

## 汇添富保本混合型证券投资基金

## [2012] 第一季度报告

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:2012年4月24日

基金管理人的董事会及董事保证本报告不存在虚假记载、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2012年4月20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。本基金复核后不存在虚假记载、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。

本报告期内财务资料未经审计。

§ 1 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

基金经理生效日 2011年1月26日

报告期末基金份额总额 1,816,014,360.62份

本基金主要通过保险保障技术来运作，在保证本金安全的前提下，力争在本报告期内实现基金资产的稳健增值。

本基金将按照投资组合保险技术的要求动态调整本产品的风险资产比例，以确保基金在任何时间点后的净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增值保值的目的，在此基础上将通过严谨的量化分析和定期的专题研讨，精选优质股票和债券资产进行投资布局，以实现基金资产最大限度的增值。

三年定期定额申购后收益率

风险收益特征 本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种。

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

单位:人民币元

报告期(2012年1月1日 - 2012年3月31日)

1.本期已实现收益 9,933,181.11

2.本期利润 29,488,358.12

3.加权平均基金份额本期利润 0.0153

4.期末基金资产净值 1,865,251,148.44

5.期末基金份额净值 1.027

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.所列数据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据。

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 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.48% 0.13% 1.21% 0.02% 0.27% 0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金的 资金合同生效日为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 资金合同生效之日起6个月,建仓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 任职日期 离任日期 说明

陆文麟 本基金的基金经理,汇添富增强收益债券型基金的基金经理。 2011年1月26日 - 10年

国籍:中国,学历:华东理工大学金融学博士,相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任申银万国证券研究所研究员,2007年1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1月26日在任汇添富保本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“离任日期”为根据公司决议确定的辞职日期;

2.非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3.基金经理的变更由基金管理人根据法律法规、证监会公告、基金合同的约定办理,并予以公告;

4.2 管理人对报告期内本基金运作情况的说明

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、证监会公告及基金合同的约定,勤勉尽责地履行诚实守信、受托管理原则和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为持有人谋取利益,使基金资产得到保值增值。

本基金管理人在本报告期内严格执行公平交易制度,确保公平对待所有客户,在研究分析、投资决策、投资交易、业绩评估、风险管理等方面均实行公平交易,确保公平对待所有客户。

本基金管理人在本报告期内严格执行基金资产估值政策,在估值方法的选择和参数设置、估值程序、尤其是定价模型和定价参数的确定方面,严格按照有关规定执行,确保估值公允、合理。

4.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内,本基金管理人对投资交易全过程实施了严格的监控、分析和检查,未发现任何异常交易行为。

4.4 报告期内,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 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 M10168 10京投MTN2 1,000,000 99,120,000.00 5.31

2 M11024 11苏国资 MTN1 800,000 80,680,000.00 4.33

3 110203 11国电03 800,000 80,112,000.00 4.29

4 120401 12农发01 600,000 59,694,000.00 3.20

5 M00940 09沪电力 MTN2 600,000 59,340,000.00 3.18

5.5 报告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 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 M10168 10京投MTN2 1,000,000 99,120,000.00 2.68

2 行业票据 96,735,000.00 5.19

3 金融债券 291,031,000.00 15.60

4 中央政策性金融债 291,031,000.00 15.60

5 企业短期融资券 434,020,999.60 23.27

6 企业中期票据 151,766,000.00 8.14

7 可转债 622,805,000.00 33.39

8 其他 16,837,711.94 0.90

9 合计 6,155,000.00 30.30

5.5.2 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 600697 欧亚集团 499,985 11,734,647.95 0.63

2 601117 中国化学 2,000,000 11,700,000.00 0.63

3 601669 中国水电 2,300,000 10,325,000.00 0.55

4 000888 丽珠集团 A 425,014 7,892,509.98 0.42

5 600805 悦达投资 500,000 5,615,000.00 0.30

6 601800 中国交建 1,006,000 5,603,420.00 0.30

7 600581 信孚高科 86,209 2,684,548.26 0.14

8 600306 招商银行 199,987 2,379,845.30 0.13

9 600612 东飞祥 75,043 2,014,904.55 0.11

10 600079 人福医药 100,000 1,801,000.00 0.10

5.5.3 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 M10168 10京投MTN2 1,000,000 99,120,000.00 2.68

2 行业票据 96,735,000.00 5.19

3 金融债券 291,031,000.00 15.60

4 中央政策性金融债 291,031,000.00 15.60

5 企业短期融资券 434,020,999.60 23.27

6 企业中期票据 151,766,000.00 8.14

7 可转债 622,805,000.00 33.39

8 其他 16,837,711.94 0.90

9 合计 6,155,000.00 30.30

5.5.4 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 125709 唐钢转债 12,508,060.74 0.67

2 113001 中行转债 4,329,651.20 0.23

5.5.5 报告期末前十名股票中有存在流通受限股票。

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

5.6 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000895 双汇发展 2,089,083.34 0.11

2 110203 国电南瑞 221,511,995.75

3 120401 12农发01 300,000.00

4 110015 石化债 2,034,721,273.03

5.6.1 本基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的辞职日期;

2.非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3.基金经理的变更由基金管理人根据法律法规、证监会公告、基金合同的约定办理,并予以公告;

4.2 管理人对报告期内本基金运作情况的说明

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、证监会公告及基金合同的约定,勤勉尽责地履行诚实守信、受托管理原则和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为持有人谋取利益,使基金资产得到保值增值。

本基金管理人在本报告期内严格执行公平交易制度,确保公平对待所有客户,在研究分析、投资决策、投资交易、业绩评估、风险管理等方面均实行公平交易,确保公平对待所有客户。

本基金管理人在本报告期内严格执行基金资产估值政策,在估值方法的选择和参数设置、估值程序、尤其是定价模型和定价参数的确定方面,严格按照有关规定执行,确保估值公允、合理。

4.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内,本基金管理人对投资交易全过程实施了严格的监控、分析和检查,未发现任何异常交易行为。

4.4 报告期内,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 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 M10168 10京投MTN2 1,000,000 99,120,000.00 2.68

2 行业票据 96,735,000.00 5.19

3 金融债券 291,031,000.00 15.60

4 中央政策性金融债 291,031,000.00 15.60

5 企业短期融资券 434,020,999.60 23.27

6 企业中期票据 151,766,000.00 8.14

7 可转债 622,805,000.00 33.39

8 其他 16,837,711.94 0.90

9 合计 6,155,000.00 30.30

5.6.2 本基金的首任基金经理,其“任职日期