

汇添富保本混合型证券投资基金 2011 年年度报告

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 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

本报告期自 2011 年 1 月 26 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	8
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	11
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	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	18
§8 投资组合报告	38
8.1 期末基金资产组合情况	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	39
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
8.7 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	42
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	42
8.9 投资组合报告附注	42
§9 基金份额持有人信息	43

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
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.....	43
§10 开放式基金份额变动.....	44
§11 重大事件揭示.....	44
11.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
11.4 基金投资策略的改变.....	45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
11.8 其他重大事件.....	47
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富保本混合型证券投资基金
基金简称	汇添富保本混合
基金主代码	470018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 26 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	2,034,721,273.03 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资组合保险技术来运作，在保证本金安全的前提下，力争在保本周期内实现基金财产的稳健增值。
投资策略	本基金将按照投资组合保险技术的要求动态调整保本资产与风险资产的投资比例，以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值，从而实现基金资产在保本基础上的保值增值目的；在此基础上将通过严谨的量化分析和翔实的实地调研，精选优质股票和债券进行投资布局，以实现基金资产最大限度的增值。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	赵会军
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		桂水发	姜建清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所	北京市东城区东长安街 1 号东方广场 东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	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、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 1 月 26 日（基金合同生效日）-2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	44,504,509.83
本期利润	27,626,778.74
加权平均基金份额本期利润	0.0120
本期加权平均净值利润率	1.20%
本期基金份额净值增长率	1.20%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末
期末可供分配利润	24,924,283.77
期末可供分配基金份额利润	0.0122
期末基金资产净值	2,059,645,556.80
期末基金份额净值	1.012
3.1.3 累计期末指标	2011 年末
基金份额累计净值增长率	1.20%

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、本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 1 月 26 日，至本报告期末未满三年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2011 年 12 月 31 日数据，特此说明。

3.2 基金净值表现

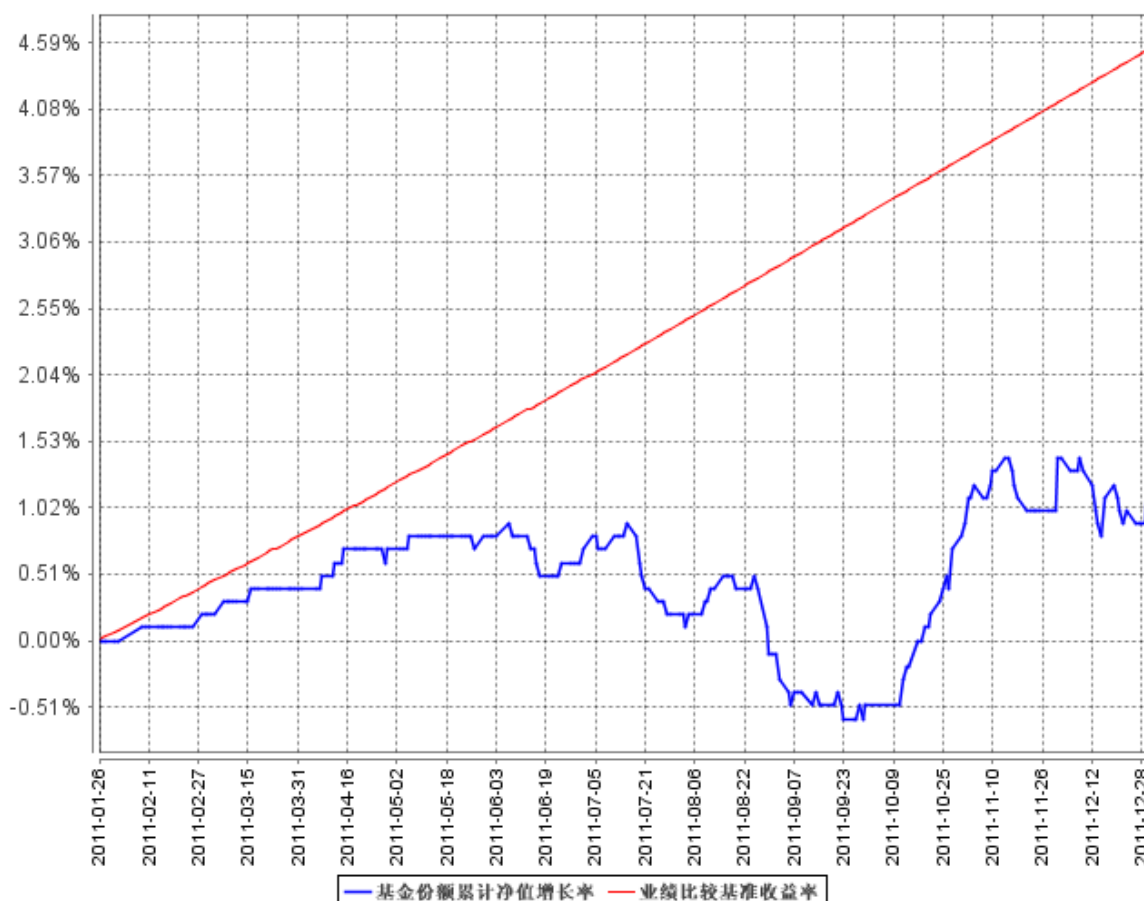
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.71%	0.12%	1.24%	0.02%	0.47%	0.10%
过去六个月	0.60%	0.11%	2.50%	0.02%	-1.90%	0.09%
自基金合同生效日起至 今	1.20%	0.08%	4.55%	0.01%	-3.35%	0.07%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 1 月 26 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

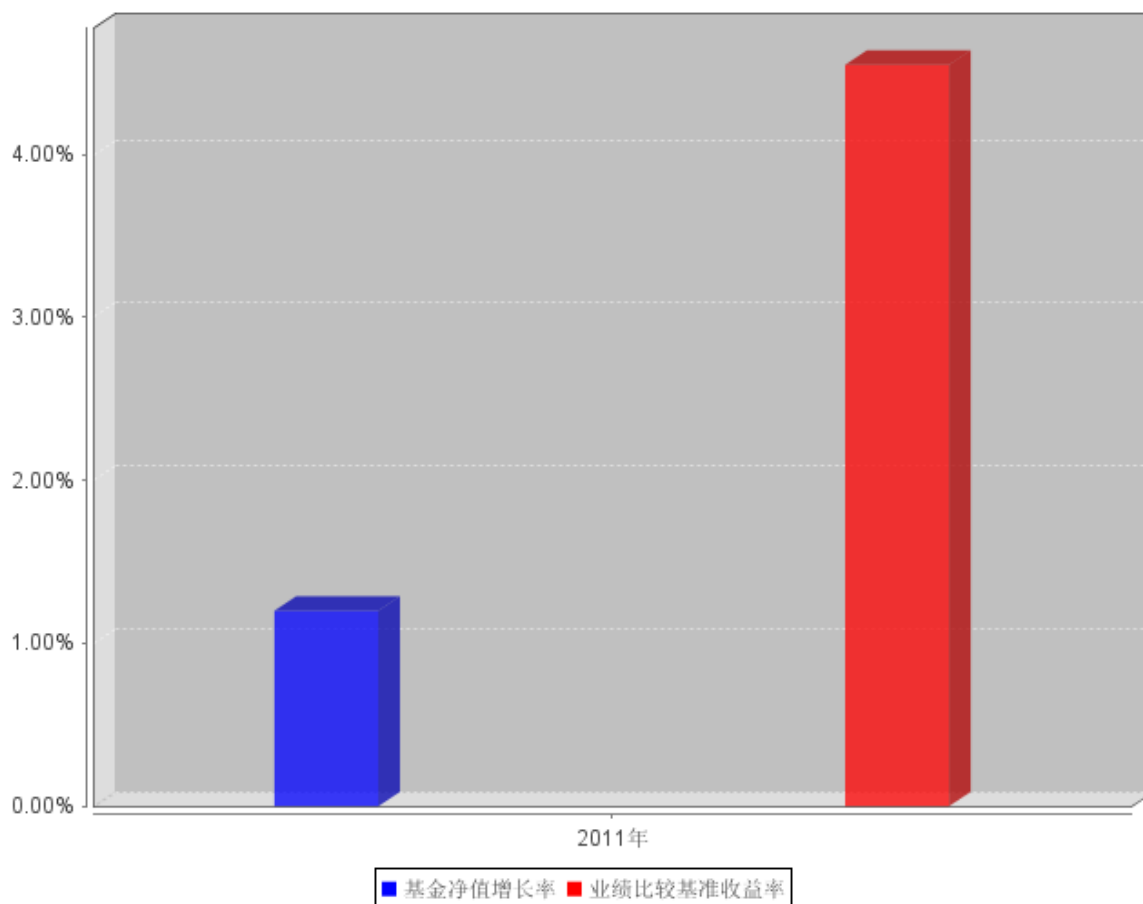


注：1、本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 1 月 26 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为自《基金合同》生效之日(2011 年 1 月 26 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。

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

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》生效日为 2011 年 1 月 26 日，至本报告期末未逾五年。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于 2011 年 1 月 26 日，2011 年度未进行利润分配。

§ 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，汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。	2011年1月26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。

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

本基金为保本型基金，通过投资组合保险技术配置大类资产，在保证本金安全的前提下力争净值的稳健增值，属于较低风险品种，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 年经济增长逐季回落，到四季度已低于 9%，为 2010 年以来的低位。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。

经济回落、通胀高企和流动性收紧对 2011 年股票和债券市场都造成了重大的冲击，前三季度股票和债券市场双双下跌，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，而股票市场继续下跌。全年中债综合财富指数上涨 5.3%，上证指数下跌 21.7%。本基金 2011 年大部分时间以防御策略为主，根据 CPPI 策略，保本资产主要配置了 1-3 年期债券，风险资产配置上则适度配置了估值低、具有一定安全边际的可转债和股票资产，由于股票市场持续回落，缺乏明显的投资机会，因此本基金全年风险资产始终控制在较低的比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金收益率为 1.20%，同期业绩比较基准收益率为 4.55%。

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 年仍然面临非常复杂的基本面环境。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，2012 年宏观经济政策的重点将从防通胀转向促进经济结构调整，政策将进行微调，财政政策基调仍然偏积极，货币政策也将有所放松，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。

经过 2011 年的大幅下跌，股票市场的整体估值水平已经处于低位，随着政策微调和流动性逐渐放松，市场的整体投资环境有望比 2011 年有所改善，但由于经济仍处于回落阶段，企业盈利将继续下滑，加之宏观政策的重心在于促进经济结构调整和增长转型，难以出现类似 2009 年那样的大规模经济刺激，所以，股票市场也暂时难以看到明显的趋势性机会。从债券市场来看，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。本基金管理人将严格遵守 CPPI 策略，逐渐增加对高收益的信用债券的配置比例，以进一步提高安全垫厚度，同时密切关注经济形势和政策趋势的变化，在做好基本面分析的基础上积极参与寻找可转债和股票的投资机会，争取为投资者创造稳健的收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

（一）完善规章制度，健全内部控制体系

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

（二）加强稽核监察，确保基金运作和公司经营合法合规

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

（三）强化培训教育，提高全员合规意识

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、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历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《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。

4.8 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 6 次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金 2011 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间未进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011 年，本基金托管人在对汇添富保本混合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，汇添富保本混合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保本混合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。

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保本混合型证券投资基金 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

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的汇添富保本混合型证券投资基金财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是汇添富保本混合型证券投资基金的基金管理人汇添富基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按

	照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富保本混合型证券投资基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	徐 艳 汤 骏
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2012 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富保本混合型证券投资基金

报告截止日： 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	62,345,023.86
结算备付金		865,808.34
存出保证金		391,407.90
交易性金融资产	7.4.7.2	1,963,255,840.85
其中：股票投资		126,805,377.75
基金投资		-
债券投资		1,836,450,463.10

资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	36,332,470.07
应收股利		-
应收申购款		10,796.45
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		2,063,201,347.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		687,042.77
应付管理人报酬		2,119,447.06
应付托管费		353,241.18
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	25,543.71
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	370,515.95
负债合计		3,555,790.67
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	2,034,721,273.03
未分配利润	7.4.7.10	24,924,283.77
所有者权益合计		2,059,645,556.80
负债和所有者权益总计		2,063,201,347.47

注：1、本基金于 2011 年 1 月 26 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 12 月 31 日数据，特此说明。

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

3、报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.012 元，基金份额总额 2,034,721,273.03 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富保本混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
一、收入		59,776,574.05
1.利息收入		66,650,593.27
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,570,600.27
债券利息收入		57,616,454.89
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		7,463,538.11
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,606,155.17
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,608,983.04
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	5,728,342.96
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	268,829.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-16,877,731.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,397,556.70
减：二、费用		32,149,795.31
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	25,770,742.99
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,295,123.85
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	654,600.39
5. 利息支出		937,550.22
其中：卖出回购金融资产支出		937,550.22
6. 其他费用	7.4.7.19	491,777.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27,626,778.74

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、本基金于 2011 年 1 月 26 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 12 月 31 日数据，特此说明。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富保本混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月26日（基金合同生效日）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）	2,506,696,469.30	-	2,506,696,469.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,626,778.74	27,626,778.74
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）	-471,975,196.27	-2,702,494.97	-474,677,691.24
其中：1.基金申购款	4,800,355.53	32,017.58	4,832,373.11
2.基金赎回款	-476,775,551.80	-2,734,512.55	-479,510,064.35
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）	2,034,721,273.03	24,924,283.77	2,059,645,556.80

注：本基金于 2011 年 1 月 26 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 12 月 31 日数据，特此说明。

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

汇添富保本混合型证券投资基金（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]1875 号文《关于核准汇添富保本混合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于 2011 年 1 月 4 日至 2011 年 1 月 24 日向社会公开募集，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_B01 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 1 月 26 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 2,506,133,948.78 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 562,520.52 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 2,506,696,469.30 元，折合 2,506,696,469.30 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要通过投资组合保险技术来运作，在保证本金安全的前提下，力争在保本周期内实现基金财产的稳健增值。本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市 的股票、债券、货币市场工具、权证以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款税后收益率。

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 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2011 年 1 月 26 日(基金合同生效日)起至 2011 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

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

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债;本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债;

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1) 股票投资

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

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

(2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

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

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

(4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

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，也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

1) 股票投资

(1)上市流通的股票的估值

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

(2)未上市的股票的估值

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

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

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

D.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

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

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

2)债券投资

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

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

调整最近交易市价，确定公允价值；

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

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

3)权证投资

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

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

(3)因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4)分离交易可转债

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

5)其他

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

(2)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20%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 0.2%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。

7.4.4.11 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,每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日可供分配利润的 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两种:

a.保本周期内:仅采用现金分红一种收益分配方式,不进行红利再投资;

b.转型后:基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值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)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即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)每一基金份额享有同等分配权;

(5)基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过 15 个工作日;

(6)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券(股票)交易印花税率，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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	62,345,023.86
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	62,345,023.86

注：本基金 2011 年度未投资于定期存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		143,620,758.68	126,805,377.75	-16,815,380.93
债券	交易所市场	354,931,484.56	350,745,463.10	-4,186,021.46
	银行间市场	1,481,581,328.70	1,485,705,000.00	4,123,671.30
	合计	1,836,512,813.26	1,836,450,463.10	-62,350.16
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,980,133,571.94	1,963,255,840.85	-16,877,731.09

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	14,635.93
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	389.60

应收债券利息	36,317,444.54
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	36,332,470.07

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	13,769.41
银行间市场应付交易费用	11,774.30
合计	25,543.71

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10,515.95
应付信息披露费	360,000.00
合计	370,515.95

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,506,696,469.30	2,506,696,469.30
本期申购	4,800,355.53	4,800,355.53
本期赎回(以“-”号填列)	-476,775,551.80	-476,775,551.80
本期末	2,034,721,273.03	2,034,721,273.03

注：1、基金合同于 2011 年 1 月 26 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 2,506,133,948.78 元，在募集期间产生的利息为人民币 562,520.52 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 2,506,696,469.30 元，折合 2,506,696,469.30 份基金份额。

2、表中“本期申购”包含红利再投、转换入份额，“本期赎回”包含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

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	44,504,509.83	-16,877,731.09	27,626,778.74
本期基金份额交易产生的变动数	-5,043,986.57	2,341,491.60	-2,702,494.97
其中：基金申购款	52,315.38	-20,297.80	32,017.58
基金赎回款	-5,096,301.95	2,361,789.40	-2,734,512.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,460,523.26	-14,536,239.49	24,924,283.77

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,511,251.32
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	59,345.40
其他	3.55
合计	1,570,600.27

注：表中“其他”指直销申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	167,191,094.53
减：卖出股票成本总额	165,582,111.49
买卖股票差价收入	1,608,983.04

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月26日（基金合同生效日）至2011年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,801,075,522.07
减：卖出债券（债转股及债	2,749,576,698.58

券到期兑付) 成本总额	
减: 应收利息总额	45,770,480.53
债券投资收益	5,728,342.96

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期未有衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	268,829.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	268,829.17

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2011 年 1 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-16,877,731.09
——股票投资	-16,815,380.93
——债券投资	-62,350.16
——资产支持证券投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-16,877,731.09

7.4.7.17 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,397,556.70
合计	2,397,556.70

7.4.7.18 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	617,025.39
银行间市场交易费用	37,575.00
合计	654,600.39

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2011 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日	
审计费用		80,000.00
信息披露费		360,000.00
其他费用		900.00
银行划款费用		40,377.86
帐户维护费		10,500.00
合计		491,777.86

注：表中“其他费用”为开户费。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控集团有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2011 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 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	423,840,488.03	97.71

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日	
	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	448,528,133.57	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011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(%)
东方证券股份 有限公司	8,058,900,000.00	100.00

7.4.10.1.4 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26日(基金合同生效日)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	356,300.55	97.78	13,769.41	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	25,770,742.99
其中：支付销售机构的客户维护费	9,512,814.86

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,295,123.85

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2011 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日					
	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	141,090,333.16	30,881,500.68	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期本公司未发生运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本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。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	62,345,023.86	1,511,251.32

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金 2011 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日止期间在承销期内未参与关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况**7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	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
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	863,551	19,861,673.00	14,429,937.21	-
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	1,495,950	13,164,360.00	12,506,142.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2011 年 12 月 31 日
A-1	523,165,000.00
A-1 以下	-
未评级	96,675,000.00
合计	619,840,000.00

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2011 年 12 月 31 日
--------	-------------------------

AAA	597,943,463.10
AAA 以下	488,246,000.00
未评级	130,421,000.00
合计	1,216,610,463.10

7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 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	62,345,023.86	-	-	-	-	-	62,345,023.86
结算备付金	865,808.34	-	-	-	-	-	865,808.34
存出保证金	-	-	-	-	-	391,407.90	391,407.90
交易性金融资产	-	170,051,000.00	449,789,000.00	1,123,425,858.60	93,184,604.50	126,805,377.75	1,963,255,840.85
应收利息	-	-	-	-	-	36,332,470.07	36,332,470.07

应收申购款						10,796.45	10,796.45
其他资产						-	-
资产总计	63,210,832.20	170,051,000.00	449,789,000.00	1,123,425,858.60	93,184,604.50	163,540,052.17	2,063,201,347.47
负债							
应付赎回款						687,042.77	687,042.77
应付管理人报酬						2,119,447.06	2,119,447.06
应付托管费						353,241.18	353,241.18
应付交易费用						25,543.71	25,543.71
其他负债						370,515.95	370,515.95
负债总计						3,555,790.67	3,555,790.67
利率敏感度缺口	63,210,832.20	170,051,000.00	449,789,000.00	1,123,425,858.60	93,184,604.50	159,984,261.50	2,059,645,556.80

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；	
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；	
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；	
	4. 银行存款、结算备付金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；	
	5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券。	
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 12 月 31 日）
	0.25%	-6,762,583.82
	-0.25%	6,817,791.97

7.4.13.4.2 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。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。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 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	126,805,377.75	6.16
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,836,450,463.10	89.16
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	1,963,255,840.85	95.32

注：股票、权证等风险资产占基金资产的的比例不高于 40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于 60%，其中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%。

7.4.13.4.2.2 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，即与基金所投资证券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 12 月 31 日）
	5%	7,678,778.87
	-5%	-7,678,778.87

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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例
----	----	----	-----------

			(%)
1	权益投资	126,805,377.75	6.15
	其中：股票	126,805,377.75	6.15
2	固定收益投资	1,836,450,463.10	89.01
	其中：债券	1,836,450,463.10	89.01
	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	63,210,832.20	3.06
6	其他各项资产	36,734,674.42	1.78
7	合计	2,063,201,347.47	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	41,104,085.06	2.00
C0	食品、饮料	-	-
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	39,177,085.06	1.90
C8	医药、生物制品	1,927,000.00	0.09
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	0.09
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	7,994,600.25	0.39
I	金融、保险业	61,104,292.72	2.97
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	2,292,863.04	0.11
L	传播与文化产业	12,506,142.00	0.61
M	综合类	-	-
	合计	126,805,377.75	6.16

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600000	浦发银行	2,399,903	20,375,176.47	0.99
2	600036	招商银行	1,399,987	16,617,845.69	0.81
3	601100	恒立油缸	867,951	14,503,461.21	0.70
4	600016	民生银行	2,300,000	13,547,000.00	0.66
5	601928	凤凰传媒	1,495,950	12,506,142.00	0.61
6	601601	中国太保	549,936	10,564,270.56	0.51
7	000581	威孚高科	266,209	9,554,241.01	0.46
8	600697	欧亚集团	299,985	7,994,600.25	0.39
9	000527	美的电器	400,000	4,896,000.00	0.24
10	600690	青岛海尔	500,000	4,465,000.00	0.22
11	000338	潍柴动力	99,910	3,147,165.00	0.15
12	601908	京运通	121,114	2,611,217.84	0.13
13	000888	峨眉山 A	125,088	2,292,863.04	0.11
14	600079	人福医药	100,000	1,927,000.00	0.09
15	601886	江河幕墙	129,183	1,803,394.68	0.09

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601601	中国太保	29,517,552.69	1.43
2	600000	浦发银行	29,382,386.28	1.43
3	601100	恒立油缸	19,961,498.00	0.97
4	600016	民生银行	19,417,271.25	0.94
5	600690	青岛海尔	17,286,562.19	0.84
6	600036	招商银行	16,854,691.78	0.82
7	600581	八一钢铁	14,296,205.40	0.69
8	600079	人福医药	13,792,837.00	0.67
9	600805	悦达投资	13,313,394.80	0.65
10	601928	凤凰传媒	13,164,360.00	0.64
11	000698	沈阳化工	13,074,329.02	0.63
12	000338	潍柴动力	12,397,948.69	0.60
13	000527	美的电器	11,144,994.60	0.54

14	000581	威孚高科	10,139,180.80	0.49
15	000650	仁和药业	9,524,435.64	0.46
16	600688	S 上石化	8,717,154.00	0.42
17	600697	欧亚集团	8,213,769.81	0.40
18	600612	老凤祥	6,940,639.81	0.34
19	600997	开滦股份	6,752,137.65	0.33
20	601699	潞安环能	6,690,936.81	0.32

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601601	中国太保	17,580,195.54	0.85
2	600581	八一钢铁	15,049,057.57	0.73
3	000698	沈阳化工	14,561,681.62	0.71
4	600805	悦达投资	12,445,451.26	0.60
5	600079	人福医药	11,918,298.80	0.58
6	000650	仁和药业	11,132,116.85	0.54
7	600690	青岛海尔	10,577,031.67	0.51
8	600688	S 上石化	9,472,390.20	0.46
9	000338	潍柴动力	7,885,579.84	0.38
10	600612	老凤祥	7,671,460.85	0.37
11	600000	浦发银行	7,566,013.00	0.37
12	600997	开滦股份	6,785,330.70	0.33
13	601699	潞安环能	6,657,692.19	0.32
14	000778	新兴铸管	6,555,867.44	0.32
15	600016	民生银行	5,990,000.00	0.29
16	600594	益佰制药	5,603,762.16	0.27
17	002266	浙富股份	2,993,524.04	0.15
18	000527	美的电器	2,760,000.00	0.13
19	002307	北新路桥	2,121,960.00	0.10
20	600251	冠农股份	1,863,680.80	0.09

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	309,202,870.17
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	167,191,094.53
--------------	----------------

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	96,675,000.00	4.69
3	金融债券	130,421,000.00	6.33
	其中：政策性金融债	130,421,000.00	6.33
4	企业债券	468,172,606.80	22.73
5	企业短期融资券	523,165,000.00	25.40
6	中期票据	515,780,000.00	25.04
7	可转债	102,236,856.30	4.96
8	其他	-	-
9	合计	1,836,450,463.10	89.16

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	1181348	11 武钢 CP02	1,000,000	100,800,000.00	4.89
2	1181125	11 广晟 CP01	1,000,000	100,420,000.00	4.88
3	1082168	10 京投 MTN2	1,000,000	97,820,000.00	4.75
4	110015	石化转债	868,010	87,243,685.10	4.24
5	110203	11 国开 03	800,000	80,176,000.00	3.89

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

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

8.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	391,407.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	36,332,470.07
5	应收申购款	10,796.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,734,674.42

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	87,243,685.10	4.24
2	113001	中行转债	9,052,251.80	0.44

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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	601100	恒立油缸	14,429,937.21	0.70	网下新股锁定
2	601928	凤凰传媒	12,506,142.00	0.61	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

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 (%)
21,416	95,009.40	79,902,748.04	3.93	1,954,818,524.99	96.07

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	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	0.00	0.00

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年1月26日）基金份额总额	2,506,696,469.30
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,800,355.53
减：本报告期基金总赎回份额	476,775,551.80
本报告期期末基金份额总额	2,034,721,273.03

注：表内“总申购份额”含转换入份额；“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（2011 年 1 月 26 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	423,840,488.03	97.71	356,300.55	97.78	-
中信证券	2	9,946,257.17	2.29	8,081.39	2.22	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-

民生证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

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	448,528,133.57	100.00	8,058,900,000.00	100.00
中信证券	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易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 18 个交易单元与汇添富蓝筹稳健混合型证券投资基金共用。本报告期新增 4 家证券公司的 5 个交易单元：招商证券（上交所和深交所交易单元）、德邦证券（深交所交易单元）、金元证券（上交所交易单元）、民生证券（上交所交易单元）。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于汇添富保本混合型证券投资基金增加中国光大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 1 月 4 日
2	关于汇添富保本混合型证券投资基金增加国金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 1 月 5 日
3	关于汇添富保本混合型证券投资基金增加厦门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 1 月 6 日
4	关于汇添富保本混合型证券投资基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 1 月 13 日
5	关于汇添富保本混合型证券投资基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 1 月 14 日
6	关于汇添富保本混合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 1 月 18 日
7	关于汇添富保本混合型证券投资基金增加江海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 1 月 20 日
8	关于汇添富保本混合型证券投资基金增加平安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 1 月 21 日
9	汇添富保本混合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 1 月 27 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	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

12	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
13	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
14	汇添富保本混合型证券投资基金2011年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011年4月22日
15	汇添富基金管理有限公司关于汇添富保本混合型证券投资基金基金开放日常申购（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4月23日
16	关于汇添富保本混合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4月23日
17	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011年4月25日
18	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
19	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
20	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
21	汇添富基金管理有限公司关于增加天津银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011年5月23日
22	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
23	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
24	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	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

	2011 倾心回馈基金定投申购费率优惠活动的公告		
25	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
26	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
27	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商证券开展的电子交易申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 6 月 29 日
28	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
29	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金 2011 年上半年度资产净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 1 日
30	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与厦门证券开展的网上交易系统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 7 月 11 日
31	汇添富基金管理有限公司关于南方分公司办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 14 日
32	汇添富基金管理有限公司关于增加长城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 7 月 15 日
33	汇添富基金管理有限公司关于香港子公司办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 19 日
34	汇添富保本混合型证券投资基金 2011 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 20 日
35	汇添富基金管理有限公司关于投资者利益保护的温馨提示	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 21 日
36	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与天津银行开展的基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 25 日
37	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与长江证券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 8 月 4 日

38	汇添富基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 8 月 13 日
39	汇添富保本混合型证券投资基金 2011 年半年度报告	管理人网站	2011 年 8 月 24 日
40	汇添富保本混合型证券投资基金 2011 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 8 月 24 日
41	汇添富基金管理有限公司关于网上直销系统使用中国农业银行借记卡申购基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 8 月 31 日
42	汇添富保本混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2011 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 9 月 9 日
43	汇添富保本混合型证券投资基金更新招募说明书（2011 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 9 月 9 日
44	汇添富基金管理有限公司关于增加红塔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 9 月 26 日
45	汇添富基金管理有限公司关于增加五矿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 10 月 14 日
46	汇添富基金管理有限公司关于增加天源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 10 月 14 日
47	汇添富保本混合型证券投资基金 2011 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 10 月 26 日
48	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券开展的网上交易系统申购和定投基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 11 月 4 日
49	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与中国民族证券网上交易系统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 11 月 29 日
50	汇添富基金管理有限公司关于增加中信万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 12 月 20 日
51	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国农业银行网上银行申购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 12 月 29 日

52	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“2012 倾心回馈”定投基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 12 月 29 日
----	---	------------------------	------------------

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富保本混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富保本混合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、报告期内汇添富保本混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼汇添富基金管理有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理有限公司
2012 年 3 月 30 日