

汇添富保本混合型证券投资基金 2012年半年度报告

2012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：2012年8月28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 2012 年 8 月 24 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 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	34
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	35
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	35
7.9 投资组合报告附注.....	35
§8 基金份额持有人信息	35
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	36
§9 开放式基金份额变动	36

§10 重大事件揭示	36
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
10.4 基金投资策略的改变.....	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	37
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 其他重大事件.....	39
§11 备查文件目录	41
11.1 备查文件目录.....	41
11.2 存放地点.....	42
11.3 查阅方式.....	42

§ 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	1,692,284,213.76 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		潘鑫军	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层汇添富基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	23,893,307.41
本期利润	63,583,897.41
加权平均基金份额本期利润	0.0347
本期加权平均净值利润率	3.36%
本期基金份额净值增长率	3.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	55,417,976.40
期末可供分配基金份额利润	0.0327
期末基金资产净值	1,770,934,783.56
期末基金份额净值	1.046
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	4.60%

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

2、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

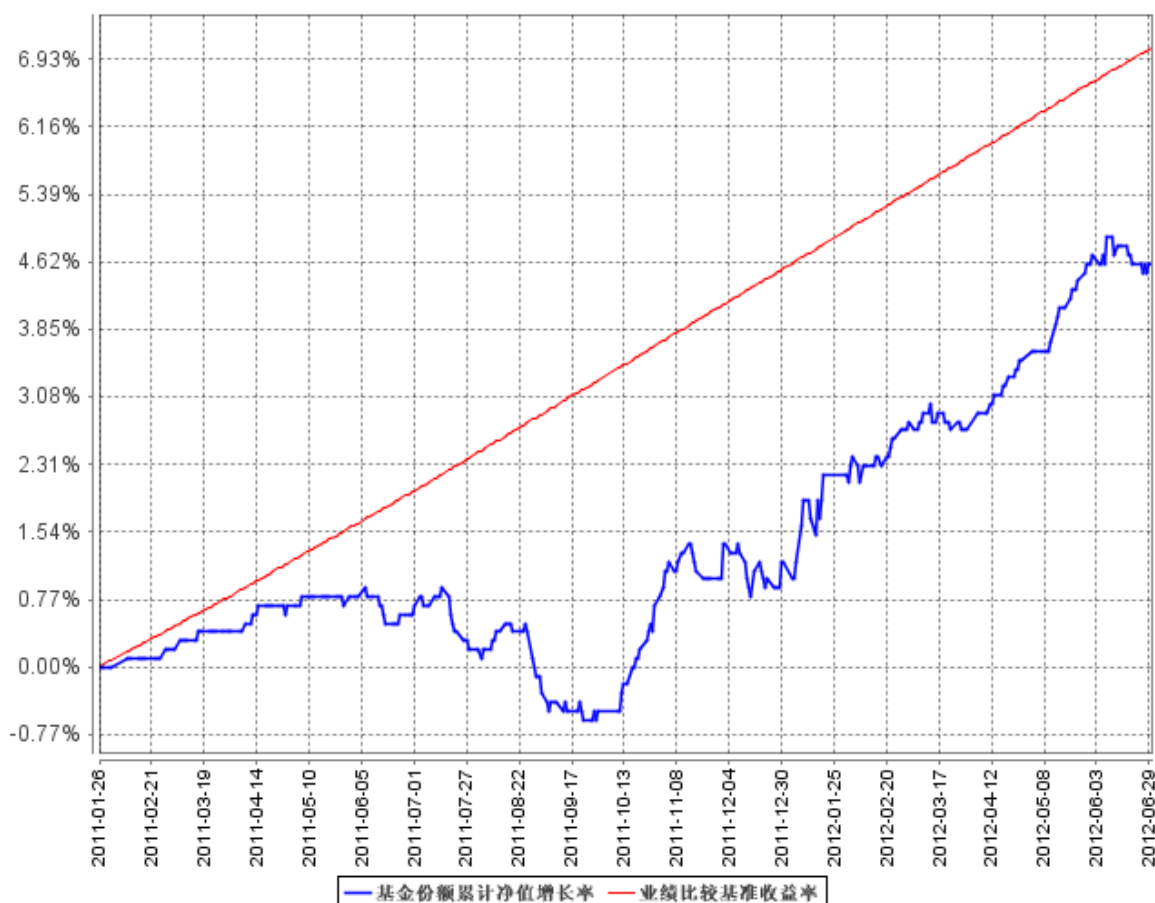
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	0.00%	0.10%	0.37%	0.01%	-0.37%	0.09%
过去三个月	1.85%	0.08%	1.17%	0.01%	0.68%	0.07%
过去六个月	3.36%	0.11%	2.40%	0.02%	0.96%	0.09%
过去一年	3.98%	0.11%	4.96%	0.02%	-0.98%	0.09%
自基金合同生效日起至 今	4.60%	0.09%	7.05%	0.02%	-2.45%	0.07%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 1 月 26 日，至本报告期末未满三年。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（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约定。

§ 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。截止到 2012 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模达到 803.69 亿元，基金份额持有人户数近 200 万，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 22 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、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天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		
陆文磊	本基金的基金经理，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	-	10 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

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各投资组合、各投资市场、各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人对投资交易全过程实施了严格的监控、分析和检查，未发现任何异常交易行为。

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

上半年国内经济增速持续放缓，从外部环境来看，美国经济维持弱复苏态势，欧元区则持续动荡，外需偏弱，全球货币政策环境极度宽松，大宗商品价格波动较大。从国内需求来看，上半年投资和消费需求增速持续放缓，通胀压力明显减轻，PPI 连续四个月负增长，而 6 月份 CPI 也已经降至 3% 以下。随着经济增长放缓和通胀压力减轻，上半年宏观调控政策开始放松，“稳增长”成为政策首要目标，央行年初以来多次下调准备金率和存贷款利率，市场流动性比去年明显好转。二季度以后财政政策也趋于积极，基建投资速度有所加快。

上半年在经济回落、货币政策放松的环境下，债券市场走出牛市行情，中债总指数上涨 2.35%，各类债券均有较大的涨幅，中短期债券收益率降幅较大。股票市场先扬后抑，一季度市场出现上涨，二季度以后市场震荡加剧，由于宏观经济和企业盈利不及预期，加之欧债危机的扰动，5 月份以后股票市场开始大幅回落。上半年上证指数仅小幅上涨 1.18%。本基金在上半年增持了 3 年以内的信用债，并适度配置了一定比例的中长期利率债，以提高债券资产的投资收益。在股票资产的投资上，一季度在股票市场反弹的过程中，我们阶段性的提高了股票资产的配置比例，并在 3 月份作了减持，二季度以后股票资产始终保持较低的配置比例，较好的规避了市场调整的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金收益率为 3.36%，同期业绩比较基准收益率为 2.40%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年美国经济继续维持弱复苏态势，美联储维持低利率政策，如果经济下滑压力加大，可能会推出 QE3。随着希腊大选结束和欧美峰会达成一系列救助计划，欧元区债务危机的高峰可能正在过去，下半年欧债问题仍会对市场带来一定波动，但引发市场全面恐慌的可能性不大。欧元区中长期的问题并未根本解决，欧元区实体经济仍将保持低迷。国内经济在三季度仍面临一定下滑压力，短期内的经济增长低点可能会在三季度出现，四季度 GDP 增速将有所反弹。中期来看，经济处于转型期，新的增长动力尚未出现，经济企稳后迅速回升的可能性不大。三季度 CPI 涨幅有望继续回落，7-8 月将向 2% 靠拢，四季度随着基数的降低，CPI 涨幅面临一定的回升压力。下半年货币政策将进一步放松，今年以来已经降息两次，预计年内仍至少还有一次降息的空间，本

轮降息周期还在进行之中。存款准备金率已经作为对冲外汇占款减少的常规工具，年内将继续下调，下半年市场流动性将保持宽松。

由于目前中短期债券收益率已经处于较低的水平，下半年债券资产难以延续上半年持续上涨的走势，票息收益将成为债券资产的主要收益来源。股票市场经过二季度以来的大幅调整，大部分股票的估值进一步降低，市场继续大幅下跌的可能性较低，但在经济增长缺乏明显的动力、政策以“稳增长”为主要基调的情况下，企业盈利尚难以出现快速回升，因此，股票市场保持宽幅震荡的可能性较大，主要以阶段性的反弹机会和结构性的投资机会为主。本基金管理人将严格遵守 CPPI 策略，继续选取较好的债券作为保本资产，同时努力做好大类资产配置，积极把握股票和债券的投资机会，争取为投资者创造稳健的收益。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每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。

本基金本报告期内未进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012 年上半年，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

2012 年上半年，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。本报告期内，汇添富保本混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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保本混合型证券投资基金 2012 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：汇添富保本混合型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	42,506,141.70	62,345,023.86
结算备付金		67,493.77	865,808.34
存出保证金		431,351.51	391,407.90
交易性金融资产	6.4.7.2	1,700,709,603.00	1,963,255,840.85
其中：股票投资		73,079,549.60	126,805,377.75
基金投资		-	-
债券投资		1,627,630,053.40	1,836,450,463.10
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	31,009,508.78	36,332,470.07
应收股利		-	-
应收申购款		20,119.85	10,796.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,774,744,218.61	2,063,201,347.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,458,865.54	687,042.77
应付管理人报酬		1,761,671.87	2,119,447.06
应付托管费		293,611.98	353,241.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	59,131.66	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	6.4.7.8	236,154.00	370,515.95
负债合计		3,809,435.05	3,555,790.67
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,692,284,213.76	2,034,721,273.03
未分配利润	6.4.7.10	78,650,569.80	24,924,283.77
所有者权益合计		1,770,934,783.56	2,059,645,556.80
负债和所有者权益总计		1,774,744,218.61	2,063,201,347.47

注：1、报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.046 元，基金份额总额 1,692,284,213.76 份。

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：汇添富保本混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2011 年 1 月 26 日至
-----	-----	-----------------------	-----------------------------

		2012 年 6 月 30 日	2011 年 6 月 30 日
一、收入		78,022,417.05	31,338,297.11
1.利息收入		38,708,300.77	30,415,158.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	349,538.61	1,133,998.01
债券利息收入		37,703,390.78	22,039,427.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		655,371.38	7,241,732.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,181,236.74	4,464,847.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-9,587,071.43	2,431,254.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,348,457.80	1,886,984.93
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	57,376.89	146,608.35
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	39,690,590.00	-4,364,711.20
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,804,763.02	823,002.48
减：二、费用		14,438,519.64	15,385,411.18
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,329,225.72	12,605,897.93
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,888,204.29	2,100,982.99
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	561,138.05	295,073.92
5. 利息支出		421,415.06	162,975.60
其中：卖出回购金融资产支出		421,415.06	162,975.60
6. 其他费用	6.4.7.19	238,536.52	220,480.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		63,583,897.41	15,952,885.93

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富保本混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	2,034,721,273.03	24,924,283.77	2,059,645,556.80

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	63,583,897.41	63,583,897.41
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）	-342,437,059.27	-9,857,611.38	-352,294,670.65
其中：1.基金申购款	8,364,534.33	292,131.56	8,656,665.89
2.基金赎回款	-350,801,593.60	-10,149,742.94	-360,951,336.54
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）	1,692,284,213.76	78,650,569.80	1,770,934,783.56
	上年度可比期间 2011 年 1 月 26 日至 2011 年 6 月 30 日		
项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	15,952,885.93	15,952,885.93
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）	-161,728,136.22	-1,150,208.53	-162,878,344.75
其中：1.基金申购款	1,708,934.92	12,786.27	1,721,721.19
2.基金赎回款	-163,437,071.14	-1,162,994.80	-164,600,065.94
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）	2,344,968,333.08	14,802,677.40	2,359,771,010.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

林利军

基金管理公司负责人

陈灿辉

主管会计工作负责人

王小练

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富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》的批准,由汇添富基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2011)验字第60466941_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,担保人为中国投资担保有限公司。

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。

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2012年6月30日的财

务状况以及 2012 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 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	42,506,141.70
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	42,506,141.70

注：本基金本期末未投资于定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	79,753,662.65	73,079,549.60	-6,674,113.05	
债券	交易所市场	284,004,051.42	288,179,053.40	4,175,001.98
	银行间市场	1,314,139,030.02	1,339,451,000.00	25,311,969.98
	合计	1,598,143,081.44	1,627,630,053.40	29,486,971.96
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,677,896,744.09	1,700,709,603.00	22,812,858.91	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	13,277.66
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	27.36
应收债券利息	30,996,203.76
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	31,009,508.78

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	53,458.26
银行间市场应付交易费用	5,673.40
合计	59,131.66

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	22,329.48
预提审计费	44,753.80
预提信息披露费	169,070.72
合计	236,154.00

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,034,721,273.03	2,034,721,273.03
本期申购	8,364,534.33	8,364,534.33
本期赎回(以“-”号填列)	-350,801,593.60	-350,801,593.60
本期末	1,692,284,213.76	1,692,284,213.76

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	39,460,523.26	-14,536,239.49	24,924,283.77
本期利润	23,893,307.41	39,690,590.00	63,583,897.41
本期基金份额交易产生的变动数	-7,935,854.27	-1,921,757.11	-9,857,611.38
其中：基金申购款	221,327.99	70,803.57	292,131.56
基金赎回款	-8,157,182.26	-1,992,560.68	-10,149,742.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,417,976.40	23,232,593.40	78,650,569.80

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	13,378.95
其他	9.16
合计	349,538.61

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
	卖出股票成交总额

减：卖出股票成本总额	211,368,338.65
买卖股票差价收入	-9,587,071.43

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,069,904,232.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,038,410,546.62
减：应收利息总额	24,145,228.18
债券投资收益	7,348,457.80

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本期未投资衍生工具。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	57,376.89
基金投资产生的股利收益	-
合计	57,376.89

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1.交易性金融资产	39,690,590.00
——股票投资	10,141,267.88
——债券投资	29,549,322.12
——资产支持证券投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	39,690,590.00

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日

基金赎回费收入	1,804,763.02
合计	1,804,763.02

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	552,088.05
银行间市场交易费用	9,050.00
合计	561,138.05

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	44,753.80
信息披露费	169,070.72
银行划款费用	9,312.00
帐户维护费	15,400.00
合计	238,536.52

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	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	328,730,944.66	100.00%	181,775,403.42	94.81%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
东方证券股份 有限公司	399,510,346.39	100.00%	233,822,918.20	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	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	895,000,000.00	100.00%	7,848,900,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
东方证券股份 有限公司	278,238.49	100.00%	53,458.26	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
东方证券股份 有限公司	153,003.75	94.98%	78,588.18	90.68%

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月 30日	2011年1月26日(基金合同生效日)至 2011年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	11,329,225.72	12,605,897.93
其中：支付销售机构的客 户维护费	4,266,971.61	4,580,046.24

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.2% 的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 1.2\% / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月26日(基金合同生效日) 至2011年6月30日
当期发生的基金应支付 的托管费	1,888,204.29	2,100,982.99

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.20% 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取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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	-	-	-	-	96,000,000.00	43,449.86
上年度可比期间 2011 年 1 月 26 日至 2011 年 6 月 30 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	141,090,333.16	-	-	-	-	-

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

注：本报告期及上年度可比期间本公司未发生运用固有资金投资本基金的情况。

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	42,506,141.70	336,150.50	105,864,093.16	1,079,179.23

股份有限公司				
--------	--	--	--	--

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

注：本基金本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2012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

注：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

注：本基金本期末未持有暂时停牌股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.2.1 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 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
A-1	202,282,000.00	523,165,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	96,935,000.00	96,675,000.00
合计	299,217,000.00	619,840,000.00

6.4.13.2.2 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 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
AAA	458,520,134.40	597,943,463.10
AAA 以下	613,352,704.00	488,246,000.00
未评级	256,540,215.00	130,421,000.00
合计	1,328,413,053.40	1,216,610,463.10

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，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、结算备付金、部分应收申购款及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012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	42,506,141.70	-	-	-	-	-	42,506,141.70
结算备付金	67,493.77	-	-	-	-	-	67,493.77
存出保证金	-	-	-	-	-	431,351.51	431,351.51
交易性金融资产	-	-	370,387.00 0.00	1,033,596,381.40	223,646,672.00	73,079,549.60	1,700,709,603.00
应收利息	-	-	-	-	-	31,009,508.78	31,009,508.78
应收申购款	893.58	-	-	-	-	19,226.27	20,119.85
资产总计	42,574,529.05	-	370,387.00 0.00	1,033,596,381.40	223,646,672.00	104,539,636.16	1,774,744,218.61
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,458,865.54	1,458,865.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,761,671.87	1,761,671.87
应付托管费	-	-	-	-	-	293,611.98	293,611.98
应付交易费用	-	-	-	-	-	59,131.66	59,131.66
其他负债	-	-	-	-	-	236,154.00	236,154.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,809,435.05	3,809,435.05

计							
利率敏 感度缺 口	42,574,529.05		-370,387.00 0.00	1,033,596,381.40	223,646,672.00	100,730,201.11	1,770,934,783.56
上年度 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	0.00					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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	4. 银行存款、结算备付金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；		
	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（2012 年 6 月 30 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	0.25%	-8,580,962.79	-6,762,583.82
	-0.25%	8,676,927.09	6,817,791.97

6.4.13.4.2 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	73,079,549.60	4.13	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	1,627,630,053.40	91.91	1,836,450,463.10	89.16
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,700,709,603.00	96.03	1,963,255,840.85	95.32

注：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 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%。

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金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（2012年6月30日）	上年度末（2011年12月31日）
	5%	3,665,961.33	7,678,778.87
	-5%	-3,665,961.33	-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。

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	73,079,549.60	4.12
	其中：股票	73,079,549.60	4.12
2	固定收益投资	1,627,630,053.40	91.71
	其中：债券	1,627,630,053.40	91.71
	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	42,573,635.47	2.40
6	其他各项资产	31,460,980.14	1.77
7	合计	1,774,744,218.61	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	16,960,976.13	0.96
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	16,316,118.88	0.92
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	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	644,857.25	0.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	34,780,246.76	1.96
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	11,434,656.95	0.65
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	9,903,669.76	0.56
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	73,079,549.60	4.13

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601669	中国水电	4,099,907	17,916,593.59	1.01
2	601800	中国交建	3,505,957	16,863,653.17	0.95
3	601339	百隆东方	1,451,612	16,316,118.88	0.92
4	600697	欧亚集团	499,985	11,434,656.95	0.65
5	000888	峨眉山 A	425,014	9,086,799.32	0.51
6	601117	中国化学	141,572	816,870.44	0.05
7	600612	老凤祥	25,043	644,857.25	0.04

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	601800	中国交建	20,570,611.20	1.00
2	601117	中国化学	20,186,353.40	0.98
3	601339	百隆东方	19,741,923.20	0.96
4	601669	中国水电	18,184,314.42	0.88
5	600612	老凤祥	10,999,511.44	0.53
6	601699	潞安环能	9,902,863.80	0.48
7	000937	冀中能源	9,502,051.10	0.46
8	600805	悦达投资	6,789,587.00	0.33
9	601628	中国人寿	5,642,279.54	0.27
10	601288	农业银行	5,420,000.00	0.26
11	601601	中国太保	5,401,217.55	0.26
12	600016	民生银行	5,183,193.68	0.25
13	000888	峨眉山 A	4,855,504.81	0.24
14	600697	欧亚集团	4,344,589.50	0.21
15	603128	华贸物流	777,241.98	0.04

注：买入金额按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	600000	浦发银行	21,885,416.52	1.06
2	600016	民生银行	19,541,639.36	0.95
3	601117	中国化学	18,783,804.60	0.91
4	600036	招商银行	17,425,339.19	0.85
5	601601	中国太保	16,735,875.16	0.81
6	601100	恒立油缸	15,512,725.14	0.75
7	601928	凤凰传媒	14,595,672.37	0.71
8	600612	老凤祥	11,404,473.88	0.55
9	601699	潞安环能	9,781,482.95	0.47
10	000937	冀中能源	9,603,439.98	0.47
11	000581	威孚高科	8,871,487.69	0.43

12	600805	悦达投资	5,938,160.86	0.29
13	601628	中国人寿	5,580,818.50	0.27
14	601288	农业银行	5,420,000.00	0.26
15	000527	美的电器	5,109,029.00	0.25
16	600690	青岛海尔	4,662,479.00	0.23
17	000338	潍柴动力	3,403,327.38	0.17
18	601908	京运通	2,659,327.37	0.13
19	600079	人福医药	2,136,235.00	0.10
20	601886	江河幕墙	1,843,590.47	0.09

注：卖出金额按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	147,501,242.62
卖出股票收入（成交）总额	201,781,267.22

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	96,935,000.00	5.47
3	金融债券	212,880,000.00	12.02
	其中：政策性金融债	212,880,000.00	12.02
4	企业债券	494,291,381.40	27.91
5	企业短期融资券	202,282,000.00	11.42
6	中期票据	612,850,000.00	34.61
7	可转债	8,391,672.00	0.47
8	其他	-	-
9	合计	1,627,630,053.40	91.91

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1082168	10 京投 MTN2	1,000,000	100,550,000.00	5.68
2	1182024	11 苏国资 MTN1	800,000	82,064,000.00	4.63
3	122065	11 上港 01	610,480	61,890,462.40	3.49
4	120401	12 农发 01	600,000	60,390,000.00	3.41

5	1082178	10 山水 MTN1	600,000	60,282,000.00	3.40
---	---------	------------	---------	---------------	------

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

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

7.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	431,351.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	31,009,508.78
5	应收申购款	20,119.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,460,980.14

7.9.4 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。

7.9.5 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
19,279	87,778.63	49,122,406.85	2.90%	1,643,161,806.91	97.10%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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 员持有本基金	-	-

注：1) 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

2) 该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

§ 9 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
本报告期期初基金份额总额	2,034,721,273.03
本报告期基金总申购份额	8,364,534.33
减：本报告期基金总赎回份额	350,801,593.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,692,284,213.76

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。

§ 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、基金管理人 2012 年 3 月 3 日公告，增聘韩贤旺先生、叶从飞先生担任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，与苏竞先生共同管理该基金。同时，陈晓翔先生、欧阳沁春先生不再担任该基金的基金经理。

2、基金管理人 2012 年 3 月 3 日公告，增聘周睿先生担任汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理，由其与王栩先生共同管理该基金。

3、《汇添富逆向投资股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 9 日正式生效，顾耀强先生任该基金的基金经理。

4、基金管理人于 2012 年 3 月 14 日公告，聘请雷继明先生担任本公司副总经理。

5、《汇添富理财 30 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 9 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2012 年 6 月 7 日公告，潘鑫军先生担任本公司董事长，桂水发先生不再担任本公司的董事长。

7、《汇添富理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 12 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

8、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	
东方证券	2	328,730,944.66	100.00%	278,238.49	100.00%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-

广发证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	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	
	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
东方证券	399,510,346.39	100.00%	895,000,000.00	100.00%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

此 19 个交易单元均为本基金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 1 家证券公司的 1 个交易单元：爱建证券（上交所交易单元）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金 2011 年年度资产净值的公告	管理人网站	2012 年 1 月 4 日
2	汇添富基金管理有限公司关于增加财富里昂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	2012 年 1 月 9 日
3	汇添富基金管理有限公司关于增加国海证券为代销机构并参与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	2012 年 1 月 11 日
4	汇添富保本混合型证券投资基金 2011 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	2012 年 1 月 20 日
5	汇添富保本混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2012 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 3 月 10 日
6	汇添富保本混合型证券投资基金更新招募说明书（2012 年第 1 号）	管理人网站	2012 年 3 月 10 日
7	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	2012 年 3 月 14 日

8	汇添富基金管理有限公司关于开通浦发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	2012 年 3 月 21 日
9	汇添富保本混合型证券投资基金 2011 年年度报告	管理人网站	2012 年 3 月 30 日
10	汇添富保本混合型证券投资基金 2011 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	2012 年 3 月 30 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	2012 年 3 月 31 日
12	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国泰君安证券开展的自助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	2012 年 4 月 6 日
13	汇添富基金管理有限公司关于开通中信银行借记卡进行网上直销业务的公	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 4 月 11 日
14	汇添富基金管理有限公司关于调整旗下基金在中国建设银行定投申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 4 月 16 日
15	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东吴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	2012 年 4 月 23 日
16	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东吴证券开展的网上交易系统申购基金费率优惠	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 4 月 23 日

	活动的公告		
17	汇添富保本混合型证券投资基金 2012 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	2012 年 4 月 24 日
18	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 行开展的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	2012 年 5 月 2 日
19	汇添富基金管理有限公司关于增 加新时代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	2012 年 5 月 14 日
20	汇添富基金管理有限公司关于开 通支付宝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	2012 年 5 月 15 日
21	汇添富基金管理有限公司关于旗 下部分基金增加众禄基金为代销 机构并参与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	2012 年 6 月 6 日
22	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	2012 年 6 月 7 日
23	汇添富基金管理有限公司关于旗 下部分基金继续参与交通银行电 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	2012 年 6 月 27 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富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。

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 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 8 月 28 日