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:2012年3月30日

汇添富增强收益债券型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年12月31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2012年3月20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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2011年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富增强收益债券	
基金主代码	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	
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	1,299,977,741.77份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C
下属分级基金的交易代码:	519078	470078
报告期末下属分级基金的份额总额	1,288,245,573.42份	11,732,168.35份

2.2 基金产品说明

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。

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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市富城路99号贵旦国际大楼21楼 汇添富基金管理有限公司

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2011年		2010年		2009年	
	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C
本期已实现收益	37,679,752.04	763,258.51	151,349,610.09	4,440,488.83	115,250,270.52	6,776.73
本期利润	-18,440,257.55	212,121.29	145,455,812.91	9,735,404.73	12,344,525.55	21,548.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0127	0.0093	0.0755	0.1523	0.0054	0.0158
本期基金份额净值增长率	-1.33%	-1.52%	7.14%	6.77%	1.83%	1.53%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末		2010年末		2009年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0053	-0.0018	0.0874	0.0823	0.0579	0.0567
期末基金资产净值	1,295,120,716.92	11,710,827.30	1,911,732,793.52	33,635,692.03	1,522,185,981.70	2,106,433.84
期末基金份额净值	1.005	0.998	1.088	1.083	1.064	1.063

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(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。

4、本基金自2009年9月15日起增加C类收费模式,该模式只收取赎回费和销售服务费,不收取申购费。

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

汇添富增强收益债券A

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
过去三个月	2.45%	0.15%	3.24%	0.13%	-0.79%	0.02%
过去六个月	-2.05%	0.21%	2.97%	0.13%	-5.02%	0.08%
过去一年	-1.33%	0.20%	2.52%	0.11%	-3.85%	0.09%
过去三年	7.66%	0.17%	-2.89%	0.11%	10.55%	0.06%
自基金合同生效日起至今	17.95%	0.17%	5.88%	0.14%	12.07%	0.03%

注:本基金的(基金合同)生效日为2008年3月6日,至本报告期末未满五年。

汇添富增强收益债券C

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
过去三个月	2.36%	0.16%	3.24%	0.13%	-0.88%	0.03%
过去六个月	-2.16%	0.21%	2.97%	0.13%	-5.13%	0.08%
过去一年	-1.52%	0.20%	2.52%	0.11%	-4.04%	0.09%
自基金合同生效日起至今	6.75%	0.19%	1.09%	0.10%	5.66%	0.09%

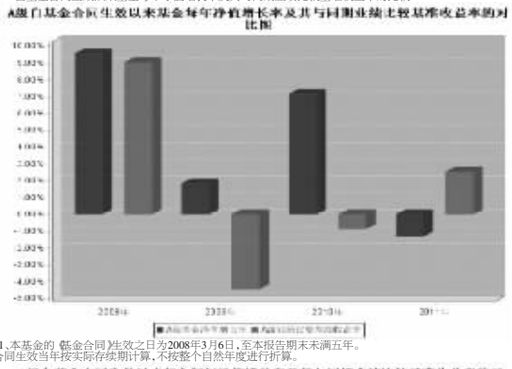
注:汇添富增强收益C类基金的基金分级日为2009年9月15日,至本报告期末未满三年。

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: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规定。

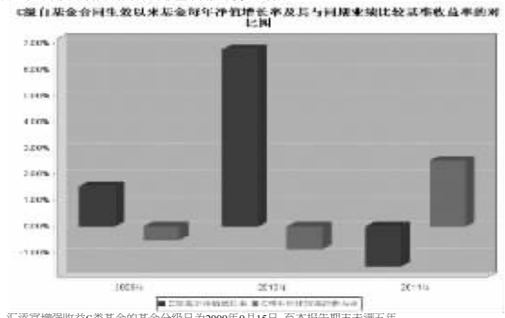
2、本基金自2009年9月15日起增加C类收费模式,该类别基金的累计份额净值增长率和业绩比较基准收益率自2009年9月15日起计算。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1、本基金的(基金合同)生效之日为2008年3月6日,至本报告期末未满五年。

2、合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。



注:1、汇添富增强收益C类基金的基金分级日为2009年9月15日,至本报告期末未满五年。

2、基金分级当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

汇添富增强收益债券A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011	0.700	88,347,022.55	28,900,174.27	117,247,196.82	-
2010	0.500	79,544,919.62	25,399,470.82	104,944,390.44	-
2009	0.200	31,523,991.48	13,946,423.66	45,470,415.14	-
合计	1.400	199,415,933.65	68,246,068.75	267,662,002.40	-
汇添富增强收益债券C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011	0.700	1,278,889.97	511,175.54	1,790,065.51	-
2010	0.500	1,012,369.03	236,872.89	1,249,241.92	-
2009	-	-	-	-	-
合计	1.200	2,291,259.00	748,048.43	3,039,307.43	-

§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成立于2005年2月,总部设在上海陆家嘴,公司旗下设立了北京分公司、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)。

截至2011年12月,汇添富资产管理规模接近600亿元人民币,是业内最早一批获得QDII资格、最早一批开展专户业务、首批获得RQFII资格的基金管理公司,同时也是全国社会保障基金的投资管理人。经过七年的发展,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,具有较强综合竞争实力的资产管理公司。

2011年,汇添富大力发展公募基金业务,全年新发7只基金,分别是汇添富保本混合基金、汇添富社会责任股票型基金、汇添富可转换债券基金、汇添富黄金及贵金属基金、汇添富深证300ETF基金及其联接基金、汇添富信用债债券基金。目前,公司共管理19只证券投资基金,形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征的产品线。

汇添富始终坚持"以企业基本分析为立足点,挖洗高质量的证券,把握市场脉络,做中长期投资布局,以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益"这一长期价值投资理念,并在投资研究中坚定有效地贯彻和执行。2011年,汇添富整体投资业绩继续保持行业优秀。

2011年,汇添富专户业务快速发展,在全年市场大幅下跌的背景下,13只专户组合当年实现了正收益,专户业务综合实力和竞争力进一步提升。

2011年,汇添富国际业务取得重大突破,成为业内第一批获得RQFII资格、第一批获得RQFII外汇额度、第一批获得香港证监会产品批文、第一家在港正式发行RQFII产品的基金公司。

2011年,汇添富正式开展社保组合管理,是业内少数几家在权益类和固定收益类产品上同时和社保展开合作的基金公司之一。

2011年,汇添富电子商务业务实现跨越式发展,公司推出全国首张货币市场基金直接支付消费账单的信用卡——"惜富信用卡"。该卡集信用卡消费信贷功能和基金投资功能于一体,开创了"货币基金支付消费账单"的新模式,在"2012 WORLD营销大会"中,"惜富信用卡"营销项目获得2011年度金麒麟奖中的最佳互动创新奖。

2011年,汇添富力实现贴心的客户服务与投资者教育工作。公司积极开展"惜富通行证升级"、"定投计算器"等活动,得到广大客户的大力支持和踊跃参与。同时,公司进一步大力开展"投资者见面会"、"惜富之约"客户沙龙、投资者"走进汇添富"和"走进上市公司"等全方位的投资者服务与教育活动。

2011年,汇添富持续推进社会慈善事业,积极探索企业慈善公益事业新形式,不断丰富公益活动新内容,持续推进公益项目长期建设。在上海汇添富社会基金会的整体平台下,汇添富积极与社会组织、企业团体合作,举办了众多有影响力的活动,提升了基金业的整体社会形象。

展望2012年,基金行业仍将面临巨大的压力和挑战。汇添富全体员工将进一步发扬"匠直、激情、团队、客户第一、感恩"的企业价值观,不畏困难,以更加积极的心态,大力深化变革,全面提升公司核心竞争力,为实现汇添富基金中长期发展目标打下更加坚实的基础,为中国基金业的繁荣发展做出贡献。

2011年,汇添富凭借稳健的经营管理和优秀业绩,荣获权威机构评选的多个奖项:

1.汇添富优势精选混合基金荣获《中国证券报》评选的2010年度"金基金?业绩优胜混合型金牌基金"。

2.汇添富基金荣获《上海证券报》评选的2010年度"金基金?创新公司奖"。

3.汇添富策略回报股票基金荣获《上海证券报》评选的2010年度一年期"金基金?主动型股票基金奖"。

4.汇添富基金荣获《证券时报》评选的"2010年度十大明星基金公司奖"。

5.汇添富策略回报股票基金荣获《证券时报》评选的"2010年度股票型明星基金奖"。

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		
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:曾任上海申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、汇添富信用债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:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任申银万国证券股份有限公司固定收益总部投资部经理。2005年4月加入汇添富基金管理有限公司任交易主管,2006年3月23日至今任汇添富货币市场基金的基金经理,2008年3月6日至2011年6月21日任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理,2011年6月17日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理,2011年12月20日至今任汇添富信用债债券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、证监会规定的有关规定,在投资决策、风控、合规、内部交易等方面,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,涵盖了投资决策、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

本基金为债券型基金,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,公司公平交易制度的执行情况良好,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年经济呈现高位回落的运行趋势,GDP增长率逐季回落,到四季度已低于9%。经济回落的原因主要有二:一是欧债危机愈演愈烈,希腊、西班牙、意大利等高债务国纷纷陷入主权债务困境,国债融资成本大幅攀升,严重拖累了发达国家经济复苏,造成外需偏弱;二是国内宏观调控持续收紧,2011年政府对房地产调控力度不断升级,货币政策也明显收紧,造成了内需尤其是投资需求增速放缓。在经济回落的同时,2011年物价大幅上升,全年CPI平均涨幅达到5.4%,显著高于调控目标。通胀压力高企也导致全年货币政策始终以防通胀为首要目标,央行全年共加息3次,准备金率上调6次,屡创历史新高,全年金融市场流动性与前两年相比明显收紧,回购利率大幅飙升。年底政策有所微调,12月份央行下调准备金率0.5个百分点,为2009年以来首次下调。

2011年债券市场先抑后扬,一到三季度受货币政策紧缩和通胀压力持续上升的影响,市场整体上以持续下跌为主,债券收益率一度大幅上升,到四季度随着经济和通胀回落的趋势日趋明朗,政策出现微调迹象,债券市场出现了较大幅度的反弹,国债、金融债和高信用等级的企业债涨幅最大,可转债、低信用等级的企业债则出现下跌。本基金在2011年大部分时间以规避风险为主,上半年我们转换高比例配置了企业债,以获取利息收益,在二季度末大幅减持了企业债,较好的规避了之后企业债大幅下跌的风险,但可转债配置比例偏高,对基金业绩产生了一定的负面影响。三季度末基于对市场乐观的判断,我们提高组合久期,增持了中长期金融债和高信用等级中票、企业债的配置比例,较好的分享了四季度债券市场的上涨。全年本基金仅少量参与了新股的申购。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,汇添富增强收益债券A净值增长-1.33%,汇添富增强收益债券C净值增长-1.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业业绩的简要展望

2012年基本面环境仍然复杂,从世界经济来看,欧债危机远未平息,高债务国的偿债和融资困境会成为经济最大的潜在不稳定因素,欧元区经济增长可能面临萎缩,美国的情况好于欧洲,但也面临政府削减财政赤字的压力,美国经济有望延续复苏态势,但复苏力度不会很强。从国内经济来看,一方面,在世界经济增长偏弱的情况下,外需可能进一步放缓,另一方面,房地产市场的调整远未结束,房地产投资面临大幅放缓的风险,并将影响整个固定资产投资的增长。预计2012年国内经济增长可能下滑至8.5%左右。在经济周期下行的情况下,2012年通胀压力将明显减轻,全年CPI涨幅有望回落至3%左右。随着通胀压力减轻,货币政策将有所放松,预计存款准备金率全年仍有1.5-2%的下调空间,央行有望降息1-2次,总体上,全年货币和流动性环境整体上将好于2011年。

由于2012年上半年经济和通胀回落趋势较为确定,债券市场仍存在投资机会,但考虑到截止2011年末国债、金融债等信券券收益率已经处于较低水平,未来收益率继续下降的空间有限,而信用债券的信用利差仍然处于高位,企业债、公司债、中期票据等信用类债券的投资机会相对更大。此外,可转债目前整体估值水平也处于低位,随着股票市场的波动,可转债也有望提供一定的阶段性投资机会。本基金管理人将密切关注经济和通胀走势、货币政策以及流动性环境等方面的变化,灵活调整债券组合的久期和债券结构,我们将更加注重绝对收益,更加注重债券资产对组合收益的贡献,控制可转债、新股等波动率较高的资产的投资比例,力争在控制风险的前提下进行投资,降低基金的波动率,为投资者创造持续稳定的收益。

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、固定收益部、集中交易室、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,可以提议调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致性。

报告期内,本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

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:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,A类基金全年分配比例不得低于年度可供分配收益的25%,C类基金每次分配比例不得低于可供分配收益的25%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

本基金于2011年6月24日实施利润分配,每份基金份额派发红利0.07元人民币。

§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,本基金托管人在对汇添富增强收益债券型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,汇添富增强收益债券型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增强收益债券型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,汇添富增强收益债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为119,037,262.33元。

5.3 托管人对本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增强收益债券型证券投资基金2011年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 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所审计,注册会计师徐艳、汤骏于2012年3月29日签字出具了安永华明(2012)审字第60466941_B06号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:汇添富增强收益债券型证券投资基金

报告截止日:2011年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产:		
银行存款	19,042,892.47	51,292,752.90
结算备付金	294,568.07	511,113.05
存出保证金	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	1,277,000,694.72	1,865,622,557.66
其中:股票投资	62,186,887.95	225,039,614.78
基金投资	-	-
债券投资	1,214,813,806.77	1,640,582,942.88
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	-	-
应收利息	17,115,182.61	20,413,387.84
应收股利	-	-
应收申购款	142,929.36	9,450,812.78
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,313,846,267.23	1,947,540,624.23
负债和所有者权益	**本期末 2011年12月31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	5,000,000.00	-
应付证券清算款	1,902.78	-
应付赎回款	504,921.38	142,818.17
应付管理人报酬	692,013.91	993,971.44
应付托管费	230,671.31	331,323.84
应付销售服务费	3,973.27	7,089.75
应付交易费用	10,752.60	46,908.52
应交税费	-	-
应付利息	336.11	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	570,151.65	650,026.96
负债合计	7,014,723.01	2,172,138.68
所有者权益:		
实收基金	1,299,977,741.77	1,787,365,914.91
未分配利润	6,853,802.45	158,002,570.64
所有者权益合计	1,306,831,544.22	1,945,368,485.55
负债和所有者权益总计	1,313,846,267.23	1,947,540,624.23

注:报告截止日2011年12月31日,添富增收(A类)基金份额净值1.005元,添富增收(C类)基金份额净值0.998元;添富增收基金份额总额1,299,977,741.77份(其中A类1,288,245,573.42份,C类11,732,168.35份)。

7.2 利润表

会计主体:汇添富增强收益债券型证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入	-2,475,086.28	177,801,418.47
1.利息收入	49,728,800.99	57,155,108.91
其中:存款利息收入	898,262.35	1,724,235.76
债券利息收入	48,080,751.54	55,350,791.19
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	749,787.10	80,081.96
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	4,185,963.49	120,624,997.16
其中:股票投资收益	20,586,203.04	72,536,607.16
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-16,842,051.80	47,952,302.44
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	441,812.25	136,087.56
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-56,671,146.81	-598,881.28
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	281,296.05	620,193.68
减:二、费用	15,753,049.98	22,610,200.83
1.管理人报酬	9,296,673.96	12,910,017.24
2.托管费	3,098,891.38	4,303,339.05
3.销售服务费	98,185.75	284,910.95
4.交易费用	731,828.80	862,795.41
5.利息支出	2,077,732.33	3,794,178.84
其中:卖出回购金融资产支出	2,077,732.33	3,794,178.84
6.其他费用	449,737.76	454,959.34
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-18,228,136.26	155,191,217.64

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富增强收益债券型证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31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)	1,787,365,914.91	158,002,570.64	1,945,368,485.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-18,228,136.26	-18,228,136.26
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)	-487,388,173.14	-13,883,369.60	-501,271,542.74
其中:1.基金申购款	766,586,080.77	50,143,686.64	816,729,767.41
2.基金赎回款	-1,253,974,253.91	-64,027,056.24	-1,318,001,310.15
四、本期向基金分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-119,037,262.33	-119,037,262.33
五、期末所有者权益(基金净值)	1,299,977,741.77	6,853,802.45	1,306,831,544.22
项目	**上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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)	1,432,245,307.23	92,047,108.31	1,524,292,415.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	155,191,217.64	155,191,217.64
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)	355,120,607.68	16,957,877.05	372,078,484.73
其中:1.基金申购款	1,971,440,425.55	151,694,370.14	2,123,134,795.69
2.基金赎回款	-1,616,319,817.87	-134,736,493.09	-1,751,056,310.96
四、本期向基金分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-106,193,632.36	-106,193,632.36
五、期末所有者权益(基金净值)	1,787,365,914.91	158,002,570.64	1,945,368,485.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富增强收益债券型证券投资基金(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")证监基金字[2007]346号文《关于核准汇添富增强收益债券型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发行募集,基金合同于2008年3月6日正式生效,首次设立募集规模为5,049,981,789.51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公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司和汇添富基金管理公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金C类收费模式的推出时间为2009年9月15日。自该日起,投资人可选择按照原有前端收取申购费和赎回费的A类模式,亦可选择按照不收取前端申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的C类收费模式申购本基金份额,但C类基金份额不能通过上海证券交易所开放式基金销售系统进行场内申购,只能通过场外销售机构购买。

本基金对债券等固定收益类品种的投资比例为基金资产的80%-100%,现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,股票(包括购新股所得,不在二级市场买入)等权益类品种的投资比例为基金资产的0-20%。本基金建立了自上而下和自下而上两方面的研究流程,自上而下的研究包含宏观基本面分析、资金技术面分析,自下而上的研究包含信用分析、个券分析、创新金融工具和交易策略分析,由此形成宏观和微观层面相配套的研究决策体系,最后形成具体的投资策略。

本基金的业绩比较基准为:中债总指数。

7.4.2 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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2011年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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相一致。

7.4.5 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。

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》,对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入,由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴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。

7.4.7 关联方关系

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司