汇添富保本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	汇添富保本混合
交易代码	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
报告期末基金份额总额	2,344,968,333.08份
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
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	14,208,804.86
2.本期利润	7,056,622.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0029
4.期末基金资产净值	2,359,771,010.48
5.期末基金份额净值	1.006

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。

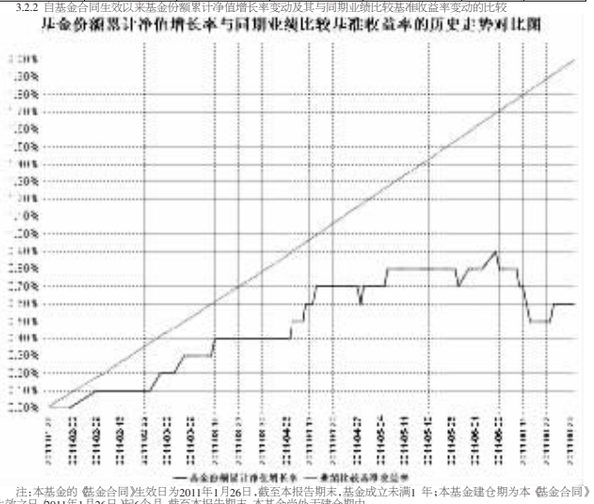
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.20%	0.05%	1.19%	0.01%	-0.99%	0.04%

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:本基金的《基金合同》生效日为2011年1月26日,截至本报告期末,基金成立未满1年;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,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

§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		
陆文磊	本基金的基金经理,汇添富货币市场基金的基金经理,汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。	2011年1月26日	-	9年	国籍:中国,学历:华东师范大学金融学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾任上海中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,汇添富货币市场基金的基金经理,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

本基金为保本型基金,通过投资组合保险技术配置大类资产,在保证本金安全的前提下力争净值的稳健增值,属于较低风险品种,与本基金管理人旗下其他基金投资组合风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,公司公平交易制度执行情况良好,未发生任何异常交易行为。

4.4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

二季度市场基本面的不确定因素明显增加,欧美等发达经济体增长速度有所放缓,欧洲债务问题重新引起市场的担忧,同时美联储在6月末正式结束量化宽松,经济疲软和政策转向导致二季度以来大宗商品价格出现较大幅度回调。从国内经济来看,二季度内需、外需均有所放缓,工业生产增速出现较大幅度回落,企业去库存行为较为明显。二季度通胀处于高位,尤其是5月份以后受猪肉价格大幅上涨的影响,CPI涨幅屡创09年以来的新高。由于通胀压力较大,二季度货币政策依然从紧,4月份以来央行三次上调准备金率、两次加息,M1、M2增长率已降至08年以来的低点附近。持续的货币信贷紧缩导致市场资金面偏紧。

二季度不利的基本面环境导致股票、债券市场均表现不佳,上证指数累计下跌5.67%,中短期债券收益率也大幅上行,导致央票、短期融资券等品种出现下跌。本基金二季度在操作上以防御为主,一方面继续提高保本资产配置比例,增加安全垫厚度,另方面在股票等风险资产配置上保持了很低的配置比例,以防范股票市场下跌的风险,6月下旬以后适度增加了可转债和股票资产的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内净值上涨0.20%,业绩基准上涨1.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度经济仍可能保持在相对低位运行,但经济指标回落的速度有望放缓,同时,随着需求的放缓和大宗商品价格的回落,通胀压力会有所减弱,CPI同比涨幅在下半年有望适度回落,但回落的幅度可能较为有限。总体上来看,三季度将是经济筑底、通胀见顶的关键时期。货币政策尽管短期内难以出现明显放松,但随着调控效果的逐渐显现,政策基调也有望出现微调,更加兼顾控制通胀和保持增长之间的平衡,加息已经进入尾声,下半年出现加息的可能性较小。三季度本基金将继续保持对信用债的较高比例配置,同时继续持有具备长期投资价值的可转债品种,并积极关注新发可转债和新股的投资机会。在做好风险控制的基础上,争取为投资者创造稳健的收益。

§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	41,566,676.98	1.76
	其中:股票	41,566,676.98	1.76
2	固定收益投资	2,086,006,436.50	88.25
	其中:债券	2,086,006,436.50	88.25
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	99,500,194.25	4.21
	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	106,364,337.23	4.50
6	其他资产	30,217,114.68	1.28
7	合计	2,363,654,759.64	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	3,281,000.00	0.14
C	制造业	28,712,946.98	1.22
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	28,712,946.98	1.22
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	7,675,200.00	0.33
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,897,530.00	0.08
	合计	41,566,676.98	1.76

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	600079	人福医药	600,000	13,236,000.00	0.56
2	000650	仁和药业	699,926	9,959,946.98	0.42
3	600000	浦发银行	780,000	7,675,200.00	0.33
4	600594	益佰制药	300,000	5,517,000.00	0.23
5	601699	潞安环能	100,000	3,281,000.00	0.14
6	600805	悦达投资	126,502	1,897,530.00	0.08

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	97,370,000.00	4.13
3	金融债券	178,192,000.00	7.55
	其中:政策性金融债	178,192,000.00	7.55
4	企业债券	426,471,000.00	18.07
5	企业短期融资券	1,269,823,000.00	53.81
6	中期票据	-	-
7	可转债	114,150,436.50	4.84
8	其他	-	-
9	合计	2,086,006,436.50	88.40

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	1081339	10首钢CP01	1,000,000	100,000,000.00	4.24
2	1081326	10中交建CP01	1,000,000	99,980,000.00	4.24
3	1181125	11广晟CP01	1,000,000	99,810,000.00	4.23
4	110406	11农发06	1,000,000	99,080,000.00	4.20
5	110203	11国开03	800,000	79,112,000.00	3.35

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、处罚的情况。

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	301,913.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	42,000.00
4	应收利息	29,858,980.92
5	应收申购款	14,220.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,217,114.68

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	47,511,000.00	2.01

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

§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	2,506,696,469.30
本报告期基金总申购份额	1,708,934.92
减:本报告期基金总赎回份额	163,437,071.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,344,968,333.08

§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。

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

汇添富社会责任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	汇添富社会责任股票
交易代码	470028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月29日
报告期末基金份额总额	5,442,798,556.82份
投资目标	精选积极履行社会责任,并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司,谋求基金资产的稳健增值。
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积极履行社会责任的优质上市公司,以谋求基金资产稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80% + 中证全债指数收益率×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	-8,542,667.64
2.本期利润	-20,668,118.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0037
4.期末基金资产净值	5,423,173,567.43
5.期末基金份额净值	0.996

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。

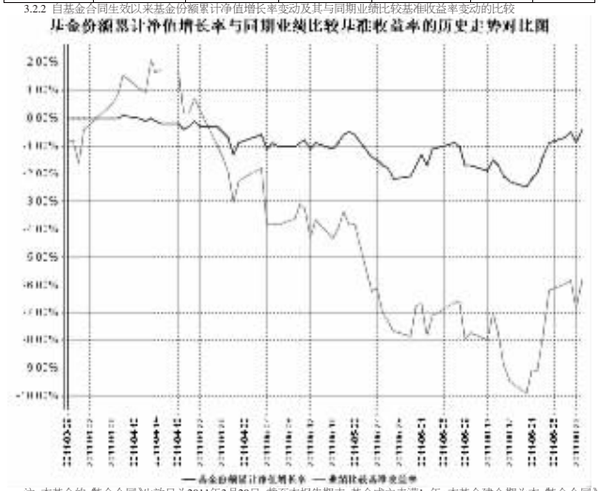
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.40%	0.31%	-4.27%	0.88%	3.87%	-0.57%

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:本基金的《基金合同》生效日为2011年3月29日,截至本报告期末,基金成立未满1年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2011年3月29日)起6个月,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

§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		
欧阳沁春	本基金的基金经理,汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理	2011年3月29日	-	10年	国籍:中国,学历:卫生部武汉生物制品研究所医学硕士、中欧国际工商学院工商管理硕士、相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任卫生部武汉生物制品研究所助理研究员、中国网络(百慕大)有限公司项目经理、大成基金管理有限公司行业研究员、国联安基金管理有限公司行业研究员、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6月17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,2007年6月18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,2011年3月29日至今任汇添富社会责任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

本基金精选积极履行社会责任,有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司,是专注于社会责任投资的股票型基金,截止报告期,与本基金管理人旗下其他基金风格不同。

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

三季度的A股市场表现不佳,随着宏观紧缩政策渐渐发挥作用,市场的流动性收紧,A股市场在二季度不断走低筑底。消费品行业表现最为优异,部分股票在市场大幅下跌过程中依然取得了正向收益,前期估值过高的板块取得正收益,行业与公司则出现了明显的价值回归。

本季度是添富社会责任基金的建仓期,我们对二季度市场一直比较谨慎,因此,建仓速度比较缓慢,有效的规避了市场的下跌。在行业配置方面,我们一直倾心非周期与成长类资产。我们在有长期增长潜力的消费品行业进行了中长期的布局,重点选择业绩突出、成长性好、管理层优秀的公司进行投资,我们也进行了部分估值比较低、有一定规模的资源股的投资。

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-0.40%,同期业绩比较基准为-4.27%。

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,国内外经济环境将依然表现迟异,国内经济政策取向也会出现微调。从海外经济角度观察,美国经济复苏是一个漫长的过程,欧洲受制于债务危机泥潭,阴霾远远没有消除,日本经济也需要时间复苏。国内总需求出现减速现象,自去年四季度以来,密集的紧缩效果逐步显现,当前实体经济确实已从去年的过热状态逐步回归。很多上市公司的二、三季度业绩势必下滑。因此,在货币政策短期受制于通胀而无法放松的情况下,财政政策率先出现微调是大概率事件,政策放松的预期与企业的三季度实际业绩会出现一定的差距。展望三季度的证券市场,我们认为股票市场窄幅波动的可能性较大,结构性机会是主流。本基金在下个季度依然挑选有社会责任感的企业,结合企业的基本面,精选选择有企业家精神、激励机制完善、治理结构清晰、财务报表质量稳健的上市公司做中长期布局。

§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	1,905,501,164.47	33.91
	其中:股票	1,905,501,164.47	33.91
2	固定收益投资	50,040,000.00	0.89
	其中:债券	50,040,000.00	0.89
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,230,101,415.05	21.89
	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	2,430,059,921.32	43.24
6	其他资产	3,667,367.98	0.07
7	合计	5,619,369,868.82	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	381,833,011.91	7.04
C	制造业	1,050,295,564.79	19.37
C0	食品、饮料	379,324,975.69	6.99
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	101,246,752.68	1.87
C6	金属、非金属	865,015.00	0.02
C7	机械、设备、仪表	111,738,810.49	2.06
C8	医药、生物制品	457,120,010.93	8.43
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	27,376,480.00	0.50
H	批发和零售贸易	208,604,331.16	3.85
I	金融、保险业	102,565,380.31	1.89
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	134,826,396.30	2.49
	合计	1,905,501,164.47	35.14

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	600519	贵州茅台	1,350,478	287,152,137.14	5.29
2	600415	小商品城	7,799,970	95,861,631.30	1.77
3	002241	歌尔声学	3,275,044	83,120,616.72	1.53
4	600535	天士力	1,998,210	82,186,377.30	1.52
5	000968	煤气化	3,132,131	79,336,878.23	1.46
6	600123	兰花科创	1,763,041	73,659,852.98	1.36
7	000915	山大华特	3,987,181	70,373,744.65	1.30
8	600079	人福医药	3,108,035	68,563,252.10	1.26
9	600859	王府井	1,691,104	67,593,426.88	1.25
10	600062	双鹤药业	2,718,188	67,383,880.52	1.24

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	50,040,000.00	0.92
	其中:政策性金融债	50,040,000.00	0.92
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	50,040,000.00	0.92

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	080416	08农发16	500,000	50,040,000.00	0.92

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、处罚的情况。

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	1,000,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	587,987.40
4	应收利息	2,004,105.55
5	应收申购款	75,275.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,667,367.98

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存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§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	5,622,650,211.18
本报告期基金总申购份额	75,958.66
减:本报告期基金总赎回份额	179,927,613.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,442,798,556.82

§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社会责任股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富社会责任股票型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富社会责任股票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、报告期内汇添富社会责任股票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

汇添富增强收益债券型证券投资基金

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	汇添富增强收益债券
交易代码	519078
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年3月6日
报告期末基金份额总额	1,726,667,920.34份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,主要投资于债券等固定收益类品种和其他低风险品种,力求为基金份额持有人谋求持续稳定的投资收益。
投资策略	类属资产配置由本基金管理人根据宏观经济分析、债券基准收益率研究、不同类别债券利差水平研究,判断不同类别债券类属的相对投资价值,并确定不同债券类属在组合资产中的配置比例。
业绩比较基准	中债总指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。
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
下属两级基金简称	汇添富增强收益债券A / 汇添富增强收益债券C
下属两级交易代码	519078 / 470078
下属两级基金报告期末份额总额	1,701,262,141.22份 / 25,405,779.12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)	
	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C
1.本期已实现收益	7,506,246.54	173,620.33
2.本期利润	-3,842,346.86	-75,214.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0026	-0.0023
4.期末基金资产净值	1,746,320,341.95	25,911,632.52
5.期末基金份额净值	1.026	1.020

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

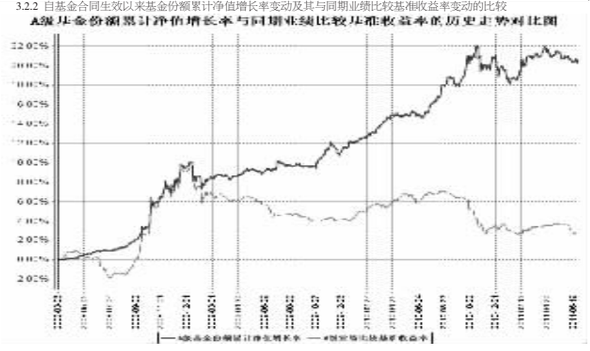
汇添富增强收益债券A

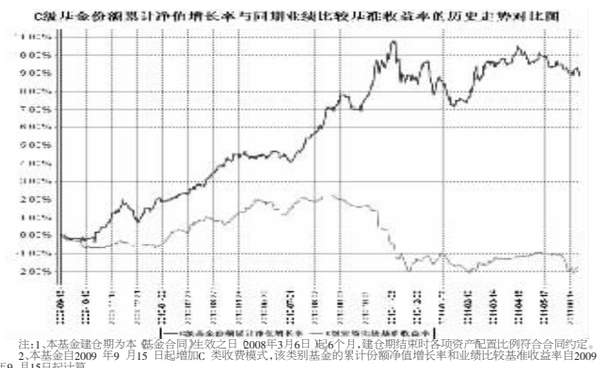
阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去三个月	-0.36%	0.13%	-0.52%	0.07%	0.16%	0.06%

汇添富增强收益债券C

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	-0.37%	0.14%	-0.52%	0.07%	0.15%	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:1.本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2008年3月6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.本基金自2009年9月15日起增加C类收费模式,该类别基金的累计份额净值增长率和业绩比较基准收益率自2009年9月15日起计算。

§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		
陆文磊	本基金的基金经理,汇添富货币市场基金的基金经理,汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理。	2008年3月6日	-	9年	国籍:中国,学历:华东师范大学金融学博士、相关业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾任上海中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。
王珏池	本基金的基金经理,汇添富货币市场基金的基金经理,汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。	2008年3月6日	2011年6月21日	17年	国籍:中国,学历:澳门科技大学管理学硕士、相关业务资格:证券