

汇添富保本混合型证券投资基金

2011 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:2011年4月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、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基金合同规定，于2011年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策、基金资产净值和基金份额总额。
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。

本报告期自2011年1月26日起至3月31日止。

§ 2 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
基金合同生效日	2011年1月26日
报告期末基金份额总额	2,506,696,469.30份
投资目标	本基金主要通过投资组合保险技术来运作，在保证本基金安全的前提下，力争在本周期内实现基金财产的最大增值。
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，从而实现基金资产保本基础下的保值增值的；在此基础上将通过严谨的量化分析和翔实的实践调研，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
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

主要财务指标	报告期(2011年1月26日-2011年3月31日)
1.本期已实现收益	6,108,792.27
2.本期利润	8,896,263.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0035
4.期末基金份额净值	2,515,732.31
5.期末基金份额净值	1.004

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入、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将低于所列数字。

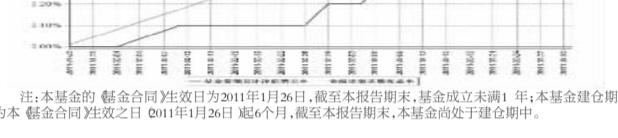
3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

自基金合同生 0.40% 0.03% 0.80% 0.02% 0.03% 0.01% 活以来

3.2.2 自基金合同生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:本基金的基金合同生效日为2011年1月26日,截至本报告期末,基金成立未满1年;本基金建仓期为本基金合同生效之日起6个月内,截至本报告期末,本基金尚未建仓。

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:2011年4月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、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基金合同规定,于2011年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策、基金份额总额。

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。

本报告期自2011年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年1月1日-2011年3月31日)
1.本期已实现收益	41,912,733.63
2.本期利润	-162,113,129.62
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1102
4.期末基金份额净值	1,399,607,102.76
5.期末基金份额净值	1.105

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.本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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -8.79% 1.30% 6.24% 0.90% -11.43% 0.21%

3.2.2 自基金合同生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:本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内,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

本报告期自2011年1月1日起至3月31日止。

§ 5 投资组合报告

本基金为股票型基金,以股票投资为主。股票投资的主要策略包括资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略,构建有效的投资组合,并在科学的选股风险管理下,力求为基金份额持有人实现持续稳健的较高投资回报。

本基金为股票型基金,以股票投资为主。股票投资的主要策略包括资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略,构建有效的投资组合,并在科学的选股风险管理下,力求为基金份额持有人实现持续稳健的较高投资回报。

本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高风险较高预期收益品种。

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

主要财务指标	报告期(2011年1月1日-2011年3月31日)
1.本期已实现收益	23,402,776.00
2.本期利润	-104,159,595.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0696
4.期末基金份额净值	2,563,883,063.43
5.期末基金份额净值	1.1554

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.本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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去2个月 -4.05% 1.27% 2.64% 1.09% -6.69% 0.18%

3.2.2 自基金合同生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:本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内,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

本报告期自2011年1月1日起至3月31日止。

§ 5 投资组合报告

本基金为股票型基金,以股票投资为主。股票投资的主要策略包括资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略,构建有效的投资组合,并在科学的选股风险管理下,力求为基金份额持有人实现持续稳健的较高投资回报。

本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高风险较高预期收益品种。

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

主要财务指标	报告期(2011年1月1日-2011年3月31日)
1.本期已实现收益	23,402,776.00
2.本期利润	-104,159,595.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0696
4.期末基金份额净值	2,563,883,063.43
5.期末基金份额净值	1.1554

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.本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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去2个月 -4.05% 1.27% 2.64% 1.09% -6.69% 0.18%

3.2.2 自基金合同生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:本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内,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

本报告期自2011年1月1日起至3月31日止。

§ 5 投资组合报告

本基金为股票型基金,以股票投资为主。股票投资的主要策略包括资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略,构建有效的投资组合,并在科学的选股风险管理下,力求为基金份额持有人实现持续稳健的较高投资回报。

本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高风险较高预期收益品种。

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

主要财务指标	报告期(2011年1月1日-2011年3月31日)
1.本期已实现收益	23,402,776.00
2.本期利润	-104,159,595.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0696
4.期末基金份额净值	2,563,883,063.43
5.期末基金份额净值	1.1554

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入