丰和价值证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2011年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2011年4月1日起至2011年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实丰和价值封闭 (深交所上市简称:基金丰和)
基金主代码	184721
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2002年3月22日
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00份
投资目标	本基金为价值型证券投资基金,主要投资于依照有关区分股票价值、成长特征的指标所界定的价值型股票,通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险,在注重基金资产安全的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用"自上而下"与"自下而上"相结合的投资方法,在综合宏观经济发展情况、政策取向、证券市场走势等多种因素的基础上,确定基金在股票、固债上的投资比例。坚持价值型投资理念,确立以相对价值判断为核心,兼顾对公司内在价值评估的选股思路;同时,以基本分析为基础,重视数量分析,系统考察上市公司的投资价值,最终确定所投资的股票,并以技术分析辅助个股投资的时机选择。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	-83,573,655.36
2.本期利润	-223,102,392.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0744
4.期末基金资产净值	3,048,641,705.41
5.期末基金份额净值	1.0162

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-6.82%	2.37%				

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率历史走势对比图

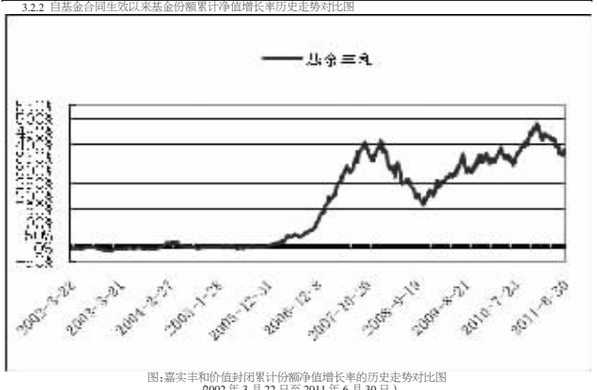


图:嘉实丰和价值封闭累计份额净值增长率的历史走势对比图
(2002年3月22日至2011年6月30日)

注:按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同七、(四)投资组合(1)的有关约定;(2)本基金投资于股票、债券的比重不低于基金资产总值的80%,投资于固债的比重不低于基金资产净值的20%;(3)本基金投资于一家上市公司的股票,不超过基金资产净值的10%;(5)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;(4)本基金股票投资组合的平均BP值高于沪深A股市场的平均BP值;(6)遵守中国证监会规定的其他比例限制。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
顾义河	本基金基金经理	2009年6月17日	-	10年	曾任职于中银国际控股有限公司,2002年9月加盟嘉实基金管理有限公司,先后任分析师、高级分析师。硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)任职日期、离任日期指公司作出决定后公告之日;(2)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遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《丰和价值证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待了旗下管理的所有基金和组合。

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

本基金与其他投资组合的投资风格不同,未与其他投资组合进行业绩比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生异常交易行为。

4.4 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

回顾第二季度,市场出现了较大幅度的普遍下跌,中证500跑输沪深300,我们认为主要基于以下几点原因:第一,通货膨胀压力引发了政府持续的紧缩政策,市场的流动性紧张,资本市场的资金供应受到压制;第二,上市公司,尤其是中小市值上市公司的第一季度业绩出现了较大幅度的低于预期的情形;第三,受益于三三线城市投资增长和保障房建设的部分行业,如工程机械、水泥、煤炭等表现较佳,而TMT、医药等则表现较差。本基金基于对3月的CPI阶段性的低于预期导致对4月的CPI抱有乐观的态度,判断政策可能不会进一步紧缩,因此在操作中没有及时减仓,二季度前期蒙受了一定的亏损,后期加强了对重点持仓的跟踪,取得了较好的阶段性收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0162元,本报告期基金份额净值增长率为-6.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,我们认为通胀状况依旧是政策的首要风向标。如果通胀指标在三季度不出现超预期高的情形,我们认为政策的基调将保持稳定,而在中西部投资消费发展、保障房建设、水利设施建设等方面将出现较为有利的财政政策支持。一方面,随着政策的相对宽松、资本市场的预期和资金供应压力有望缓解。另一方面,鉴于市场整体估值水平处于历史上中低位置,我们认为市场有较大的安全边际。因此,我们认为市场将可能会有一个相对较好的表现。我们将一方面关注估值处于历史低位且存在修复和提升空间的行业和个股,另一方面将同时兼顾新兴产业规划细则的出台对中小盘绩优股带来的估值修复的空间。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,322,171,606.55	74.72
	其中:股票	2,322,171,606.55	74.72
2	固定收益投资	620,538,408.60	19.97
	其中:债券	620,538,408.60	19.97
	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	156,666,583.34	5.04
6	其他资产	8,320,959.02	0.27
7	合计	3,107,697,557.51	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	250,562,823.61	8.22
C	制造业	1,259,472,077.76	41.31
C0	食品、饮料	157,306,135.80	5.16
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	332,847,915.40	10.92
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	170,089,106.18	5.58
C7	机械、设备、仪表	428,009,447.82	14.04
C8	医药、生物制品	171,219,472.56	5.62
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	116,822,061.69	3.83
F	交通运输、仓储业	164,283,853.60	5.39
G	信息技术业	238,618,323.23	7.83
H	批发和零售贸易	27,427,396.60	0.90
I	金融、保险业	68,289,704.67	2.24
J	房地产业	78,379,488.07	2.57
K	社会服务业	33,679,316.40	1.10
L	传播与文化产业	28,842,021.00	0.95
M	综合类	55,794,539.92	1.83
	合计	2,322,171,606.55	76.17

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002152	广电运通	5,203,269	160,416,783.27	5.26
2	002037	久联发展	4,388,086	106,981,536.68	3.51
3	002063	远光软件	5,490,221	103,929,883.53	3.41
4	600104	上海汽车	5,208,152	97,600,768.48	3.20
5	600009	上海机场	6,749,656	86,395,596.80	2.83
6	002410	广联达	2,392,103	83,053,816.16	2.72
7	600458	时代新材	4,291,848	82,575,155.52	2.71
8	600887	伊利股份	4,940,572	82,260,523.80	2.70
9	002341	新纶科技	4,045,426	81,798,513.72	2.68
10	002430	杭氧股份	3,608,331	80,790,531.09	2.65

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	60,189,408.60	1.97
2	央行票据	312,799,000.00	10.26
3	金融债券	247,550,000.00	8.12
	其中:政策性金融债	247,550,000.00	8.12
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	620,538,408.60	20.35

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100226	10国开26	1,000,000	99,570,000.00	3.27
2	1101018	11央行票据18	1,000,000	96,590,000.00	3.17
3	1101023	11央行票据23	500,000	49,625,000.00	1.63
4	1101025	11央行票据25	500,000	49,620,000.00	1.63
5	010203	02国债(3)	497,780	49,215,508.60	1.61

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告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

报告期末,本基金未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,160,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	419,933.64
4	应收利息	6,480,235.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	260,790.04
8	其他	-
9	合计	8,320,959.02

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位:份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	12,010,000.00
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	12,010,000.00
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	0.40

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准丰和价值证券投资基金设立的文件;

(2)《丰和价值证券投资基金基金合同》;

(3)《丰和价值证券投资基金招募说明书》;

(4)《丰和价值证券投资基金基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内丰和价值证券投资基金公告的各项原稿。

7.2 存放地点

北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

7.3 查阅方式

(1)书面查询:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。

(2)网站查询:基金管理人网址:http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话400-600-8800,或发电子邮件,E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2011年7月20日

汇添富策略回报股票型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2011年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富策略回报股票
交易代码	470008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月22日
报告期末基金份额总额	1,022,385,902.56份
投资目标	本基金采用"自上而下"的投资方式,灵活运用资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略,构建有效的投资组合,并在科学严格的投资风险管理前提下,力求为基金份额持有人实现持续稳健的较高投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金,以股票投资为主。股票投资的主要策略包括资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略。其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险,行业轮动策略用于把握行业基本面变化以精选优势行业,个股精选策略用于挖掘各行业中的优质股票以获取超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高风险较高预期收益的品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	47,175,637.49
2.本期利润	-34,962,812.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0328
4.期末基金资产净值	1,096,605,677.44
5.期末基金份额净值	1.073

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。

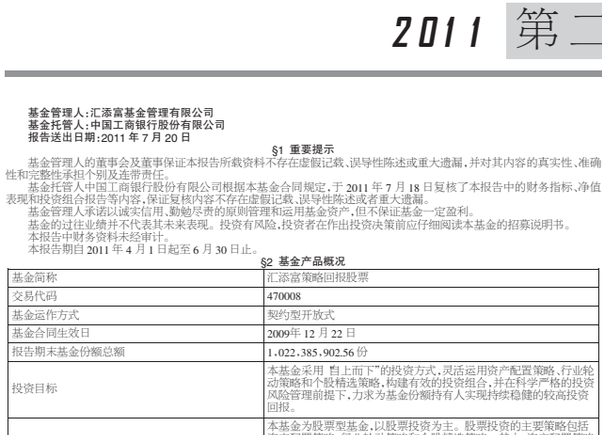
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.90%	0.95%	-4.30%	0.88%	1.40%	0.07%

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



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2009年12月22日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
顾耀强	本基金的基金经理	2009年12月22日	-	7年	国籍:中国。学历:清华大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、中海优质成长基金经理助理、中海能源策略基金经理助理。2009年3月加入汇添富基金管理有限公司任高级行业分析师,2009年7月7日至2011年3月13日任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理助理,2009年12月22日至今任汇添富策略回报股票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遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

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

本基金为股票型基金,采用"自上而下"的投资方式,灵活运用资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略,构建投资组合,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 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

二季度,中国经济总体保持稳步发展态势。受国外原材料价格居高不下和国内生产成品上升的影响,CPI表现反复,6月份有冲高的迹象。

进入二季度,央行仍然通过调高存款准备金率的方式实现"紧货币"的目的,与一季度的调整步伐相同,二季度的存款准备金率保持一月一提高,至二季度末,存款准备金率又创造了历史记录——21.5%。于此相反,公开市场操作在整个二季度净投放了9240亿,特别是在6月份,单月释放了4160亿。这一现象表明,市场对于在央行票据利率有很高的预期,同时,也反映出在存款准备金率一刀切的收缩方式下,部分商业银行的流动性受影响,倒逼央行在公开市场上释放流动性。

本季,中国货币市场的资金面表现出逐步趋紧的形态,至半年末市场资金的紧张程度达到极致,市场收益率大幅上升。与前几次调整准备金率不同,6月份这次调整的边际效益较为明显,为了满足自身流动性的需求,以及对于下半年信贷考核指标的需求,整个6月份市场都处于资金紧缺的态势。跨越回购利率一度逼近历史最高位。

本基金针对市场的变化积极调整组合配置结构,控制整体投资组合剩余期限的策略在市场收益率大幅上升的时候起到了作用,组合中充裕的流动性保证了客户申购、赎回的需求。同时,本基金通过逆回购以及银行存款的手段实现组合的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金A级本期净值收益率为0.8252%,B级本期净值收益率为0.8854%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,我们认为,欧美经济复苏仍然有较大不确定性,特别是美国在结束QE2后,很难判断美国国内消费能否快速复苏以拉动经济。如果欧美经济增长下半年趋缓,加上国内日益累积的紧缩效应,可能会对中国经济增长产生较大的负面影响。因此,我们有理由相信中国管理层在通胀得到控制的前提下,有可能提前展开新一轮经济复苏计划,运用积极的财政政策对冲经济下滑的风险。三季度仍有调高一次存贷款利率的可能,存款准备金率的上调频率肯定会下降。

三季度货币政策将保持货币市场处于"紧平衡"状态,资金紧张程度会有所下降。本基金将选择合适的时间、合适的信用产品进行投资,适度提高组合的剩余期限。密切关注货币市场的变化,阶段性地调整利率投资品和信用投资品的投资比例,以期获得理想收益。

§5 投资组合报告

5.1 基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	871,213,319.20	53.22
	其中:债券	871,213,319.20	53.22
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	318,901,158.35	19.48
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	405,234,115.68	24.75
4	其他资产	41,713,232.85	2.55
5	合计	1,637,061,826.08	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.66	
	其中:买断式回购融资	0.08	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	79,999,760.00	5.16
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 期末基金组合剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	136
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	60.26	5.16
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	9.06	-
2	30天(含)-60天	5.8	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.64	-
3	60天(含)-90天	7.17	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.59	-
4	90天(含)-180天	5.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.53	-
5	180天(含)-397天(含)	23.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		102.85	5.16

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	99,885,767.08	6.44
3	金融债券	201,489,083.91	12.99
	其中:政策性金融债	201,489,083.91	12.99
4	企业债券	59,598,380.10	3.84
5	企业短期融资券	510,240,088.11	32.89
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	871,213,319.20	56.16
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	261,087,464.01	16.83

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	090213	09国开13	1,300,000	130,234,587.18	8.39
2	090205	09国开05	700,000	71,254,496.73	4.59
3	1181183	11津城建CP01	500,000	50,013,972.68	3.22
4	1101021	11央票21	500,000	49,961,930.70	3.22
5	1101023	11央行票据23	500,000	49,923,836.38	3.22
6	1181217	11正大CP01	400,000	40,003,503.94	2.58
7	068019	06京投债	400,000	39,293,995.08	2.53
8	1081315	10大重起CP01	300,000	30,033,963.42	1.94
9	1181160	11华晨CP01	300,000	30,031,694.77	1.94
10	1181124	11信达CP01	300,000	30,021,458.03	1.94

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	2
报告期内偏离度的最高值	0.26%
报告期内偏离度的最低值	-0.04%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.16%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金估值方法说明。

本基金估值采用摊余成本法计价,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.8.2 本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

5.8.4 其他资产构成

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	9,444,347.95
4	应收申购款	32,018,884.90
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	41,713,232.85

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富货币A	汇添富货币B
本报告期期初基金份额总额	365,799,509.52	1,915,665,755.42
本报告期基金总申购份额	1,358,888,050.46	3,143,251,834.10
减:本报告期基金总赎回份额	1,337,771,990.03	3,894,457,347.23
本报告期期末基金份额总额	386,915,569.95	1,164,460,242.29

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富货币市场基金募集的文件;

2、《汇添富货币市场基金基金合同》;

3、《汇添富货币市场基金托管协议》;

4、《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、报告期内汇添富货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告;

7、中国证监会要求的其他文件。

7.2 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

7.3 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
2011年7月20日

汇添富货币市场基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2011年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富货币	
交易代码	519518	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年3月23日	
报告期末基金份额总额	1,551,375,812.24份	
投资目标	力求在本金稳妥和基金资产高流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略,力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。	
业绩比较基准	税后活期存款利率(扣活期存款利率×0-利息税率)%。	
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。	
基金管理人	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属两级基金简称	汇添富货币A	汇添富货币B
下属两级交易代码	519518	519517
下属两级基金报告期末份额总额	386,915,569.95份	1,164,460,242.29份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)	
	汇添富货币A	汇添富货币B
1. 本期已实现收益	4,312,332.72	16,884,968.42
2.本期利润	4,312,332.72	16,884,968.42
3.期末基金资产净值	386,915,569.95	1,164,460,242.29

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富货币A

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	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	0.8252%	0.0035%	0.1233%	0.0001%	0.7019%	0.0034%

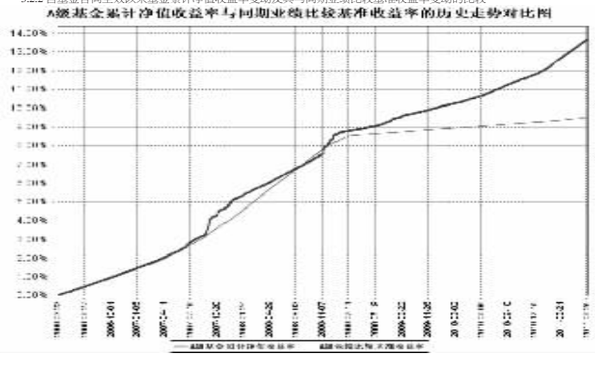
注:本基金收益分配按月结转份额。

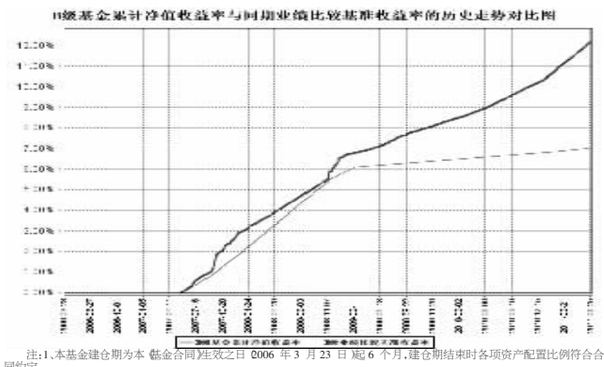
汇添富货币B

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	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	0.8854%	0.0036%	0.1233%	0.0001%	0.7621%	0.0035%

注:本基金收益分配按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2006年3月23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。

2、本基金从本《基金合同》生效之日起至2009年2月15日采用的业绩比较基准为同期银后一年定期存款利率。从2009年2月16日起,本基金业绩比较基准为同期银后活期存款利率。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王珏池