

# 汇添富社会责任股票型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 3 月 29 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.....	11
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>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.9 投资组合报告附注.....	41
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
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.....	42
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>42</b>

<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	45
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>48</b>
11.1 备查文件目录.....	48
11.2 存放地点.....	48
11.3 查阅方式.....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富社会责任股票型证券投资基金
基金简称	汇添富社会责任股票
基金主代码	470028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月29日
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,442,798,556.82份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	精选积极履行社会责任，并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司，谋求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金为股票型基金。股票投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘积极履行社会责任的优质上市公司，以谋求基金资产稳健增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80% + 中证全债指数收益率×20%
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预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	李芳菲
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-63201816
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	200120	100031
法定代表人	桂水发	项俊波

## 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	http://www.99fund.com
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 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	-8,973,886.33
本期利润	-21,243,654.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0038
本期加权平均净值利润率	-0.38%
本期基金份额净值增长率	-0.40%
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	-19,624,989.39
期末可供分配基金份额利润	-0.0036
期末基金资产净值	5,423,173,567.43
期末基金份额净值	0.996
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	-0.40%

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

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低

数。

### 3.2 基金净值表现

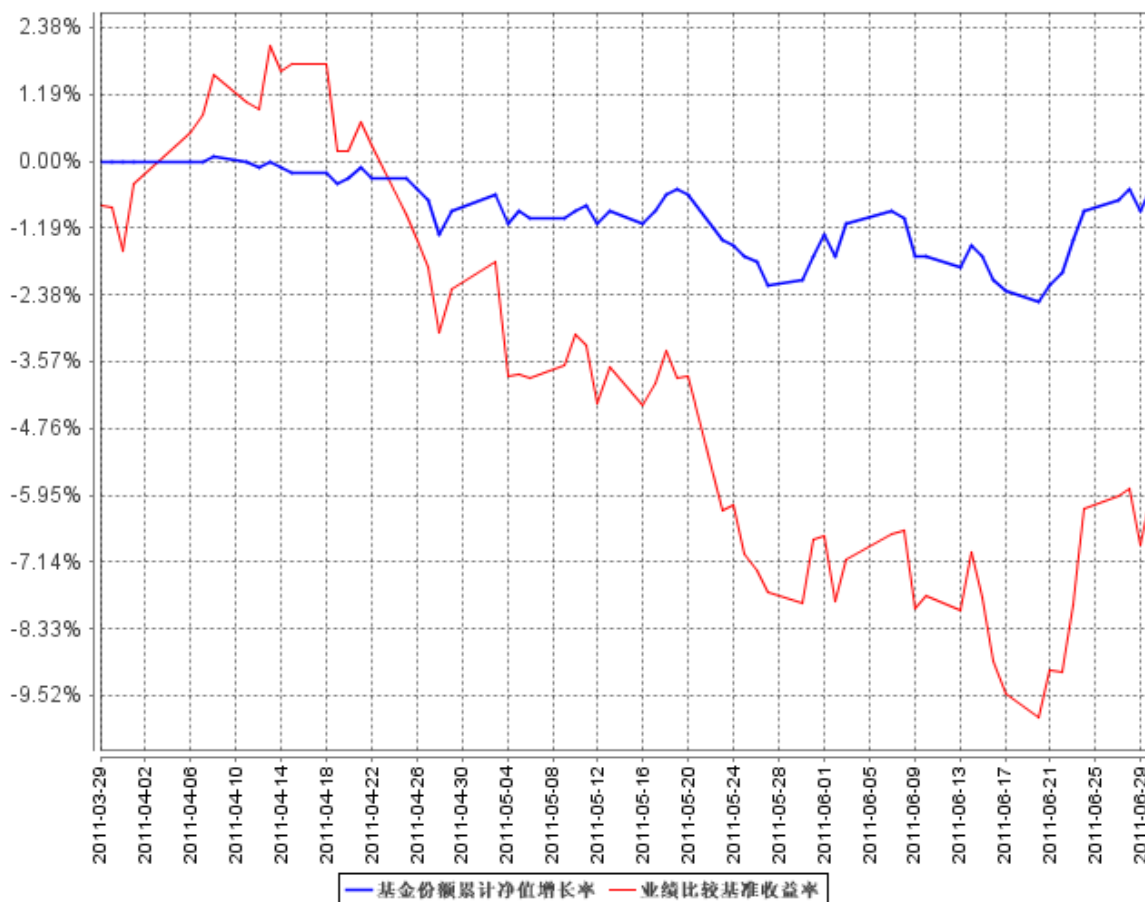
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.32%	0.38%	1.05%	0.96%	0.27%	-0.58%
过去三个月	-0.40%	0.31%	-4.27%	0.88%	3.87%	-0.57%
自基金合同生效日起至 今	-0.40%	0.30%	-5.78%	0.87%	5.38%	-0.57%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 29 日，至本报告期末未满一年。

#### 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：本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 29 日，截至本报告期末，基金成立未满 1 年；本基金建仓期为自《基金合同》生效之日（2011 年 3 月 29 日）起 6 个月，截至本报告期末，本

基金尚处于建仓期中。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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		
欧阳沁春	本基金的基金经理，汇添富均衡增长股票型	2011 年 3 月 29 日	-	10 年	国籍：中国。学历：卫生部武汉生物制品研究所医学硕士、中欧国际工商学院工商管理硕



	<p>证 券 投 资 基 金 的 基 金 经 理</p>			<p>士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任卫生部武汉生物制品研究所助理研究员、中国网络（百慕大）有限公司项目经理、大成基金管理有限公司行业研究员、国联安基金管理有限公司行业研究员，2006年9月加入汇添富基金管理有限公司，任高级行业分析师，2007年3月6日至2007年6月17日任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理助理，2007年6月18日至今任汇添富均衡增长股票型证券投资基金</p>
--	--	--	--	---

					的基金经理， 2011 年 3 月 29 日至今任汇添 富社会责任股 票型证券投资 基金的基金经 理。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

本基金精选积极履行社会责任，有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特竞争优势的优质上市公司，是专注于社会责任投资的股票型基金，截止报告期，与本基金管理人旗下其他基金风格不同。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司公平交易制度执行情况良好，未发生任何异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年 A 股市场走出了个倒 V 形，市场冲高回落。一季度，以低估值为代表的周期股表现抢眼，二季度，市场的流动性逐步收缩，A 股市场逐渐盘跌，消费品行业表现最为优异，部分股票在市场大幅下跌过程中依然取得了正向收益，前期估值过高的行业与公司出现了比较大的价值回归。

二季度是添富社会责任基金的建仓期，我们对二季度市场比较谨慎，建仓速度比较缓慢，有效的规避了市场的下跌，在行业配置方面，我们重点考虑了非周期与成长性比较好的行业，我们在有长期增长潜力的消费品行业进行了中长期的布局，重点选择了业绩突出、成长性好、管理层优秀的公司进行了投资，我们也选择了部分估值比较低、有一定瓶颈的资源股的投资。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年上半年，本基金收益率-0.40%，同期业绩比较基准收益率-5.78%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2011 年下半年，美国经济回升之路漫长，欧洲依然比较低迷，欧债危机阴霾远远没有消除。但是中国政府的紧缩政策不太可能会持续，政策继续收紧的空间在逐渐减小，货币政策的腾挪空间已经不大，而财政政策会发挥比较积极的作用。对于通胀，我们对下半年的总趋势判断不改变，随着翘尾因素、货币因素等的减弱，高位的回落是大概率事件，但是回落速度会比较缓慢。自去年四季度以来，密集的紧缩效应会逐步显现，部分先行指标显示经济增速出现减缓迹象，当前实体经济确实已从去年的过热状态逐步回归甚至有一定程度的下滑。受此影响，很多上市公司的业绩在三季度可能不太理想。展望下半年的证券市场，我们认为市场会处于上下盘整的局面，指数波动幅度不会太大，但是结构性机会不断涌现。本基金在下半年依然挑选有社会责任感的的企业，结合企业的基本面，精选选择有企业家精神、激励机制完善、治理结构清晰、财务报表质量稳健的上市公司做中长期的布局。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值

复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、产品创新部、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金依据签署的《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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于该次收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

## **§ 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**

在托管汇添富社会责任证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《汇添富社会责任证券投资基金基金合同》、《汇添富社会责任证券投资基金托管协议》的约定，对汇添富社会责任证券投资基金管理人—汇添富基金管理有限公司自本基金成立日 2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### **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**

本托管人认为，汇添富基金管理有限公司在汇添富社会责任证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等事项上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，汇添富基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的汇添富社会责任证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：汇添富社会责任股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	2,424,657,682.73
结算备付金		5,402,238.59
存出保证金		1,000,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,955,541,164.47
其中：股票投资		1,905,501,164.47
基金投资		-
债券投资		50,040,000.00
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	1,230,101,415.05
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	2,004,105.55
应收股利		587,987.40
应收申购款		75,275.03
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		5,619,369,868.82
<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>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		6,943,491.72
应付赎回款		177,416,723.51

应付管理人报酬		6,828,705.10
应付托管费		1,138,117.50
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	2,072,123.93
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	1,797,139.63
负债合计		196,196,301.39
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	5,442,798,556.82
未分配利润	6.4.7.10	-19,624,989.39
所有者权益合计		5,423,173,567.43
负债和所有者权益总计		5,619,369,868.82

注：1、由于本基金于 2011 年 3 月 29 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2011 年 6 月 30 日数据，特此说明。

2、报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.996，基金份额总额 5,442,798,556.82 份。

3、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：汇添富社会责任股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		6,623,534.46
1. 利息收入		19,011,895.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,098,132.52
债券利息收入		253,315.07
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		12,660,447.53
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-341,483.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,146,696.58
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	7,805,213.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-12,269,767.70
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	222,890.21
<b>减：二、费用</b>		<b>27,867,188.49</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	21,291,624.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,548,604.08
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,879,654.59
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	147,305.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-21,243,654.03</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-21,243,654.03</b>

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、由于本基金于 2011 年 3 月 29 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示从基金合同生效日至 2011 年 6 月 30 日数据，特此说明。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富社会责任股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 3 月 29 日 至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 3 月 29 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）	5,622,650,211.18	-	5,622,650,211.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-21,243,654.03	-21,243,654.03
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）	-179,851,654.36	1,618,664.64	-178,232,989.72
其中：1. 基金申购款	75,958.66	-683.63	75,275.03
2. 基金赎回款	-179,927,613.02	1,619,348.27	-178,308,264.75

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）	5,442,798,556.82	-19,624,989.39	5,423,173,567.43

注：由于本基金于 2011 年 3 月 29 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益（基金净值）变动表只列示从基金合同生效日至 2011 年 6 月 30 日数据，特此说明。

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：

林利军	陈灿辉	王小练
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

汇添富社会责任股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2010]1887号文《关于核准汇添富社会责任股票型证券投资基金募集的批复》的批准，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，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2011）验字第 60466941\_B03 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2011 年 3 月 29 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 5,620,367,127.29 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 2,283,083.89 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 5,622,650,211.18 元，折合 5,622,650,211.18 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金精选积极履行社会责任，并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司，谋求基金资产的稳健增值。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80% + 中证全债指数收益率×20%。

### 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 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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。

##### 6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间系 2011 年 3 月 29 日(基金合同生效日)起至 2011 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 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。

##### 6.4.4.3 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。

#### 6.4.4.4 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

买入股票于交易日确认为股票投资；股票投资成本，按交易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

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。

### 6.4.4.5 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。

## 6.4.4.6 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。

## 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)”。

#### 6.4.4.9 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机构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机构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。

#### 6.4.4.10 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 1.50% 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 0.25% 的年费率逐日计提；
- (3) 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，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；
- (4) 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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于该次收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；
- (2) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (3) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (4) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- (5) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 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	2,424,657,682.73
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,424,657,682.73

注：本基金本报告期末未投资于定期存款。

#### 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	1,917,637,832.17	1,905,501,164.47	-12,136,667.70	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	50,173,100.00	50,040,000.00	-133,100.00
	合计	50,173,100.00	50,040,000.00	-133,100.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,967,810,932.17	1,955,541,164.47	-12,269,767.70	

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	1,230,101,415.05	-
合计	1,230,101,415.05	-

##### 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	364,474.59
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	2,187.90
应收债券利息	1,470,328.77
应收买入返售证券利息	167,114.29
应收申购款利息	-
其他	-
合计	2,004,105.55

#### 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	2,035,598.64
银行间市场应付交易费用	36,525.29
合计	2,072,123.93

#### 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	1,000,000.00
应付赎回费	668,651.03
预提审计费	27,050.38
预提信息披露费	101,438.22
合计	1,797,139.63

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年3月29日(基金合同生效日)至2011年6月30日
----	--------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	5,622,650,211.18	5,622,650,211.18
本期申购	75,958.66	75,958.66
本期赎回(以“-”号填列)	-179,927,613.02	-179,927,613.02
本期末	5,442,798,556.82	5,442,798,556.82

注：1、基金合同于 2011 年 3 月 29 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 5,620,367,127.29 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 2,283,083.89 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 5,622,650,211.18 元，折合 5,622,650,211.18 份基金份额。

2、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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-8,973,886.33	-12,269,767.70	-21,243,654.03
本期基金份额交易产生的变动数	309,406.11	1,309,258.53	1,618,664.64
其中：基金申购款	-130.68	-552.95	-683.63
基金赎回款	309,536.79	1,309,811.48	1,619,348.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,664,480.22	-10,960,509.17	-19,624,989.39

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月29日至2011年6月30日
活期存款利息收入	6,066,070.88
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	32,061.64
其他	-
合计	6,098,132.52

#### 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3月29日至2011年6月30日

卖出股票成交总额	308,084,676.36
减：卖出股票成本总额	316,231,372.94
买卖股票差价收入	-8,146,696.58

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月29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	0
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	0
减：应收利息总额	0
债券投资收益	0

#### 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3月29日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,805,213.41
合计	7,805,213.41

#### 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3月29日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-12,269,767.70
——股票投资	-12,136,667.70
——债券投资	-133,100.00
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-12,269,767.70

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011年3月29日至2011年6月30日
基金赎回费收入	222,890.21
合计	222,890.21

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2011年3月29日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	2,879,379.59
银行间市场交易费用	275.00
合计	2,879,654.59

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2011年3月29日至2011年6月30日
审计费用	27,050.38
信息披露费	101,438.22
其他	900.00
银行费用	17,916.69
合计	147,305.29

注：表中“其他”为开户费。

#### 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
中国农业银行股份有限公司	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3月29日(基金合同生效日)至2011年6月30日	
	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	2,131,077,653.42	83.84%

##### 6.4.10.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年3月29日(基金合同生效日)至2011年6月30日	
	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	2,368,600,000.00	100.00%

##### 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3月29日(基金合同生效日)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	占期末应付佣金总量 的比例
东方证券股份有限公司	1,786,659.50	83.94%	1,693,768.30	83.21%

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 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	21,291,624.53
其中：支付销售机构的客户维护费	6,565,445.51

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times 1.50\% /$ 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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，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
	2011 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,548,604.08

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times 0.25\% /$ 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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，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
----	----

	2011 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2011 年 3 月 29 日）持有的基金份额	30,002,300.00
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	30,002,300.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.55%

注：本公司于 2011 年 3 月 23 日运用自有资金 30,000,000.00 元认购本基金份额 30,002,300.00 份（含募集期利息结转的份额），认购费用 1,000.00 元，符合招募说明书规定的认购费率。

#### 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 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	2,424,657,682.73	6,066,070.88

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

本基金本期未进行利润分配。

#### 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
002296	辉煌科技	2011年6月28日	重组停牌	26.00	-	-	71,720	1,975,638.50	1,864,720.00	-

### 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银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

### 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。

#### 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、买入返售金融资产及债券投资等。

##### 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	2,424,657,682.73	-	-	-	-	-	2,424,657,682.73
结算备付金	5,402,238.59	-	-	-	-	-	5,402,238.59
存出保证金	-	-	-	-	-	1,000,000.00	1,000,000.00
交易性金融资产	-	-	50,040,000.00	-	-	1,905,501,164.47	1,955,541,164.47
买入返售金融资产	1,230,101,415.05	-	-	-	-	-	1,230,101,415.05
应收利息	-	-	-	-	-	2,004,105.55	2,004,105.55
应收股利	-	-	-	-	-	587,987.40	587,987.40
应收申购款	-	-	-	-	-	75,275.03	75,275.03
资产总计	3,660,161	-	50,040,000.00	-	-	1,909,168,532.45	5,619,369,868.82

	, 336.37		00				
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	6,943,491.72	6,943,491.72
应付赎回款	-	-	-	-	-	177,416,723.51	177,416,723.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,828,705.10	6,828,705.10
应付托管费	-	-	-	-	-	1,138,117.50	1,138,117.50
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,072,123.93	2,072,123.93
其他负债	-	-	-	-	-	1,797,139.63	1,797,139.63
负债总计	-	-	-	-	-	196,196,301.39	196,196,301.39
利率敏感度缺口	3,660,161,336.37		-50,040,000.00			-1,712,972,231.06	5,423,173,567.43

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）
	0.25%	-34,565.96
	-0.25%	34,612.41

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,905,501,164.47	35.14
交易性金融资产—债券投资	50,040,000.00	0.92
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	1,955,541,164.47	36.06

注：股票资产占基金资产的 60%—95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、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，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）
	5%	83,267,542.64
	-5%	-83,267,542.64

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	1,905,501,164.47	33.91
	其中：股票	1,905,501,164.47	33.91

2	固定收益投资	50,040,000.00	0.89
	其中：债券	50,040,000.00	0.89
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,230,101,415.05	21.89
	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	2,430,059,921.32	43.24
6	其他各项资产	3,667,367.98	0.07
7	合计	5,619,369,868.82	100.00

## 7.2 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	-	-
B	采掘业	381,833,011.91	7.04
C	制造业	1,050,295,564.79	19.37
C0	食品、饮料	379,324,975.69	6.99
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	101,246,752.68	1.87
C6	金属、非金属	865,015.00	0.02
C7	机械、设备、仪表	111,738,810.49	2.06
C8	医药、生物制品	457,120,010.93	8.43
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	27,376,480.00	0.50
H	批发和零售贸易	208,604,331.16	3.85
I	金融、保险业	102,565,380.31	1.89
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	134,826,396.30	2.49
	合计	1,905,501,164.47	35.14

## 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

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	600519	贵州茅台	1,350,478	287,152,137.14	5.29
2	600415	小商品城	7,799,970	95,861,631.30	1.77
3	002241	歌尔声学	3,275,044	83,120,616.72	1.53
4	600535	天士力	1,998,210	82,186,377.30	1.52
5	000968	煤气化	3,132,131	79,336,878.23	1.46
6	600123	兰花科创	1,763,041	73,659,852.98	1.36
7	000915	山大华特	3,987,181	70,373,744.65	1.30
8	600079	人福医药	3,108,035	68,563,252.10	1.26
9	600859	王府井	1,691,104	67,593,426.88	1.25
10	600062	双鹤药业	2,718,188	67,383,880.52	1.24
11	600188	兖州煤业	1,799,794	63,532,728.20	1.17
12	600729	重庆百货	1,457,423	62,989,822.06	1.16
13	000937	冀中能源	2,411,420	61,129,497.00	1.13
14	601699	潞安环能	1,699,970	55,776,015.70	1.03
15	000538	云南白药	924,730	52,783,588.40	0.97
16	600809	山西汾酒	704,263	49,333,623.15	0.91
17	600000	浦发银行	4,934,909	48,559,504.56	0.90
18	000983	西山煤电	1,999,919	48,398,039.80	0.89
19	000527	美的电器	2,499,921	45,973,547.19	0.85
20	000028	一致药业	1,650,573	42,617,794.86	0.79
21	600690	青岛海尔	1,512,174	42,265,263.30	0.78
22	600805	悦达投资	2,597,651	38,964,765.00	0.72
23	000650	仁和药业	2,737,267	38,951,309.41	0.72
24	000501	鄂武商A	2,072,792	35,403,287.36	0.65
25	600702	沱牌曲酒	1,579,946	32,641,684.36	0.60
26	601009	南京银行	3,299,975	29,600,775.75	0.55
27	002230	科大讯飞	629,920	25,511,760.00	0.47
28	601601	中国太保	1,090,000	24,405,100.00	0.45
29	000651	格力电器	1,000,000	23,500,000.00	0.43
30	000590	紫光古汉	1,864,228	23,302,850.00	0.43
31	600276	恒瑞医药	756,873	22,683,483.81	0.42
32	002475	立讯精密	502,666	18,126,135.96	0.33
33	002004	华邦制药	387,036	17,455,323.60	0.32
34	002007	华兰生物	395,881	13,436,201.14	0.25

35	000869	张裕A	99,959	9,875,949.20	0.18
36	002296	辉煌科技	71,720	1,864,720.00	0.03
37	000708	大冶特钢	56,500	865,015.00	0.02
38	002304	洋河股份	2,549	321,581.84	0.01

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	266,788,889.91	4.92
2	600415	小商品城	119,918,787.34	2.21
3	000937	冀中能源	91,761,632.58	1.69
4	000968	煤气化	90,467,846.67	1.67
5	600079	人福医药	78,941,725.14	1.46
6	600535	天士力	77,636,626.52	1.43
7	600188	兖州煤业	73,985,516.67	1.36
8	002241	歌尔声学	72,142,670.33	1.33
9	000915	山大华特	71,322,344.74	1.32
10	600859	王府井	70,864,390.66	1.31
11	600062	双鹤药业	70,187,251.17	1.29
12	600123	兰花科创	70,059,427.50	1.29
13	600809	山西汾酒	67,257,520.29	1.24
14	600729	重庆百货	63,605,819.89	1.17
15	000983	西山煤电	57,692,472.57	1.06
16	600508	上海能源	55,324,031.75	1.02
17	601699	潞安环能	54,385,236.77	1.00
18	000538	云南白药	54,103,342.46	1.00
19	600000	浦发银行	53,087,458.98	0.98
20	000028	一致药业	48,822,500.83	0.90

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	600508	上海能源	43,084,541.11	0.79
2	600750	江中药业	40,900,940.80	0.75
3	000937	冀中能源	37,673,301.41	0.69
4	002304	洋河股份	31,616,195.05	0.58
5	600016	民生银行	29,402,669.16	0.54
6	600809	山西汾酒	25,576,182.19	0.47
7	600970	中材国际	24,033,693.68	0.44
8	600519	贵州茅台	19,600,114.98	0.36
9	600251	冠农股份	18,575,812.32	0.34
10	600079	人福医药	12,570,779.14	0.23
11	600997	开滦股份	7,099,879.38	0.13
12	600188	兖州煤业	7,039,740.34	0.13
13	000401	冀东水泥	5,056,437.00	0.09
14	000650	仁和药业	4,215,313.00	0.08
15	600702	沱牌舍得	1,639,076.80	0.03

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	2,233,869,205.11
卖出股票收入（成交）总额	308,084,676.36

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	-	-
3	金融债券	50,040,000.00	0.92
	其中：政策性金融债	50,040,000.00	0.92
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	50,040,000.00	0.92



### 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	080416	08 农发 16	500,000	50,040,000.00	0.92

### 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 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 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	1,000,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	587,987.40
4	应收利息	2,004,105.55
5	应收申购款	75,275.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,667,367.98

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中未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
126,705	42,956.46	521,373,569.21	9.58%	4,921,424,987.61	90.42%

### 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	426,435.62	0.0078%

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( 2011 年 3 月 29 日 ) 基金份额总额	5,622,650,211.18
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	75,958.66
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	179,927,613.02
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,442,798,556.82

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、2011 年 1 月 21 日，中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格（证监许可【2011】116 号），张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

### 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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

东方证券	2,131,077,653.42	83.84%	1,786,659.50	83.94%	-
德邦证券	2410,876,228.05	16.16%	341,830.34	16.06%	-

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
长江证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	2,368,600,000.00	100.00%	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

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 11 个交易单元均为本基金本报告期内新增交易单元：长江证券（上交所交易单元、深交所交易单元）、齐鲁证券（上交所交易单元）、兴业证券（上交所交易单元、深交所交易单元）、中投证券（上交所交易单元、深交所交易单元）、东方证券（上交所交易单元、深交所交易单元）、德邦证券（上交所交易单元、深交所交易单元）。

**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	汇添富社会责任股票型证券投资基金基金合同	管理人网站	2011 年 2 月 24 日
2	汇添富社会责任股票型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 2 月 24 日
3	汇添富社会责任股票型证券投资基金托管协议	管理人网站	2011 年 2 月 24 日
4	汇添富社会责任股票型证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 2 月 24 日
5	汇添富社会责任股票型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 2 月 24 日
6	关于汇添富社会责任股票型证券投资基金增加中国银河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 3 月 1 日
7	汇添富基金管理有限公司关于运用自有资金认购汇添富社会责任股票型证券投资基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 3 月 2 日
8	关于汇添富社会责任股票型证券投资基金增加天相投顾为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 3 月 2 日

9	关于汇添富社会责任股票型证券投资基金增加广东发展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 3 月 14 日
10	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
11	关于汇添富社会责任股票型证券投资基金增加浦发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 3 月 17 日
12	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金增加中信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 3 月 17 日
13	汇添富社会责任股票型证券投资基金基金合同生效公告	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
14	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
15	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
16	汇添富基金管理有限公司关于开通招商银行 i 理财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 4 月 27 日
17	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
18	汇添富基金管理有限公司关于增	中国证券报、上海证	2011 年 5 月 20 日

	加中信金通证券为代销机构的公告	券报、证券时报、管理人网站	
19	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
20	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
21	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行 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	2011 年 6 月 17 日
22	汇添富基金管理有限公司关于汇添富社会责任股票型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 6 月 27 日
23	关于汇添富社会责任股票型证券投资基金参加部分代销机构定投基金、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 27 日
24	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
25	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
26	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	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

	的公告		
27	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社会责任股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富社会责任股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富社会责任股票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、报告期内汇添富社会责任股票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。

### 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