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:2013年8月26日

汇添富保本混合型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

§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2013年8月22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2013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	汇添富保本混合
基金主代码	470018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月26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	1,214,100,143.63份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资组合保险技术来运作,在保证本金安全的前提下,力争在保本周期内实现基金财产的稳健增值。
投资策略	本基金将按照投资组合保险技术的要求动态调整保本资产与风险资产的投资比例,以确保基金在一段时间以后其价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保值增值目的;在此基础上将通过严谨的量化分析和翔实的实地调研,精选优质股票和债券进行投资布局,以实现基金资产最大限度的增值。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率。
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。

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	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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	1,431,628.19
本期利润	-6,246,896.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0048
本期基金份额净值增长率	-0.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0403
期末基金资产净值	1,265,852,065.98
期末基金份额净值	1.043

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。

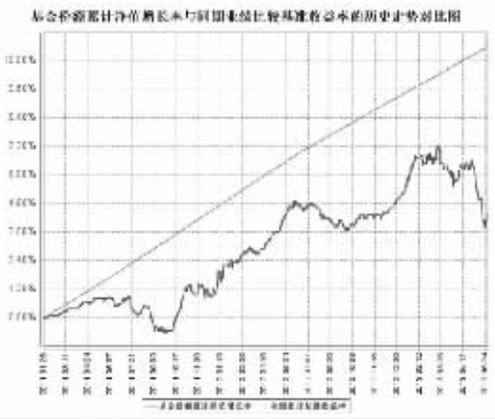
3.1 基金净值表现

3.1.1 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	-1.97%	0.22%	0.32%	0.02%	-2.29%	0.20%
过去三个月	-2.07%	0.18%	0.97%	0.01%	-3.04%	0.17%
过去六个月	-0.67%	0.17%	1.96%	0.02%	-2.63%	0.15%
过去一年	-0.29%	0.13%	4.03%	0.01%	-4.32%	0.12%
自基金合同生效日起至今	4.30%	0.11%	11.37%	0.01%	-7.07%	0.10%

注:本基金的《基金合同》生效日为2011年1月26日,至本报告期末未满三年。

3.1.2 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(2011年1月26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)6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。截止到2013年6月30日,公司管理证券投资基金规模逾650亿元,基金份额持有人户数近200万,资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理33只开放式证券投资基金,形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征,较为完善、有效的产品线,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、汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)、深证300交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财30天债券型证券投资基金、汇添富理财60天债券型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富理财28天债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金、汇添富消费行业股票型证券投资基金、汇添富理财7天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽30股票型证券投资基金、汇添富高息债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		
陈加荣	汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理。汇添富收益快线货币市场基金的基金经理,汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理。汇添富高息债债券型证券投资基金的基金经理。	2013年2月7日	-	12年	国籍:中国。学历:天津大学管理工程硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格;从业经历:曾在中国平安集团任债券研究员、交易员及本外币投资经理,国联安基金公司任基金经理助理、债券组合经理,农银汇理基金公司任固定收益投资负责人。2008年12月23日到2011年3月2日任农银汇理恒久增利债券型证券投资基金的基金经理,2009年4月2日到2010年5月9日任农银汇理平衡双利混合型证券投资基金的基金经理。2012年3月加入汇添富基金管理有限公司任全融工程部高级经理,2012年12月21日至今任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理,2013年6月27日至今任汇添富高息债债券型证券投资基金的基金经理。
陆文磊	汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理。汇添富收益快线货币市场基金的基金经理,汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。汇添富收益快线货币市场基金的基金经理助理,固定收益投资副总监。	2011年1月26日	2013年2月7日	11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,现任固定收益投资副总监。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,汇添富季季红定期开放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2013年2月7日任汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理,2012年7月26日至今任汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2012年12月31日至今任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理助理。

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,形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合、交易所市场、银行间市场等各投资市场、债券、股票、回购等各投资标的,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

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》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为2次,分别是由于基金流动性需要、专户组合到期清算卖出证券所致。

本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

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

从2012年12月到2013年2月上旬,"经济、政策、流动性以及市场偏好"相对偏正面,市场充分享受着对经济、政策组合的乐观预期,从1月底的上证指数看,市场对1季度经济增长的预期快到8.5%,但随后的经济数据以及政策手段让市场逐步回归理性,首先是高频的中观数据显示经济走势不太强,PMI尽管有所反弹,但力度偏弱,市场开始逐步下调对1季度GDP增速预期;2月的通胀有明显超预期的反弹,尽管市场意识到有偶然因素,但由此而来的"帮胀"担心开始出现;央行春节后未如市场预期的那样维持一定的流动性,而是进行正回购操作大幅回笼资金,也加深了市场对流动性趋紧的担心。3月28日发布的银监会8号文更使市场担心今后社会融资总量将大幅下降、流动性趋紧、经济增速下行、无风险利率上行。到2季度,尽管银监会颁布了8号文,但社会融资总量并未如市场担心的那样出现较大幅的下滑,仍维持高位,不过PMI整体上并未反弹,而是持续的低于市场预期,市场对此背离的各种解读不一而足,与此同时,CPI反弹有限,PPI持续走弱,总体上呈现"略宽货币+弱经济+低通胀"的经济格局,面对此局面,新政府应对之策逐步显示出自己的特色,为促进经济"转型",政策转型"开始凸显,不管是新领导的政策表态,还是实际推行的政策,都让市场感觉到新政府更重视尽快排查风险,更重视推进改革,通过促进结构调整以实现经济有质量的增长,6月末,在市场资金高度紧张状况下,央行一反常态的"淡定",更使市场充分认识到新领导、新政府的宏观管理思路已经发生了切实的转变,金融机构降杠杆、减少资产负债的期限错配,经济结构转型势在必行。

在这样的背景下,股市在2月上旬前延续去年年底上涨行情后转而下跌,前期涨幅较大的银行股受8号文影响大幅下挫,一些涨幅较大的消费类、中小板的股票也显颓势;可转债显示出一定的抗跌性,电力类以及个别的化工类转债相对较强;一般债券,尤其信用债除了在3月中上旬略有回调外,其余时间涨势良好,除了前述经济偏弱外,银行间资金相对宽松、年初机构的配置需要、资金成本低廉尤其后期银监会8号文带来的经济下滑、买债资金量扩大是主要原因。

2季度债市在经济偏弱、政府不再轻易出台刺激政策、流动性先偏松后趋紧的背景下,先走强,5月份在"愤市稽查"的影响下大幅走弱近两周,但随后由于银监会8号文以及央行释放流动性的影响,市场需求旺盛而反弹,但在5月末到6月底,由于市场资金日渐紧张,甚至濒临"崩溃"而大幅下挫,并再次在央行一定程度的施以援手后而反弹。期间,银行间隔夜回购利率最高曾达30%,AAA评级的1年期短融收益率曾经上升150-200bp。股市的反应也是十分令人深思,整个2季度,估值便宜、被众多市场人士认为已经较充分反映经济悲观预期的银行、地产等大盘蓝筹股持续下行,而高估值的创业板股票则屡创新高,二者间的溢价出创历史新高。不少股票投资人,不由得发出与老虎基金创始人十分类似的感慨,"价值股的熊市何时结束?"

本基金严格按照保本的要求,在剩余保本期的基础上配置保本资产,年初果断加仓权益类资产,止盈止损,取得一定收益,后期受清理理财产品的影响,盈利受到一定削弱。二季度在保本资产上配置和保本期限相匹配的债券资产,资金紧张前,减持了部分债券资产,并在市场收益率上升后及时增持了部分债券,减少了一些损失,获得一定收益。股票资产的配置上考虑到基金特点,主要持有估值便宜、红利确定或业绩增长相对较稳定、可靠的银行、地产,但可惜的是,在这段时间,低估值行业未录得收益,在反思投资思路并对中国发展阶段、股市特色加以进一步研究后,我们加强了整体仓位的控制以及投资行业的优选,转向更重视有真实成长的消费等类型的公司,初步取得一定成效。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金收益率为-0.67%,同期业绩比较基准收益率为1.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济转型期,政策影响尤其大。6月末资金高度紧张下央行的"淡定"已让市场对新政府管理思路有了较深刻的认识。这次较严厉的通过数量调整迫使金融机构降杠杆的举动,也许只是更广范围、更深层次、更大力度的改革的"预演",经济中长期前景反而更值得期待。政治局"宏观政策稳住、微观政策放活、社会政策托底"的要求已开始得到执行。展望未来一段时间,总体仍较弱,因为在美国经济略有复苏、欧元区不振的情况下,出口预期应该一般,消费也会偏弱,投资方面,由于房地产投资、基建投资缺少资金都难以有较大的反弹。通胀由于大宗商品价格下行压力仍存、猪周期影响降低以及基期因素,上行压力不大。更关键的是,此时的政策,很大的概率是继续维持前期促进"出清"的思路。央行更可能在实际上仍然维持中性略偏紧的货币政策,通过数量措施逼迫金融机构尽快降杠杆,发改委、交易商协会等部门会加大对债券发行的审查和已发债券信用风险的排查,从而从源头上减少城投平台以及一些不符合发展方向的行业的资金供应,而银行理财产品在银监会8号文的持续发酵下,净发行量可能下降,从而降低对高票息债券的需求。债券、股票市场因此都将面临一定的不确定性。

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: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6次,每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

§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

2013年上半年,本基金托管人在对汇添富保本混合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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2013年上半年,汇添富保本混合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保本混合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,汇添富保本混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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保本混合型证券投资基金2013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:汇添富保本混合型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:		
银行存款	1,284,442.89	14,752,136.95
结算备付金	5,147,103.05	867,259.27
存出保证金	443,689.70	202,074.69
交易性金融资产	1,226,144,491.78	1,454,807,293.29
其中:股票投资	47,872,391.18	77,170,924.59
基金投资	-	-
债券投资	1,169,152,100.60	1,353,777,368.70
资产支持证券投资	9,120,000.00	23,859,000.00
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	9,500,000.00	-
应收证券清算款	982,902.74	3,561,306.93
应收利息	25,478,461.86	27,244,063.80
应收股利	-	-
应收申购款	18,162.09	12,871.75
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,268,999,254.11	1,501,447,006.68
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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	394,999.72	-
应付赎回款	364,873.86	1,023,250.97
应付管理人报酬	1,273,617.76	1,541,089.21
应付托管费	212,269.62	256,848.18
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	682,451.01	69,333.12
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	218,976.16	218,109.05
负债合计	3,147,188.13	3,108,630.53
所有者权益:		
实收基金	1,214,100,143.63	1,427,428,351.72
未分配利润	51,751,922.35	70,910,024.43
所有者权益合计	1,265,852,065.98	1,498,338,376.15
负债和所有者权益总计	1,268,999,254.11	1,501,447,006.68

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.043元,基金份额总额1,214,100,143.63份。

6.2 利润表

会计主体:汇添富保本混合型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

资产	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	6,738,846.28	78,022,417.05
1.利息收入	27,822,145.29	38,708,300.77
其中:存款利息收入	112,575.52	349,538.61
债券利息收入	27,014,696.12	37,703,390.78
资产支持证券利息收入	405,736.35	-
买入返售金融资产收入	289,137.30	655,371.38
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-14,018,352.22	-2,181,236.74
其中:股票投资收益	-14,707,971.04	-9,587,071.43
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-143,395.37	7,348,457.80
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	833,014.19	57,376.89
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-7,678,525.10	39,690,590.00
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	613,578.31	1,804,763.02
减:二、费用	12,985,743.19	14,438,519.64
1.管理人报酬	8,282,990.72	11,329,225.72
2.托管费	1,380,498.48	1,888,204.29
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,019,214.22	561,138.05
5.利息支出	1,074,005.64	421,415.06
其中:卖出回购金融资产支出	1,074,005.64	421,415.06
6.其他费用	229,034.13	238,536.52
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-6,246,896.91	63,583,897.41

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富保本混合型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	1,427,428,351.72	70,910,024.43	1,498,338,376.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,246,896.91	-6,246,896.91
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)	-213,328,208.09	-12,911,205.17	-226,239,413.26
其中:1.基金申购款	8,112,738.35	516,687.85	8,629,426.20
2.基金赎回款	-221,440,946.44	-13,427,893.02	-234,868,839.46
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)	1,214,100,143.63	51,751,922.35	1,265,852,065.98
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	2,034,721,273.03	24,924,283.77	2,059,645,556.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	63,583,897.41	63,583,897.41
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)	-342,437,059.27	-9,857,611.38	-352,294,670.65
其中:1.基金申购款	8,364,534.33	292,131.56	8,656,665.89
2.基金赎回款	-350,801,593.60	-10,149,742.94	-360,951,336.54
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)	1,692,284,213.76	78,650,569.80	1,770,934,783.56

注:报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

林利军 陈灿辉 王小练

基金管理人负责人 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

汇添富保本混合型证券投资基金(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")证监许可[2010]1875号文《关于核准汇添富保本混合型证券投资基金募集的批复》的批准,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,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2011)验字第60466941_B01号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2011年1月26日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币2,506,133,948.78元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币562,520.52元,以上实收基金(本息)合计为人民币2,506,696,469.30元,折合2,506,696,469.30份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均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,担保人为中国投资担保有限公司。

本基金主要通过投资组合保险技术来运作,在保证本金安全的前提下,力争在保本周期内实现基金财产的稳健增值。本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:三年期银行定期存款税后收益率。

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2013年6月30日的财务状况以及2013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 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。

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、证监会财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,对证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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、基金托管人的股东、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
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	1,287,084,142.71	97.43%	328,730,944.66	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	310,175,448.49	95.47%	399,510,346.39	100.00%

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券股份有限公司	3,933,270,000.00	95.13%	895,000,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013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	1,161,027.37	97.46%	679,687.01	99.59%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	278,238.49	100.00%	53,458.26	100.00%

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

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间