

汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金 2010 年半年度报告

2010 年 6 月 30 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

送出日期：2010 年 8 月 26 日

§1 重要提示及目录

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 2010 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9

4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
§5	托管人报告	11
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3	托管人对半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1	资产负债表	12
6.2	利润表	13
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4	报表附注	15
§7	投资组合报告	30
7.1	期末基金资产组合情况	30
7.2	期末按行业分类的股票投资组合	30
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	31
7.4	报告期内权益投资组合的重大变动	32
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	34
7.6	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	34
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	34
7.8	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	34
7.9	投资组合报告附注	34
§8	基金份额持有人信息	35
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	35
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	35
§9	开放式基金份额变动	35
§10	重大事件揭示	36
10.1	基金份额持有人大会决议	36
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	36
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	36
10.4	基金投资策略的改变	37
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	37
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	37
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	37
10.8	其它重大事件	38
§11	备查文件目录	42
11.1	备查文件目录	42
11.2	存放地点	42
11.3	查阅方式	42

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	汇添富蓝筹稳健混合
基金主代码	519066
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
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	475,562,194.44 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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	蒋松云
	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
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		桂水发	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 22 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,440,289.92
本期利润	-70,929,463.57
加权平均基金份额本期利润	-0.1693
本期加权平均净值利润率	-11.84%
本期基金份额净值增长率	-10.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	133,055,338.27
期末可供分配基金份额利润	0.2798
期末基金资产净值	608,617,532.71
期末基金份额净值	1.280
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2010 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	41.72%

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（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。

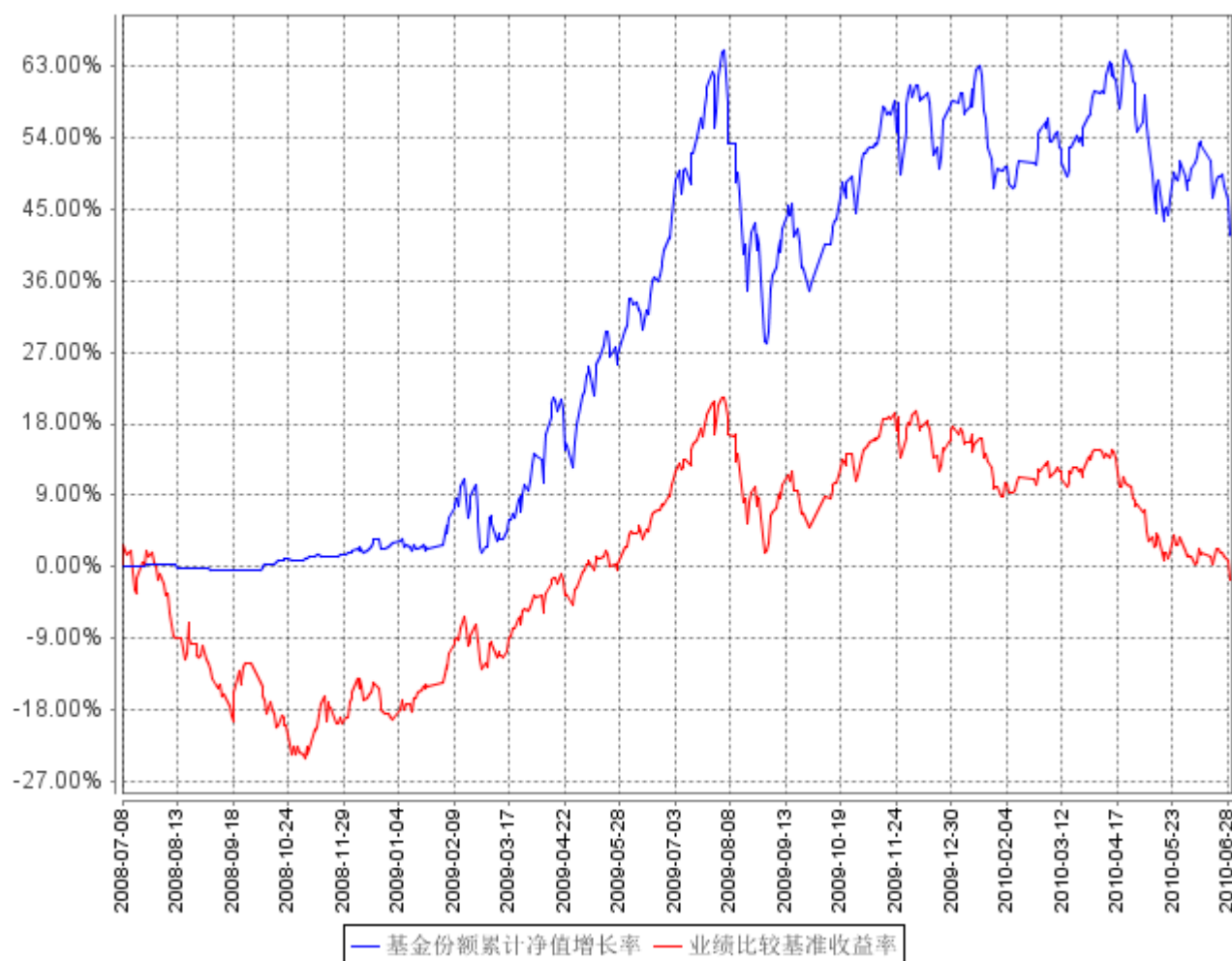
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	-4.97%	1.25%	-4.46%	1.00%	-0.51%	0.25%
过去三个月	-10.05%	1.38%	-13.61%	1.09%	3.56%	0.29%
过去六个月	-10.75%	1.21%	-15.91%	0.95%	5.16%	0.26%
过去一年	0.33%	1.50%	-10.01%	1.13%	10.34%	0.37%
自基金合同生效起至今	41.72%	1.27%	-2.27%	1.33%	43.99%	-0.06%

3.2.2 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

基金份额累计净值增长率与比较基准收益率的历史走势对比图



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）5号文批准，于2005年2月3日正式成立，注册资本为1亿元人民币。截止到2010年6月30日，公司管理证券投资基金规模达到497.11亿元，基金份额持有人户数超过184万，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理11只开放式证券投资基金，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币基金（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。

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		
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	-	7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。
--	--	--	--	--	--

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

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易机制，涵盖了各投资组合、各投资市场、各投资标的，贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程，并通过分析报告、监控、稽核保证制度流程的有效执行。

4.3.2 本投资组合与其它投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为混合型基金，股票投资对象主要是“价值相对低估的蓝筹公司股票”，与本基金管理人旗下其他基金投资组合风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司公平交易制度执行情况良好，未发生任何异常交易行为。

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

10 年初，市场还沉浸在 09 年经济和股市 V 型回升的幸福中，宏观刺激政策退出的步伐悄然迈开，紧缩预期逐步升温。对经济和企业盈利回落、通胀预期上升、以及融资节奏加快导致供求关系恶化等因素的担忧逐步改变了年初的乐观预期，并在政府关于房地产调控措施出台，以及欧洲主权债务危机蔓延等事件的冲击下市场大幅调整。虽然阶段性也有区域振兴、医药以及和“调结构”相关的节能减排、智能电网等主题活跃，但是市场整体呈普跌和轮跌的态势，调整幅度超出预期。

本基金在年初注意到政策调整和市场供求矛盾等信号后，积极调整组合结构，降低了金融、地产、煤炭等周期性大类资产配置，增加了与刺激内需、调整经济结构相关联相关领域资产的权重，在一季度的结构分化行情中获得比较明显相对收益。二季度，在操作上采取相对防御的策略，进一步降低仓位，收缩战线。但是对于各种负面因素叠加导致的市场深幅调整估计不足，虽然相对于市场和业绩比较基准取得比较明显的相对收益，但是基金净值仍然遭受了一定损失。纵观上半年，整体操作策略还是比较符合投资主题和市场环境的变化，但在市场形势急剧变化下的应变和风险控制能力需要进一步总结和提高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内净值增长-10.75%，超越比较基准 5.16%。但由于市场定价中枢较大幅度回落，本基金未能实现正收益。

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，虽然宏观经济和企业盈利增速回落的趋势比较明显，但在对地产行业的调控未见明显成效、通胀压力居高不下的情势下，我们认为政策松动的余地比较有限。政策主导方向在“保增长”和“调结构”上的纠结将会是常态，下半年市场在政策环境上面临的不确定性不会小于上半年。经济的回落和政策的不确定性使得下半年 A 股市场依然面临比较严峻的投资环境。我们依然认为从中长期角度来看，刺激和扩大内需消费、加大“调结构”的努力，既是实体经济保持可持续发展的需要，也是后续资本市场主导性的、有持续性的投资主题。

我们下半年将立足于上述判断，积极寻找符合经济和产业发展趋势，增长确定和估值相对合理的投资标的作为组合的基本配置，同时也会密切关注宏观经济形势和政策动向，根据市场环境的变化适时调整和优化组合结构，争取在控制组合风险的前提下取得较好的基金业绩。

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验，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，本基金未签约与估值相关的定价服务。

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 12 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 25%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。

本报告期内，本基金 2010 年 3 月 22 日对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 44,962,380.75 元。

§ 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

2010 年上半年，本基金托管人在对汇添富蓝筹稳健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资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010 年上半年，汇添富蓝筹稳健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蓝筹稳健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，汇添富蓝筹稳健混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 44,962,380.75 元。

5.3 托管人对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蓝筹稳健混合型证券投资基金 2010 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：汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	174,679,096.43	87,125,008.65
结算备付金		1,000,686.31	2,025,069.14
存出保证金		1,418,051.09	2,004,512.27
交易性金融资产	6.4.7.2	433,717,055.96	594,210,586.46
其中：股票投资		364,409,055.96	543,182,366.46
基金投资		-	-
债券投资		69,308,000.00	51,028,220.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	5,711,246.33
应收利息	6.4.7.5	741,660.65	55,290.96
应收股利		-	-
应收申购款		383,373.96	48,822.95
递延所得税资产		-	-
其它资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		611,939,924.40	691,180,536.76
负债和所有者权益	附注号	本期期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 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		-	1,755,357.97
应付赎回款		254,930.38	393,999.03
应付管理人报酬		814,397.03	885,481.42
应付托管费		135,732.84	147,580.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	643,243.45	946,671.99
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其它负债	6.4.7.8	1,474,087.99	1,671,373.86
负债合计		3,322,391.69	5,800,464.51
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	475,562,194.44	442,781,048.67
未分配利润	6.4.7.10	133,055,338.27	242,599,023.58
所有者权益合计		608,617,532.71	685,380,072.25
负债和所有者权益总计		611,939,924.40	691,180,536.76

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、报告截止日 2010 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.280 元，基金份额总额 475,562,194.44 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
一、收入		-62,457,356.18	224,591,554.37
1.利息收入		834,766.50	2,305,938.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	501,008.49	479,990.01
债券利息收入		331,734.59	1,825,948.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,023.42	-
其它利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,867,222.84	111,404,636.97
其中：股票投资收益	6.4.7.12	13,156,044.37	108,877,569.20
债券投资收益	6.4.7.13	194,626.85	-365,717.91
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,516,551.62	2,892,785.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-78,369,753.49	110,170,072.55
4.其它收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	210,407.97	710,906.44
减：二、费用		8,472,107.39	11,571,536.18
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	4,462,489.31	5,058,860.95
2.托管费	6.4.10.2.2	743,748.22	843,143.46

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,024,877.21	5,431,043.46
5. 利息支出		7,536.06	10,533.43
其中：卖出回购金融资产支出		7,536.06	10,533.43
6. 其它费用	6.4.7.19	233,456.59	227,954.88
三、利润总额		-70,929,463.57	213,020,018.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-70,929,463.57	213,020,018.19

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 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)	442,781,048.67	242,599,023.58	685,380,072.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-70,929,463.57	-70,929,463.57
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)	32,781,145.77	6,348,159.01	39,129,304.78
其中：1. 基金申购款	173,792,560.77	77,031,498.52	250,824,059.29
2. 基金赎回款	-141,011,415.00	-70,683,339.51	-211,694,754.51
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)	-	-44,962,380.75	-44,962,380.75
五、期末所有者权益(基金净值)	475,562,194.44	133,055,338.27	608,617,532.71
项目	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 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)	652,444,976.56	19,374,015.37	671,818,991.93
二、本期经营活动产生的基金净	-	213,020,018.19	213,020,018.19

值变动数(本期利润)			
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)	74,777,817.78	55,899,410.28	130,677,228.06
其中:1.基金申购款	573,307,483.87	126,094,255.91	699,401,739.78
2.基金赎回款	-498,529,666.09	-70,194,845.63	-568,724,511.72
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)	-	-13,957,783.95	-13,957,783.95
五、期末所有者权益(基金净值)	727,222,794.34	274,335,659.89	1,001,558,454.23

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；

基金管理人负责人 林利军 主管会计工作负责人 陈灿辉 会计机构负责人 王小练

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2008]645 号文《关于核准汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准,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,基金合同于 2008 年 7 月 8 日生效。首次设立募集规模为 741,799,533.92 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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、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》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

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它有关规定的声明

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 2010 年 6 月 30 日的财务状况以及 2010 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未有会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未有会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内不存在重大会计差错。

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
活期存款	174,679,096.43
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其它存款	-
合计：	174,679,096.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	381,149,515.94	364,409,055.96	-16,740,459.98	
债券	交易所市场	20,050,812.84	20,228,000.00	177,187.16
	银行间市场	49,171,200.00	49,080,000.00	-91,200.00
	合计	69,222,012.84	69,308,000.00	85,987.16

资产支持证券	-	-	-
其它	-	-	-
合计	450,371,528.78	433,717,055.96	-16,654,472.82

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
应收活期存款利息	35,879.72
应收定期存款利息	-
应收其它存款利息	-
应收结算备付金利息	315.18
应收债券利息	705,465.75
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其它	-
合计	741,660.65

6.4.7.6 其它资产

本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
交易所市场应付交易费用	642,674.30
银行间市场应付交易费用	569.15
合计	643,243.45

6.4.7.8 其它负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
应付券商交易单元保证金	1,250,000.00
应付赎回费	934.90
预提信息披露费	178,522.11

预提审计费	44,630.98
合计	1,474,087.99

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	442,781,048.67	442,781,048.67
本期申购	173,792,560.77	173,792,560.77
本期赎回	-141,011,415.00	-141,011,415.00
本期末	475,562,194.44	475,562,194.44

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	184,976,549.01	57,622,474.57	242,599,023.58
本期利润	7,440,289.92	-78,369,753.49	-70,929,463.57
本期基金份额交易产生的变动数	9,139,402.56	-2,791,243.55	6,348,159.01
其中：基金申购款	71,683,013.69	5,348,484.83	77,031,498.52
基金赎回款	-62,543,611.13	-8,139,728.38	-70,683,339.51
本期已分配利润	-44,962,380.75	-	-44,962,380.75
本期末	156,593,860.74	-23,538,522.47	133,055,338.27

6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	
	活期存款利息收入	482,105.29
定期存款利息收入	-	
其它存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	10,717.56	
其它	8,185.64	
合计	501,008.49	

注：表中“其他”指直销申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	
	卖出股票成交总额	1,041,145,228.67
减：卖出股票成本总额	1,027,989,184.30	
买卖股票差价收入	13,156,044.37	

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	51,098,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	50,735,000.00
减：应收利息总额	168,373.15
债券投资收益	194,626.85

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本期末投资衍生工具。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,516,551.62
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,516,551.62

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
1.交易性金融资产	-78,369,753.49
——股票投资	-78,162,520.65
——债券投资	-207,232.84
——资产支持证券投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其它	-
合计	-78,369,753.49

6.4.7.17 其它收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
基金赎回费收入	210,394.07
其他	13.90
合计	210,407.97

注：本基金本期其他收入中的“其他”是指根据上海证券交易所发布的有关规定返还的 2008 年券商印花税。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	3,024,602.21
银行间市场交易费用	275.00
合计	3,024,877.21

6.4.7.19 其它费用

单位：人民币元

项目	本期
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	178,522.11
账户维护费	9,000.00
银行划款费用	1,303.50
其他	-
合计	233,456.59

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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、基金发起人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
东航金戎控股有限责任公司	基金管理人股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 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	356,515,062.02	18.22%	632,562,712.95	17.09%

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010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	299,725.87	18.47%	124,416.55	19.36%
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	532,020.88	17.31%	327,468.30	16.78%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	4,462,489.31
其中：支付给销售机构的客户维护费	226,370.88	209,137.13

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金

管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	743,748.22	843,143.46

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期和上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
基金合同生效日(2008 年 07 月 08 日)持有的基金份额		-
期初持有的基金份额	57,814,664.09	50,075,500.00
期间申购/买入总份额	-	7,739,164.09
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	57,814,664.09	57,814,664.09
期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.16%	7.95%

注：1、本公司于 2009 年 6 月 10 日运用固有资金 10,000,000 元申购本基金份额 7,739,164.09

份，申购费用 1,000.00 元，符合招募说明书规定的申购费率。

2、其中“申购/买入”含红利再投、转换入份额；“赎回/卖出”含转换出份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其它关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末和上年度可比期间未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	174,679,096.43	482,105.29	177,704,217.12	449,802.53

注：由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入包含了关联方保管的银行存款期末余额、除了最低备付金以外的结算备付金期末余额及当期产生的利息收入。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期和上年度可比期间在承销期内未有参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
1	2010 年 3 月 22 日	2010 年 3 月 22 日	1.100	39,125,701.78	5,836,678.97	44,962,380.75	-
合计	-	-	1.100	39,125,701.78	5,836,678.97	44,962,380.75	-

6.4.12 期末（2010 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002215	诺普信	2010-3-17	2011-3-18	非公开发行流通受限	31.00	24.22	210,000	6,510,000.00	5,086,200.00	-
002421	达实智能	2010-5-26	2010-9-3	网下新股锁定	20.50	31.79	49,230	1,009,215.00	1,565,021.70	-

				期						
300086	康芝药业	2010-5-17	2010-8-26	网下新股锁定期	60.00	52.52	25,873	1,552,380.00	1,358,849.96	-
300077	国民技术	2010-4-23	2010-7-30	网下新股锁定期	87.50	116.75	10,223	894,512.50	1,193,535.25	-
002405	四维图新	2010-5-6	2010-8-18	网下新股锁定期	25.60	33.18	30,285	775,296.00	1,004,856.30	-
300072	三聚环保	2010-4-16	2010-7-27	网下新股锁定期	32.00	40.82	19,751	632,032.00	806,235.82	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000895	双汇发展	2010-3-22	重大事项停牌	43.57	-	-	5,354,881.00	306,921,044.37	233,312,165.17	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行

人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于年末持有的流通受限证券外，本年末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010年6月30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	174,679,096.43	-	-	-	-	-	174,679,096.43
结算备付金	1,000,686.31	-	-	-	-	-	1,000,686.31
存出保证金	-	-	-	-	-	1,418,051.09	1,418,051.09

交易性金融资产	-	49,080,000.00	20,228,000.00	-	-	364,409,055.96	433,717,055.96
应收利息	-	-	-	-	-	741,660.65	741,660.65
应收申购款	45,418.16	-	-	-	-	337,955.80	383,373.96
资产总计	175,725,200.90	49,080,000.00	20,228,000.00	-	-	366,906,723.50	611,939,924.40
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	254,930.38	254,930.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	814,397.03	814,397.03
应付托管费	-	-	-	-	-	135,732.84	135,732.84
应付交易费用	-	-	-	-	-	643,243.45	643,243.45
其他负债	-	-	-	-	-	1,474,087.99	1,474,087.99
负债总计	-	-	-	-	-	3,322,391.69	3,322,391.69
利率敏感度缺口	175,725,200.90	49,080,000.00	20,228,000.00	-	-	363,584,331.81	608,617,532.71
上年度末 2009 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	87,125,008.65	-	-	-	-	-	87,125,008.65
结算备付金	2,025,069.14	-	-	-	-	-	2,025,069.14
存出保证金	-	-	-	-	-	2,004,512.27	2,004,512.27
交易性金融资产	-	49,835,000.00	-	1,193,220.00	-	543,182,366.46	594,210,586.46
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,711,246.33	5,711,246.33
应收利息	-	-	-	-	-	55,290.96	55,290.96
应收申购款	-	-	-	-	-	48,822.95	48,822.95
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	89,150,077.79	49,835,000.00	-	1,193,220.00	-	551,002,238.97	691,180,536.76
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,755,357.97	1,755,357.97
应付赎回款	-	-	-	-	-	393,999.03	393,999.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	885,481.42	885,481.42
应付托管费	-	-	-	-	-	147,580.24	147,580.24

应付交易费用	-	-	-	-	-	946,671.99	946,671.99
其他负债	-	-	-	-	-	1,671,373.86	1,671,373.86
负债总计	-	-	-	-	-	5,800,464.51	5,800,464.51
利率敏感度缺口	89,150,077.79	49,835,000.00	-	1,193,220.00	-	545,201,774.46	685,380,072.25

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	2、该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	3、该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	4、银行存款和结算备付金均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2010年6月30日）	上年度末（2009年12月31日）
	基准利率增加 0.25%	-24,093.87	-24,176.71
	基准利率减少 0.25%	24,117.20	24,200.18

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其它价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其它价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2010 年 6 月 30 日		2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	364,409,055.96	59.87	543,182,366.46	79.25
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	69,308,000.00	11.39	51,028,220.00	7.45
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其它	-	-	-	-
合计	433,717,055.96	71.26	594,210,586.46	86.70

注：本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 30%-80%；债券及资产支持证券为 0%-60%；权证为 0%-3%；现金和到期日在 1 年以内的政府债券不低于 5%。

6.4.13.4.3.2 其它价格风险的敏感性分析

假 设	1. 基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合的贝塔系数紧密相关；		
	2. 对于上市时间不足一年的股票，使用申银万国行业指数替代股票价格计算其贝塔系数；		
	3. 以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分 析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2010 年 6 月 30 日）	上年度末（2009 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	15,100,929.07	26,493,448.33
业绩比较基准减少 5%	-15,100,929.07	- 26,493,448.33	

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其它事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	364,409,055.96	59.55
	其中：股票	364,409,055.96	59.55
2	固定收益投资	69,308,000.00	11.33
	其中：债券	69,308,000.00	11.33
	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	175,679,782.74	28.71
6	其它各项资产	2,543,085.70	0.42
7	合计	611,939,924.40	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	13,710,000.00	2.25
C	制造业	192,246,672.99	31.59
C0	食品、饮料	39,988,616.57	6.57
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	22,168,937.10	3.64
C5	电子	20,099,628.25	3.30
C6	金属、非金属	4,535,000.00	0.75
C7	机械、设备、仪表	44,595,355.12	7.33
C8	医药、生物制品	52,363,609.26	8.60
C99	其它制造业	8,495,526.69	1.40
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	26,922,687.75	4.42
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	27,099,856.30	4.45

H	批发和零售贸易	47,188,209.32	7.75
I	金融、保险业	13,010,000.00	2.14
J	房地产业	1,992,000.00	0.33
K	社会服务业	42,239,629.60	6.94
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	364,409,055.96	59.87

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600785	新华百货	1,000,002	32,820,065.64	5.39
2	002007	华兰生物	640,008	28,851,560.64	4.74
3	600298	安琪酵母	550,066	19,230,307.36	3.16
4	002081	金螳螂	600,000	18,780,000.00	3.09
5	600054	黄山旅游	800,090	14,737,657.80	2.42
6	600327	大厦股份	1,600,016	14,368,143.68	2.36
7	002306	湘鄂情	600,027	13,560,610.20	2.23
8	600036	招商银行	1,000,000	13,010,000.00	2.14
9	600261	浙江阳光	500,030	11,550,693.00	1.90
10	300039	上海凯宝	400,007	11,352,198.66	1.87
11	000559	万向钱潮	1,000,042	10,360,435.12	1.70
12	000888	峨眉山A	600,080	10,213,361.60	1.68
13	002123	荣信股份	300,060	9,601,920.00	1.58
14	002421	达实智能	300,000	9,537,000.00	1.57
15	000895	双汇发展	200,053	8,716,309.21	1.43
16	002003	伟星股份	500,031	8,495,526.69	1.40
17	600352	浙江龙盛	900,081	8,190,737.10	1.35
18	600570	恒生电子	500,000	7,510,000.00	1.23
19	002214	大立科技	260,000	7,355,400.00	1.21
20	600395	盘江股份	400,000	7,200,000.00	1.18
21	600537	海通集团	400,000	7,196,000.00	1.18
22	600580	卧龙电气	400,000	6,912,000.00	1.14
23	600348	国阳新能	500,000	6,510,000.00	1.07
24	000026	飞亚达A	500,000	6,395,000.00	1.05
25	002158	汉钟精机	300,000	6,021,000.00	0.99
26	002325	洪涛股份	200,025	5,502,687.75	0.90
27	600487	亨通光电	200,000	5,320,000.00	0.87

28	600765	中航重机	500,000	5,305,000.00	0.87
29	002215	诺普信	210,000	5,086,200.00	0.84
30	000858	五粮液	200,000	4,846,000.00	0.80
31	002326	永太科技	100,000	4,810,000.00	0.79
32	002225	濮耐股份	500,000	4,535,000.00	0.75
33	300072	三聚环保	100,000	4,082,000.00	0.67
34	002308	威创股份	200,000	3,728,000.00	0.61
35	300070	碧水源	40,000	3,728,000.00	0.61
36	600129	太极集团	500,000	3,720,000.00	0.61
37	600594	益佰制药	200,000	3,598,000.00	0.59
38	000522	白云山A	300,000	3,483,000.00	0.57
39	000961	中南建设	300,000	2,640,000.00	0.43
40	600223	鲁商置业	300,000	1,992,000.00	0.33
41	300086	康芝药业	25,873	1,358,849.96	0.22
42	300077	国民技术	10,223	1,193,535.25	0.20
43	002405	四维图新	30,285	1,004,856.30	0.17

7.4 报告期内权益投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002003	伟星股份	27,893,079.13	4.07
2	002007	华兰生物	25,104,567.48	3.66
3	000536	闽闽东	22,431,867.35	3.27
4	002225	濮耐股份	19,658,494.02	2.87
5	002089	新海宜	19,573,411.08	2.86
6	002081	金螳螂	17,877,575.07	2.61
7	600054	黄山旅游	17,837,786.66	2.60
8	600395	盘江股份	17,467,489.97	2.55
9	000338	潍柴动力	17,127,521.94	2.50
10	002306	湘鄂情	17,064,401.46	2.49
11	300072	三聚环保	16,859,642.97	2.46
12	002421	达实智能	15,943,190.43	2.33
13	601766	中国南车	15,743,951.14	2.30
14	600785	新华百货	15,631,385.11	2.28
15	600129	太极集团	15,456,905.75	2.26

16	600487	亨通光电	15,153,801.41	2.21
17	600594	益佰制药	14,813,665.85	2.16
18	600348	国阳新能	14,604,226.49	2.13
19	600303	曙光股份	14,279,502.02	2.08
20	000522	白云山 A	14,224,754.80	2.08
21	601111	中国国航	14,107,228.39	2.06
22	300039	上海凯宝	13,753,746.12	2.01

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	37,467,691.49	5.47
2	600537	海通集团	33,666,437.52	4.91
3	601318	中国平安	28,195,347.05	4.11
4	000536	闽闽东	23,365,829.21	3.41
5	601328	交通银行	22,774,278.52	3.32
6	000338	潍柴动力	22,183,226.48	3.24
7	000001	深发展 A	21,109,726.20	3.08
8	000858	五粮液	20,977,338.10	3.06
9	002089	新海宜	18,685,102.71	2.73
10	000063	中兴通讯	18,031,775.61	2.63
11	600418	江淮汽车	17,965,354.40	2.62
12	600303	曙光股份	17,773,634.48	2.59
13	002003	伟星股份	17,768,934.63	2.59
14	601766	中国南车	16,344,523.86	2.38
15	600546	山煤国际	16,212,206.82	2.37
16	000540	中天城投	14,840,540.67	2.17
17	002225	濮耐股份	13,926,495.75	2.03
18	000933	神火股份	13,714,926.97	2.00
19	002154	报喜鸟	13,046,997.12	1.90
20	601001	大同煤业	12,776,301.36	1.86

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	927,378,394.45
卖出股票收入（成交）总额	1,041,145,228.67

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	49,080,000.00	8.06
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	可转债	20,228,000.00	3.32
N-1	其它	-	-
N	合计	69,308,000.00	11.39

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0901042	09 央票 42	500,000	49,080,000.00	8.06
2	113001	中行转债	200,000	20,228,000.00	3.32

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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。

7.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 期末其它各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,418,051.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	741,660.65
5	应收申购款	383,373.96
6	其它应收款	-
7	待摊费用	-
8	其它	-
9	合计	2,543,085.70

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
16,434	28,937.70	347,880,035.09	73.15%	127,682,159.35	26.85%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

份额单位：份

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	10,133,430.25	2.13%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2008 年 7 月 8 日) 基金份额总额	741,799,533.92
本报告期期初基金份额总额	442,781,048.67
本报告期基金总申购份额	173,792,560.77
减:本报告期基金总赎回份额	141,011,415.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	475,562,194.44

注：表内“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人 2010 年 1 月 9 日公告，增聘陈晓翔先生担任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，由其与欧阳沁春先生、苏竞先生共同管理汇添富均衡增长股票型证券投资基金。同时，庞飒先生不再担任该基金的基金经理。

2、基金管理人 2010 年 2 月 6 日公告，增聘吴振翔先生担任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理，由其与何仁科先生共同管理该基金。

3、基金管理人 2010 年 2 月 6 日公告，增聘王栩先生担任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理，由其与苏竞先生共同管理该基金。同时，庞飒先生不再担任该基金的基金经理。

4、《汇添富民营活力股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 5 月 5 日正式生效，齐东超先生任该基金的基金经理。

5、《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基金合同》于 2010 年 6 月 25 日正式生效，刘子龙先生、王致人先生任该基金的基金经理。

6、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
东方证券	2	356,515,062.02	18.22%	-	-	299,725.87	18.47%
中信证券	2	909,921,732.57	46.51%	-	-	739,318.87	45.56%
中金公司	2	11,231,092.53	0.57%	-	-	9,392.93	0.58%
国信证券	2	583,880,740.46	29.85%	21,153,196.40	100.00%	493,690.75	30.43%
国金	2	94,681,160.04	4.84%	-	-	80,477.76	4.96%

证 券							
合 计	10	1,956,229,787.62	100.00%	21,153,196.40	100.00%	1,622,606.18	100.00%

注：1、 此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、 专用交易单元的选择标准和程序：

(1) 基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

(2) 交易交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

3、 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增和退租证券公司交易单元。

10.8 其它重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金 2009 年年度资产净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 1 月 4 日
2	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参加浦发银行基金定	中国证券报、上海证券报、证券时报、管	2010 年 1 月 7 日

	投申购费率优惠活动的公告	理人网站	
3	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳发展银行电子渠道申购费率优惠活动及基金定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 1 月 16 日
4	蓝筹基金 2009 年 4 季报	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 1 月 21 日
5	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金增加平安银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 1 月 21 日
6	汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 2 月 22 日
7	汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 2 月 22 日
8	汇添富基金管理有限公司关于设立汇添富资产管理(香港)有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 2 月 22 日
9	汇添富基金管理有限公司关于调整旗下基金转换业务规则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 3 月 11 日
10	汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 3 月 18 日
11	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金投资诺普信(002215)非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 3 月 18 日

12	汇添富基金管理有限公司关于调整旗下基金转换业务规则的提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 3 月 30 日
13	汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金 2009 年年度报告	国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 3 月 30 日
14	汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金 2010 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 3 月 30 日
15	关于旗下基金参与上海银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 3 月 31 日
16	汇添富基金管理有限公司关于增加江苏银行为代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 4 月 1 日
17	汇添富基金管理有限公司关于调整旗下基金在上海浦东发展银行定期定额投资起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 4 月 7 日
18	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金增加民生银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 4 月 12 日
19	汇添富基金管理有限公司关于增加英大证券为代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 4 月 14 日
20	汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金 2010 年第一季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 4 月 20 日
21	关于增加厦门证券为代销机构并开通基金定投及转换业务的	中国证券报、上海证券报、证券时报、管	2010 年 4 月 29 日

	公告	理人网站	
22	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金继续参与深圳发展银行开展的基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 4 月 30 日
23	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 5 月 13 日
24	汇添富基金管理有限公司关于增加江海证券为代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 5 月 21 日
25	汇添富基金管理有限公司关于开通网上直销一户多卡功能的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 5 月 21 日
26	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信银行个人网银申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 5 月 31 日
27	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 6 月 3 日
28	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与中投证券网上申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 6 月 28 日
29	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金参与安信证券网上申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 6 月 28 日
30	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金继续参与中国邮政储	中国证券报、上海证券报、证券时报、管	2010 年 6 月 30 日

	蓄银行开展的网上申购基金费率优惠活动的公告	理人网站	
31	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金继续参与交通银行开展的网上银行申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富蓝筹稳健灵活配置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、报告期内汇添富蓝筹稳健灵活配置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。

11.2 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

11.3 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

2010 年 8 月 26 日