

汇添富保本混合型证券投资基金 2013 年半年度报告

2013 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：2013 年 8 月 26 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 2013 年 8 月 22 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 2013 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主要会计数据和财务指标	6
3.1 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.....	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.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	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.....	40
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.....	40
7.9 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
§9 开放式基金份额变动	41
§10 重大事件揭示	42

10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	45
§11 备查文件目录.....	48
11.1 备查文件目录.....	48
11.2 存放地点.....	48
11.3 查阅方式.....	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富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	1,214,100,143.63 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(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,431,628.19
本期利润	-6,246,896.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0048
本期加权平均净值利润率	-0.45%
本期基金份额净值增长率	-0.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	48,930,987.42
期末可供分配基金份额利润	0.0403
期末基金资产净值	1,265,852,065.98
期末基金份额净值	1.043
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	4.30%

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。

3.1 基金净值表现

3.1.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

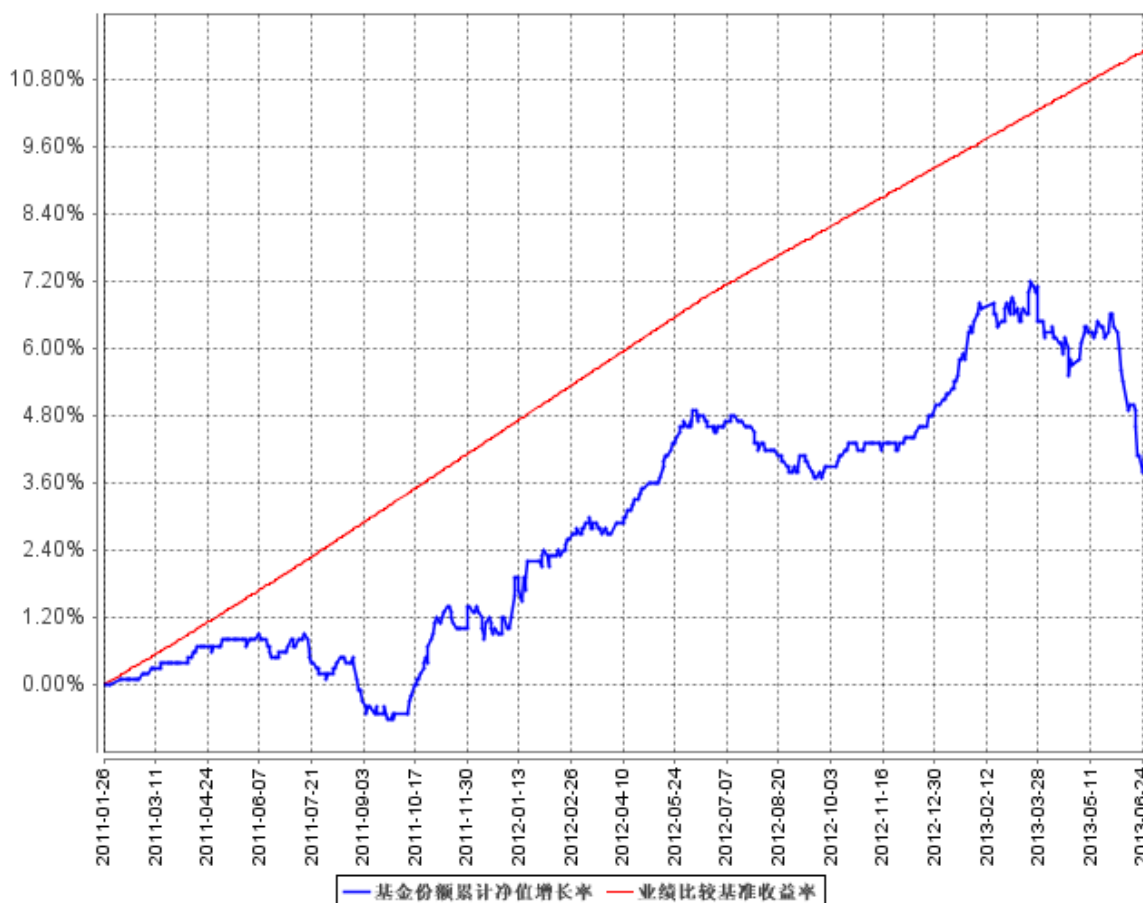
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-1.97%	0.22%	0.32%	0.02%	-2.29%	0.20%
过去三个月	-2.07%	0.18%	0.97%	0.01%	-3.04%	0.17%
过去六个月	-0.67%	0.17%	1.96%	0.02%	-2.63%	0.15%
过去一年	-0.29%	0.13%	4.03%	0.01%	-4.32%	0.12%
自基金合同生效日起至 今	4.30%	0.11%	11.37%	0.01%	-7.07%	0.10%

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。

3.1.2 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、东航金戎控股有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立，注册资本金为 1 亿元人民币。截止到 2013 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模逾 650 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 33 只开放式证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线，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、汇添富医疗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、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富理财 28 天债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金、汇添富消费行业股票型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽 30 股票型证券投资基金、汇添富高息债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		
陈加荣	汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理，汇添富收	2013 年 2 月 7 日	-	12 年	国籍：中国。学历：天津大学管理工程硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾在中国平

	<p>益快线货币市场基金的基金经理，汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理，汇添富高息债债券型证券投资基金的基金经理。</p>				<p>安集团任债券研究员、交易员及本外币投资经理，国联安基金公司任基金经理助理、债券组合经理，农银汇理基金公司任固定收益投资负责人。2008 年 12 月 23 日到 2011 年 3 月 2 日任农银汇理恒久增利债券型证券投资基金的基金经理，2009 年 4 月 2 日到 2010 年 5 月 9 日任农银汇理平衡双利混合型证券投资基金的基金经理。2012 年 3 月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程部高级经理，2012 年 12 月 21 日至今任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，2013 年 2 月 7 日至今任汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 2 月 7 日至今任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理，2013 年 6 月 27 日至今任汇添富高息债债券型证券投资基金的基金经理。</p>
<p>陆文磊</p>	<p>汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经</p>	<p>2011 年 1 月 26 日</p>	<p>2013 年 2 月 7 日</p>	<p>11 年</p>	<p>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</p>

	<p>理，汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理，汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金的基金经理，汇添富收益快线货币市场基金的基金经理助理，固定收益投资副总监。</p>			<p>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，现任固定收益投资副总监。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2013年2月7日任汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理，2012年7月26日至今任汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2012年12月31日至今任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理助理。</p>
--	---	--	--	---

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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，形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合，交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，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

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》，公司制定了同日反向交易控制的规则，同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5% 的交易次数为 2 次，分别是由于基金流动性需要、专户组合到期清算卖出证券所致。

本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

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

从 2012 年 12 月到 2013 年 2 月上旬，“经济、政策、流动性以及市场偏好”相对偏正面，市场充分享受着对经济、政策组合的乐观预期，从 1 月底的上证指数看，市场对 1 季度经济增长的预期快到 8.5%，但随后的经济数据以及政策手段让市场逐步回归理性，首先是高频的中观数据显示经济走势不太强，PMI 尽管有所反弹，但力度偏弱，市场开始逐步下调对 1 季度 GDP 增速预期；2 月的通胀有明显超预期的反弹，尽管市场意识到有偶然因素，但由此而来的“滞胀”担心开始出现；央行春节后未如市场预期的那样维持一定的流动性，而是进行正回购操作大幅回笼资金，也

加深了市场对流动性趋紧的担心。3月28日发布的银监会8号文更使市场担心今后社会融资总量将大幅下降、流动性趋紧、经济增速下行、无风险利率上行。到2季度，尽管银监会颁布了8号文，但社会融资总量并未如市场担心的那样出现较大幅度的下滑，仍维持高位，不过PMI整体上并未反弹，而是持续的低于市场预期，市场对此背离的各种解读不一而足，与此同时，CPI反弹有限，PPI持续走弱，总体上呈现“略宽货币+弱经济+低通胀”的经济格局，面对此局面，新政府应对之策逐步显示出自己的特色，为促进经济“转型”，政策“转型”开始凸显，不管是新领导的政策表态，还是实际推行的政策，都让市场感觉到新政府更重视尽快排查风险，更重视推进改革，通过促进结构调整以实现经济有质量的增长，6月末，在市场资金高度紧张状况下，央行一反常态的“淡定”，更使市场充分认识到新领导、新政府的宏观管理思路已经发生了切实的转变，金融机构降杠杆、减少资产负债的期限错配，经济结构转型势在必行。

在这样的背景下，股市在2月上旬前延续去年年底上涨行情后转而下落，前期涨幅较大的银行股受8号文影响大幅下挫，一些涨幅较大的消费类、中小板的股票也显颓势；可转债显示出一定的抗跌性，电力类以及个别的化工类转债相对较强；一般债券，尤其信用债除了在3月中上旬略有回调外，其余时间涨势良好，除了前述经济偏弱外，银行间资金相对宽松、年初机构的配置需要、资金成本低廉尤其后期银监会8号文带来的经济下滑、买债资金量扩大是主要原因。

2季度债市在经济偏弱、政府不再轻易出台刺激政策、流动性先偏松后趋紧的背景下，先走强，5月份在“债市稽查”的影响下大幅走弱近两周，但随后由于银监会8号文以及央行释放流动性的影响，市场需求旺盛而反弹，但在5月末到6月底，由于市场资金日渐紧张，甚至濒临“崩溃”而大幅下挫，并再次在央行一定程度的施以援手后而反弹。期间，银行间隔夜回购利率最高曾达30%，AAA评级的1年期短融收益率曾经上升150—200bp。股市的反应也是十分令人深思，整个2季度，估值便宜、被众多市场人士认为已经较充分反映经济悲观预期的银行、地产等大盘蓝筹股持续下行，而高估值的创业板股票则屡创新高，二者间的溢价也创历史新高。不少股票投资人，不由得发出与老虎基金创始人十分类似的感慨，“价值股的熊市何时结束？”

本基金严格按照保本的要求，在剩余保本期的基础上配置保本资产，年初果断加仓权益类资产，止盈止损，取得一定收益，后期受清理理财产品的影响，盈利受到一定削弱。二季度在保本资产上配置和保本期限相匹配的债券资产，资金紧张前，减持了部分债券资产，并在市场收益率上升后及时增持了部分债券，减少了一些损失，获得一定收益。股票资产的配置上考虑到基金特点，主要持有估值便宜、红利确定或业绩增长相对较稳定、可靠的银行、地产，但可惜的是，在这段时间，低估值行业未录得收益，在反思投资思路并对中国发展阶段、股市特色加以进一步研究后，我们加强了整体仓位控制以及投资行业的优选，转向更重视有真实成长的消费等类型的

公司，初步取得一定成效。

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-0.67%，同期业绩比较基准收益率为 1.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济转型期，政策影响尤其大。6 月末资金高度紧张下央行的“淡定”已让市场对新政府管理思路有了较深刻的认识。这次较严厉的通过数量调整迫使金融机构降杠杆的举动，也许只是更广范围、更深层次、更大力度的改革的“预演”，经济中长期前景反而更值得期待。政治局“宏观政策稳住、微观政策放活、社会政策托底”的要求已开始得到执行。展望未来一段时间，总体仍较弱，因为在美国经济略有复苏、欧元区不振的情况下，出口预期应该一般，消费也会偏弱，投资方面，由于房地产投资、基建投资缺少资金都难以有较大的反弹。通胀由于大宗商品价格下行压力仍存、猪周期影响降低以及基期因素，上行压力不大。更关键的是，此时的政策，很大的概率是继续维持前期促进“出清”的思路。央行更可能在实际上仍然维持中性略偏紧的货币政策，通过数量措施逼迫金融机构尽快降杠杆，发改委、交易商协会等部门会加大对债券发行的审查和已发债券信用风险的排查，从而从源头上减少城投平台以及一些不符合发展方向的行业的资金供应，而银行理财产品在银监会 8 号文的持续发酵下，净发行量可能下降，从而降低对高票息债券的需求。债券、股票市场因此都将面临一定的不确定性。

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

和程序的一贯性。

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

4.7 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

2013 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

2013 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 2013 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：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,284,442.89	14,752,136.95
结算备付金		5,147,103.05	867,259.27
存出保证金		443,689.70	202,074.69
交易性金融资产	6.4.7.2	1,226,144,491.78	1,454,807,293.29
其中：股票投资		47,872,391.18	77,170,924.59
基金投资		-	-
债券投资		1,169,152,100.60	1,353,777,368.70
资产支持证券投资		9,120,000.00	23,859,000.00
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	9,500,000.00	-
应收证券清算款		982,902.74	3,561,306.93
应收利息	6.4.7.5	25,478,461.86	27,244,063.80
应收股利		-	-
应收申购款		18,162.09	12,871.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,268,999,254.11	1,501,447,006.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 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		394,999.72	-
应付赎回款		364,873.86	1,023,250.97
应付管理人报酬		1,273,617.76	1,541,089.21
应付托管费		212,269.62	256,848.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	682,451.01	69,333.12
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	218,976.16	218,109.05
负债合计		3,147,188.13	3,108,630.53
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,214,100,143.63	1,427,428,351.72
未分配利润	6.4.7.10	51,751,922.35	70,910,024.43
所有者权益合计		1,265,852,065.98	1,498,338,376.15
负债和所有者权益总计		1,268,999,254.11	1,501,447,006.68

注：1、报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.043 元，基金份额总额 1,214,100,143.63 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		6,738,846.28	78,022,417.05
1.利息收入		27,822,145.29	38,708,300.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	112,575.52	349,538.61
债券利息收入		27,014,696.12	37,703,390.78
资产支持证券利息收入		405,736.35	-
买入返售金融资产收入		289,137.30	655,371.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-14,018,352.22	-2,181,236.74
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-14,707,971.04	-9,587,071.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-143,395.37	7,348,457.80
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	833,014.19	57,376.89
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-7,678,525.10	39,690,590.00
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	613,578.31	1,804,763.02
减：二、费用		12,985,743.19	14,438,519.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,282,990.72	11,329,225.72
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,380,498.48	1,888,204.29
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,019,214.22	561,138.05
5. 利息支出		1,074,005.64	421,415.06
其中：卖出回购金融资产支出		1,074,005.64	421,415.06
6. 其他费用	6.4.7.19	229,034.13	238,536.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,246,896.91	63,583,897.41

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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	1,427,428,351.72	70,910,024.43	1,498,338,376.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,246,896.91	-6,246,896.91
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）	-213,328,208.09	-12,911,205.17	-226,239,413.26
其中：1.基金申购款	8,112,738.35	516,687.85	8,629,426.20
2.基金赎回款	-221,440,946.44	-13,427,893.02	-234,868,839.46
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）	1,214,100,143.63	51,751,922.35	1,265,852,065.98
项目	上年度可比期间 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

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 林利军	_____ 陈灿辉	_____ 王小练
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 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。

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、证监会财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，对证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	1,284,442.89
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,284,442.89

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 2013 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	50,505,617.48	47,872,391.18	-2,633,226.30
债券	交易所市场	263,328,100.60	-1,709,970.19
	银行间市场	905,824,000.00	10,483,185.20
	合计	1,169,152,100.60	8,773,215.01
资产支持证券	9,465,000.00	9,120,000.00	-345,000.00
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,220,349,503.07	1,226,144,491.78	5,794,988.71

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

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	9,500,000.00	-
合计	9,500,000.00	-

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 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,639.70
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,084.58
应收债券利息	25,467,747.53
应收买入返售证券利息	2,075.92
应收申购款利息	-
其他	4,914.13
合计	25,478,461.86

注：“其他”包括资产支持证券利息及存出保证金利息。

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 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	679,687.01
银行间市场应付交易费用	2,764.00
合计	682,451.01

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,905.03
预提费用	216,071.13
合计	218,976.16

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,427,428,351.72	1,427,428,351.72
本期申购	8,112,738.35	8,112,738.35
本期赎回(以“-”号填列)	-221,440,946.44	-221,440,946.44
本期末	1,214,100,143.63	1,214,100,143.63

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	58,071,643.39	12,838,381.04	70,910,024.43
本期利润	1,431,628.19	-7,678,525.10	-6,246,896.91
本期基金份额交易产生的变动数	-10,572,284.16	-2,338,921.01	-12,911,205.17
其中：基金申购款	421,970.78	94,717.07	516,687.85

基金赎回款	-10,994,254.94	-2,433,638.08	-13,427,893.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,930,987.42	2,820,934.93	51,751,922.35

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	72,970.34
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,627.95
结算备付金利息收入	37,961.27
其他	15.96
合计	112,575.52

注：表中“其他”指直销申购款利息收入；“其他存款利息收入”指存出保证金利息收入。

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	665,682,921.14
减：卖出股票成本总额	680,390,892.18
买卖股票差价收入	-14,707,971.04

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	479,897,647.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	467,038,686.54
减：应收利息总额	13,002,356.79
债券投资收益	-143,395.37

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
----	----

	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	833,014.19
基金投资产生的股利收益	-
合计	833,014.19

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-7,678,525.10
——股票投资	-5,470,247.13
——债券投资	-2,844,277.97
——资产支持证券投资	636,000.00
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-7,678,525.10

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	613,578.31
合计	613,578.31

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,015,789.22
银行间市场交易费用	3,425.00
合计	2,019,214.22

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	37,467.82
信息披露费	168,603.31
银行划款费用	4,363.00
帐户维护费	18,600.00
合计	229,034.13

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
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	1,287,084,142.71	97.43%	328,730,944.66	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	310,175,448.49	95.47%	399,510,346.39	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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	3,933,270,000.00	95.13%	895,000,000.00	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 2013年1月1日至2013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	1,161,027.37	97.46%	679,687.01	99.59%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,282,990.72	11,329,225.72
其中：支付销售机构的客户维护费	3,123,646.72	4,266,971.61

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
	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,380,498.48	1,888,204.29

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：

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

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						
2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日						
银行间市场交易各关联方名称	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
上年度可比期间						
2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日						
银行间市场交易各关联方名称	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

注：本基金本期未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期本公司未发生运用自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：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,284,442.89	72,970.34	42,506,141.70	336,150.50

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（2013 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 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
A-1	160,459,000.00	210,945,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	29,985,000.00	39,932,000.00
合计	190,444,000.00	250,877,000.00

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 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
AAA	431,680,698.50	455,504,368.70
AAA 以下	463,511,106.00	597,461,000.00
未评级	83,516,296.10	49,935,000.00
合计	978,708,100.60	1,102,900,368.70

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、存出保证金、部分应收申购款、买入返售金融资产及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013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	1,284,442.89	-	-	-	-	-	1,284,442.89
结算备	5,147,103.05	-	-	-	-	-	5,147,103.05

付金							
存出保证金	443,689.70	-	-	-	-	-	443,689.70
交易性金融资产	100,100,000.00	150,930,400.00	523,199,050.50	394,922,650.10	-	56,992,391.18	1,226,144,491.78
买入返售金融资产	9,500,000.00	-	-	-	-	-	9,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	982,902.74	982,902.74
应收利息	-	-	-	-	-	25,478,461.86	25,478,461.86
应收申购款	1,192.85	-	-	-	-	16,969.24	18,162.09
资产总计	116,476,428.49	150,930,400.00	523,199,050.50	394,922,650.10	-	83,470,725.02	1,268,999,254.11
负债							
应	-	-	-	-	-	394,999.72	394,999.72

付 证 券 清 算 款							
应 付 赎 回 款	-	-	-	-	-	364,873.86	364,873.86
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	-	1,273,617.76	1,273,617.76
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	212,269.62	212,269.62
应 付 交 易 费 用	-	-	-	-	-	682,451.01	682,451.01
其 他 负 债	-	-	-	-	-	218,976.16	218,976.16
负 债 总 计	-	-	-	-	-	3,147,188.13	3,147,188.13
利 率 敏 感 度 缺 口	116,476,428.49	150,930,400.00	523,199,050.50	394,922,650. 10	-	80,323,536.89	1,265,852,065.98
上	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

年度末 2012年 12月 31日							
资产							
银行存款	14,752,136.95	-	-	-	-	-	14,752,136.95
结算备付金	867,259.27	-	-	-	-	-	867,259.27
存出保证金	-	-	-	-	-	202,074.69	202,074.69
交易性金融资产	23,859,000.00	90,528,000.00	534,792,164.50	707,578,886.40	20,878,317.80	77,170,924.59	1,454,807,293.29
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,561,306.93	3,561,306.93
应收利息	-	-	-	-	-	27,244,063.80	27,244,063.80
应收	397.62	-	-	-	-	12,474.13	12,871.75

申购款							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	39,478,793.84	90,528,000.00	534,792,164.50	707,578,886.40	20,878,317.80	108,190,844.14	1,501,447,006.68
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,023,250.97	1,023,250.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,541,089.21	1,541,089.21
应付托管费	-	-	-	-	-	256,848.18	256,848.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	69,333.12	69,333.12
其他负债	-	-	-	-	-	218,109.05	218,109.05
负债总计	-	-	-	-	-	3,108,630.53	3,108,630.53
利	39,478,793.84	90,528,000.00	534,792,164.50	707,578,886.40	20,878,317.80	105,082,213.61	1,498,338,376.15

率 敏 感 度 缺 口				40		
----------------------------	--	--	--	----	--	--

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	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；		
	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；		
	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；		
	银行存款、结算备付金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	0.25%	-2,952,995.21	-3,768,467.31
	-0.25%	2,975,824.08	3,795,637.19

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 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	47,872,391.18	3.78	77,170,924.59	5.15
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,178,272,100.60	93.08	1,353,777,368.70	90.35
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	23,859,000.00	1.59
合计	1,226,144,491.78	96.86	1,454,807,293.29	97.09

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%。

6.4.13.4.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金所投资证券的贝塔系数紧密相关；		
	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；		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2013年6月30日）	上年度末（2012年12月31日）
	5%	1,655,423.53	3,933,847.84
	-5%	-1,655,423.53	-3,933,847.84

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	47,872,391.18	3.77
	其中：股票	47,872,391.18	3.77
2	固定收益投资	1,178,272,100.60	92.85
	其中：债券	1,169,152,100.60	92.13
	资产支持证券	9,120,000.00	0.72

3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	9,500,000.00	0.75
	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	6,431,545.94	0.51
6	其他各项资产	26,923,216.39	2.12
7	合计	1,268,999,254.11	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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	38,036,493.29	3.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,835,897.89	0.78
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	47,872,391.18	3.78

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	600535	天士力	532,207	20,835,904.05	1.65

2	000538	云南白药	117,196	9,845,635.96	0.78
3	002344	海宁皮城	514,699	9,835,897.89	0.78
4	600499	科达机电	391,552	4,655,553.28	0.37
5	600315	上海家化	60,000	2,699,400.00	0.21

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	601166	兴业银行	85,942,727.98	5.74
2	600016	民生银行	54,185,178.50	3.62
3	600535	天士力	45,641,135.58	3.05
4	000001	平安银行	38,930,919.61	2.60
5	600000	浦发银行	37,852,097.50	2.53
6	600048	保利地产	37,286,951.78	2.49
7	000423	东阿阿胶	30,426,100.63	2.03
8	000024	招商地产	29,181,445.88	1.95
9	600795	国电电力	29,069,027.75	1.94
10	601818	光大银行	26,721,000.00	1.78
11	002344	海宁皮城	22,767,477.37	1.52
12	300039	上海凯宝	20,298,977.45	1.35
13	600499	科达机电	15,413,931.94	1.03
14	600315	上海家化	14,981,738.95	1.00
15	000826	桑德环境	14,936,164.51	1.00
16	600030	中信证券	14,173,487.50	0.95
17	601318	中国平安	13,846,069.66	0.92
18	600199	金种子酒	13,363,919.72	0.89
19	000002	万科A	12,305,823.14	0.82
20	601328	交通银行	10,691,845.80	0.71

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	601166	兴业银行	84,921,462.00	5.67
2	600016	民生银行	55,300,265.83	3.69

3	600048	保利地产	49,524,577.70	3.31
4	600000	浦发银行	38,195,846.08	2.55
5	000001	平安银行	35,358,236.78	2.36
6	000002	万科A	28,931,605.37	1.93
7	601818	光大银行	28,259,000.00	1.89
8	600795	国电电力	27,457,672.65	1.83
9	600535	天士力	26,662,412.84	1.78
10	000024	招商地产	26,351,939.40	1.76
11	000423	东阿阿胶	25,418,071.73	1.70
12	300039	上海凯宝	19,745,209.66	1.32
13	600315	上海家化	19,310,806.35	1.29
14	002146	荣盛发展	14,697,857.84	0.98
15	601669	XD 中国水	14,452,661.48	0.96
16	000826	桑德环境	14,011,850.76	0.94
17	600030	中信证券	13,942,000.00	0.93
18	601318	中国平安	12,627,436.85	0.84
19	002344	海宁皮城	11,707,826.92	0.78
20	601601	中国太保	11,302,281.26	0.75

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	656,562,605.90
卖出股票收入（成交）总额	665,682,921.14

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	39,956,000.00	3.16
3	金融债券	29,985,000.00	2.37
	其中：政策性金融债	29,985,000.00	2.37
4	企业债券	396,293,946.20	31.31
5	企业短期融资券	160,459,000.00	12.68
6	中期票据	522,981,000.00	41.31
7	可转债	19,477,154.40	1.54
8	其他	-	-
9	合计	1,169,152,100.60	92.36

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	1182024	11 苏国资 MTN1	800,000	80,184,000.00	6.33
2	1082178	10 山水 MTN1	600,000	60,078,000.00	4.75
3	0982040	09 沪电力 MTN2	600,000	59,442,000.00	4.70
4	122065	11 上港 01	587,990	58,793,120.10	4.64
5	122102	11 广汇 01	500,000	52,100,000.00	4.12

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
2	N00847	12 上元 1A	300,000	9,120,000.00	0.72

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

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、处罚的情况。

7.9.2

本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	443,689.70
2	应收证券清算款	982,902.74
3	应收股利	-
4	应收利息	25,478,461.86
5	应收申购款	18,162.09

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,923,216.39

7.9.4 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	16,831,648.40	1.33
2	110018	国电转债	537,400.00	0.04

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
14,711.00	82,530.09	43,736,204.29	3.60%	1,170,363,939.34	96.40%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	189.39	0.00%

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	1,427,428,351.72
本报告期基金总申购份额	8,112,738.35
减:本报告期基金总赎回份额	221,440,946.44
本报告期末基金份额总额	1,214,100,143.63

注：表内“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、《汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2013 年 1 月 24 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

2、基金管理人 2013 年 2 月 1 日公告，增聘娄焱女士担任本公司副总经理。

3、基金管理人 2013 年 2 月 8 日公告，增聘曾刚先生担任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。同时，王珏池先生不再担任该基金的基金经理。

4、基金管理人 2013 年 2 月 8 日公告，增聘陈加荣先生担任汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理。同时，陆文磊先生不再担任该基金的基金经理。

5、基金管理人 2013 年 2 月 8 日公告，增聘陈加荣先生担任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理。同时，王珏池先生不再担任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2013 年 3 月 30 日公告，增聘梁珂先生担任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

7、《汇添富消费行业股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 5 月 3 日正式生效，朱晓亮先生任该基金的基金经理。

8、基金管理人 2013 年 5 月 11 日公告，汇添富医药保健股票型证券投资基金由周睿先生单独管理，王栩先生不再管理该基金。

9、基金管理人 2013 年 5 月 11 日公告，汇添富优势精选混合型证券投资基金由王栩先生单独管理，苏竟先生不再管理该基金。

10、《汇添富理财 7 天债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 5 月 29 日正式生效，曾刚

先生任该基金的基金经理。

11、《汇添富实业债债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 6 月 14 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

12、《汇添富美丽 30 股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 6 月 25 日正式生效，王栩先生任该基金的基金经理。

13、《汇添富高息债债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 6 月 27 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。

14、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	1,287,084,142.71	97.43%	1,161,027.37	97.46%	-
德邦证券	2	22,167,626.13	1.68%	19,616.23	1.65%	-
国金证券	2	11,462,832.48	0.87%	10,435.83	0.88%	-
金元证券	1	273,196.00	0.02%	248.73	0.02%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

爱建证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	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	310,175,448.49	95.47%	3,933,270,000.00	95.13%	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	12,234,081.50	3.77%	61,000,000.00	1.48%	-	-
金元证券	2,489,162.60	0.77%	140,500,000.00	3.40%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

财富里昂	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期新增 4 家证券公司的 5 个交易单元：信达证券（上交所交易单元和深交所交易单元）、万联证券（上交所交易单元）、银河证券（上交所交易单元）、华龙证券（深交所交易单元）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金 2012 年年度资产净值的公告	管理人网站	2013 年 1 月 4 日
2	汇添富保本混合型证券投资基金 2012 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	2013 年 1 月 21 日
3	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金百临为代销机	中国证券报、上海证券报、证券时报、管	2013 年 1 月 28 日

	构的公告	理人网站	
4	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	2013 年 2 月 1 日
5	汇添富基金管理有限公司关于调整基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 2 月 8 日
6	汇添富基金管理有限公司关于获准设立子公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 3 月 5 日
7	汇添富保本混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2013 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 3 月 11 日
8	汇添富保本混合型证券投资基金更新招募说明书(2013 年第 1 号)	管理人网站	2013 年 3 月 11 日
9	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	2013 年 3 月 29 日
10	汇添富保本混合型证券投资基金 2012 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	2013 年 3 月 28 日
11	汇添富保本混合型证券投资基金 2012 年度报告	管理人网站	2013 年 3 月 28 日
12	汇添富基金管理有限公司关于设立汇添富资本管理有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 3 月 30 日
13	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方	中国证券报、上海证券报、证券时报、管	2013 年 4 月 3 日

	法的公告	理人网站	
14	汇添富基金管理有限公司关于现金宝快速取现服务免费及金额上限调整为 500 万的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 4 月 9 日
15	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金在好买基金开通定投业务并参与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	2013 年 4 月 10 日
16	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联讯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	2013 年 4 月 16 日
17	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中金公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 4 月 16 日
18	汇添富保本混合型证券投资基金 2013 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	2013 年 4 月 19 日
19	汇添富基金管理有限公司关于网上直销系统使用中国工商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	2013 年 4 月 24 日
20	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 5 月 30 日
21	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海证券开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 6 月 6 日
22	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中天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	2013 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增加利得基金为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 6 月 20 日
24	汇添富基金管理有限公司关于开通财付通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	2013 年 6 月 20 日
25	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 6 月 25 日
26	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中期时代销售为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 6 月 28 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
2013 年 8 月 26 日