汇添富上证综合指数证券投资基金

【2012】第二季度报告

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7月18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2012年7月16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2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富上证综合指数
交易代码	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
报告期末基金份额总额	6,228,885,300.84份
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。
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(2012年4月1日 - 2012年6月30日)
1.本期已实现收益	50,699,170.76
2.本期利润	-1,595,215.65
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0003
4.期末基金资产净值	4,585,490,964.38
5.期末基金份额净值	0.736

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。

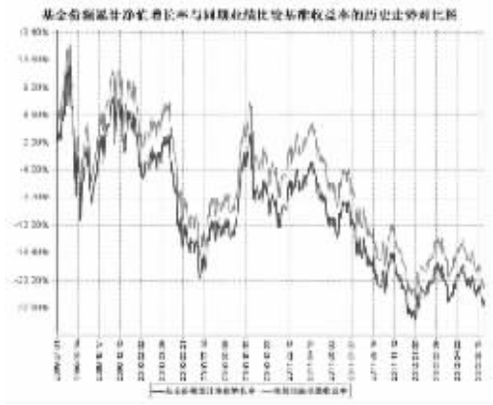
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.14%	0.90%	-1.56%	0.91%	1.42%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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		
吴振翔	本基金的基金经理,深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。	2010年2月5日	-	6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,2011年9月16日至今任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2011年9月28日至今任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

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

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各投资组合、各投资市场、各投资标的,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年2季度通货膨胀加速回调,市场处于对实体经济增速的担忧和对政策放松的预期之间纠结中,一方面经济数据持续恶化,另一方面降准和降息同时并行,在这两种因素主导下,A股市场在二季度走出了先扬后抑的行情。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业绩比较基准的投资目的。

本基金对抽样复制组合继续采取缓冲式调整,以降低了冗余的交易量,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

上证综合指数下跌了1.65%,本基金在报告期内累计收益率为-0.14%,同期业绩比较基准收益率为-1.56%,收益率领先业绩比较基准1.42%。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0.103%,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,本基金倾向于认为CPI和经济增速都会处于一个筑底过程,投资者需警惕因货币放松引起通胀的反弹,这将很大程度上抑制政策放松的力度,需要关注成品油、食品等价格的变化方向,由于前期PPI数据的快速下滑,企业盈利水平将出现较大的下滑,上市公司半年报期待不大,进出口增速是不稳定的,而且出于民生考虑房地产市场的调控仍将保持一定力度,在此种大背景下,央行在短期可能继续施行结构型积极的财政政策和微调的货币政策。外围市场中,全球经济复苏持续放缓,美国经济数据时好时坏,欧洲长期问题仍待解决,从而继续影响我国的外需增速。从保增长和确保经济软着陆的角度来看,政策在短期可能出现超预期,这将给股票市场带来短期的投资机会。

整体来看,2012年A股市场将处于底部震荡形态,目前A股市场经过前期的大幅调整,估值水平已处于历史低位,下降空间相对有限。如果经济筑底成功,A股市场将出现较好的投资机会,目前也是投资者逐步进场的可选择时机。

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。

§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	4,284,637,059.54	93.34
	其中:股票	4,284,637,059.54	93.34
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	274,727,841.71	5.99
6	其他资产	30,779,294.04	0.67
7	合计	4,590,144,195.29	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	21,843,745.13	0.48
B	采掘业	831,134,626.22	18.13
C	制造业	1,087,184,210.23	23.71
C0	食品、饮料	167,413,626.26	3.65
C1	纺织、服装、皮毛	20,940,599.74	0.46
C2	木材、家具	8,253,807.43	0.18
C3	造纸、印刷	8,294,375.95	0.18
C4	石油、化学、塑胶、塑料	106,895,090.24	2.33
C5	电子	49,341,821.44	1.08
C6	金属、非金属	216,997,976.84	4.73
C7	机械、设备、仪表	365,615,147.15	7.97
C8	医药、生物制品	132,794,429.34	2.90
C99	其他制造业	10,637,335.84	0.23
D	电力、煤气及水的生产和供应业	176,229,811.57	3.84
E	建筑业	133,182,523.76	2.90
F	交通运输、仓储业	195,508,639.18	4.26
G	信息技术业	99,942,395.08	2.18
H	批发和零售贸易	96,568,621.60	2.11
I	金融、保险业	1,372,495,031.97	29.93
J	房地产业	149,473,716.70	3.26
K	社会服务业	53,749,736.88	1.17
L	传播与文化产业	20,304,121.21	0.44
M	综合类	47,019,880.01	1.03
	合计	4,284,637,059.54	93.44

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601857	中国石油	43,990,035	398,109,816.75	8.68
2	601288	农业银行	83,788,153	217,011,316.27	4.73
3	601988	中国银行	59,802,100	168,641,922.00	3.68
4	600028	中国石化	19,030,786	119,893,951.80	2.61
5	600016	民生银行	18,349,549	109,913,798.51	2.40
6	601628	中国人寿	5,911,754	108,185,098.20	2.36
7	601088	中国神华	4,681,746	105,245,650.08	2.30
8	600036	招商银行	9,214,871	100,626,391.32	2.19
9	601328	交通银行	21,466,227	97,456,670.58	2.13
10	600519	贵州茅台	294,693	70,475,830.95	1.54

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注: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

注: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、处罚的情形。

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	400,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	28,884,202.56
4	应收利息	50,626.85
5	应收申购款	1,444,464.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,779,294.04

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

5.8.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未进行积极投资,不存在流通受限情况。

§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	6,208,232,917.94
本报告期基金总申购份额	246,186,141.84
减:本报告期基金总赎回份额	225,533,758.94
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,228,885,300.84

§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上证综合指数证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富上证综合指数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、报告期内汇添富上证综合指数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
2012年7月18日

汇添富价值精选股票型证券投资基金

【2012】第二季度报告

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7月18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2012年7月16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2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富价值精选股票
交易代码	519069
前端交易代码	519069
后端交易代码	519070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年1月23日
报告期末基金份额总额	2,302,519,273.06份
投资目标	本基金精选价值相对低估的优质公司股票,在有效管理风险的前提下,追求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金采用灵活积极的资产配置和股票投资策略。在资产配置中,通过以宏观经济及宏观经济政策分析为核心的情景分析法来确定投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例,并结合对市场估值、市场资金、投资主体行为和市场信心影响等因素的综合判断进行灵活调整;在股票投资中,采取"自下而上"的策略,优选价值相对低估的优质公司股票构建投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得长期持续稳健的投资收益。本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×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风险较高收益的品种。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年4月1日 - 2012年6月30日)
1.本期已实现收益	-15,916,668.96
2.本期利润	128,503,266.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.0511
4.期末基金资产净值	2,475,239,939.70
5.期末基金份额净值	1.075

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。

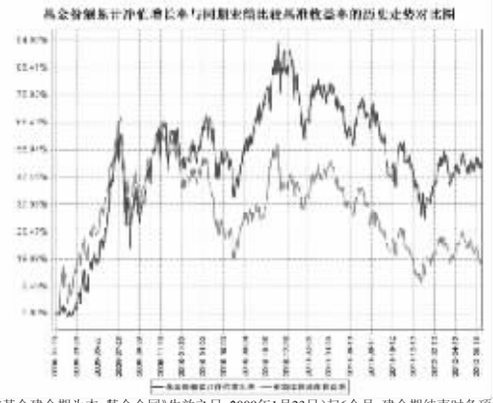
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.98%	0.87%	0.41%	0.90%	4.57%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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1月23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。

§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		
陈晓翔	本基金的基金经理。	2009年1月23日	-	11年	国籍:中国。学历:南京理工大学产业经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任宁波中根国际仓储运输有限公司业务员、华泰证券有限责任公司行业研究员、上海申银万国研究所有限责任公司行业研究员、建信基金管理有限公司行业研究员。2007年4月加入汇添富基金管理有限公司任行业研究员,2009年1月23日至今任汇添富价值精选股票型证券投资基金的基金经理,2010年1月8日至2012年3月2日任汇添富均衡增长股票型基证券投基金的基金经理。

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

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各投资组合、各投资市场、各投资标的,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度,国内外经济延续低迷走势,国内工业企业利润增长持续放缓,分析师不断下调上市公司盈利预测,国外欧债危机仍然是短期焦点,欧洲经济陷入衰退深渊,美国经济虽然处于复苏阶段但力度也较弱。政策方面,在坚持"调结构"的基础上,中央政府采取了降准、降息等预调微调政策,避免经济出现硬着陆。受以上各种因素影响,A股市场二季度呈现小幅反弹后逐级回落的走势,沪深300指数二季度微涨0.3%,分行业看,二季度两极分化现象十分明显,医药、食品原料、房地产、公用事业等行业领涨大盘,当季涨幅均超过8%,而钢铁、采掘等行业居跌幅榜前列,跌幅也超过8%。

添富价值在本季度延续了此前的投资策略,继续超配大消费行业并保持了估值处于历史底部的金融股的较高配置比例,总体上看上述策略在二季度取得了较好的超额收益。但受非对称降息影响,银行股出现较大跌幅;组合中超配的商业零售板块表现也较为低迷,对基金业绩造成一定拖累。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2012年二季度,添富价值收益4.98%,同期沪深300指数业绩比较基准收益0.3%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们认为国内外经济形势仍然严峻,海外方面欧债危机短期难以根治,欧洲经济有可能出现持续衰退的局面,美国经济虽然有所复苏但力度偏弱;国内方面产能过剩问题严重,普通制造业盈利前景不容乐观,经济转型和调结构是一个循序渐进较为漫长的过程,在出口、投资两架马车同时放缓的情况下,如何保持经济的较平稳增长并找到新的驱动力是对中央政府和各主管部门的一个考验。

证券市场方面,我们认为A股市场整体估值水平处于历史低位,结构分化迹象越来越明显,在大多数股票表现低迷之时,少数有核心竞争力和定价能力、具备持续较快增长潜力的个股得到了较高的估值溢价。因此,我们下半年的工作重点是继续保持积极的心态,通过自下而上深入研究寻找具有良好盈利模式、优秀管理团队、合理估值水平的公司,通过中长期持股来获取长期较好的回报。

§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	2,256,210,556.45	89.36
	其中:股票	2,256,210,556.45	89.36
2	固定收益投资	58,547,300.00	2.32
	其中:债券	58,547,300.00	2.32
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	167,025,568.37	6.62
6	其他资产	42,977,077.43	1.70
7	合计	2,524,760,502.25	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	14,262,751.90	0.58
B	采掘业	78,016,402.00	3.15
C	制造业	586,617,774.04	23.70
C0	食品、饮料	148,273,000.00	5.99
C1	纺织、服装、皮毛	6,526,449.80	0.26
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	105,520,774.70	4.26
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	51,937,251.20	2.10
C8	医药、生物制品	264,060,298.34	10.67
C99	其他制造业	10,300,000.00	0.42
D	电力、煤气及水的生产和供应业	131,227,620.15	5.30
E	建筑业	243,614,910.49	9.84
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	154,171,337.90	6.23
H	批发和零售贸易	319,215,020.48	12.90
I	金融、保险业	407,459,179.34	16.46
J	房地产业	104,518,862.32	4.22
K	社会服务业	212,733,063.95	8.59
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	4,373,633.88	0.18
	合计	2,256,210,556.45	91.15

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	620,000	148,273,000.00	5.99
2	600036	招商银行	12,000,000	131,040,000.00	5.29
3	600697	欧亚集团	5,005,000	114,464,350.00	4.62
4	000961	中南建设	8,999,877	112,138,467.42	4.53
5	600694	大商股份	3,092,104	103,430,878.80	4.18
6	600000	浦发银行	12,000,000	97,560,000.00	3.94
7	000501	鄂武商A	5,999,986	89,279,791.68	3.61
8	002159	三特索道	5,980,000	83,301,400.00	3.37
9	002081	金螳螂	2,025,507	69,914,521.03	2.82
10	601318	中国平安	1,500,000	68,610,000.00	2.77

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	48,425,000.00	1.96
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	10,122,300.00	0.41
8	其他	-	-
9	合计	58,547,300.00	2.37

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	1101086	11央票86	500,000	48,425,000.00	1.96
2	110018	国电转债	90,000	10,122,300.00	0.41

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

注: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

注: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、处罚的情形。

5.8.2

本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,386,806.39
2	应收证券清算款	38,835,099.78
3	应收股利	314,996.40
4	应收利息	1,176,798.19
5	应收申购款	263,376.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,977,077.43

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	110018	国电转债	10,122,300.00	0.41

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002081	金螳螂	39,894,521.03	1.61	非公开发行

§6 开放式基金份额变动

单位:份

序号	2,637,930,531.10
本报告期基金总申购份额	240,824,627.38
减:本报告期基金总赎回份额	576,235,885.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,302,519,273.06

§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价值精选股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富价值精选股票型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富价值精选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、报告期内汇添富价值精选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
2012年7月18日

汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金

【2012】第二季度报告

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7月18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2012年7月16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2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富蓝筹稳健混合
交易代码	519066
前端交易代码	519066
后端交易代码	519067
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月8日
报告期末基金份额总额	354,009,666.10份
投资目标	通过投资于价值相对低估的蓝筹公司股票,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为灵活配置混合型基金,属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年4月1日 - 2012年6月30日)
1.本期已实现收益	-7,033,828.40
2.本期利润	16,976,878.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0550
4.期末基金资产净值	406,280,738.13
5.期末基金份额净值	1.148

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	4.84%	0.66%	0.54%	0.67%	4.30%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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(2008年7月8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。

§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		
苏竞	本基金的基金经理、汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理、汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理。	2008年7月8日	-	9年	国籍:中国。学历:上海海事大学经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任北京中国运载火箭技术研究院助理工程师、上海申银万国证券研究所高级研究员、上投摩根基金管理有限公司