

汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金

2013 年第 2 季度报告

2013 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

报告送出日期：2013 年 7 月 19 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 2013 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 2013 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 | 175,673,804.66 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（2013年4月1日—2013年6月30日） |
|----------------|---------------------------|
| 1.本期已实现收益 | 21,316,734.20 |
| 2.本期利润 | 16,842,974.29 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0652 |
| 4.期末基金资产净值 | 213,837,307.97 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.217 |

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。

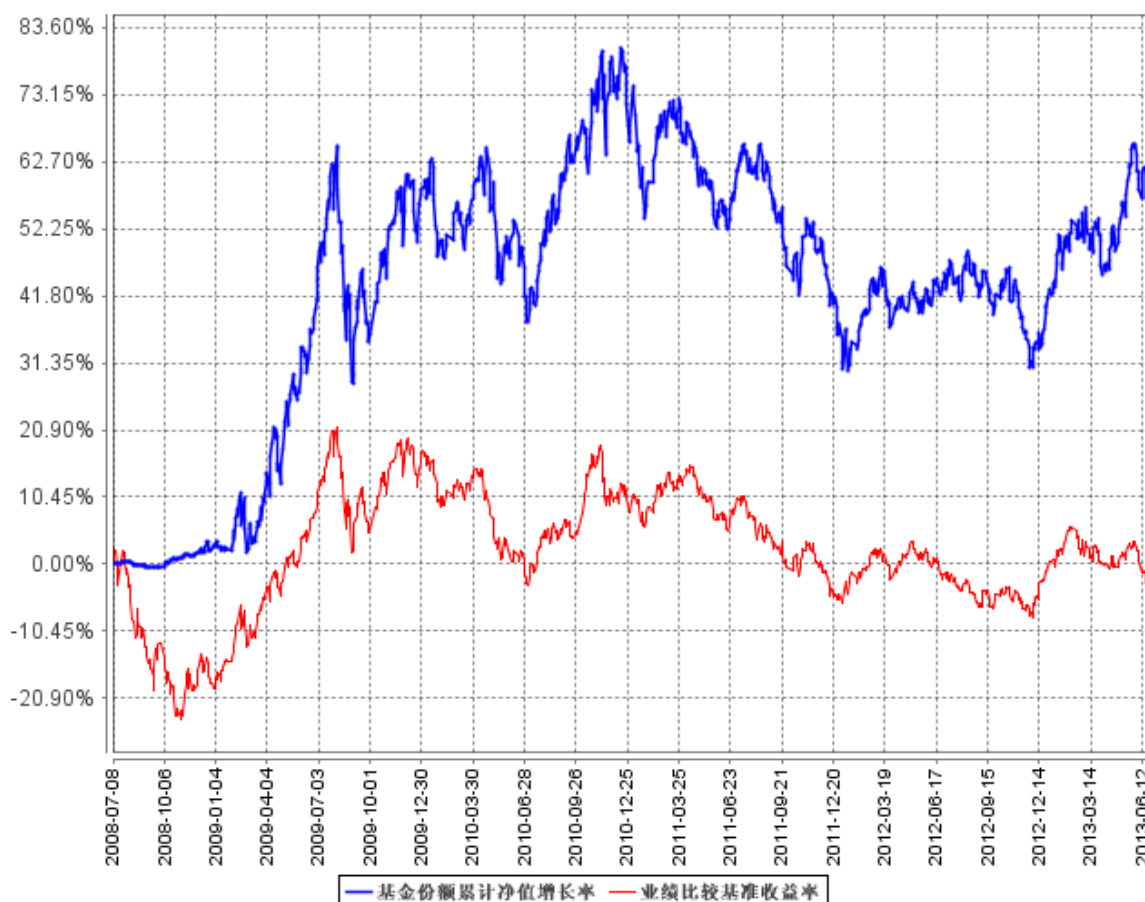
3.2 基金净值表现

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 | 3.93% | 1.19% | -6.75% | 0.87% | 10.68% | 0.32% |

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩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 | 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，汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资 | 2008 年 7 月 8 日 | - | 10 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。 |

| | | | | |
|--|--------------|--|--|---|
| | 基金的基金经 理。 | | | 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 2013 年 5 月 10 日任汇 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 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、社保间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 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，包括出口、工业增加值、PPI、投资、信贷等一系列经济数据显示国内经济弱势运行，但新一届政府并没有显露出台经济刺激措施的意愿，美联储退出量化宽松政策的预期进一步明确，资金抽离新兴市场，国内外宏观经济环境和企业盈利趋势对证券市场影响偏负面。在以金融地产为代表的大类资产拖累下，上证指数持续走低，但与此同时市场各类资产结构分化进一步走向极致，以电子、传媒、环保、医药为代表的成长类板块逆势走强，创业板指数迭创反弹新高，基金业绩两极分化为近年来所罕见。

本基金对二季度市场环境一直持较为谨慎心态，操作策略上适当控制股票仓位，组合构建以成长股为核心，操作思路基本吻合二季度市场结构特征，基金业绩表现取得一定超额收益。但对市场结构分化的程度还是估计不足，以电子、传媒为代表的板块在二季度继续高歌猛进的市场表现远超预期，组合配置较少，对基金业绩二季度造成一定影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

二季度本基金收益率 3.93%，同期业绩比较基准收益率-6.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，目前国内经济看不到明显的复苏迹象和新的增长动力，政府对经济低位运行的容忍性明显提升，推动经济结构调整和转型升级是新一届政府工作的重点，从宏观经济和企业盈利层面三季度难有超预期的正面因素。虽然在既往经验的路径依赖下，市场仍有经济刺激和风格转换的憧憬，但在目前经济环境和政策信号下这一预期实现的可能性并不乐观。我们认为三季度

市场更为可能的运行趋势是指数低位震荡，市场从上半年价值和成长为主线的结构性分化可能转向所谓的成长类板块内部依据确定性和估值水平而出现的分化。

三季度，我们将沿着经济结构调整和转型升级这一主线，在医药、环保、装饰园林和大众消费等领域积极寻找那些业绩确定性高、估值和成长性相匹配的个股优化组合、规避风险、合理交易，力求在有效控制风险的前提下提升基金业绩。

§ 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 | 151,803,244.76 | 70.08 |
| | 其中：股票 | 151,803,244.76 | 70.08 |
| 2 | 固定收益投资 | 22,925,208.40 | 10.58 |
| | 其中：债券 | 22,925,208.40 | 10.58 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 15,000,000.00 | 6.93 |
| | 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 | 21,806,060.29 | 10.07 |
| 6 | 其他资产 | 5,066,383.05 | 2.34 |
| 7 | 合计 | 216,600,896.50 | 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 | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 96,304,423.51 | 45.04 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 24,793,321.25 | 11.59 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 13,046,000.00 | 6.10 |
| J | 金融业 | 5,438,000.00 | 2.54 |
| K | 房地产业 | 5,019,000.00 | 2.35 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业 | 2,920,000.00 | 1.37 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 4,282,500.00 | 2.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 151,803,244.76 | 70.99 |

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 | 600594 | 益佰制药 | 640,000 | 19,782,400.00 | 9.25 |
| 2 | 600406 | 国电南瑞 | 700,000 | 10,451,000.00 | 4.89 |
| 3 | 600315 | 上海家化 | 220,053 | 9,900,184.47 | 4.63 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 50,000 | 9,618,500.00 | 4.50 |
| 5 | 300090 | 盛运股份 | 300,000 | 9,264,000.00 | 4.33 |
| 6 | 600587 | 新华医疗 | 202,916 | 8,408,839.04 | 3.93 |
| 7 | 002325 | 洪涛股份 | 700,000 | 8,330,000.00 | 3.90 |
| 8 | 000400 | 许继电气 | 300,000 | 8,124,000.00 | 3.80 |
| 9 | 600867 | 通化东宝 | 500,000 | 7,445,000.00 | 3.48 |
| 10 | 300039 | 上海凯宝 | 500,000 | 6,325,000.00 | 2.96 |

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 | - | - |
| | 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 | 20,268,000.00 | 9.48 |
| 7 | 可转债 | 2,657,208.40 | 1.24 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 22,925,208.40 | 10.72 |

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 | 1182312 | 11 五矿 MTN2 | 200,000 | 20,268,000.00 | 9.48 |
| 2 | 110015 | 石化转债 | 26,620 | 2,657,208.40 | 1.24 |

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

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 | 199,824.64 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,180,025.93 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 587,087.36 |
| 5 | 应收申购款 | 99,445.12 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,066,383.05 |

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 | 110015 | 石化转债 | 2,657,208.40 | 1.24 |

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有流通受限股票。

§ 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 | 290,164,593.91 |
| 本报告期基金总申购份额 | 9,668,107.56 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 124,158,896.81 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 175,673,804.66 |

§ 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。

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
2013 年 7 月 19 日