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:2011年8月24日

汇添富上证综合指数证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

§1 重要提示

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2011年8月18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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富上证综合指数
基金主代码	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
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	6,091,434,876.59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。

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

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 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(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	-20,384,408.30
本期利润	-39,318,543.79
加权平均基金份额本期利润	-0.0059
本期基金份额净值增长率	-1.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1160
期末基金资产净值	5,384,560,602.40
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(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。

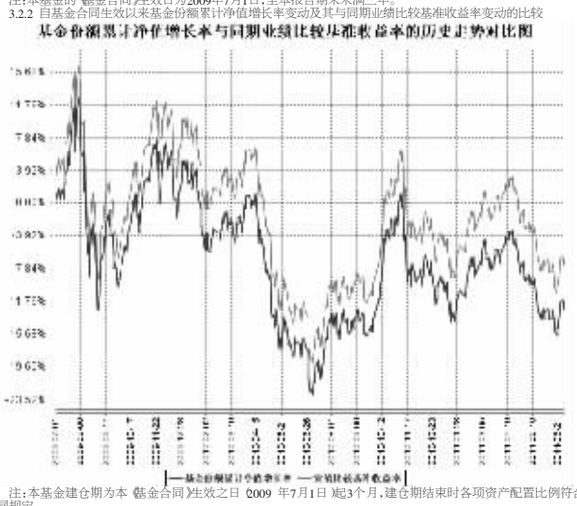
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	1.38%	0.99%	0.65%	1.00%	0.73%	-0.01%
过去三个月	-4.84%	0.95%	-5.38%	0.95%	0.54%	0.00%
过去六个月	-1.78%	1.02%	-1.55%	1.02%	-0.23%	0.00%
过去一年	13.04%	1.19%	14.42%	1.17%	-1.38%	0.02%
自基金合同生效日起至今	-11.60%	1.45%	-6.30%	1.44%	-5.30%	0.01%

注:本基金的《基金合同》生效日为2009年7月1日,至本报告期末未满三年。

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,公司总部设在上海陆家嘴。经过六年多的发展,公司已成为业务布局完善、管理体系严谨、团队稳定优秀、文化优势突出、品牌日益确立,具有较强综合竞争力的资产管理公司。公司业务覆盖公募基金管理、特定客户资产管理、QDII业务、社保委托投资管理等,并设立有北京分公司、南方分公司和汇添富资产管理(香港)有限公司(China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited)。截止2011年6月30日,公司管理证券投资基金规模达到545亿元,基金份额持有人户数超过183万,资产管理规模在行业内名列前茅。本报告期末,公司管理15只开放式证券投资基金,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、汇添富医药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。

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		
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 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

本基金为指数型基金,采用被动化投资跟踪上证综合指数的收益率,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 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

2011年上半年通货膨胀呈持续攀升态势,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股市场在1季度基本呈上涨态势,但随着2季度通胀的加剧,市场进入单边下跌的区间。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上证综合指数的投资目的。

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1.64%,本基金在报告期内累计收益率为-1.78%,同期业绩比较基准收益率为-1.55%,收益率落后业绩比较基准0.23%。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0.089%,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,在食品价格不发生大幅上涨的情况下,今年6、7月份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,投资的周期仍趋于向上,由于企业盈利能力上升引导的制造业投资周期向上,同时作为十二五的元年,来自保障房、水利和城市轨交等方面的地方政府主导投资将继续保持较高热情;实际消费方面,随着通胀高点的度过,以及政府关于收入分配政策的进一步落实,消费有望保持平稳增长;外围市场的复苏有不确定性,外需也受影响,但是我们预计出口增速不至于出现较大幅度下降,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,无论是与全球其他市场的相对估值来看,还是与历史估值水平相比来看,A股市场估值水平都处于较低的状态,市场估值底部有望在政策观察期内得到进一步抬升,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,其对投资者而言仍是非常有吸引力的。需要关注因食品价格上涨引起的通货膨胀超预期风险,进而引发的政策再次超调给股市带来的压力。

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。

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:每年度6月和12月的最后一个交易日每份基金份额可供分配利润超过0.02元时,至少将期末可供分配利润的20%进行收益分配。本基金本报告期末可供分配基金份额利润为-0.1160元,未达到收益分配的基准,因此本报告期本基金未进行利润分配。

§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

2011年上半年,本基金托管人在对汇添富上证综合指数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

2011年上半年,汇添富上证综合指数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上证综合指数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,汇添富上证综合指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对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

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上证综合指数证券投资基金2011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:汇添富上证综合指数证券投资基金

报告截止日:2011年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资 产:		
银行存款	217,327,319.60	155,284,697.55
结算备付金	260,529.17	126,941.53
存出保证金	416,666.65	583,333.31
交易性金融资产	5,159,813,255.75	6,475,938,084.01
其中:股票投资	5,062,483,255.75	6,278,778,084.01
基金投资	-	-
债券投资	97,330,000.00	197,160,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	12,159,627.62
应收利息	1,508,843.90	3,616,536.94
应收股利	9,181,351.08	-
应收申购款	1,275,006.27	1,878,397.89
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,389,782,972.42	6,649,587,618.85
负债和所有者权益	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	956,171.91	1,765,145.50
应付管理人报酬	3,249,374.52	4,306,886.93
应付托管费	649,874.92	861,377.38
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	157,628.37	797,032.78
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	209,320.30	426,896.55
负债合计	5,222,370.02	8,157,339.14
所有者权益:		
实收基金	6,091,434,876.59	7,381,183,450.73
未分配利润	-706,874,274.19	-739,753,171.02
所有者权益合计	5,384,560,602.40	6,641,430,279.71
负债和所有者权益总计	5,389,782,972.42	6,649,587,618.85

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值0.884元,基金份额总额6,091,434,876.59份。

6.2 利润表

会计主体:汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
一、收入	-9,159,347.36	-1,764,308,065.96
1.利息收入	3,090,732.94	1,745,760.84
其中:存款利息收入	630,765.29	961,339.52
债券利息收入	2,459,967.65	784,421.32
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	5,040,814.39	-15,446,216.52
其中:股票投资收益	-58,349,171.76	-61,352,467.50
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,507,152.89	2,064,943.18
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	57,882,833.26	43,841,307.80
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-18,934,135.49	-1,751,922,880.85
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,643,240.80	1,315,270.57
二、费用	30,159,196.43	31,417,534.96
1.管理人报酬	22,623,102.22	23,564,757.16
2.托管费	4,524,620.49	4,712,951.42
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,781,421.09	2,841,688.81
5.利息支出	12,182.74	69,502.69
其中:卖出回购金融资产支出	12,182.74	69,502.69
6.其他费用	217,869.89	228,634.88
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-39,318,543.79	-1,795,725,600.92
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-39,318,543.79	-1,795,725,600.92

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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)	7,381,183,450.73	-739,753,171.02	6,641,430,279.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-39,318,543.79	-39,318,543.79
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)	-1,289,748,574.14	72,197,440.62	-1,217,551,133.52
其中:1.基金申购款	370,372,296.93	-35,141,726.30	335,230,570.63
2.基金赎回款	-1,660,120,871.07	107,339,166.92	-1,552,781,704.15
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)	6,091,434,876.59	-706,874,274.19	5,384,560,602.40

项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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)	6,956,558,846.35	352,370,968.97	7,308,929,815.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,795,725,600.92	-1,795,725,600.92
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)	-138,715,508.72	-42,619,555.79	-181,335,064.51
其中:1.基金申购款	926,161,281.32	-55,227,090.26	870,934,191.06
2.基金赎回款	-1,064,876,790.04	12,607,534.47	-1,052,269,255.57
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)	6,817,843,337.63	-1,485,974,187.74	5,331,869,149.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.6财务报表由下列负责人签署:

林利军 陈灿辉 王小练

基金管理公司负责人 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

汇添富上证综合指数证券投资基金(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[2009]371号文《关于核准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的批复》的核准,由汇添富基金管理有限公司作为发起人向社会公开募集,基金合同于2009年7月1日生效,首次设立募集规模为9,097,758,651.47份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人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。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要包括上海证券交易所上市交易的所有股票、新股(如一级市场初次发行或增发)等。如以后法律法规及中国证监会允许基金投资其他金融工具,如股指期货、ETF等,本基金可以依照法律法规或监管机构的规定,将其纳入投资范围。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。本基金的业绩比较基准为:上证综合指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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》、证监会公告[2010]5号关于发布《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2011年6月30日的财务状况以及2011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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
东航金戎控股有限责任公司	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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	1,043,178,934.95	73.42%	516,633,411.18	28.71%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	2,626,092.50	2.90%	-	-

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011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	886,703.37	73.42%	80,949.24	51.35%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	438,861.17	28.70%	167,796.80	20.77%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	22,623,102.22	23,564,757.16
其中:支付销售机构的客户维护费	4,544,504.01	7,241,669.45

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.75%的年费率计提。计算方法如下:H=E×0.75%/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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,524,620.49	4,712,951.42

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.15%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金与关联方本期和上年度可比期间未通过银行间同业市场进行债券(回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
基金合同生效日(2009年7月1日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	43,496,625.00	43,496,625.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	43,496,625.00	43,496,625.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.71%	0.64%

6.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

6.4.8.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	217,327,319.60	628,586.12	174,071,801.06	927,718.65

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.9 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601998	中信银行	2011年6月29日	配股停牌	4.75	2011年7月7日	4.59	7,471,086	44,666,781.85	35,487,658.50	-
600315	上海家化	2010年12月6日	重组停牌	36.88	-	-	591,881	10,922,425.58	21,828,571.28	-
600021	上海电力	2011年5月31日	重大事项停牌	5.76	2011年7月28日	6.34	2,267,169	12,177,329.96	13,058,893.44	-
600098	广州控股	2011年6月20日	重大事项未公告	6.79	2011年7月8日	7.47	1,816,549	12,336,138.71	12,334,367.71	-
600170	上海建工	2011年6月29日	重组停牌	15.59	2011年7月4日	16.25	635,017	8,873,719.12	9,899,915.03	-
600369	西南证券	2011年3月1日	重组停牌	11.87	2011年8月16日	12.49	796,163	13,262,295.42	9,450,454.81	-
600216	浙江医药	2011年6月27日	重大事项停牌	31.39	2011年7月4日	32.60	125,538	3,427,270.32	3,940,637.82	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 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。