

汇添富增强收益债券型证券投资基金 2011 年 年度报告摘要

2011 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2012 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富增强收益债券	
基金主代码	519078	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 3 月 6 日	
基金管理人	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,299,977,741.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C
下属分级基金的交易代码:	519078	470078
报告期末下属分级基金的份额总额	1,288,245,573.42 份	11,732,168.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上, 主要投资于债券等固定收益类品种和其他低风险品种, 力求为基金份额持有人谋求持续稳定的投资收益。
投资策略	类属资产配置由本基金管理人根据宏观经济分析、债券基准收益率研究、不同类别债券利差水平研究, 判断不同类别债券类属的相对投资价值, 并确定不同债券类属在组合资产中的配置比例。
业绩比较基准	中债总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金, 其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金, 高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	赵会军
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011 年		2010 年		2009 年	
	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C
本期已实现收益	37,679,752.04	763,258.51	151,349,610.09	4,440,488.83	115,250,270.52	6,776.73
本期利润	-18,440,257.55	212,121.29	145,455,812.91	9,735,404.73	12,344,525.55	21,548.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0127	0.0093	0.0755	0.1523	0.0054	0.0158
本期基金份额净值增长率	-1.33%	-1.52%	7.14%	6.77%	1.83%	1.53%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末		2010 年末		2009 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0053	-0.0018	0.0874	0.0823	0.0579	0.0567
期末基金资产净值	1,295,120,716.92	11,710,827.30	1,911,732,793.52	33,635,692.03	1,522,185,981.70	2,106,433.84
期末基金份额净值	1.005	0.998	1.088	1.083	1.064	1.063

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

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

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

□4、本基金自 2009 年 9 月 15 日起增加 C 类收费模式，该模式只收取赎回费和销售服务费，不收取申购费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富增强收益债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.45%	0.15%	3.24%	0.13%	-0.79%	0.02%
过去六个月	-2.05%	0.21%	2.97%	0.13%	-5.02%	0.08%
过去一年	-1.33%	0.20%	2.52%	0.11%	-3.85%	0.09%
过去三年	7.66%	0.17%	-2.89%	0.11%	10.55%	0.06%
自基金合同生效日起至今	17.95%	0.17%	5.88%	0.14%	12.07%	0.03%

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

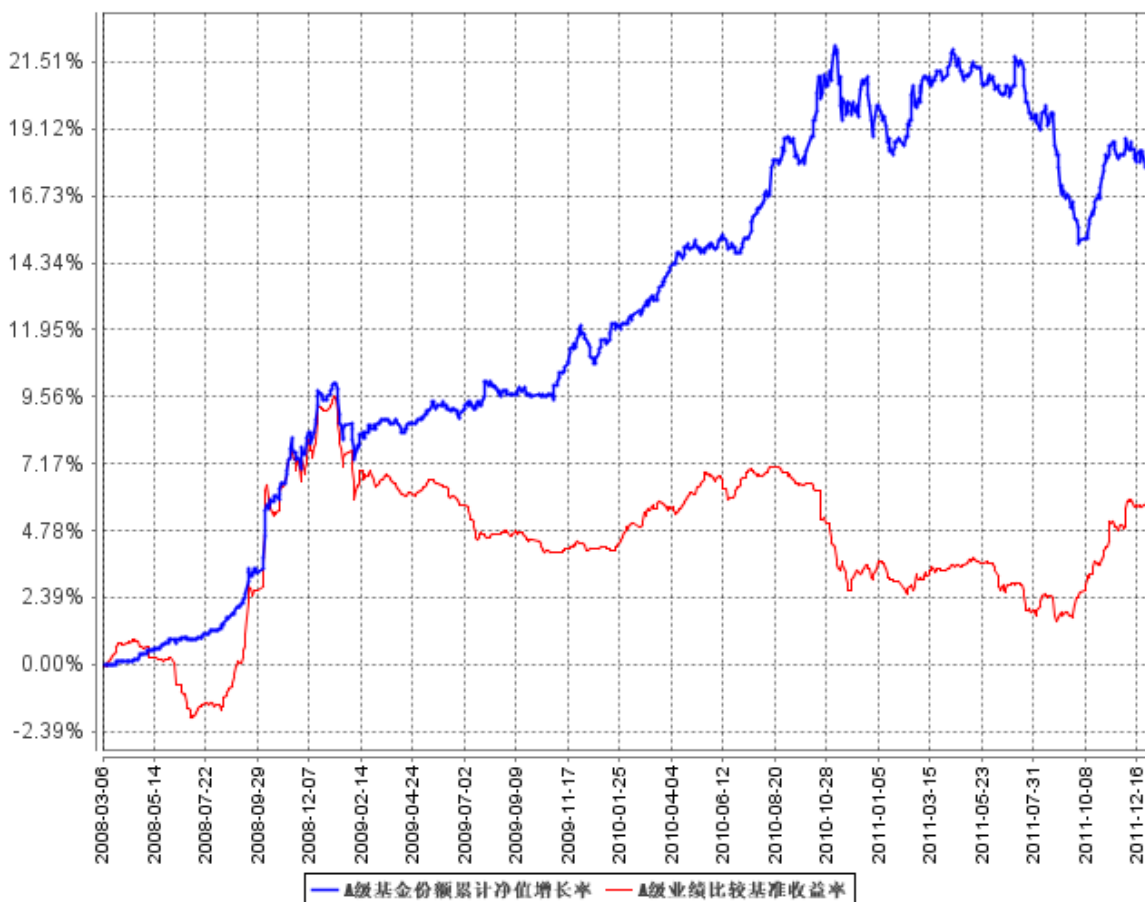
汇添富增强收益债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.36%	0.16%	3.24%	0.13%	-0.88%	0.03%
过去六个月	-2.16%	0.21%	2.97%	0.13%	-5.13%	0.08%
过去一年	-1.52%	0.20%	2.52%	0.11%	-4.04%	0.09%
自基金合同生效日起至今	6.75%	0.19%	1.09%	0.10%	5.66%	0.09%

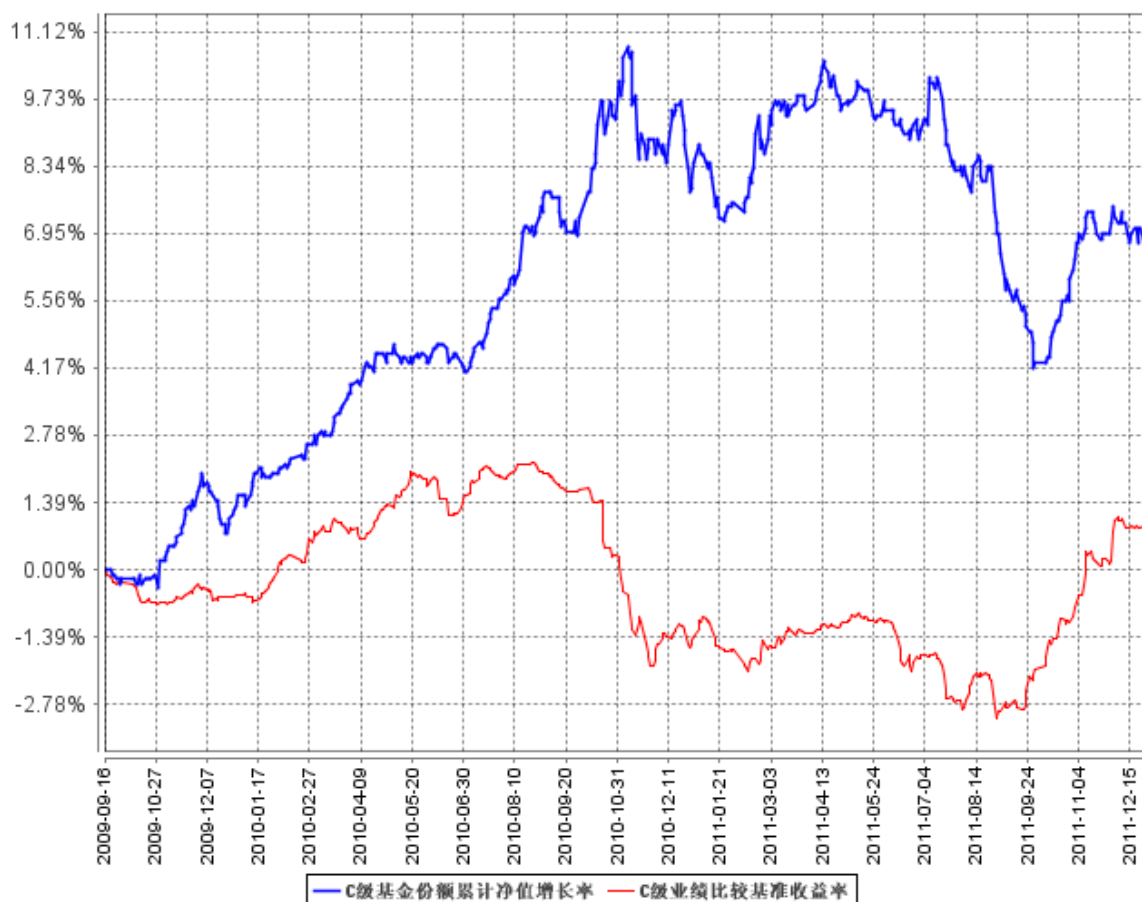
注：汇添富增强收益 C 类基金的基金分级日为 2009 年 9 月 15 日，至本报告期末未满三年。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

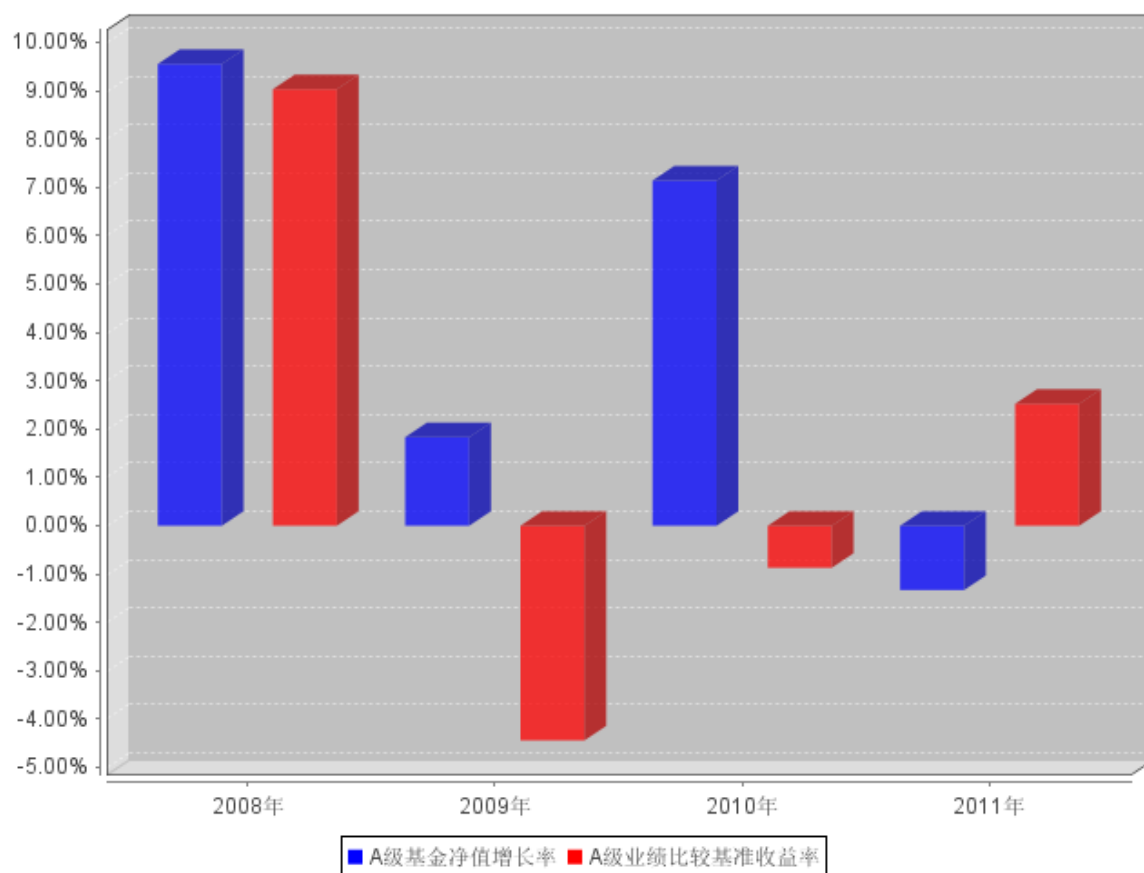


注：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2008年3月6日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

□2、本基金自2009年9月15日起增加C类收费模式，该类别基金的累计份额净值增长率和业绩比较基准收益率自2009年9月15日起计算。

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

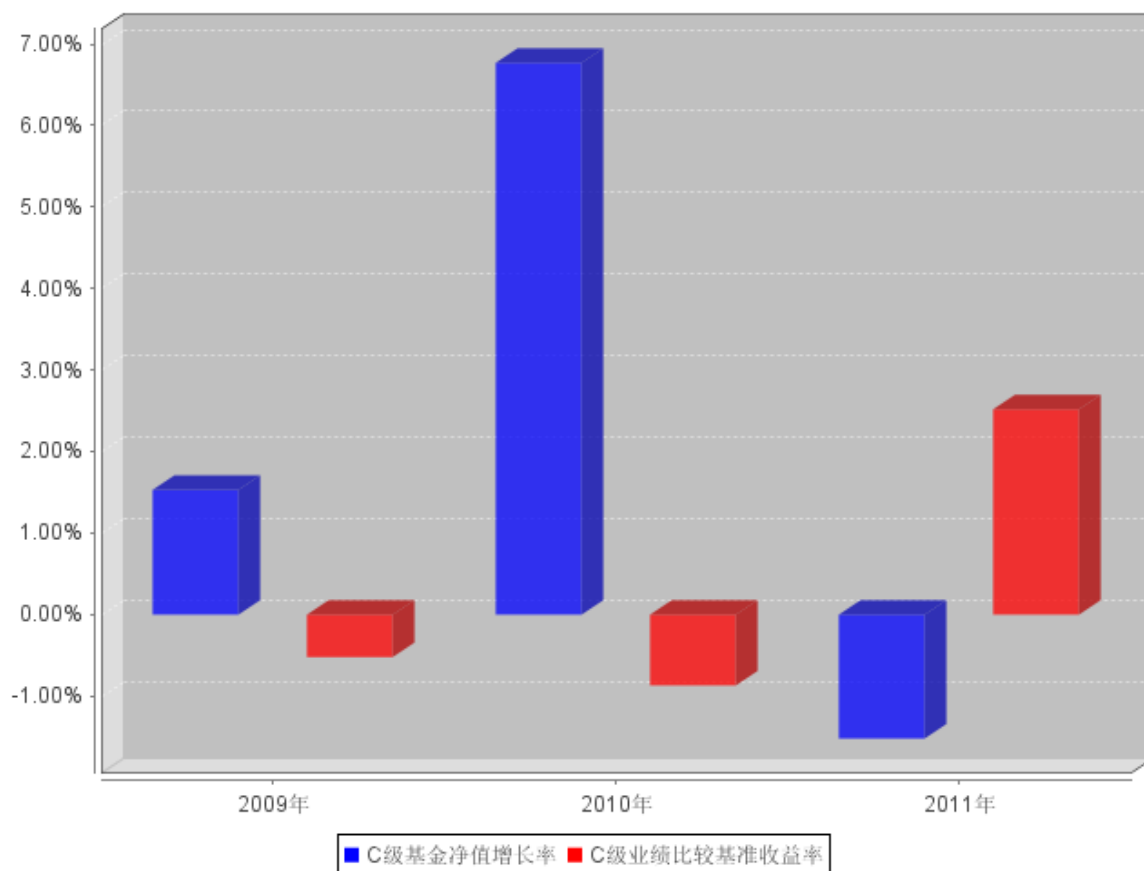
A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金的《基金合同》生效之日为 2008 年 3 月 6 日，至本报告期末未满五年。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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



注：1、汇添富增强收益 C 类基金的基金分级日为 2009 年 9 月 15 日，至本报告期末未满五年。

□2、基金分级当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

汇添富增强收益债券 A					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011	0.700	88,347,022.55	28,900,174.27	117,247,196.82	
2010	0.500	79,544,919.62	25,399,470.82	104,944,390.44	
2009	0.200	31,523,991.48	13,946,423.66	45,470,415.14	
合计	1.400	199,415,933.65	68,246,068.75	267,662,002.40	

汇添富增强收益债券 C					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011	0.700	1,278,889.97	511,175.54	1,790,065.51	
2010	0.500	1,012,369.03	236,872.89	1,249,241.92	
2009	-	-	-	-	
合计	1.200	2,291,259.00	748,048.43	3,039,307.43	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理有限公司成立于 2005 年 2 月，总部设在上海陆家嘴，公司旗下设立了北京分公司、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)。

截至 2011 年 12 月，汇添富资产管理规模接近 600 亿元人民币，是业内最早一批获得 QDII 资格、最早一批开展专户业务、首批获得 RQFII 资格的基金管理公司，同时也是全国社会保障基金的投资管理人。经过七年的发展，公司已成为业务布局完善、管理体系严谨、团队稳定优秀、文化优势突出、品牌日益确立，具有较强综合竞争实力的资产管理公司。

2011 年，汇添富大力发展公募基金业务，全年新发 7 只基金，分别是汇添富保本混合基金、汇添富社会责任股票型基金，汇添富可转换债券基金、汇添富黄金及贵金属基金、汇添富深证 300ETF 基金及其联接基金，汇添富信用债债券基金。目前，公司共管理 19 只证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征的产品线。

汇添富始终坚持“以企业基本分析为立足点,挑选高质量的证券，把握市场脉络，做中长期投资布局,以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益”这一长期价值投资理念，并在投资研究中坚定有效地贯彻和执行。2011 年，汇添富整体投资业绩继续保持行业优秀。

2011 年，汇添富专户业务快速发展，在全年市场大幅下跌的背景下，13 只专户组合当年实现了正收益，专户业务综合实力和竞争力进一步提升。

2011 年，汇添富国际业务取得重大突破，成为业内第一批获得 RQFII 资格、第一批获得 RQFII 外汇额度、第一批获得香港证监会产品批文、第一家在港正式发行 RQFII 产品的基金公司。

2011 年，汇添富正式开展社保组合管理，是业内少数几家在权益类和固定收益类产品上同时和社保展开合作的基金公司之一。

2011 年，汇添富电子商务业务实现跨越式发展，公司推出全国首张货币市场基金直接支付消费账单的信用卡——“添富信用卡”。该卡集信用卡消费信贷功能和基金投资功能于一体，开创了“货币基金支付消费账单”的新模式，在“2012 WORLD 营销大会”中，“添富信用卡”营销项目获得 2011 年度金赢销奖中的最佳互动创新奖。

2011 年，汇添富着力实现贴心的客户服务与投资者教育工作。公司积极开展“添富通行证升级”、“定投计算器”等活动，得到广大客户的大力支持和踊跃参与。同时，公司进一步大力开展“投资者见面会”、“添富

之约”客户沙龙、投资者“走进汇添富”和“走进上市公司”等全方位的投资者服务与教育活动。

2011 年，汇添富持续推进社会慈善事业，积极探索企业慈善公益事业新形式，不断丰富公益活动新内容，持续推进公益项目长期建设。在上海汇添富公益基金会的整体平台下，汇添富积极与社会组织、企业团体合作，举办了众多有影响力的活动，提升了基金业的整体社会形象。

展望 2012 年，基金行业仍将面临巨大的压力和挑战。汇添富全体员工将进一步发扬“正直、激情、团队、客户第一、感恩”的企业价值观，不畏挑战，不惧困难，以更加积极的心态，大力深化变革，全面提升公司核心竞争力，为实现汇添富基金中长期发展目标打下更加坚实的基础，为中国基金业的繁荣发展做出贡献。

2011 年，汇添富凭借稳健的经营管理和优秀业绩，荣获权威机构评选的多个奖项：

- 1、汇添富优势精选混合基金荣获《中国证券报》评选的“2010 五年持续优胜混合型金牛基金”。
- 2、汇添富基金荣获《上海证券报》评选的 2010 年度“金基金•创新公司奖”。
- 3、汇添富策略回报股票基金荣获《上海证券报》评选的 2010 年度一年期“金基金•主动型股票基金奖”。
- 4、汇添富基金荣获《证券时报》评选的“2010 年度十大明星基金公司奖”。
- 5、汇添富策略回报股票基金荣获《证券时报》评选的“2010 年度股票型明星基金奖”。

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		
陆文磊	本基金的基金经理、汇添富货币市场基金的基金经理、汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理。	2008 年 3 月 6 日	-	9 年	国籍：中国。学历：华东师范大学金融学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。2007 年 8 月加入汇添富基金管理有限公司，任固定收益高级经理，2008 年 3 月 6 日至今任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理，2009 年 1 月 21 日至 2011 年 6 月 21 日任汇添富货币市场基金的基金经理，2011 年 1 月 26

					日至今任汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理。
王珏池	本基金的基金经理、汇添富货币市场基金的基金经理、汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理、汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理。	2008 年 3 月 6 日	2011 年 6 月 21 日	17 年	国籍：中国。学历：澳门科技大学管理学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任申银万国证券股份有限公司固定收益总部投资部经理。2005 年 4 月加入汇添富基金管理有限公司任交易主管，2006 年 3 月 23 日至今任汇添富货币市场基金的基金经理，2008 年 3 月 6 日至 2011 年 6 月 21 日任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理，2011 年 6 月 17 日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理，2011 年 12 月 20 日至今任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理。

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

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

□3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易机制，涵盖了各投资组合、各投资市场、各投资标的，贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程，并通过分析报告、监控、稽核保证制度流程的有效执行。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为债券型基金，与本基金管理人旗下其他基金投资组合风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司公平交易制度执行情况良好，未发生任何异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年经济呈现高位回落的运行趋势，GDP 增长率逐季回落，到四季度已低于 9%。经济回落的原因主要有二：一是欧债危机愈演愈烈，希腊、西班牙、意大利等高债务国纷纷陷入主权债务困境，国债融资成本大幅攀升，严重拖累了发达国家经济复苏，造成外需偏弱；二是国内宏观调控持续收紧，2011 年政府对房地产调控力度不断升级，货币政策也明显收紧，造成了内需尤其是投资需求增速放缓。在经济回落的同时，2011 年物价大幅上升，全年 CPI 平均涨幅达到 5.4%，显著高于调控目标。通胀压力高企也导致全年货币政策始终以防通胀为首要目标，央行全年共加息 3 次，准备金率上调 6 次，屡创历史新高，全年金融市场流动性与前两年相比明显收紧，回购利率大幅飙升。年底政策有所微调，12 月份央行下调准备金率 0.5 个百分点，为 2009 年以来首次下调。

2011 年债券市场先抑后扬，一到三季度受货币政策紧缩和通胀压力持续上升的影响，市场整体上以持续下跌为主，债券收益率一度大幅上升，到四季度随着经济和通胀回落的趋势日益明朗，政策出现微调迹象，债券市场出现了较大幅度的反弹，国债、金融债和高信用等级企业债涨幅最大，可转债、低信用等级企业债则出现下跌。本基金在 2011 年大部分时间以规避风险为主，上半年我们较高比例配置了企业债，以获取利息收益，在二季度末大幅减持了企业债，较好的规避了之后企业债大幅下跌的风险，但可转债配置比例偏高，对基金业绩产生了一定的负面影响。三季度末基于对市场乐观的判断，我们提高组合久期，增持了中长期金融债和高信用等级中票、企业债的配置比例，较好的分享了四季度债券市场的上涨。全年本基金仅少量参与了新股的申购。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，汇添富增强收益债券 A 净值增长-1.33%，汇添富增强收益债券 C 净值增长-1.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012 年基本面环境仍然复杂，从世界经济来看，欧债危机远未平息，高债务国的偿债和融资困境会成为经济最大的潜在不稳定因素，欧元区经济增长可能面临停滞，美国的情况好于欧洲，但也面临政府削减财政赤字的压力，美国经济有望延续复苏态势，但复苏力度不会很强。从国内经济来看，一方面，在世界经济增长偏弱的情况下，外需可能进一步放缓，另一方面，房地产市场的调整远未结束，房地产投资面临大幅放缓的风险，并将影响整个固定资产投资的增长。预计 2012 年国内经济增长可能下滑至 8.5% 左右。在经济周期下行的情况下，2012 年通胀压力将明显减轻，全年 CPI 涨幅有望回落至 3% 左右。随着通胀压力减轻，货币政策将有所放松，预计存款准备金率全年仍有 1.5-2% 的下调空间，央行有望降息 1-2 次，总体上，全年货币和流动性环境整体上将好于 2011 年。

由于 2012 年上半年经济和通胀回落趋势较为确定，债券市场仍存在投资机会，但考虑到截止 2011 年末国债、金融债等债券收益率已经处于较低水平，未来收益率继续下降的空间有限，而信用债券的信用利差仍然处于高位，企业债、公司债、中期票据等信用类债券的投资机会相对更大。此外，可转债目前整体估值水平也处于低位，随着股票市场的波动，可转债也有望提供一定的阶段性投资机会。本基金管理人将密切关注经济和通胀走势、货币政策以及流动性环境等方面的变化，灵活调整债券组合的久期和债券结构，我们将更加注重绝对收益，更加注重债券资产对组合收益的贡献，控制可转债、新股等波动率较高的资产的投资比例，力争在控制风险的前提下进行投资，降低基金的波动率，为投资者创造持续稳定的收益。

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

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，A 类基金全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 25%，C 类基金每次分配比例不得低于可供分配收益的 25%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

□ 本基金于 2011 年 6 月 24 日实施利润分配，每份基金份额派发红利 0.07 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，本基金托管人在对汇添富增强收益债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年，汇添富增强收益债券型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富增强收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富增强收益债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 119,037,262.33 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理有限公司编制和披露的汇添富增强收益债券型证券投资基金 2011 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所审计，注册会计师徐艳、汤骏于 2012 年 3 月 29 日签字出具了安永华明(2012)审字第 60466941_B06 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富增强收益债券型证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	19,042,892.47	51,292,752.90
结算备付金	294,568.07	511,113.05
存出保证金	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	1,277,000,694.72	1,865,622,557.66
其中：股票投资	62,186,887.95	225,039,614.78
基金投资	-	-
债券投资	1,214,813,806.77	1,640,582,942.88
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	17,115,182.61	20,413,387.84
应收股利	-	-
应收申购款	142,929.36	9,450,812.78
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,313,846,267.23	1,947,540,624.23
负债和所有者权益	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	5,000,000.00	-

应付证券清算款	1,902.78	-
应付赎回款	504,921.38	142,818.17
应付管理人报酬	692,013.91	993,971.44
应付托管费	230,671.31	331,323.84
应付销售服务费	3,973.27	7,089.75
应付交易费用	10,752.60	46,908.52
应交税费	-	-
应付利息	336.11	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	570,151.65	650,026.96
负债合计	7,014,723.01	2,172,138.68
所有者权益：		
实收基金	1,299,977,741.77	1,787,365,914.91
未分配利润	6,853,802.45	158,002,570.64
所有者权益合计	1,306,831,544.22	1,945,368,485.55
负债和所有者权益总计	1,313,846,267.23	1,947,540,624.23

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，添富增收（A 类）基金份额净值 1.005 元，添富增收（C 类）基金份额净值 0.998 元；添富增收基金份额总额 1,299,977,741.77 份（其中 A 类 1,288,245,573.42 份，C 类 11,732,168.35 份）。

7.2 利润表

会计主体：汇添富增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入	-2,475,086.28	177,801,418.47
1.利息收入	49,728,800.99	57,155,108.91
其中：存款利息收入	898,262.35	1,724,235.76
债券利息收入	48,080,751.54	55,350,791.19
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	749,787.10	80,081.96
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,185,963.49	120,624,997.16
其中：股票投资收益	20,586,203.04	72,536,607.16
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-16,842,051.80	47,952,302.44
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-

股利收益	441,812.25	136,087.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-56,671,146.81	-598,881.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	281,296.05	620,193.68
减：二、费用	15,753,049.98	22,610,200.83
1. 管理人报酬	9,296,673.96	12,910,017.24
2. 托管费	3,098,891.38	4,303,339.05
3. 销售服务费	98,185.75	284,910.95
4. 交易费用	731,828.80	862,795.41
5. 利息支出	2,077,732.33	3,794,178.84
其中：卖出回购金融资产支出	2,077,732.33	3,794,178.84
6. 其他费用	449,737.76	454,959.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-18,228,136.26	155,191,217.64

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,787,365,914.91	158,002,570.64	1,945,368,485.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,228,136.26	-18,228,136.26
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）	-487,388,173.14	-13,883,369.60	-501,271,542.74
其中：1.基金申购款	766,586,080.77	50,143,686.64	816,729,767.41
2.基金赎回款	-1,253,974,253.91	-64,027,056.24	-1,318,001,310.15
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）	-	-119,037,262.33	-119,037,262.33
五、期末所有者权益（基金净值）	1,299,977,741.77	6,853,802.45	1,306,831,544.22
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,432,245,307.23	92,047,108.31	1,524,292,415.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	155,191,217.64	155,191,217.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	355,120,607.68	16,957,877.05	372,078,484.73
其中：1.基金申购款	1,971,440,425.55	151,694,370.14	2,123,134,795.69
2.基金赎回款	-1,616,319,817.87	-134,736,493.09	-1,751,056,310.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-106,193,632.36	-106,193,632.36
五、期末所有者权益（基金净值）	1,787,365,914.91	158,002,570.64	1,945,368,485.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>林利军</u>	<u>陈灿辉</u>	<u>王小练</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富增强收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]346 号文《关于核准汇添富增强收益债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由汇添富基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于 2008 年 3 月 6 日正式生效,首次设立募集规模为 5,049,981,789.51 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司和汇添富基金管理公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

本基金对债券等固定收益类品种的投资比例为基金资产的 80%-100%,现金和到期日在一年以内的政府

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、证监会公告[2010]5 号关于发布《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券(股票)交易印花税率，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》，对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入，由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

汇添富基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、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
东航金茂控股有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东方证券股份有限 公司	333,933,694.90	100.00%	377,676,369.79	100.00%

7.4.8.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东方证券股份有限 公司	1,762,688,816.67	100.00%	1,798,497,939.46	100.00%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回 购成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券回 购成交总额的 比例
东方证券股份有限 公司	1,675,000,000.00	100.00%	2,917,000,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 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12月31日

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	275,323.12	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	313,196.75	100.00%	30,273.82	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,296,673.96	12,910,017.24
其中：支付销售机构的客户维护费	863,450.92	868,588.96

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

□ H 为每日应计提的基金管理费

□ E 为前一日基金资产净值

□ 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的	3,098,891.38	4,303,339.05

托管费		
-----	--	--

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

$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

□H 为每日应计提的基金托管费

□E 为前一日的基金资产净值

□基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C	合计
汇添富基金管理有限公司	-	22,996.10	22,996.10
中国工商银行股份有限公司	-	18,701.22	18,701.22
合计	-	41,697.32	41,697.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C	合计
汇添富基金管理有限公司	-	254,225.47	254,225.47
中国工商银行股份有限公司	-	9,431.97	9,431.97
合计	-	263,657.44	263,657.44

注：1、本基金自 2009 年 9 月 15 日起增加 C 类收费模式，该模式只收取赎回费和销售服务费，不收取申购费。本基金 A 类模式不收取销售服务费。

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

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日						
银行间市场交易 的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份 有限公司	110,164,854.75	31,521,025.90	-	-	-	-
上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日						
银行间市场交易 的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份 有限公司	50,674,966.43	51,033,054.79	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人 2011 年度及 2010 年度均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本年度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。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份 有限公司	19,042,892.47	864,265.74	51,292,752.90	1,638,446.21

注：由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入包含了关联方保管的银行存款期末余额、除了最低备付金以外的结算备付金期末余额及当期产生的利息收入。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金 2011 年度及 2010 年度在承销期内均未参与关联方承销证券。

7.4.9 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002646	青青稞酒	2011年12月15日	2012年3月22日	网下新股流通受限	16.00	17.78	1,200,000	19,200,000.00	21,336,000.00	
601928	凤凰传媒	2011年11月24日	2012年2月29日	网下新股流通受限	8.80	8.36	1,994,600	17,552,480.00	16,674,856.00	
601100	恒立油缸	2011年10月21日	2012年1月30日	网下新股流通受限	23.00	16.71	785,046	18,056,058.00	13,118,118.66	
601336	新华保险	2011年12月9日	2012年3月16日	网下新股流通受限	23.25	27.87	69,953	1,626,407.25	1,949,590.11	

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 5,000,000.00 元，于 2012 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	62,186,887.95	4.73

	其中：股票	62,186,887.95	4.73
2	固定收益投资	1,214,813,806.77	92.46
	其中：债券	1,214,813,806.77	92.46
	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	19,337,460.54	1.47
6	其他各项资产	17,508,111.97	1.33
7	合计	1,313,846,267.23	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	39,232,872.46	3.00
C0	食品、饮料	21,336,000.00	1.63
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	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	17,896,872.46	1.37
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,803,394.68	0.14
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,526,174.70	0.19
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	1,949,590.11	0.15
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	16,674,856.00	1.28
M	综合类	-	-
	合计	62,186,887.95	4.76

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002646	青青稞酒	1,200,000	21,336,000.00	1.63
2	601928	凤凰传媒	1,994,600	16,674,856.00	1.28
3	601100	恒立油缸	785,046	13,118,118.66	1.00
4	601222	林洋电子	303,308	3,212,031.72	0.25
5	002253	川大智胜	107,726	2,526,174.70	0.19
6	601336	新华保险	69,953	1,949,590.11	0.15
7	601886	江河幕墙	129,183	1,803,394.68	0.14
8	601908	京运通	72,668	1,566,722.08	0.12

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.99fund.com 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002550	千红制药	64,000,000.00	3.29
2	002646	青青稞酒	19,200,000.00	0.99
3	601100	恒立油缸	18,056,058.00	0.93
4	601928	凤凰传媒	17,552,480.00	0.90
5	002582	好想你	17,112,000.00	0.88
6	002598	山东章鼓	16,000,000.00	0.82
7	300232	洲明科技	10,584,900.00	0.54
8	601222	林洋电子	5,459,544.00	0.28
9	002253	川大智胜	3,103,586.06	0.16
10	601908	京运通	3,052,056.00	0.16
11	601199	江南水务	2,765,367.20	0.14
12	601886	江河幕墙	2,583,660.00	0.13
13	601336	新华保险	1,626,407.25	0.08
14	002307	北新路桥	1,263,022.64	0.06

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601018	宁波港	74,601,924.00	3.83

2	002550	千红制药	56,691,962.92	2.91
3	002523	天桥起重	29,728,356.07	1.53
4	002582	好想你	21,143,018.86	1.09
5	002598	山东章鼓	20,557,194.21	1.06
6	002506	超日太阳	15,923,051.95	0.82
7	601717	郑煤机	12,734,802.02	0.65
8	601288	农业银行	12,463,947.84	0.64
9	300118	东方日升	12,035,931.88	0.62
10	300232	洲明科技	10,645,163.70	0.55
11	002497	雅化集团	6,632,274.21	0.34
12	300105	龙源技术	4,907,566.00	0.25
13	300124	汇川技术	4,555,605.30	0.23
14	002498	汉缆股份	4,103,997.95	0.21
15	002454	松芝股份	3,871,424.32	0.20
16	300119	瑞普生物	3,395,436.35	0.17
17	300122	智飞生物	2,885,645.65	0.15
18	002477	雏鹰农牧	2,695,869.00	0.14
19	300138	晨光生物	2,565,914.95	0.13
20	300103	达刚路机	2,486,084.92	0.13

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	182,359,081.15
卖出股票收入（成交）总额	333,933,694.90

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	138,124,000.00	10.57
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	478,774,280.45	36.64
5	企业短期融资券	80,574,000.00	6.17
6	中期票据	236,526,000.00	18.10
7	可转债	280,815,526.32	21.49
8	其他	-	-

9	合计	1,214,813,806.77	92.96
---	----	------------------	-------

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	1,061,550	106,696,390.50	8.16
2	1182282	11 三一 MTN2	800,000	83,928,000.00	6.42
3	110003	新钢转债	704,530	70,241,641.00	5.37
4	1101078	11 央行票据 78	600,000	60,798,000.00	4.65
5	1101088	11 央行票据 88	600,000	57,978,000.00	4.44

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,115,182.61
5	应收申购款	142,929.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,508,111.97

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	106,696,390.50	8.16
2	110003	新钢转债	70,241,641.00	5.37

3	113001	中行转债	41,982,170.40	3.21
4	110013	国投转债	15,310,093.50	1.17
5	110016	川投转债	9,956,044.80	0.76
6	110012	海运转债	7,998,673.20	0.61
7	126729	燕京转债	5,018,476.42	0.38

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002646	青青稞酒	21,336,000.00	1.63	网下新股锁定
2	601928	凤凰传媒	16,674,856.00	1.28	网下新股锁定
3	601100	恒立油缸	13,118,118.66	1.00	网下新股锁定
4	601336	新华保险	1,949,590.11	0.15	网下新股锁定

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇添富增强收益债券 A	25,051	51,424.92	856,871,879.34	66.51%	431,373,694.08	33.49%
汇添富增强收益债券 C	2,242	5,232.90	0.00	0.00%	11,732,168.35	100.00%
合计	26,639	48,799.80	856,871,879.34	65.91%	443,105,862.43	34.09%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开	汇添富增强收益债券 A	318,509.06	0.02%
	汇添富增强收益债券 C	3,495.56	0.03%

放式基金	合计	322,004.62	0.02%
------	----	------------	-------

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C
基金合同生效日(2008 年 3 月 6 日)	5,049,981,789.51	-
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	1,756,317,886.07	31,048,028.84
本报告期基金总申购份额	704,743,619.22	61,842,461.55
减：本报告期基金总赎回份额	1,172,815,931.87	81,158,322.04
本报告期末基金份额总额	1,288,245,573.42	11,732,168.35

注：1、本基金自 2009 年 9 月 15 日起增加 C 类收费模式，该模式只收取赎回费和销售服务费，不收取申购费。

□2、表内“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、《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，王珏池先生不再担任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理，陆文磊先生继续担任该基金的基金经理。
- 5、基金管理人 2011 年 6 月 22 日公告，陆文磊先生不再担任汇添富货币市场基金的基金经理，王珏池先生继续担任该基金的基金经理。
- 6、基金管理人 2011 年 8 月 13 日公告，经汇添富基金管理有限公司第二届董事会第二十六次会议

审议决定，因工作变动，解聘于东升先生公司副总经理职务。

7、《汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）基金合同》于 2011 年 8 月 31 日正式生效，刘子龙先生任该基金的基金经理。

8、《深证 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 16 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

9、《汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2011 年 9 月 28 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

10、基金管理人 2011 年 11 月 26 日公告，何仁科先生不再担任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理，吴振翔先生继续担任该基金的基金经理。

11、《汇添富信用债债券型证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 20 日正式生效，王珏池先生任该基金的基金经理。

12、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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所自本基金合同生效日（2008 年 3 月 6 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内已支付当期审计费用为人民币捌万元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	333,933,694.90	100.00%	275,323.12	100.00%	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券	1,762,688,816.67	100.00%	1,675,000,000.00	100.00%

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

2、报告期内未新增或退租证券公司交易单元。

汇添富基金管理有限公司
2012 年 3 月 30 日