

# 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 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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告(未经审计)</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	34
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	34
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	39
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	41
7.8 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
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	41
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	41
7.11 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
基金简称	汇添富亚澳成熟优选股票（QDII）
基金主代码	470888
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月25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	93,678,982.52份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在亚洲澳洲成熟证券市场（除日本外）精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的公司股票等证券，通过有效的资产配置和组合管理，进行中长期投资布局，在有效管理风险的前提下，追求持续稳健的较高投资回报。
投资策略	本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，并基于业绩比较基准的市场权重，通过分析各个股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合中各市场的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出具有持续竞争优势，且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。
业绩比较基准	60%×MSCI 太平洋（除日本）指数（MSCI Pacific ex Japan Index）+ 40%×MSCI 中国指数（MSCI China Index）
风险收益特征	本基金为投资于亚洲澳洲地区成熟市场（除日本外）的主动股票型基金，属于证券投资基金中高收益高风险的品种。

### 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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Capital International, Inc.	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	资本国际公司	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		11100 Santa Monica Blvd, 15th Floor Los Angeles, CA 90025-3384, USA	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		One Raffles Quay, 33rd Floor North Tower Singapore 048583	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		Singapore 048583	NY 10005

## 2.5 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

## 2.6 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	2,487,687.93

本期利润	-5,033,570.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0467
本期加权平均净值利润率	-4.37%
本期基金份额净值增长率	-5.10%
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	3,546,712.40
期末可供分配基金份额利润	0.0379
期末基金资产净值	97,225,694.92
期末基金份额净值	1.038
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	5.72%

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

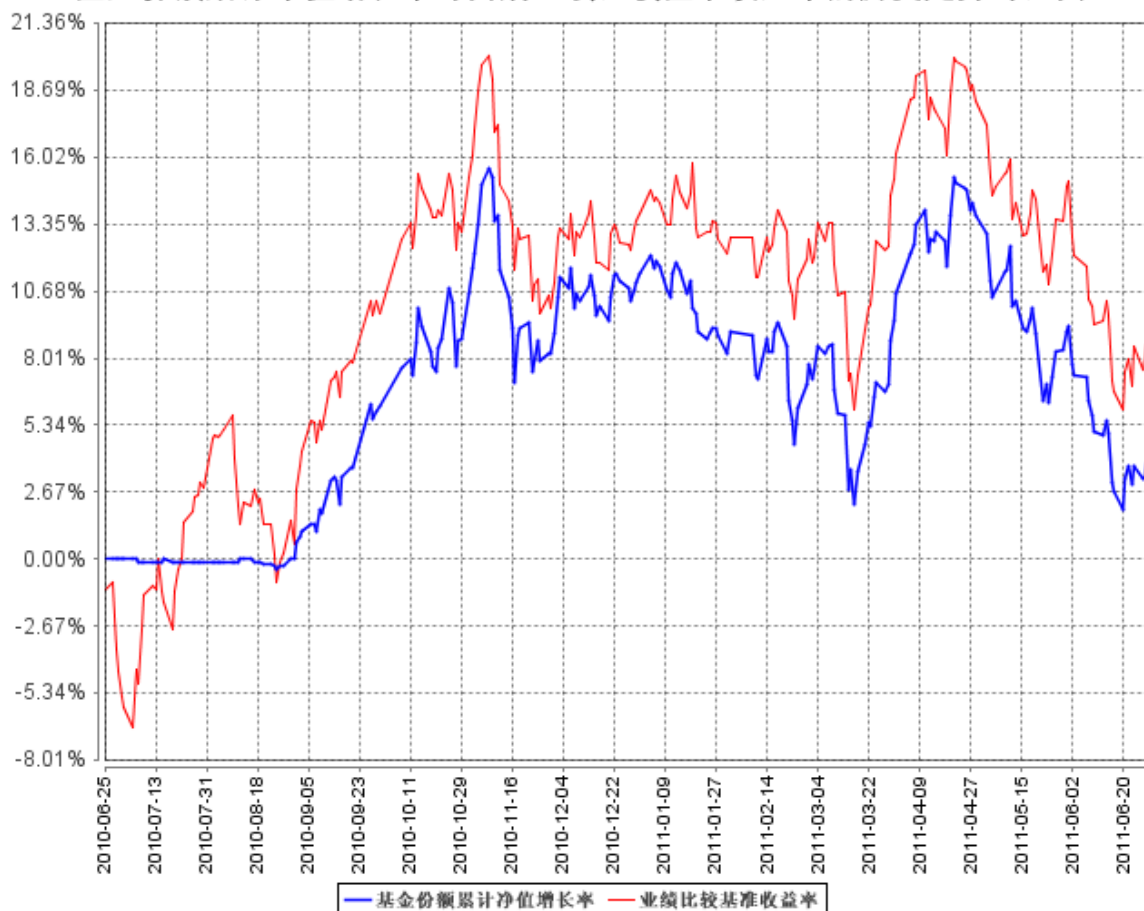
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-3.08%	0.82%	-3.17%	1.09%	0.09%	-0.27%
过去三个月	-3.44%	0.89%	-3.36%	1.03%	-0.08%	-0.14%
过去六个月	-5.10%	0.88%	-2.17%	1.00%	-2.93%	-0.12%
过去一年	5.72%	0.81%	16.59%	1.01%	-10.87%	-0.20%
自基金合同生效日起至今	5.72%	0.80%	11.33%	1.02%	-5.61%	-0.22%

注：1、本基金的《基金合同》生效日为2010年6月25日，至本报告期末未满三年。

2、由于基金净值受汇率影响，为保持可比性，业绩比较基准也考虑了汇率的影响，管理人决定自2010年年报始，使用彭博系统中以人民币计价的指数进行计算。

#### 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（2010年6月25日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

## § 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		
刘子龙	本基金的基金经理	2010年6月25日	-	16年	国籍：中国香港。学历：英国剑桥大学工商管理硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格、特许金融分析师（CFA）。从业经历：曾任香港花旗银行业务经理，汇丰投资管理（香港）有限公司上海代表处首席代表，2000年11月20日至2005年11月30日任花旗投资管理（香港）有限公司全球平衡组合的基金经理。2007年9月加入汇添富基金管理有限公司，任国际投资副总监。2010年6月25日至今任汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金的基金经理。
王致人	本基金的基金经理	2010年6月25日	-	11年	国籍：中国台湾。学历：美国波士顿大学财务硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格、特许金融分析师（CFA），财务风险经理人（FRM）。从业经历：

					<p>曾任日正企管顾问股份有限公司顾问, 国票证券投资顾问股份有限公司研究员, 美商 Financial Science Incorporated 研究员, 2005 年 1 月 1 日至 2007 年 9 月 30 日任美商 AIG 南山人寿亚太策略基金的基金经理, 2005 年 12 月 1 日至 2007 年 9 月 30 日任美商 AIG 南山人寿台湾基金的基金经理, 2006 年 6 月 1 日至 2007 年 9 月 30 日任美商 AIG 南山人寿亚太不动产证券化基金的基金经理。2007 年 10 月加入汇添富基金管理有限公司, 任国际投资副总监。2010 年 6 月 25 日至今任汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金的基金经理。</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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职位	证券从业年限	说明
Christopher Choe	投资经理人, 资本国际高级副总裁, 资本集团中国业务发展委员会的成员。	28 年	英国和威尔士注册会计师, 新加坡注册公共会计师协会和澳洲 CPA 协会会员。现任资本国际高级副总裁,

			也是资本集团中国业务发展委员会的成员。在加入资本国际之前，曾任职 JP Morgan 财务投资部门，Swiss Bank Corporation 投资分析师。
Eugene Cheah	资本国际研究公司的高级副总裁和资本国际公司副总裁	13年	他是亚太地区（日本除外）的投资组合经理，也负责欧洲和亚洲药品及生物技术行业的研究分析。

### 4.3 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。

### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

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。

#### 4.4.2 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

注：在亚洲澳洲成熟证券市场（除日本外）精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的公司股票等证券，通过有效的资产配置和组合管理，进行中长期投资布局，在有效管理风险的前提下，追求持续稳健的较高投资回报。与本基金管理人旗下其他基金投资组合风格不同。

#### 4.4.3 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。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来亚澳成熟市场波动较大，一方面是天灾频传，澳大利亚昆士兰洪灾导致国际焦煤、粮食价格飙涨，而日本受地震、海啸与核灾三重袭击，各国已重新评估核电作为发展新能源主力的风险，而汽车、电子业板块也因产业链断裂，相关个股有较大回调。美联储二次量化宽松 6 月底已经到期，加上欧美经济数据仍有反复，造成包括原油在内的大宗商品价格冲高回落，一定程度拖累了澳洲资源股表现；而中国 CPI 仍高位震荡，通胀形势不容乐观导致流动性收紧，并引发市场对“硬着陆”的担忧，影响香港上市的中资股、红筹股表现；另外，以希腊为首的欧债危机再次升温，导致投资人避险情绪上升。在投资策略上，我们一方面调整澳洲资源股配置，买入盈利能见度较高的新加坡综合企业股；一方面也加大对香港市场低估值、高派息、未来增长明确的蓝筹股配置，提高组合防御性。回顾期间股票仓位在 80%左右。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

今年上半年基金收益率-5.1%，同期基准跌幅 2.2%，由于股市、汇市波动较大，我们采取了恒定的股票仓位，因此在重点持有的个股短期跌幅较大时，对基金净值影响也较大，在半年报公布前我们已针对重点持股进行深入排查，确保业绩增长情况。未来仍将秉持大盘股与中小盘股均衡配置，自下而上精选个股的投资策略。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期海外市场存在经济增长不如预期的隐忧，美国二季度 GDP 增长仅有 1.3%，美联储预估全年 GDP 增长 2.7 - 2.9% 的目标存在下修风险，但企业获利仍旧亮丽，根据美国标普 500 强企业已公布的二季报，盈利同比增长 15%，好于市场预期的 12%。进入 8 月份，我们重点投资的亚澳成熟市场也将进入半年报公布高峰期，板块盈利增长变化将对下半年投资具指引性。未来我们将密切跟踪美联储二次量化宽松结束对全球经济与金融、商品市场的影响。二次量化宽松期间美国标普 500 指数上涨 10.1%，而澳洲与香港市场却分别下跌 1.8%、7.5%，主要原因是亚澳市场的通胀风险在量化宽松的背景下被放大，因此在没有第三轮量化宽松的前提下，亚澳市场有机会落后补涨。根据基金基准，目前的动态市盈率为 12.3 倍，低于过去五年均值（15.2 倍），说明估值优势还比较明显。

#### 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。

#### **4.8 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，最少一次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 25%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金于 2011 年 1 月 20 日实施利润分配，每份基金份额派发红利 0.02 元人民币。

### **§ 5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

2011 年上半年，本基金托管人在对汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金的托管过程中，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，汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金的投资运作、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对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 2,466,073.66 元。

### 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 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

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	23,282,313.59	27,656,239.76
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	73,880,136.07	125,420,212.59
其中: 股票投资		73,880,136.07	125,420,212.59
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		305,023.73	-
应收利息	6.4.7.5	1,748.59	1,734.95
应收股利		318,241.43	75,331.96
应收申购款		62,062.66	127,396.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	19,469.80	13,235.88
资产总计		97,868,995.87	153,294,151.67
<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		-	490,660.19
应付赎回款		244,116.26	8,953,574.53
应付管理人报酬		142,953.45	224,692.83

应付托管费		27,796.48	43,690.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	228,434.76	317,029.30
负债合计		643,300.95	10,029,647.11
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	93,678,982.52	128,625,234.06
未分配利润	6.4.7.10	3,546,712.40	14,639,270.50
所有者权益合计		97,225,694.92	143,264,504.56
负债和所有者权益总计		97,868,995.87	153,294,151.67

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.038 元，基金份额总额 93,678,982.52 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

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 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 6 月 25 日(基 金合同生效日)至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-3,036,591.41	52,263.60
1. 利息收入		19,636.17	52,263.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	19,636.17	52,263.60
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,844,504.19	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,506,782.49	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	24,000.54	-
股利收益	6.4.7.14	1,313,721.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-7,521,258.30	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-441,687.18	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	62,213.71	-

<b>减：二、费用</b>		1,996,978.96	162,124.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,036,469.36	128,858.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	201,535.76	25,055.75
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	541,563.45	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.18	217,410.39	8,210.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,033,570.37	-109,860.82
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-5,033,570.37	-109,860.82

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 2010 年 6 月 25 日成立，因此所有者权益（基金净值）变动表中上年度可比期间只列示 2010 年 6 月 25 日至 2010 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

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)	128,625,234.06	14,639,270.50	143,264,504.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-5,033,570.37	-5,033,570.37
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）	-34,946,251.54	-3,592,914.07	-38,539,165.61
其中：1. 基金申购款	10,526,524.55	786,512.60	11,313,037.15
2. 基金赎回款	-45,472,776.09	-4,379,426.67	-49,852,202.76
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-2,466,073.66	-2,466,073.66
五、期末所有者权益(基金净值)	93,678,982.52	3,546,712.40	97,225,694.92
项目	上年度可比期间 2010 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日		





International, Inc.), 境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)。

本基金的投资范围为亚洲澳洲已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的成熟证券市场国家或地区公开上市的股票, 固定收益产品, 基金, 货币市场工具以及相关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金坚持长期价值投资的理念, 通过深入的“自下而上”的企业基本面分析, 精选具有持续竞争优势的公司, 在亚洲澳洲成熟市场(除日本外)估值比较的基础上, 进行中长期的投资布局。本基金的业绩比较基准为: 60%×MSCI 太平洋(除日本)指数(MSCI Pacific ex Japan Index)+40%×MSCI 中国指数(MSCI China Index)。

#### 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

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

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

### 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	23,282,313.59
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	23,282,313.59

注：本基金于 2011 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：澳元 2,821.56 元（折合人民币 19,550.99 元），港元 17,446,084.70 元（折合人民币 14,508,512.96 元）。

#### 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	68,095,488.30	73,880,136.07	5,784,647.77
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	68,095,488.30	73,880,136.07	5,784,647.77

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本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

注：本基金本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

注：本基金本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	1,748.59
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	1,748.59

### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
其他应收款	19,469.80
待摊费用	-
合计	19,469.80

注：表中“其他应收款”为在途换汇资金，应收港元 23,411.89 元，折合人民币 19,469.80 元。

### 6.4.7.7 应付交易费用

注：本基金本期末未有应付交易费用。

#### 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	608.88
其他应付款	19,550.99
预提费用	208,274.89
合计	228,434.76

#### 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	128,625,234.06	128,625,234.06
本期申购	10,526,524.55	10,526,524.55
本期赎回(以“-”号填列)	-45,472,776.09	-45,472,776.09
本期末	93,678,982.52	93,678,982.52

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	5,745,945.00	8,893,325.50	14,639,270.50
本期利润	2,487,687.93	-7,521,258.30	-5,033,570.37
本期基金份额交易产生的变动数	-1,090,713.59	-2,502,200.48	-3,592,914.07
其中：基金申购款	474,043.25	312,469.35	786,512.60
基金赎回款	-1,564,756.84	-2,814,669.83	-4,379,426.67
本期已分配利润	-2,466,073.66	-	-2,466,073.66
本期末	4,676,845.68	-1,130,133.28	3,546,712.40

#### 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	19,498.63
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	-
其他	137.54
合计	19,636.17

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	150,024,100.93
减：卖出股票成本总额	146,517,318.44
买卖股票差价收入	3,506,782.49

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出权证成交总额	24,000.54
减：卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	24,000.54

#### 6.4.7.14 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	1,313,721.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,313,721.16

#### 6.4.7.15 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	-7,521,258.30
——股票投资	-7,521,258.30
——债券投资	-

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-7,521,258.30

#### 6.4.7.16 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	62,213.71
合计	62,213.71

#### 6.4.7.17 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	541,563.45
银行间市场交易费用	-
合计	541,563.45

#### 6.4.7.18 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
其他费用	9,000.00
银行汇划费用	135.50
合计	217,410.39

#### 6.4.7.19 分部报告

收入	2011年1月1日至2011年6月30日止期间
中国大陆	81,849.88
中国香港	-2,767,348.08

澳大利亚	-534,732.26
新加坡	644,605.41
新西兰	-19,279.18
其他	-441,687.18
合计	-3,036,591.41

注：1、对外交易收入归属于本基金所处区域；

2、截至 2011 年 6 月 30 日止，本基金无非流通资产。

#### 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
东航金控控股有限公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
布朗兄弟哈里曼银行 (Brown Brothers Harriman & Co.)	基金境外托管人
资本国际公司 (Capital International, Inc.)	境外投资顾问

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

注：本基金本期未有通过关联方交易单元进行的交易。



## 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	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 6 月 25 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,036,469.36	128,858.15
其中：支付销售机构的客户维护费	107,515.48	7,206.70

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.8% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 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 6 月 25 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	201,535.76	25,055.75

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，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

注：本基金本期未有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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6月25日至2010年6月30日
基金合同生效日（2010年6月25日）持有的基金份额	-	40,017,937.50
期初持有的基金份额	40,017,937.50	-
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	40,017,937.50	40,017,937.50
期末持有的基金份额占基金总份额比例	42.72%	7.66%

注：本公司分别于2010年5月25日，2010年6月23日运用自有资金25,000,000.00元，15,000,000.00元认购本基金，总计认购本基金份额40,017,937.50份（含募集期利息结转的份额），认购费用2,000.00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

注：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		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年6月25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	8,754,249.64	19,636.17	522,636,079.14	52,263.60
布朗兄弟哈里曼银行	14,528,063.95	-	-	-

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本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

金额单位：人民币元

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	2011 年 1 月 20 日	2011 年 1 月 19 日	0.200	2,021,235.67	444,837.99	2,466,073.66	
合计	-	-	0.200	2,021,235.67	444,837.99	2,466,073.66	

#### 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

本基金本期末未持有暂时停牌股票。

##### 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，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。

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，本期末本基金的资产均能及时变现。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、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	23,282,313.59	-	-	-	-	-	23,282,313.59
交易性金融资产	-	-	-	-	-	73,880,136.07	73,880,136.07
应收股利	-	-	-	-	-	318,241.43	318,241.43
应收利息	-	-	-	-	-	1,748.59	1,748.59
应收申购款	7,191.41	-	-	-	-	54,871.25	62,062.66
应收证券清算	-	-	-	-	-	305,023.73	305,023.73

款							
其他资产	-	-	-	-	-	19,469.80	19,469.80
资产总计	23,289,505.00	-	-	-	-	74,579,490.87	97,868,995.87
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	244,116.26	244,116.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	142,953.45	142,953.45
应付托管费	-	-	-	-	-	27,796.48	27,796.48
其他负债	-	-	-	-	-	228,434.76	228,434.76
负债总计	-	-	-	-	-	643,300.95	643,300.95
利率敏感度缺口	23,289,505.00	-	-	-	-	73,936,189.92	97,225,694.92
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	27,656,239.76	-	-	-	-	-	27,656,239.76
交易性金融资产	-	-	-	-	-	125,420,212.59	125,420,212.59
应收股利	-	-	-	-	-	75,331.96	75,331.96
应收利息	-	-	-	-	-	1,734.95	1,734.95
应收申购款	13,756.99	-	-	-	-	113,639.54	127,396.53
其他资产	-	-	-	-	-	13,235.88	13,235.88
资产总计	27,669,996.75	-	-	-	-	125,624,154.92	153,294,151.67
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	490,660.19	490,660.19
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,953,574.53	8,953,574.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	224,692.83	224,692.83
应付托管费	-	-	-	-	-	43,690.26	43,690.26
其他负债	-	-	-	-	-	317,029.30	317,029.30
负债总计	-	-	-	-	-	10,029,647.11	10,029,647.11
利率敏感度缺口	27,669,996.75	-	-	-	-	115,594,507.81	143,264,504.56

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

本基金本年末计息资产仅包括银行存款及应收申购款，且均以活期存款利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本年末未持有其他付息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日					
	港币 折合人民币	美元 折合人民币	澳大利亚元 折合人民币	新西兰元 折合人民币	新加坡元 折合人民币	合计
以外币计价的资产						
银行存款	14,625,373.03	-	19,550.99	-	-	14,644,924.02
交易性金融资产	38,912,787.98	1,781,191.41	28,189,481.77	-	4,996,674.91	73,880,136.07
应收股利	122,197.38	-	150,285.26	-	45,758.79	318,241.43
应收利息	0.67					0.67
应收证券清算款	47,391.21				257,632.52	305,023.73
其他资产	19,469.80	-	-	-	-	19,469.80
资产合计	53,727,220.07	1,781,191.41	28,359,318.02	-	5,300,066.22	89,167,795.72
以外币计价的负债						
应付证券清算款	-					-
其他负债	-	-	19,550.99	-	-	19,550.99
负债合计	-	-	19,550.99	-	-	19,550.99
资产负债表		1,781,191.41		-		

外汇风险敞口净额	53,727,220.07		28,339,767.03		5,300,066.22	89,148,244.73
项目	上年度末 2010年12月31日					
	港币折合人民币	美元折合人民币	澳大利亚元折合人民币	新西兰元折合人民币	新加坡元折合人民币	合计
以外币计价的资产						
银行存款	16,190,092.61	-	13,284.70	-	-	16,203,377.31
交易性金融资产	59,461,575.87	3,030,547.52	53,532,485.14	410,659.55	8,984,944.51	125,420,212.59
应收股利	23,389.68	-	51,942.28	-	-	75,331.96
其他资产	13,235.88	-	-	-	-	13,235.88
资产合计	75,688,294.04	3,030,547.52	53,597,712.12	410,659.55	8,984,944.51	141,712,157.74
以外币计价的负债						
应付证券清算款	490,660.19					490,660.19
其他负债	-	-	13,284.70	-	-	13,284.70
负债合计	490,660.19	-	13,284.70	-	-	503,944.89
资产负债表外汇风险敞口净额	75,197,633.85	3,030,547.52	53,584,427.42	410,659.55	8,984,944.51	141,208,212.85

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
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）
	港币相对人民币升值5%	2,686,361.00	3,759,881.69
	港币相对人民币贬值5%	-2,686,361.00	-3,759,881.69
	美元相对人民币升值5%	89,059.57	151,527.38
	美元相对人民币贬值5%	-89,059.57	-151,527.38

澳大利亚元相对人民币升值 5%	1,416,988.35	2,679,221.37
澳大利亚元相对人民币贬值 5%	-1,416,988.35	-2,679,221.37
新西兰元相对人民币升值 5%	-	20,532.98
新西兰元相对人民币贬值 5%	-	-20,532.98
新加坡元相对人民币升值 5%	265,003.31	449,247.23
新加坡元相对人民币贬值 5%	-265,003.31	-449,247.23

#### 6.4.13.4.3 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。

##### 6.4.13.4.3.1 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	73,880,136.07	75.99	125,420,212.59	87.54
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	73,880,136.07	75.99	125,420,212.59	87.54

注：本基金股票投资占基金资产的比例为 60-95%，现金、债券、权证以及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，基金持有权证的市场价值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及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%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。



### 6.4.13.4.3.2 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、本基金利用 MSCI BARRA 的因子风险模型计算其贝塔系数；		
	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）
	业绩比较基准增加 5%	3,213,785.92	6,521,851.05
	业绩比较基准减少 5%	-3,213,785.92	-6,521,851.05

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	73,880,136.07	75.49
	其中：普通股	73,880,136.07	75.49
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,282,313.59	23.79
8	其他各项资产	706,546.21	0.72
9	合计	97,868,995.87	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
香港	38,912,787.98	40.02
澳大利亚	28,189,481.77	28.99
新加坡	6,777,866.32	6.97
合计	73,880,136.07	75.99

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
001 能源	8,304,797.27	8.54
002 材料	16,908,970.72	17.39
003 工业	5,516,744.09	5.67
004 非必需消费品	11,042,731.02	11.36
005 必需消费品	4,850,610.92	4.99
006 保健	1,301,159.85	1.34
007 金融	14,298,859.02	14.71
008 信息技术	4,611,485.92	4.74
009 电信服务	5,092,435.96	5.24
010 公共事业	1,952,341.30	2.01
合计	73,880,136.07	75.99

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	Anhui Conch Cement C	安徽海螺水泥	914 HK	香港证券交易所	香港	123,500	3,738,464.55	3.85
2	BHP	必和必拓	BHP AU	澳大利	澳大利亚	11,190	3,396,124.9	3.49

	Billiton Ltd	有限公司		亚证券交易所			9	
3	Oil Search Ltd	Oil Search 有限公司	OSH AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	58,010	2,673,030.90	2.75
4	Rio Tinto Ltd	力拓有限公司	RIO AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	4,210	2,420,958.41	2.49
5	Telstra Corp Ltd	澳大利亚电信股份有限公司	TLS AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	118,500	2,372,988.66	2.44
6	Coca-Cola Amatil Ltd	可口可乐阿马提尔有限公司	CCL AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	29,890	2,365,219.70	2.43
7	Yanzhou Coal Mining	兖州煤业股份有限公司	1171 HK	香港证券交易所	香港	88,000	2,166,203.78	2.23
8	Haier Electronics Gr	海尔电器集团有限公司	1169 HK	香港证券交易所	香港	244,000	1,960,161.60	2.02
9	DBS Group Holdings L	星展集团	DBS SP	新加坡证券交易所	新加坡	25,000	1,932,096.29	1.99
10	Jardine Matheson Hol	怡和集团	JM SP	新加坡证券交易所	新加坡	4,800	1,781,191.41	1.83
11	China Mobile Ltd	中国移动有限公司	941 HK	香港证券交易所	香港	26,500	1,586,730.96	1.63
12	Australia & New Zealand	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	ANZ AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	10,090	1,538,130.97	1.58
13	China Forestry Holdi	中国森林控股有限公司	930 HK	香港证券交易所	香港	624,000	1,530,846.10	1.57
14	Newcrest Mining Ltd	纽克雷斯特矿业有限公司	NCM AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	5,850	1,528,593.00	1.57
15	Zhaojin Mining Indus	招金矿业股份有限公司	1818 HK	香港证券交易所	香港	107,000	1,423,733.44	1.46
16	QBE Insurance	QBE 保险集团有限	QBE AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	11,770	1,406,841.05	1.45

	e Group	公司		交易所				
17	CSL Ltd	CSL 有限公司	CSL AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	5,680	1,301,159.85	1.34
18	CNOOC Ltd	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港证券交易所	香港	85,000	1,283,688.63	1.32
19	Olam International L	奥兰国际有限公司	OLAM SP	新加坡证券交易所	新加坡	87,818	1,259,236.29	1.30
20	Minth Group Ltd	敏实集团有限公司	425 HK	香港证券交易所	香港	120,000	1,255,413.55	1.29
21	Iluka Resources Ltd	艾璐卡资源有限公司	ILU AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	10,610	1,233,635.36	1.27
22	Westpac Banking Corp	西太平洋银行公司	WBC AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	7,660	1,181,499.11	1.22
23	Dongfeng Motor Group	东风汽车集团股份有限公司	489 HK	香港证券交易所	香港	96,000	1,173,582.14	1.21
24	Intime Department St	银泰百货(集团)有限公司	1833 HK	香港证券交易所	香港	105,000	1,154,371.72	1.19
25	AMP Ltd	安保集团有限公司	AMP AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	34,040	1,153,394.51	1.19
26	Soho China Ltd	SOHO 中国有限公司	410 HK	香港证券交易所	香港	199,000	1,150,172.04	1.18
27	Comba Telecom System	京信通信	2342 HK	香港证券交易所	香港	167,850	1,144,616.82	1.18
28	China Minsheng Banki	中国民生银行股份有限公司	1988 HK	香港证券交易所	香港	188,000	1,120,990.50	1.15
29	Link REIT/The	领汇房地产	823 HK	香港证券交易所	香港	50,500	1,115,015.31	1.15
30	AIA Group Ltd	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港证券交易所	香港	47,600	1,066,818.77	1.10
31	ASM	ASM 太平	522 HK	香港证	香港	12,000	1,063,808.3	1.09

	Pacific Technolo	洋		券交易所			0	
32	Kunlun Energy Co Ltd	昆仑能源有限公司	135 HK	香港证券交易所	香港	88,000	979,182.65	1.01
33	China Lilang Ltd	中国利郎有限公司	1234 HK	香港证券交易所	香港	107,000	969,918.41	1.00
34	Kingdee Internat iona	金蝶国际软件集团有限公司	268 HK	香港证券交易所	香港	271,600	944,128.21	0.97
35	Wilmar Internat ional	丰益国际有限公司	WIL SP	新加坡证券交易所	新加坡	33,000	942,905.16	0.97
36	COSCO Pacific Ltd	中远太平洋有限公司	1199 HK	香港证券交易所	香港	82,000	932,878.05	0.96
37	China Longyuan Power	龙源电力集团股份有限公司	916 HK	香港证券交易所	香港	142,000	889,218.00	0.91
38	China Pacific Insura	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	2601 HK	香港证券交易所	香港	32,200	863,595.79	0.89
39	Xinyi Glass Holdings	信义玻璃控股有限公司	868 HK	香港证券交易所	香港	134,000	859,179.89	0.88
40	SJM Holdings Ltd	澳门博彩控股有限公司	880 HK	香港证券交易所	香港	55,000	842,514.22	0.87
41	TCL Communication Te	TCL 通讯科技控股有限公司	2618 HK	香港证券交易所	香港	155,000	795,319.79	0.82
42	Stockland	Stockland 公司	SGP AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	33,130	782,808.05	0.81
43	Paladin Energy Ltd	Paladin 能源有限公司	PDN AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	44,140	770,747.88	0.79
44	Daphne Internat ional	达芙妮国际控股有限公司	210 HK	香港证券交易所	香港	126,000	727,201.79	0.75
45	QR National	QR 国际有限公司	QRN AU	澳大利亚证券	澳大利亚	30,870	722,990.85	0.74

	Ltd			交易所				
46	Maoye International	茂业国际控股有限公司	848 HK	香港证券交易所	香港	224,000	722,777.57	0.74
47	Alumina Ltd	澳大利亚氧化铝有限公司	AWC AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	48,600	710,555.81	0.73
48	Peak Sport Products	匹克体育用品有限公司	1968 HK	香港证券交易所	香港	152,000	691,442.13	0.71
49	Myer Holdings Ltd	Myer 控股有限公司	MYR AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	37,510	686,168.00	0.71
50	PCCW Ltd	电讯盈科互动多媒体有限公司	8 HK	香港证券交易所	香港	210,000	585,044.67	0.60
51	Agricultural Bank of	中国农业银行股份有限公司	1288 HK	香港证券交易所	香港	169,000	574,824.06	0.59
52	CLP Holdings Ltd	中电控股有限公司	2 HK	香港证券交易所	香港	10,000	573,401.99	0.59
53	AAC Acoustic Technol	AAC 声学科技控股有限公司	2018 HK	香港证券交易所	香港	38,000	572,620.27	0.59
54	Hutchison Whampoa Lt	和记黄埔有限公司	13 HK	香港证券交易所	香港	8,000	558,848.64	0.57
55	China Unicom Hong Ko	中国联合网络通信（香港）股份有限公司	762 HK	香港证券交易所	香港	42,000	547,671.67	0.56
56	Guangshen Railway Co	广深铁路股份有限公司	525 HK	香港证券交易所	香港	200,000	542,216.24	0.56
57	Qantas Airways Ltd	澳大利亚航空有限公司	QAN AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	41,480	528,854.30	0.54
58	Aquarius Platinum Lt	Aquarius 铂业有限公司	AQP AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	15,610	508,370.37	0.52
59	SP AusNet	新能源澳	SPN AU	澳大利	澳大利亚	74,789	489,721.31	0.50

		洲网络公司		亚证券交易所				
60	Keppel Corp Ltd	吉宝企业有限公司	KEP SP	新加坡证券交易所	新加坡	7,700	449,764.60	0.46
61	China Shenhua Energy	中国神华能源	1088 HK	香港证券交易所	香港	14,000	431,943.43	0.44
62	Boral Ltd	博罗有限公司	BLD AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	13,700	417,688.69	0.43
63	Global Logistic Prop	普洛斯	GLP SP	新加坡证券交易所	新加坡	38,000	412,672.57	0.42
64	China Mengniu Dairy	中国蒙牛乳业有限公司	2319 HK	香港证券交易所	香港	13,000	283,249.77	0.29
65	ZTE Corp	中兴通讯股份有限公司	763 HK	香港证券交易所	香港	3,880	90,992.53	0.09

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Hong Kong Exchanges	388 HK	2,779,525.92	1.94
2	CNOOC Ltd	883 HK	2,736,941.87	1.91
3	Shougang Fushan Reso	639 HK	2,705,647.53	1.89
4	Weichai Power Co Ltd	2338 HK	2,468,830.52	1.72
5	China Minsheng Banki	1988 HK	2,464,531.18	1.72
6	Comba Telecom System	2342 HK	2,378,370.81	1.66
7	Dongyue Group	189 HK	2,223,538.43	1.55
8	Yanzhou Coal Mining	1171 HK	2,195,796.24	1.53
9	Agricultural Bank of	1288 HK	2,142,331.14	1.50
10	Changsha Zoomlion He	1157 HK	2,097,916.72	1.46
11	AMP Ltd	AMP AU	2,081,070.93	1.45
12	Xinyi Glass Holdings	868 HK	2,048,462.36	1.43
13	China Longyuan Power	916 HK	2,018,240.25	1.41
14	China Liansu Group H	2128 HK	2,002,167.79	1.40
15	Zhaojin Mining Indus	1818 HK	1,742,730.83	1.22

16	AAC Acoustic Technol	2018 HK	1,600,661.32	1.12
17	ZTE Corp	763 HK	1,598,460.32	1.12
18	China Mobile Ltd	941 HK	1,568,962.48	1.10
19	Soho China Ltd	410 HK	1,484,213.60	1.04
20	China Unicom Hong Ko	762 HK	1,454,234.26	1.02

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	BHP Billiton Ltd	BHP AU	4,348,950.29	3.04
2	AAC Acoustic Technol	2018 HK	4,029,702.59	2.81
3	Weichai Power Co Ltd	2338 HK	3,431,856.36	2.40
4	CNOOC Ltd	883 HK	3,124,942.89	2.18
5	Xinyi Glass Holdings	868 HK	3,012,282.54	2.10
6	Dongfang Electric Co	1072 HK	2,942,650.62	2.05
7	Soho China Ltd	410 HK	2,723,747.98	1.90
8	Coca-Cola Amatil Ltd	CCL AU	2,592,589.61	1.81
9	Hong Kong Exchanges	388 HK	2,569,771.08	1.79
10	Shougang Fushan Reso	639 HK	2,437,921.52	1.70
11	Agricultural Bank of	1288 HK	2,315,489.81	1.62
12	Zhaojin Mining Indus	1818 HK	2,283,461.67	1.59
13	Tencent Holdings Ltd	700 HK	2,280,718.53	1.59
14	Sino Biopharmaceutic	1177 HK	2,225,955.78	1.55
15	Oil Search Ltd	OSH AU	2,169,682.01	1.51
16	Changsha Zoomlion He	1157 HK	2,131,097.98	1.49
17	Dongyue Group	189 HK	2,113,918.55	1.48
18	GCL-Poly Energy Hold	3800 HK	1,962,910.24	1.37
19	China Liansu Group H	2128 HK	1,869,083.00	1.30
20	Rio Tinto Ltd	RIO AU	1,849,028.34	1.29

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	102,498,500.22
卖出收入（成交）总额	150,024,100.93



## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

## 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期末没有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。

7.11.2 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。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	305,023.73
3	应收股利	318,241.43
4	应收利息	1,748.59
5	应收申购款	62,062.66
6	其他应收款	19,469.80
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	706,546.21

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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
2, 115	44, 292. 66	40, 709, 727. 86	43. 46%	52, 969, 254. 66	56. 54%

### 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	1, 885, 480. 73	2. 0127%

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年6月25日）基金份额总额	522, 636, 079. 14
本报告期期初基金份额总额	128, 625, 234. 06
本报告期基金总申购份额	10, 526, 524. 55
减：本报告期基金总赎回份额	45, 472, 776. 09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	93, 678, 982. 52

注：表内“总申购份额”含红利再投份额。

## § 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	
Morgan Stanley	1	109,829,599.38	43.50%	118,876.76	38.49%	-
UBS	1	31,351,027.29	12.42%	47,037.70	15.23%	-
里昂	1	-	-	-	-	-
Credit Suisse	1	31,671,837.47	12.54%	63,343.54	20.51%	-

JP Morgan	1	-	-	-	-	-
GS	1	-	-	-	-	-
Merrill Lynch	1	-	-	-	-	-
Nomura	1	-	-	-	-	-
招商香港	1	19,177,982.13	7.60%	19,178.02	6.21%	-
平安香港	1	-	-	-	-	-
德意志银行	1	-	-	-	-	-
KGI	1	-	-	-	-	-
麦格里	1	-	-	-	-	-
工银国际	1	-	-	-	-	-
海通大福	1	-	-	-	-	-
建银国际	1	60,451,365.59	23.94%	60,451.34	19.57%	-
中金香港	1	-	-	-	-	-

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS	-	-	-	-	7,478.34	100.00%	-	-
里昂	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Sussie	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morgan	-	-	-	-	-	-	-	-
GS	-	-	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura	-	-	-	-	-	-	-	-
招商香港	-	-	-	-	-	-	-	-
平安香港	-	-	-	-	-	-	-	-
德意志银行	-	-	-	-	-	-	-	-

KGI	-	-	-	-	-	-	-	-
麦格里	-	-	-	-	-	-	-	-
工银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
海通大福	-	-	-	-	-	-	-	-
建银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
中金香港	-	-	-	-	-	-	-	-

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：

本基金本报告期内未新增和减少交易单元。

### 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汇添富亚澳成熟优选股票基金(QDII)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收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 1 月 18 日

3	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 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
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 1 日
5	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更新招募说明书	管理人网站	2011 年 2 月 1 日
6	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、管理人网站	2011 年 2 月 17 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 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 2011 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	中国证券报、上海证券报、证券时报、管	2011 年 4 月 22 日

	2011 年第 1 季度报告	理人网站	
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	汇添富基金管理有限公司关于增加中信金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 5 月 20 日
24	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
25	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
26	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
27	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
28	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
29	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
30	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、管	2011 年 6 月 29 日

	电子交易申购基金费率优惠活动的公告	理人网站	
31	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募集的文件；

2、《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》；

3、《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