851	18,487,541.38	0.34
50	600893	航空动力	1,055,904	18,256,580.16	0.34
51	601618	中国中冶	4,501,272	17,735,011.68	0.33
52	601919	中国远洋	2,136,828	17,714,304.12	0.33
53	600547	山东黄金	394,460	17,687,586.40	0.33
54	600085	同仁堂	492,316	17,555,988.56	0.33
55	600048	保利地产	1,589,435	17,467,890.65	0.32
56	601169	北京银行	1,747,013	17,417,719.61	0.32
57	600549	厦门钨业	419,957	17,398,818.51	0.32
58	601958	金钼股份	894,380	17,216,815.00	0.32
59	601186	中国铁建	2,844,311	17,208,081.55	0.32
60	600251	冠农股份	512,924	17,008,559.84	0.32
61	601558	华锐风电	559,200	16,345,416.00	0.30
62	600348	国阳新能	671,802	16,217,300.28	0.30
63	600859	王府井	403,010	16,108,309.70	0.30
64	600673	东阳光铝	1,005,188	16,093,059.88	0.30
65	600169	太原重工	1,553,650	15,769,547.50	0.29
66	600971	恒源煤电	387,836	15,653,060.96	0.29
67	601299	中国北车	2,331,068	15,618,155.60	0.29
68	600029	南方航空	1,965,204	15,407,199.36	0.29
69	600011	华能国际	2,910,490	15,367,387.20	0.29
70	600418	江淮汽车	1,381,810	15,351,909.10	0.29
71	600010	包钢股份	1,801,982	15,046,549.70	0.28
72	600720	祁连山	817,810	14,916,854.40	0.28
73	600887	伊利股份	893,116	14,870,381.40	0.28
74	601808	中海油服	820,610	14,656,094.60	0.27
75	600765	中航重机	972,469	14,587,035.00	0.27
76	600489	中金黄金	512,806	13,994,475.74	0.26
77	601991	大唐发电	2,493,143	13,911,737.94	0.26
78	600150	中国船舶	186,076	13,767,763.24	0.26
79	600267	海正药业	366,491	13,684,773.94	0.25
80	601118	海南橡胶	1,102,754	13,585,929.28	0.25
81	601992	金隅股份	869,950	13,466,826.00	0.25
82	600408	安泰集团	1,832,637	13,378,250.10	0.25
83	600586	金晶科技	1,620,876	13,356,018.24	0.25
84	600685	广船国际	439,258	13,195,310.32	0.25

85	601788	光大证券	958,848	13,184,160.00	0.24
86	600236	桂冠电力	2,381,701	13,170,806.53	0.24
87	600021	上海电力	2,267,169	13,058,893.44	0.24
88	601268	二重重装	1,195,866	12,963,187.44	0.24
89	600516	方大炭素	986,438	12,951,930.94	0.24
90	600456	宝钛股份	447,680	12,920,044.80	0.24
91	600694	大商股份	334,412	12,784,570.76	0.24
92	600674	川投能源	884,728	12,686,999.52	0.24
93	600795	国电电力	4,267,216	12,630,959.36	0.23
94	600481	双良节能	869,601	12,574,430.46	0.23
95	600755	厦门国贸	1,551,590	12,490,299.50	0.23
96	600256	广汇股份	518,922	12,339,965.16	0.23
97	600820	隧道股份	1,156,017	12,334,701.39	0.23
98	600098	广州控股	1,816,549	12,334,367.71	0.23
99	600066	宇通客车	531,604	12,301,316.56	0.23
100	601117	中国化学	1,375,988	12,191,253.68	0.23
101	600195	中牧股份	532,685	12,118,583.75	0.23
102	600724	宁波富达	1,346,874	12,108,397.26	0.22
103	600688	S 上石化	1,367,714	12,104,268.90	0.22
104	600779	水井坊	537,141	12,042,701.22	0.22
105	600498	烽火通信	463,459	12,040,664.82	0.22
106	600352	浙江龙盛	1,247,682	11,952,793.56	0.22
107	600811	东方集团	1,714,242	11,793,984.96	0.22
108	600875	东方电气	461,968	11,780,184.00	0.22
109	600005	武钢股份	2,831,615	11,751,202.25	0.22
110	600426	华鲁恒升	693,883	11,726,622.70	0.22
111	600108	亚盛集团	1,915,120	11,624,778.40	0.22
112	600863	内蒙华电	1,308,458	11,592,937.88	0.22
113	600068	葛洲坝	966,685	11,590,553.15	0.22
114	601018	宁波港	3,581,970	11,462,304.00	0.21
115	600812	华北制药	993,996	11,450,833.92	0.21
116	600309	烟台万华	607,253	11,361,703.63	0.21
117	600115	东方航空	2,177,835	11,324,742.00	0.21
118	600096	云天化	557,358	11,085,850.62	0.21
119	600435	中兵光电	890,362	11,076,103.28	0.21
120	601158	重庆水务	1,338,889	11,059,223.14	0.21
121	600266	北京城建	732,244	11,020,272.20	0.20
122	600210	紫江企业	1,810,560	10,863,360.00	0.20
123	600683	京投银泰	1,278,746	10,818,191.16	0.20

124	601377	兴业证券	617,166	10,633,770.18	0.20
125	600884	杉杉股份	579,319	10,584,158.13	0.20
126	600062	双鹤药业	420,543	10,425,260.97	0.19
127	600839	四川长虹	3,118,149	10,414,617.66	0.19
128	600810	神马股份	631,595	10,383,421.80	0.19
129	600311	荣华实业	768,622	10,368,710.78	0.19
130	600058	五矿发展	297,004	10,181,297.12	0.19
131	600117	西宁特钢	988,063	10,147,407.01	0.19
132	600395	盘江股份	303,548	10,074,758.12	0.19
133	600535	天士力	241,163	9,919,034.19	0.18
134	600170	上海建工	635,017	9,899,915.03	0.18
135	600006	东风汽车	2,258,579	9,892,576.02	0.18
136	601168	西部矿业	664,704	9,850,913.28	0.18
137	600978	宜华木业	1,744,991	9,789,399.51	0.18
138	600308	华泰股份	975,682	9,786,090.46	0.18
139	600816	安信信托	488,852	9,625,495.88	0.18
140	600428	中远航运	1,315,252	9,496,119.44	0.18
141	600037	歌华有线	927,795	9,454,231.05	0.18
142	600369	西南证券	796,163	9,450,454.81	0.18
143	600835	上海机电	796,834	9,426,546.22	0.18
144	600415	小商品城	759,152	9,329,978.08	0.17
145	601607	上海医药	552,340	9,279,312.00	0.17
146	600276	恒瑞医药	309,266	9,268,702.02	0.17
147	600804	鹏博士	1,171,525	9,243,332.25	0.17
148	601666	平煤股份	654,229	9,165,748.29	0.17
149	600033	福建高速	2,803,431	9,083,116.44	0.17
150	600300	维维股份	1,755,602	9,041,350.30	0.17
151	600648	外高桥	658,912	9,020,505.28	0.17
152	601106	中国一重	1,823,679	8,844,843.15	0.16
153	600208	新湖中宝	1,389,549	8,656,890.27	0.16
154	600880	博瑞传播	615,844	8,646,449.76	0.16
155	600510	黑牡丹	883,093	8,636,649.54	0.16
156	601258	庞大集团	294,492	8,619,780.84	0.16
157	600312	平高电气	846,127	8,588,189.05	0.16
158	600183	生益科技	929,037	8,528,559.66	0.16
159	600087	长航油运	2,927,507	8,519,045.37	0.16
160	600460	士兰微	500,578	8,504,820.22	0.16
161	600809	山西汾酒	121,316	8,498,185.80	0.16
162	600825	新华传媒	1,224,593	8,412,953.91	0.16

163	600007	中国国贸	923,268	8,383,273.44	0.16
164	600491	龙元建设	1,281,538	8,381,258.52	0.16
165	600782	新钢股份	1,188,645	8,332,401.45	0.15
166	600601	方正科技	2,292,151	8,205,900.58	0.15
167	600020	中原高速	2,435,782	8,086,796.24	0.15
168	601866	中海集运	2,219,746	8,079,875.44	0.15
169	600741	华域汽车	725,446	8,074,213.98	0.15
170	600004	白云机场	1,017,872	8,031,010.08	0.15
171	600497	驰宏锌锗	363,143	8,007,303.15	0.15
172	601101	昊华能源	126,636	7,991,997.96	0.15
173	600518	康美药业	604,884	7,960,273.44	0.15
174	600158	中体产业	1,256,475	7,915,792.50	0.15
175	600220	江苏阳光	1,568,109	7,903,269.36	0.15
176	601001	大同煤业	463,742	7,883,614.00	0.15
177	600221	海南航空	1,102,799	7,873,984.86	0.15
178	600525	长园集团	939,950	7,829,783.50	0.15
179	600596	新安股份	741,847	7,804,230.44	0.14
180	600132	重庆啤酒	135,697	7,789,007.80	0.14
181	600517	置信电气	635,919	7,675,542.33	0.14
182	600499	科达机电	468,525	7,501,085.25	0.14
183	601009	南京银行	832,881	7,470,942.57	0.14
184	600190	锦州港	1,693,592	7,417,932.96	0.14
185	600511	国药股份	486,178	7,380,182.04	0.14
186	601179	中国西电	1,207,227	7,364,084.70	0.14
187	601717	郑煤机	196,362	7,159,358.52	0.13
188	600739	辽宁成大	255,065	7,090,807.00	0.13
189	600598	北大荒	498,659	6,981,226.00	0.13
190	600067	冠城大通	750,636	6,980,914.80	0.13
191	600522	中天科技	293,758	6,944,439.12	0.13
192	600628	新世界	698,265	6,919,806.15	0.13
193	600583	海油工程	1,077,672	6,918,654.24	0.13
194	600550	天威保变	383,526	6,907,303.26	0.13
195	600009	上海机场	539,168	6,901,350.40	0.13
196	600970	中材国际	252,439	6,899,157.87	0.13
197	600832	东方明珠	888,782	6,888,060.50	0.13
198	600871	S 仪化	730,204	6,842,011.48	0.13
199	600162	香江控股	1,343,950	6,813,826.50	0.13
200	600151	航天机电	589,005	6,791,227.65	0.13
201	600555	九龙山	1,355,975	6,752,755.50	0.13

202	600600	青岛啤酒	195,215	6,664,640.10	0.12
203	600642	申能股份	1,305,492	6,618,844.44	0.12
204	600546	山煤国际	210,496	6,565,370.24	0.12
205	600703	三安光电	400,105	6,561,722.00	0.12
206	600320	振华重工	985,279	6,552,105.35	0.12
207	600639	浦东金桥	679,915	6,547,581.45	0.12
208	601333	广深铁路	1,581,711	6,500,832.21	0.12
209	600621	上海金陵	943,042	6,497,559.38	0.12
210	600316	洪都航空	201,328	6,488,801.44	0.12
211	600161	天坛生物	378,956	6,423,304.20	0.12
212	600754	锦江股份	367,282	6,394,379.62	0.12
213	600123	兰花科创	152,626	6,376,714.28	0.12
214	600271	航天信息	246,739	6,375,735.76	0.12
215	601918	国投新集	519,335	6,315,113.60	0.12
216	600017	日照港	1,514,402	6,299,912.32	0.12
217	600307	酒钢宏兴	1,147,710	6,289,450.80	0.12
218	600597	光明乳业	784,434	6,220,561.62	0.12
219	600177	雅戈尔	624,580	6,164,604.60	0.11
220	600611	大众交通	854,605	5,862,590.30	0.11
221	601888	中国国旅	246,983	5,836,208.29	0.11
222	600660	福耀玻璃	562,504	5,827,541.44	0.11
223	600808	马钢股份	1,674,100	5,825,868.00	0.11
224	600100	同方股份	554,438	5,799,421.48	0.11
225	600196	复星医药	531,201	5,779,466.88	0.11
226	600377	宁沪高速	1,067,744	5,776,495.04	0.11
227	600223	鲁商置业	701,539	5,752,619.80	0.11
228	600383	金地集团	896,393	5,745,879.13	0.11
229	600743	华远地产	1,179,871	5,734,173.06	0.11
230	600570	恒生电子	382,488	5,676,121.92	0.11
231	600997	开滦股份	344,384	5,496,368.64	0.10
232	600664	哈药股份	348,583	5,472,753.10	0.10
233	600663	陆家嘴	381,164	5,328,672.72	0.10
234	600153	建发股份	597,942	5,321,683.80	0.10
235	600110	中科英华	819,028	5,258,159.76	0.10
236	601933	永辉超市	214,193	5,181,328.67	0.10
237	600166	福田汽车	592,462	5,142,570.16	0.10
238	600022	济南钢铁	1,063,897	5,074,788.69	0.09
239	601369	陕鼓动力	459,942	5,045,563.74	0.09
240	600649	城投控股	614,064	4,986,199.68	0.09

241	600026	中海发展	590,020	4,979,768.80	0.09
242	601718	际华集团	1,082,011	4,977,250.60	0.09
243	600246	万通地产	994,711	4,973,555.00	0.09
244	600219	南山铝业	516,816	4,863,238.56	0.09
245	600432	吉恩镍业	216,735	4,828,855.80	0.09
246	601098	中南传媒	500,969	4,774,234.57	0.09
247	600325	华发股份	422,620	4,741,796.40	0.09
248	600027	华电国际	1,426,903	4,737,317.96	0.09
249	600569	安阳钢铁	1,274,385	4,715,224.50	0.09
250	600508	上海能源	193,115	4,706,212.55	0.09
251	600602	广电电子	706,253	4,654,207.27	0.09
252	601877	正泰电器	268,542	4,653,832.86	0.09
253	600823	世茂股份	312,793	4,576,161.59	0.08
254	600588	用友软件	215,859	4,459,646.94	0.08
255	600089	特变电工	339,163	4,388,769.22	0.08
256	600631	百联股份	292,572	4,353,471.36	0.08
257	601216	内蒙君正	179,718	4,347,378.42	0.08
258	600052	浙江广厦	965,237	4,275,999.91	0.08
259	600595	中孚实业	422,550	4,242,402.00	0.08
260	600881	亚泰集团	506,286	4,217,362.38	0.08
261	600655	豫园商城	384,058	4,178,551.04	0.08
262	600109	国金证券	280,603	4,082,773.65	0.08
263	601099	太平洋	421,727	3,972,668.34	0.07
264	600216	浙江医药	125,538	3,940,637.82	0.07
265	600895	张江高科	413,818	3,906,441.92	0.07
266	600350	山东高速	941,316	3,897,048.24	0.07
267	600886	国投电力	533,105	3,865,011.25	0.07
268	600717	天津港	468,624	3,833,344.32	0.07
269	600500	中化国际	380,336	3,799,556.64	0.07
270	601003	柳钢股份	718,950	3,767,298.00	0.07
271	601880	大连港	954,816	3,752,426.88	0.07
272	600718	东软集团	328,018	3,732,844.84	0.07
273	601872	招商轮船	960,797	3,679,852.51	0.07
274	600331	宏达股份	275,755	3,670,299.05	0.07
275	600643	爱建股份	348,980	3,664,290.00	0.07
276	600737	中粮屯河	341,974	3,505,233.50	0.07
277	601107	四川成渝	613,963	3,450,472.06	0.06
278	601139	深圳燃气	328,662	3,444,377.76	0.06
279	600528	中铁二局	389,905	3,388,274.45	0.06

280	600008	首创股份	587,840	3,327,174.40	0.06
281	600239	云南城投	256,878	3,303,451.08	0.06
282	600748	上实发展	454,090	3,287,611.60	0.06
283	600675	中华企业	479,953	3,263,680.40	0.06
284	600657	信达地产	503,269	3,205,823.53	0.06
285	601588	北辰实业	855,269	3,130,284.54	0.06
286	600269	赣粤高速	662,981	3,122,640.51	0.06
287	601519	大智慧	197,299	3,085,756.36	0.06
288	600635	大众公用	455,893	2,689,768.70	0.05
289	600376	首开股份	139,165	1,838,369.65	0.03

### 7.3.2 期末积极投资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

本基金本报告期末未进行积极投资。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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	601558	华锐风电	18,606,107.23	0.28
2	601118	海南橡胶	15,370,758.00	0.23
3	601992	金隅股份	14,692,091.87	0.22
4	601258	庞大集团	9,718,985.06	0.15
5	601933	永辉超市	7,096,429.09	0.11
6	601098	中南传媒	6,884,990.30	0.10
7	600015	华夏银行	6,483,497.00	0.10
8	601216	内蒙君正	5,966,021.02	0.09
9	600016	民生银行	5,924,276.52	0.09
10	601857	中国石油	5,914,278.00	0.09
11	601519	大智慧	5,369,567.89	0.08
12	600005	武钢股份	2,987,190.20	0.04
13	601939	建设银行	2,504,409.25	0.04
14	601989	中国重工	2,486,636.81	0.04
15	600428	中远航运	2,085,589.36	0.03
16	600028	中国石化	1,900,494.10	0.03
17	600018	上港集团	1,618,976.31	0.02

18	601268	二重重装	1,564,668.73	0.02
19	601088	中国神华	1,549,152.00	0.02
20	601628	中国人寿	1,333,479.00	0.02

注：买入金额按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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	601857	中国石油	146,622,127.01	2.21
2	601988	中国银行	62,355,239.78	0.94
3	601288	农业银行	58,907,212.25	0.89
4	600028	中国石化	46,510,532.66	0.70
5	600036	招商银行	45,114,289.74	0.68
6	601088	中国神华	37,518,558.91	0.56
7	601628	中国人寿	35,356,697.26	0.53
8	600050	中国联通	30,482,856.16	0.46
9	601328	交通银行	27,174,866.69	0.41
10	601166	兴业银行	27,075,730.77	0.41
11	600000	浦发银行	23,884,863.16	0.36
12	601318	中国平安	19,265,950.52	0.29
13	600519	贵州茅台	14,386,202.87	0.22
14	601818	光大银行	12,158,989.77	0.18
15	601111	中国国航	11,792,318.36	0.18
16	600132	重庆啤酒	11,708,899.55	0.18
17	600311	荣华实业	11,257,206.69	0.17
18	600031	三一重工	11,149,076.19	0.17
19	601998	中信银行	11,044,933.88	0.17
20	601601	中国太保	11,000,369.91	0.17

注：卖出金额按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	145,850,015.61
卖出股票收入（成交）总额	1,283,001,536.62

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。

## 7.5 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	-	-
2	央行票据	97,330,000.00	1.81
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	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	97,330,000.00	1.81

## 7.6 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	1,000,000	97,330,000.00	1.81

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本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。

7.9.2 本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。

### 7.9.3 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	416,666.65
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	9,181,351.08
4	应收利息	1,508,843.90
5	应收申购款	1,275,006.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,381,867.90

#### 7.9.4 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。

#### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
124,824	48,800.19	768,429,208.31	12.61%	5,323,005,668.28	87.39%

### 8.2 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	761,024.43	0.0125%

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 7 月 1 日）基金份额总额	9,097,758,651.47
本报告期期初基金份额总额	7,381,183,450.73
本报告期基金总申购份额	370,372,296.93
减：本报告期基金总赎回份额	1,660,120,871.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,091,434,876.59

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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、《汇添富保本混合型证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 26 日正式生效，陆文磊先生任该基金的基金经理。

2、《汇添富社会责任股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 3 月 29 日正式生效，欧阳沁春先生任该基金的基金经理。

3、《汇添富可转换债券债券型证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 17 日正式生效，王珏池先生任该基金的基金经理。

4、基金管理人 2011 年 6 月 22 日公告，汇添富货币市场基金由王珏池先生担任基金经理，陆文磊先生不再担任该基金的基金经理。

5、基金管理人 2011 年 6 月 22 日公告，汇添富增强收益债券型证券投资基金由陆文磊先生担任基金经理，王珏池先生不再担任该基金的基金经理。

6、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
平安证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	1,043,178,934.95	73.42%	886,703.37	73.42%	-

长江证券	1	173,828,231.62	12.23%	147,752.94	12.23%	-
中投证券	1	114,367,023.26	8.05%	97,212.10	8.05%	-
中信建投	1	61,415,331.29	4.32%	52,202.55	4.32%	-
银河证券	1	28,105,685.99	1.98%	23,889.71	1.98%	-

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。

### 10.7.2 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		权证交易	
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例
平安证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	2,626,092.50	2.90%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	87,961,466.40	97.10%	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

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：

此 30 个交易单元与汇添富优势精选混合型证券投资基金共用。本基金本报告期内未新增和退租证券公司交易单元。

### 10.8 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 2010 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	2011 年 1 月 4 日
2	汇添富上证综合指数证券投资基金 2010 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	2011 年 1 月 21 日
3	汇添富上证综合指数证券投资基金更新招募说明书摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 2 月 14 日
4	汇添富上证综合指数证券投资基金更新招募说明书	管理人网站	2011 年 2 月 14 日
5	汇添富基金管理有限公司关于增加杭州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	2011 年 2 月 17 日

		理人网站	
6	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浦发银行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	2011 年 3 月 1 日
7	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与杭州银行开展的网上银行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	2011 年 3 月 8 日
8	汇添富基金管理有限公司关于开通汇付天天盈账户进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 3 月 17 日
9	汇添富上证综合指数证券投资基金 2010 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	2011 年 3 月 28 日
10	汇添富上证综合指数证券投资基金 2010 年年度报告	管理人网站	2011 年 3 月 28 日
11	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金继续参与中国工商银行个人电子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	2011 年 3 月 30 日
12	汇添富基金管理有限公司关于开通通联支付进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 3 月 30 日
13	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华夏银行“盈基金 2011”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	2011 年 4 月 6 日
14	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华夏银行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	2011 年 4 月 8 日
15	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金增加世纪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	2011 年 4 月 14 日
16	汇添富上证综合指数证券投资基金 2011 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 4 月 22 日
17	汇添富基金管理有限公司关于增加天津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	2011 年 4 月 25 日
18	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行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	2011 年 4 月 25 日
19	汇添富基金管理有限公司关于开	中国证券报、上海证	2011 年 4 月 27 日

	通招商银行 i 理财进行网上直销业务的公告	券报、证券时报、管理人网站	
20	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与江苏银行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	2011 年 4 月 29 日
21	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金在中信证券开通基金定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 4 月 29 日
22	汇添富基金管理有限公司关于增加上海农商银行作为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 5 月 9 日
23	汇添富基金管理有限公司关于增加哈尔滨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	2011 年 5 月 16 日
24	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海农商银行开展的网上银行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	2011 年 5 月 16 日
25	汇添富基金管理有限公司关于增加恒泰长财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	2011 年 5 月 17 日
26	汇添富基金管理有限公司关于增加中航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	2011 年 5 月 27 日
27	汇添富基金管理有限公司关于开通上海银行借记卡进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 5 月 30 日
28	汇添富基金管理有限公司关于增加财通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	2011 年 6 月 7 日
29	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行电子渠道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	2011 年 6 月 29 日
30	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与中信银行电子渠道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	2011 年 6 月 29 日
31	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商证券开展的电子交易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	2011 年 6 月 29 日
32	关于招商银行 i 理财账户持有人通过汇添富网上直销系统申购基金费率调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 6 月 30 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富上证综合指数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、报告期内汇添富上证综合指数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。

### 11.2 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

### 11.3 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](http://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 8 月 24 日