

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
重要提示: 基金管理人及基金托管人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...

汇添富策略回报股票型证券投资基金 2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日 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...

6.1 资产负债表 6.2 利润表 6.3 所有者权益变动表
单位: 人民币元
资产: 银行存款 54,590,088.62; 结算备付金 1,103,390.86; 存出保证金 1,607,673.05...

3.1 期间数据和指标 3.2 基金净值指标 3.3 基金业绩比较基准
报告期: 2011年1月1日至2011年6月30日
期间基金净值增长率: 3.37%; 业绩比较基准: 沪深300指数收益率*80%+上证国债指数*20%

3.3.1 基金业绩比较基准 3.3.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
阶段: 过去一个月 3.37%; 过去三个月 -2.90%; 过去六个月 -11.43%; 过去一年 20.00%

注: 1. 本期已实现投资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)扣除相关费用的余额...
注: 2. 本基金建仓期为2009年12月22日至2010年1月22日...

4.1 基金管理人及基金基金经理 4.2 基金经理
姓名: 李文 职务: 基金经理
任职日期: 2010年11月11日

5.1 基金投资组合报告 5.2 基金投资组合报告
期末公允价值: 958,278,394.03
权益类资产: 958,278,394.03

7.1 期末基金资产组合情况 7.2 期末按行业分类的股票投资组合
行业: 农林牧渔 0.00%; 医药生物 1.69%; 信息技术 1.80%; 金融保险 1.80%; 消费品 1.80%; 工业 1.80%; 公用事业 1.80%; 房地产 1.80%; 其他 1.80%; 合计 100.00%

7.3 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: 1 股票代码: 600415 股票名称: 小商品城 公允价值: 69,772,245.18

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
序号: 1 债券代码: 110015 债券名称: 石化转债 公允价值: 393,660

7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号: 1 权证代码: 069009 权证名称: 苏宁转债 公允价值: 39,836,000.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
序号: 1 合约名称: 沪深300股指期货 公允价值: 39,836,000.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
序号: 1 资产支持证券名称: 华安转债 公允价值: 39,836,000.00

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号: 1 权证代码: 069009 权证名称: 苏宁转债 公允价值: 39,836,000.00

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
序号: 1 合约名称: 沪深300股指期货 公允价值: 39,836,000.00

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
序号: 1 资产支持证券名称: 华安转债 公允价值: 39,836,000.00

7.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号: 1 权证代码: 069009 权证名称: 苏宁转债 公允价值: 39,836,000.00

7.12 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
序号: 1 合约名称: 沪深300股指期货 公允价值: 39,836,000.00

7.13 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
序号: 1 资产支持证券名称: 华安转债 公允价值: 39,836,000.00

7.14 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号: 1 权证代码: 069009 权证名称: 苏宁转债 公允价值: 39,836,000.00

6.4.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3 本报告期关联方交易
6.4.3.1 本报告期关联方交易
6.4.3.2 关联方交易
6.4.3.3 关联方交易

6.4.3.1 本报告期关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.2 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.3 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.4 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.5 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.6 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.7 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.8 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.9 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.10 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.11 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.12 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.13 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.14 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.15 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.16 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.17 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.18 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.19 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.20 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.21 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.22 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.23 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.24 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.25 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.26 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.27 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

6.4.3.28 关联方交易
关联方名称: 汇添富基金管理有限公司 与本基金的关系: 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

7.4.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票投资明细
序号: 1 股票代码: 600415 股票名称: 小商品城 本期累计买入金额: 69,772,245.18

7.4.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
序号: 1 债券代码: 110015 债券名称: 石化转债 公允价值: 393,660

7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号: 1 权证代码: 069009 权证名称: 苏宁转债 公允价值: 39,836,000.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
序号: 1 合约名称: 沪深300股指期货 公允价值: 39,836,000.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
序号: 1 资产支持证券名称: 华安转债 公允价值: 39,836,000.00

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号: 1 权证代码: 069009 权证名称: 苏宁转债 公允价值: 39,836,000.00

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
序号: 1 合约名称: 沪深300股指期货 公允价值: 39,836,000.00

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
序号: 1 资产支持证券名称: 华安转债 公允价值: 39,836,000.00

7.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号: 1 权证代码: 069009 权证名称: 苏宁转债 公允价值: 39,836,000.00

7.12 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
序号: 1 合约名称: 沪深300股指期货 公允价值: 39,836,000.00

7.13 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
序号: 1 资产支持证券名称: 华安转债 公允价值: 39,836,000.00

7.14 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号: 1 权证代码: 069009 权证名称: 苏宁转债 公允价值: 39,836,000.00

7.15 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
序号: 1 合约名称: 沪深300股指期货 公允价值: 39,836,000.00

7.16 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
序号: 1 资产支持证券名称: 华安转债 公允价值: 39,836,000.00

7.17 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号: 1 权证代码: 069009 权证名称: 苏宁转债 公允价值: 39,836,000.00

7.18 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
序号: 1 合约名称: 沪深300股指期货 公允价值: 39,836,000.00

7.19 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
序号: 1 资产支持证券名称: 华安转债 公允价值: 39,836,000.00

7.20 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号: 1 权证代码: 069009 权证名称: 苏宁转债 公允价值: 39,836,000.00

7.21 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
序号: 1 合约名称: 沪深300股指期货 公允价值: 39,836,000.00

7.22 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
序号: 1 资产支持证券名称: 华安转债 公允价值: 39,836,000.00

7.23 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号: 1 权证代码: 069009 权证名称: 苏宁转债 公允价值: 39,836,000.00

7.24 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
序号: 1 合约名称: 沪深300股指期货 公允价值: 39,836,000.00

7.25 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
序号: 1 资产支持证券名称: 华安转债 公允价值: 39,836,000.00

7.26 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号: 1 权证代码: 069009 权证名称: 苏宁转债 公允价值: 39,836,000.00

7.27 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
序号: 1 合约名称: 沪深300股指期货 公允价值: 39,836,000.00

7.28 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
序号: 1 资产支持证券名称: 华安转债 公允价值: 39,836,000.00