汇添富优势精选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	汇添富优势精选混合
交易代码	519008
前端交易代码	519008
后端交易代码	519009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年8月25日
报告期末基金份额总额	1,224,556,761.83份
投资目标	投资具有持续竞争优势的企业，分享其在中国经济持续高速成长背景下的长期优异业绩，为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采用适度动态资产配置策略，同时运用汇添富持续竞争优势企业评估系统自下而上精选个股，并对投资组合进行积极而有效的风险管理。
业绩比较基准	70%×沪深300指数收益率+30%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金是精选股票、并且进行积极风险控制的混合型基金，本基金的风险和预期收益比较均衡，在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。
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	-111,712,515.66
2.本期利润	189,301,016.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.1438
4.期末基金资产净值	2,564,042,444.24
5.期末基金份额净值	2.0939

注：1、本期已实现收益指基本期利息收入、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。

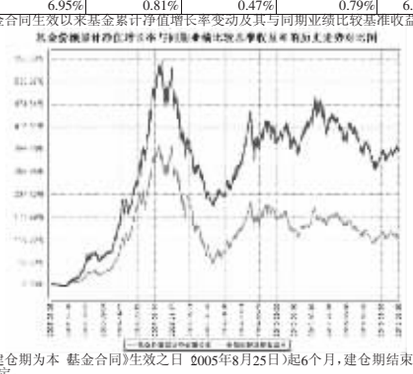
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	6.95%	0.81%	0.47%	0.79%	6.48%	0.02%

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（2005年8月25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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
苏克	本基金的基金经理，汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2007年10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高级行业研究员、博时基金管理有限公司高级行业研究员。2006年9月加入汇添富基金管理有限公司，任高级行业分析师，2007年3月6日至2007年10月7日任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理助理，2007年10月8日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理，2007年12月17日至今任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日至今任汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
王栩	本基金的基金经理，汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理	2010年2月5日	-	10年	国籍：中国。学历：南京大学管理学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任上海永嘉投资管理有限公司研究员。2004年11月加入汇添富基金管理有限公司任高级行业研究员，2009年11月30日至2010年2月4日任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理助理，2010年2月5日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理，2010年9月21日至今任汇添富医药保健股票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年二季度国内经济继续快速下滑，固定资产投资、出口和消费基本上都维持在一季度的低位，工业生产则快速下滑。面对经济形势的变化，国务院提出将稳增长放在更加重要的位置，政府投资有所加速，人民银行也在金融危机之后首次下调基准利率，但这些政策调整在二季度尚未见到成效。国际方面，美国经济的复苏势头出现反复，欧债危机由于希腊选举以及西班牙银行业的危机而出现激化，全球风险资产价格二季度普遍下跌。在经济快速下滑与政策刺激力度逐渐加大的综合作用下，A股市场二季度整体呈现震荡走势，沪深300指数上涨了0.27%，医药生物、食品饮料、餐饮旅游、环保等弱周期行业涨幅居前，电力、房地产等与宏观经济有一定负相关性的行业也有出色表现。

本基金在二季度根据经济和市场环境的变化对资产配置结构做出调整。股票资产比例小幅上升，从2011年末的78.56%上升至82.95%。行业配置方面，增持了公用事业、医药生物、TMT、食品饮料等行业，减持了金融、煤炭、有色等行业。个股投资上，延续了原有的自下而上精选优质成长股的思路，并且大幅提高部分个股的投资集中度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2012年二季度本基金的收益率为6.95%，比业绩比较基准高6.48个百分点。

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2012年三季度乃至下半年，本基金的观点如下：第一，宏观经济环境总体仍不乐观，国内经济仍将逐步探底，欧债危机近期虽有所缓和但欧元区国家在财政统一和经济刺激方面仍很难达成共识，欧元区经济继续衰退是大概率事件。因此，上市公司的盈利状况下半年同样不乐观。第二，随着通胀率的快速下行，国内货币政策仍有进一步放松的空间，存贷款基准利率有可能再下调两次以上，A股市场面临的流动性环境会进一步改善。第三，由于实体经济的投资机会减少、社会整体流动性趋于宽松以及A股市场整体估值水平处于低位，产业资本对于A股市场的态度有可能逐步发生转变，股票的供给压力有望缓解。综合上述因素，本基金认为A股市场下半年依然存在较多的结构性投资机会。本基金主要关注以下方面的投资机会。第一，在整体经济前景趋于悲观的背景下投资者对于业绩确定性的追求会显著上升，弱周期的医药和消费股可能仍会有较好表现，但要警惕受经济下滑影响的可选消费品。第二，政府已经确定经济结构转型的大方向，各个领域的改革措施下半年有望加速推进，例如金融、铁路等行业，这其中会蕴含大量的投资机会。第三，刺激性的财政和货币政策的累积效应在下半年有可能逐步显现，可以适度关注周期股的逆向投资机会。

§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	2,127,032,412.49	82.39
	其中：股票	2,127,032,412.49	82.39
2	固定收益投资	106,265,000.00	4.12
	其中：债券	106,265,000.00	4.12
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	150,000,000.00	5.81
	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	189,241,147.16	7.33
6	其他资产	9,090,233.96	0.35
7	合计	2,581,628,793.61	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	-	-
B	采掘业	17,806,196.37	0.69
C	制造业	1,007,911,529.30	39.31
C0	食品、饮料	434,763,408.31	16.96
C1	纺织、服装、皮毛	35,083,462.40	1.37
C2	木材、家具	5,327,317.60	0.21
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	34,081,281.55	1.33
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	9,072,338.88	0.35
C7	机械、设备、仪表	78,301,264.42	3.05
C8	医药、生物制品	411,282,456.14	16.04
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	62,860,332.88	2.45
E	建筑业	301,024,290.86	11.74
F	交通运输、仓储业	38,188,836.00	1.49
G	信息技术业	23,726,010.20	0.93
H	批发和零售贸易	190,375,785.80	7.42
I	金融、保险业	229,619,939.04	8.96
J	房地产业	69,010,661.88	2.69
K	社会服务业	149,174,052.86	5.82
L	传播与文化产业	37,334,777.30	1.46
M	综合类	-	-
	合计	2,127,032,412.49	82.96

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	002081	金螳螂	5,250,000	199,500,000.00	7.78
2	600036	招商银行	13,446,912	146,840,279.04	5.73
3	600519	贵州茅台	573,283	137,100,629.45	5.35
4	600199	金种子酒	3,996,058	99,821,528.84	3.89
5	600079	人福医药	4,202,219	97,449,458.61	3.80
6	600535	天士力	1,953,759	85,418,343.48	3.33
7	600000	浦发银行	10,182,000	82,779,660.00	3.23
8	000869	张裕A	1,093,569	73,553,450.94	2.87
9	600104	上汽集团	4,880,258	69,738,886.82	2.72
10	600887	伊利股份	3,366,126	69,274,873.08	2.70

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	-	-
3	金融债券	50,030,000.00	1.95
	其中：政策性金融债	50,030,000.00	1.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	56,235,000.00	2.19
8	其他	-	-
9	合计	106,265,000.00	4.14

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	110018	国电转债	500,000	56,235,000.00	2.19
2	110242	11国开42	500,000	50,030,000.00	1.95

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、处罚的情况。

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	917,886.55
2	应收证券清算款	5,354,708.69
3	应收股利	277,783.38
4	应收利息	2,216,353.04
5	应收申购款	323,502.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,090,233.96

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	56,235,000.00	2.19

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§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	1,458,825,955.97
本报告期基金总申购份额	16,771,413.75
减：本报告期基金总赎回份额	251,040,607.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,224,556,761.83

§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优势精选混合型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富优势精选混合型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富优势精选混合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、报告期内汇添富优势精选混合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

金鹰保本混合型证券投资基金

【2012】第二季度报告

基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一二年七月十八日

§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17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	金鹰保本混合
基金主代码	210006
交易代码	210006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月17日
报告期末基金份额总额	643,249,413.07份
投资目标	采用改进的固定比例组合保险策略(CPPI)，引入收益锁定机制，在严格控制投资风险、保证本金安全的基础上，力争在保本期结束时，实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金的保本策略为改进的固定比例组合保险策略(CPPI)，是本基金投资运作过程中的核心策略；投资策略采用"自上而下"的投资视角，根据宏观经济与资本市场运行状况、固定收益类与权益类资产风险收益特性、基金净资产、价值底线，定性分析与定量分析并用，灵活动态地选取适当的风险乘数，以期对固定收益类与权益类资产之间的配置额进行优化调节，力争在确保本金安全的前提下，获取投资收益。
业绩比较基准	3年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为积极配置的保本混合型基金，属于证券投资基金当中的低风险品种，其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，但高于货币市场基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金保证人	广州国际集团有限公司

§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	9,457,516.94
2.本期利润	18,854,728.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0277
4.期末基金资产净值	680,993,979.11
5.期末基金份额净值	1.0590

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；

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、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

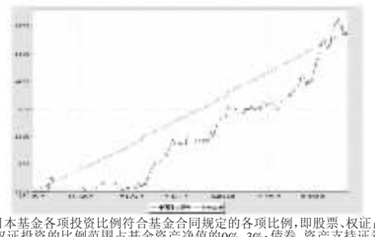
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.72%	0.14%	1.25%	0.01%	1.47%	0.13%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

金鹰保本混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2011年5月17日至2012年6月30日）



注：1、截至报告日本基金各项投资比例符合基金合同规定的各项比例，即股票、权证占基金资产净值的比例为0%~40%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的0%~3%；债券、资产支持证券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的60%~100%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；

2、本基金的业绩比较基准为：3年期银行定期存款利率（税后）。

§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	证券从业年限	说明
邱新红	基金经理	2011-5-17	-	9	邱新红先生，美国卡内基梅隆大学计算金融专业硕士，证券从业年限9年。曾任职于美国太平洋投资管理公司(PIMCO)，担任投资组合经理助理。2008年3月到2010年6月担任Bayview资产管理公司的投资经理，负责债券投资组合管理。2010年8月加入金鹰基金管理有公司，任职债券研究员，现任金鹰保本混合型证券投资基金基金经理并兼任金鹰持久回报分级债券型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；

2、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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则、《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，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。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期，本基金管理人按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，根据本公司《公平交易制度》的规定，通过规范化的投资、研究和交易流程，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本基金管理人事前规定了严格的股票备选库管理制度、投资权限管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等；事中重视交易执行环节的公平交易措施，以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则，必要时启用投资交易系统中的公平交易模块；事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况；与本公司管理的被动型投资组合发生的同日反向交易，未发生过成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

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，上证指数先扬后抑，4月份上证综指震荡上行，5月份中下旬以来震荡下行，与2012年1季末相比，截止到6月底上证指数下跌近50点，上证指数在2012年2季度下降了约1.65%。债券市场2012年2季度随着央行降息和降低法定存款准备金率的相对宽松的货币政策的实施，债券市场有不错表现，尤其是短端收益率下降幅度较大，如1年期AAA短融在2季度收益率下降了约80BP；在债券品种中信用债表现相对较好，信用债收益率出现了较大幅度的下降，中低等级表现好于高等级，如3年AAA中票收益率下降了65BP，中低等级如AA级收益率下降更多，AA级收益率下降了近100BP。与信用债相比，利率债表现稍微逊色，利率债的收益率下降幅度小于信用债。

本保本基金才运作1年左右，还处于进一步做大安全垫的阶段，目前的资产配置仍以债券为主，债券保持较高的仓位，谨慎参与权益类投资。在二季度债券市场的牛市行情下，在债券配置上在保持基金流动性的条件下适当参与了中低等级的信用债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年6月30日，基金份额净值1.0590元，本报告期份额净值增长率为2.72%，同期业绩比较基准增长率为1.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于权益市场，虽然目前A股市场估值处于历史相对低位，但是难以看到大幅上涨的空间；从国外环境来看，欧债危机的影响难以很快消去，发达国家的经济复苏需要一段相对较长的过程，这将对我国的出口带来一定的影响；对于国内经济，由于调整经济结构的影响以及地产调控措施的实施，我们认为经济增速将有所下降。

对于债券市场，我们仍相对看好信用债的投资价值，在下半年的投资中，将密切关注信用债的走势，根据不同的经济环境确定组合的久期以及债券的品种，精挑细选个券，综合权衡风险与收益的基础上确定信用债个券的配置，同时做好基金的流动性管理，严格按照保本策略进行操作，做大安全垫，倾尽所能从资本市场中寻找可能存在的超额收益，力争为基金持有人获得更好的收益。

§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	42,117,260.93	4.55
	其中：股票	42,117,260.93	4.55
2	固定收益投资	620,995,154.10	67.12
	其中：债券	620,995,154.10	67.12
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	223,000,894.50	24.10
	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	21,331,933.22	2.31
6	其他各项资产	17,725,313.78	1.92
7	合计	925,170,556.53	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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	24,552,299.01	3.61
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	13,020,545.26	1.91
C7	机械、设备、仪表	11,531,753.75	1.69
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,588,002.52	0.38
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	14,976,959.40	2.20
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	42,117,260.93	6.18

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	601318	中国平安	181,200	8,288,088.00	1.22
2	600066	宇通客车	285,800	6,419,068.00	0.94
3	601601	中国太保	169,200	3,752,856.00	0.55
4	600801	华新水泥	267,401	3,347,860.52	0.49
5	000012	南玻A	371,200	3,340,800.00	0.49
6	000528	柳工	263,800	3,273,758.00	0.48
7	000039	中集集团	243,000	3,231,900.00	0.47
8	000060	中金岭南	359,627	3,099,984.74	0.46
9	601628	中国人寿	160,438	2,936,015.40	0.43
10	000063	中兴通讯	185,387	2,588,002.52	0.38

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	-	-
3	金融债券	30,018,000.00	4.41
	其中：政策性金融债	30,018,000.00	4.41
4	企业债券	383,096,431.20	56.25
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	148,908,000.00	21.87
7	可转债	58,972,722.90	8.66
8	其他	-	-
9	合计	620,995,154.10	91.19

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	122086	11正泰债	549,680	56,067,360.00	8.23
2	1182298	11TCL集MTN1	500,000	52,940,000.00	7.77
3	122070	11海航01	489,900	49,626,870.00	7.29
4	122089	11马钢01	324,130	33,644,694.00	4.94
5	1182276	11中铁股MTN2	300,000	32,502,000.00	4.77

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

本基金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

本基金报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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 本基金报告期内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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	861,965.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,859,582.39
5	应收申购款	3,766.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,725,313.78

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	113001	中行转债	19,424,000.00	2.85
2	110017	中海转债	9,575,550.40	1.41
3	110018	国电转债	8,747,916.60	1.28
4	110013	国投转债	8,596,800.00	1.26
5	110015	石化转债	7,575,176.20	1.11
6	125709	唐钢转债	2,640,706.60	0.39
7	125887	中期转债	15,549.10	0.00

5.8.5 报告期末前十名股票中不在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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	717,752,484.18
本报告期基金总申购份额	1,041,338.59
减：本报告期基金总赎回份额	75,544,409.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	643,249,413.07

§7 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准金鹰保本混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰保本混合型证券投资基金托管协议》。

4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。

5、基金托管人业务资格批件和营业执照。

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、更新的招股说明书及其他临时公告。

8.2 存放地点

广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：http://www.gefund.com.cn。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：4006-135-888或020-83936180。

金鹰基金管理有限公司
二〇一二年七月十八日

汇添富货币市场基金

【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：上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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	汇添富货币	
交易代码	519518	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年3月23日	
报告期末基金份额总额	4,143,949,031.50份	
投资目标	力求在本金稳妥和基金资产高流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。	
业绩比较基准	税后活期存款利率(即活期存款利率×(1-利息税率))。	
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。	
基金管理人	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	汇添富货币A	汇添富货币B
下属两级基金的交易代码	519518	519517
报告期末下属两级基金的份额总额	1,247,921,330.92份	2,896,027,700.58份

§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)	
	汇添富货币A	汇添富货币B
1. 本期已实现收益	15,595,051.59	64,123,493.49
2.本期利润	15,595,051.59	64,123,493.49
3.期末基金资产