汇添富上证综合指数证券投资基金

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	汇添富上证综合指数
交易代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月1日
报告期末基金份额总额	6,091,434,876.59份
投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于6%,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性,主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%且年化跟踪误差小于6%的投资目标。
业绩比较基准	上证综合指数收益率×95% + 银行活期存款利率(税后)×5%
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	34,115,604.10
2.本期利润	-265,587,387.35
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0436
4.期末基金资产净值	5,384,560,602.40
5.期末基金份额净值	0.884

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。

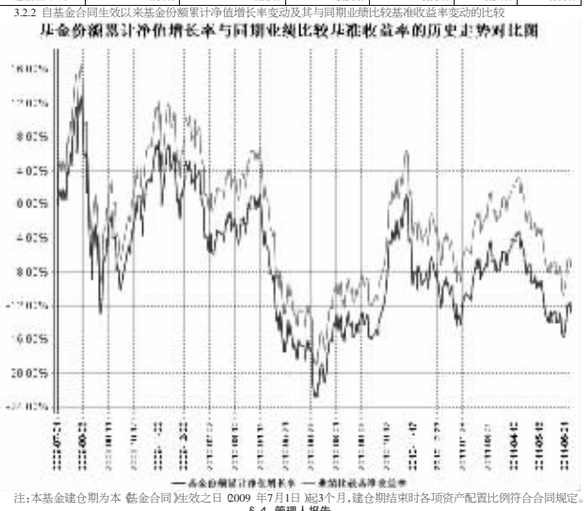
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-4.84%	0.95%	-5.38%	0.95%	0.54%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率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7月1日)起3个月,建仓期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		
何仁科	本基金的基金经理,产品创新部总监	2009年7月1日	-	10年	国籍:中国。学历:华中科技大学数量经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任东方证券股份有限公司研究所高级经理。2004年12月加入汇添富基金管理有限公司任产品与金融工程部副总监,产品创新部总监,2009年7月1日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。
吴振翔	本基金的基金经理	2010年2月5日	-	5年	国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008年3月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程研究员,2010年1月8日至2010年2月4日任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理助理,2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数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

本基金为被动式指数基金,原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性,主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%且年化跟踪误差小于6%的投资目标。

本基金为指数型基金,股票投资比例以有效规避跟踪误差为目的,本报告期内基金股票投资比例在报告期内基本保持在92%-95%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

本基金对抽样复制组合采取缓冲式调整,有效的降低了冗余的交易量,报告期内抽样复制组合领先于上证综合指数中小盘股票的市场表现,我们将继续观察抽样复制方法在后续投资过程中的适用性。

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

2011年2季度通货膨胀延续了前期的攀升态势,控制通胀成为政府的首要任务,央行加息的同时并数次上调存款准备金率,A股市场本土呈现单边下跌的态势。本基金遵循了指数基金的被动投资原则,保持了指数基金的本质属性。本基金股票投资仓位在报告期内基本保持在92%-95%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

本基金对抽样复制组合采取缓冲式调整,有效的降低了冗余的交易量,报告期内抽样复制组合领先于上证综合指数中小盘股票的市场表现,我们将继续观察抽样复制方法在后续投资过程中的适用性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

上证综合指数在报告期内下跌了5.67%,本基金在报告期内累计收益率为-4.84%,同期业绩比较基准收益率为-5.38%,收益率领先业绩比较基准0.54%。收益率的差异因素主要来源于托管行股票替代、申购赎回、小股票替代组合与实际组合差异等因素的综合作用。本基金日均跟踪误差为0.101%,这一跟踪误差水平远低于0.35%,在报告期达到了投资目标。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间,在不发生重大食品价格上涨的情况下,今年6月份的CPI见顶的概率较大,政府控制通货膨胀的压力将在一定程度上减轻,可能将更加关注经济的增长,在这样的大环境下,继续收紧的货币政策有望结束,利率和存款准备金率继续上调的空间都很小,货币政策转而进入平稳期。从经济增长来看,以保障房建设和水利建设为代表的政府主导投资仍将向上,同时随着对中小企业生存环境的改善,民间投资也将逐渐实现恢复增长;消费增长虽然难以维持较高速度,但下滑态势并不明显;外围市场的复苏将是影响中国出口的不稳定因素,我们认为出口在下半年难以出现显著性的改善,经济在政策放松环境下仍将保持较好的发展。

A股市场经过今年上半年的估值挤压,目前与全球其他市场的估值比较来看,A股市场估值水平仍然较低,市场整体估值水平有望随着货币政策转平稳而进一步抬升,股票市场也可能出现较好的投资机会,同时考虑中国经济成长性因素,其整体估值在全球股市来看是非常有吸引力的。

作为被动投资的指数型基金,汇添富上证综合指数基金将严格遵守基金合同,继续坚持既定的指数化投资策略,积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。我们也非常期望添富上证能继续与投资者一起分享中国经济的美好未来。

§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	5,062,483,255.75	93.93
	其中:股票	5,062,483,255.75	93.93
2	固定收益投资	97,330,000.00	1.81
	其中:债券	97,330,000.00	1.81
	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	217,587,848.77	4.04
6	其他资产	12,381,867.90	0.23
7	合计	5,389,782,972.42	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末指数投资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	49,200,493.52	0.91
B	采掘业	1,070,904,952.52	19.89
C	制造业	1,370,841,198.62	25.46
C0	食品、饮料	135,307,748.08	2.51
C1	纺织、服装、皮毛	24,652,032.09	0.46
C2	木材、家具	9,789,399.51	0.18
C3	造纸、印刷	9,786,090.46	0.18
C4	石油、化学、塑胶、塑料	152,426,915.13	2.83
C5	电子	46,429,547.69	0.86
C6	金属、非金属	313,447,198.80	5.82
C7	机械、设备、仪表	500,693,818.29	9.30
C8	医药、生物制品	143,291,778.85	2.66
C99	其他制造业	35,016,669.72	0.65
D	电力、煤气及水的生产和供应业	180,886,646.15	3.36
E	建筑业	150,873,489.61	2.80
F	交通运输、仓储业	255,952,341.82	4.75
G	信息技术业	125,903,266.52	2.34
H	批发和零售贸易	112,822,598.53	2.10
I	金融、保险业	1,465,202,902.85	27.21
J	房地产业	137,197,153.08	2.55
K	社会服务业	56,663,427.73	1.05
L	传播与文化产业	22,874,915.38	0.42
M	综合类	63,159,869.42	1.17
	合计	5,062,483,255.75	94.02

5.2.2报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未进行积极投资。

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

5.3.1报告期末指数投资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	601857	中国石油	45,440,035	494,841,981.15	9.19
2	601288	农业银行	83,788,153	234,606,828.40	4.36
3	601988	中国银行	59,802,100	187,778,594.00	3.49
4	600028	中国石化	19,622,090	161,489,800.70	3.00
5	601088	中国神华	4,627,846	139,483,278.44	2.59
6	600036	招商银行	9,214,871	119,977,620.42	2.23
7	601628	中国人寿	5,843,667	109,568,756.25	2.03
8	601328	交通银行	19,514,752	108,111,726.08	2.01
9	600016	民生银行	18,349,549	105,142,915.77	1.95
10	600000	浦发银行	8,296,090	81,633,525.60	1.52

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末进行积极投资。

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	-	-
2	央行票据	97,330,000.00	1.81
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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	97,330,000.00	1.81

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	1001095	10央票95	1,000,000	97,330,000.00	1.81

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有权证。

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。

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	416,666.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	9,181,351.08
4	应收利息	1,508,843.90
5	应收申购款	1,275,006.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,381,867.90

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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存在流通受限情况的说明

5.8.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未进行积极投资,不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	6,180,304,006.06
本报告期基金总申购份额	214,634,582.13
减:本报告期基金总赎回份额	303,503,711.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,091,434,876.59

§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上证综合指数证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富上证综合指数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、报告期内汇添富上证综合指数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。

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

汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金

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	汇添富蓝筹稳健混合
交易代码	519066
前端交易代码	519066
后端交易代码	519067
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月8日
报告期末基金份额总额	367,684,020.48份
投资目标	通过投资于价值相对低估的蓝筹公司股票,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为灵活配置混合型基金,属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。
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	-9,512,868.67
2.本期利润	-20,815,454.87
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0569
4.期末基金资产净值	465,122,538.71
5.期末基金份额净值	1.265

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

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	-4.31%	0.78%	-3.04%	0.66%	-1.27%	0.12%

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(2008年7月8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		
苏竞	本基金的基金经理、汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理、汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理。	2008年7月8日	-	8年	国籍:中国。学历:上海海事大学经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任北京中国运载火箭技术研究院助理工程师、上海中银万国证券研究所高级研究员、上投摩根基金管理有限公司高级行业研究员。2006年9月加入汇添富基金管理有限公司,任高级行业分析师,2007年3月6日至2007年10月7日任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理助理,2007年10月8日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理,2007年12月17日至今任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理,2008年7月8日至今任汇添富蓝筹稳健灵活配置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

本基金为混合型基金,股票投资对象主要是"价值相对低估的蓝筹公司股票",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,经济增速回落趋势逐渐显现,通胀压力进一步走高,在货币政策维持收紧的形势下,实体经济资金紧张程度加剧,资金成本持续攀升。通胀、政策紧缩、企业盈利和流动性环境等诸多负面因素的累加对市场情绪形成较大的负面影响,导致指数持续走低,除高档白酒、水泥等极个别板块之外,市场缺乏明显的亮点,各细分行业板块基本呈现阴跌和轮跌态势。

本基金在上季度末,对经济形势的判断是通胀压力在二季度可能高位企稳,保障房、水利建设开工将有利于拉动总需求,认为二季度市场投资环境略好于一季度。但是二季度初,我们发现通胀压力、经济增速和企业盈利回落态势超出先前预期,于是主动调整了先前投资策略和组合结构,适当控制仓位,减持了部分与投资相关的周期性资产以及部分成本压力较大的制造业个股,增加了部分估值适中的消费类资产配置权重。二季度总体操作思路还是与市场环境的演变比较契合,但是在结构调整操作中对个别股票的减持力度不够坚决,对净值表现有所拖累。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011年二季度本基金的收益率为-4.31%,同期业绩比较基准为-3.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入三季度,随着市场预期通胀于近两个月将见顶回落,而前期持续收紧的货币政策可能也将进入观察期,市场情绪有所好转,指数近期也有所回升。虽然目前市场乐观情绪攀升,但是我们认为三季度经济增长和通胀形势都还面临着较多的不确定性。由于去年基数原因,通胀数据近两月可能会见到相对高点,但是考虑到本轮通胀形成原因的复杂性和结构性问题短期难以从根本上得到解决,后续通胀形势我们认为还有反复,而且在目前实际负利率比较严重的情况下,货币政策放松的空间不大,三季度货币政策方面更有可能是维持目前政策力度观察后续效果。而财政政策方面,最近开始显露的地方融资平台问题,一方面限制了后续财政政策空间,同时也让市场对银行的资产质量产生担忧进而对银行股的估值形成压制。综合宏观环境、企业盈利和市场流动性等因素来看,我们认为市场反转或者指数大幅上涨的可能性并不大,三季度更大可能是在目前位置附近的区间震荡。

从中长期来看,依靠出口拉动和信贷投放刺激投资的经济增长模式面临着挑战,而经济结构转型和刺激内需消费也不是短期可以一蹴而就,经济增速中期内适度回落可能是我们必然要接受的现实。在这个阶段,只有那些商业模式清晰、行业中长期成长前景明朗、治理规范的成长性公司才是可以跨越经济周期波动,获得超额收益的中长期投资标的。我们将依据上述思路自下而上精选个股,并依据宏观经济形势和市场风格有可能出现的变化适时调整和优化组合结构,争取在有效控制风险的前提下取得较好的基金业绩。

§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	295,521,128.92	63.13
	其中:股票	295,521,128.92	63.13
2	固定收益投资	32,747,967.00	7.00
	其中:债券	32,747,967.00	7.00
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	70,000,225.00	14.95
	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	68,353,921.39	14.60
6	其他资产	1,485,558.96	0.32
7	合计	468,108,801.27	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	2,442,000.00	0.53
B	采掘业	14,591,000.00	3.14
C	制造业	123,920,201.74	26.64
C0	食品、饮料	22,552,000.00	4.85
C1	纺织、服装、皮毛	5,151,000.00	1.11
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	8,440,000.00	1.81
C7	机械、设备、仪表	32,761,000.00	7.04
C8	医药、生物制品	41,307,961.85	8.88
C99	其他制造业	13,708,239.89	2.95
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	34,653,000.00	7.45
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	27,668,000.00	5.95
H	批发和零售贸易	58,187,804.18	12.51
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	11,769,123.00	2.53
K	社会服务业	13,290,000.00	2.86
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	9,000,000.00	1.93
	合计	295,521,128.92	63.54

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	600594	益佰制药	1,300,086	23,908,581.54	5.14
2	002081	金螳螂	500,000	20,100,000.00	4.32
3	000669	领先科技	500,000	15,140,000.00	3.26
4	000858	五粮液	400,000	14,288,000.00	3.07
5	600612	老凤祥	400,007	13,708,239.89	2.95
6	600785	新华百货	500,000	13,340,000.00	2.87
7	601117	中国化学	1,500,000	13,290,000.00	2.86
8	000417	合肥百货	700,042	12,740,764.40	2.74
9	600403	大有能源	400,000	12,528,000.00	2.69
10	601088	中国神华	400,000	12,056,000.00	2.59

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,877,000.00	6.42
	其中:政策性金融债	29,877,000.00	6.42
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,870,967.00	0.62
8	其他	-	-
9	合计	32,747,967.00	7.04

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	090309	09进出09	300,000	29,877,000.00	6.42
2	110015	石化转债	26,620	2,870,967.00	0.62

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明:

本基金投资前十名证券五粮液(000858)于2011年5月27日受到证监会行政处罚,该上市公司于2009年9月被证监会立案调查之初,我司即对其可能产生的影响进行过研究评估,认为此事件并不影响其经营业绩,不会对其投资价值造成较大影响。本基金一直重仓持有该股,并经过合理的投资决策授权审批。

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	719,376.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	722,139.38
5	应收申购款	44,043.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,485,558.96

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未有处于流通受限情况的说明

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	363,226,318.11
本报告期基金总申购份额	10,400,574.55
减:本报告期基金总赎回份额	5,942,872.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	367,684,020.48

§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蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富蓝筹稳健灵活配置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、报告期内汇添富蓝筹稳健灵活配置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。

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

汇添富民营活力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	汇添富民营活力股票
交易代码	470009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月5日
报告期末基金份额总额	696,859,793.59份
投资目标	本基金采用自下而上的方法,精选与中国经济发展密切相关的优秀民营企业上市公司股票进行投资布局,在科学严格管理风险的前提下,力求基金资产的中长期增值。
投资策略	本基金为股票型基金。股票投资的主要策略包括资产配置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,个股精选策略用于挖掘成长性较高且估值有吸引力的优秀民营企业上市公司以获取超额收益。本基金通过投资于具有良好的公司治理结构、灵活的用人和分配机制、独特的核心竞争优势等突出特征的优秀民营企业,以分享优秀民营企业成长所带来的资本增值。
业绩比较基准	中证民营企业综合指数×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预期风险较高预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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	-15,853,939.22
2.本期利润	-21,665,206.82
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0299
4.期末基金资产净值	741,327,