

汇添富均衡增长股票型证券投资基金  
2007 年半年度报告

报告期间：2007 年 1 月 1 日至 2007 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：2007 年 8 月 28 日

## 重要提示

基金管理人——汇添富基金管理有限公司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。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 2007 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

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。

## 目录

|                        |    |
|------------------------|----|
| 第一节 基金简介.....          | 3  |
| 第二节 主要财务指标、基金净值表现..... | 4  |
| 第三节 管理人报告.....         | 6  |
| 第四节 托管人报告.....         | 7  |
| 第五节 财务会计报告（未经审计）.....  | 8  |
| 第六节 投资组合报告.....        | 19 |
| 第七节 基金份额持有人情况.....     | 23 |
| 第八节 基金份额变动情况.....      | 23 |
| 第九节 重大事件揭示.....        | 24 |
| 第十节 备查文件目录.....        | 27 |

## 第一节 基金简介

### 一、基金基本情况

基金名称：汇添富均衡增长股票型证券投资基金

基金简称：添富均衡

交易代码：519018

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2006年8月7日

报告期末基金份额总额：2,331,976,426.79份

### 二、基金投资基本情况

投资目标：本基金应用“由上而下”和“自下而上”相结合的投资策略，通过行业的相对均衡配置和投资布局于具有持续增长潜质的企业，在有效控制风险的前提下，分享中国经济的持续增长，以持续稳定地获取较高的投资回报。

投资策略：本基金采用“由上而下”和“自下而上”相结合的投资方法，适度动态调整资产配置，行业保持相对均衡配置，同时通过三级过滤模型（Tri-Filtering Model）来构建核心股票池，深入剖析核心股票池企业的增长逻辑和增长战略，以达到审慎精选，并对投资组合进行积极而有效的风险管理（详见本基金的基金合同和招募说明书）。

业绩比较基准：沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

风险收益特征：本基金是主动型的股票基金，属于证券投资基金中风险偏上的品种。

### 三、基金管理人

名称：汇添富基金管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区大沽路288号6幢538室

办公地址：上海市富城路99号震旦国际大楼21层

邮政编码：200120

法定代表人：桂水发

信息披露负责人：李文

联系电话：021-28932888

传真：021-28932998

电子邮箱: service@99fund.com

#### 四、基金托管人

名称: 中国工商银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码: 100032

法定代表人: 姜建清

信息披露负责人: 蒋松云

联系电话: 010-66106912

传真: 010-66106904

电子邮箱: custody@icbc.com.cn

#### 五、信息披露方式

信息披露报纸名称: 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》

登载本报告正文的基金管理人互联网网址: <http://www.99fund.com>

本报告置备地点: 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层

#### 六、注册登记机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

办公地址: 北京西城区金融大街 27 号投资广场 22 层

### 第二节 主要财务指标、基金净值表现

#### 一、主要财务指标

单位: 元

|   |              |                  |
|---|--------------|------------------|
| 1 | 基金本期净收益      | 3,280,557,290.74 |
| 2 | 基金份额本期净收益    | 0.8678           |
| 3 | 期末可供分配基金收益   | 2,080,721,835.70 |
| 4 | 期末可供分配基金份额收益 | 0.8923           |
| 5 | 期末基金资产净值     | 5,201,437,260.75 |
| 6 | 期末基金份额净值     | 2.2305           |
| 7 | 基金加权平均净值收益率  | 48.1553%         |
| 8 | 本期基金份额净值增长率  | 55.4321%         |
| 9 | 基金份额累计净值增长率  | 137.4692%        |

注: 上述财务指标中“本期”指 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日期间。

上述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(例如: 开放式基

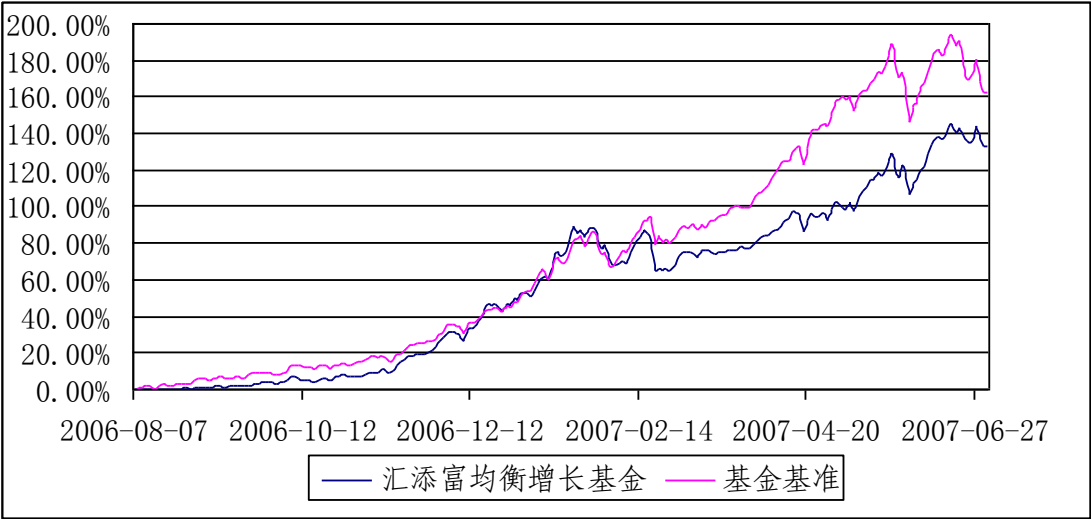
金的申购赎回费、基金转换费等), 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 二、基金净值表现

### 1、本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

| 阶段         | 净值增长率<br>(1) | 净值增长率标准差<br>(2) | 业绩比较基准收益率<br>(3) | 业绩比较基准收益率标准差<br>(4) | (1) - (3) | (2) - (4) |
|------------|--------------|-----------------|------------------|---------------------|-----------|-----------|
| 过去 1 个月    | 4.96%        | 2.37%           | -3.53%           | 2.44%               | 8.49%     | -0.07%    |
| 过去 3 个月    | 33.41%       | 2.15%           | 27.87%           | 2.02%               | 5.54%     | 0.13%     |
| 过去 6 个月    | 55.43%       | 2.29%           | 67.21%           | 2.02%               | -11.78%   | 0.27%     |
| 自基金合同生效起至今 | 137.47%      | 1.83%           | 162.47%          | 1.64%               | -25.00%   | 0.19%     |

### 2、本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:



注: 根据本基金合同所规定的资产配置, 股票资产 60%-95%, 债券资产 0%-35%, 权证类资产 0-3%, 现金类资产最低为 5%。2007 年 6 月 30 日实际履行为, 股票资产占基金资产净值为 90.04%, 债券资产占基金资产净值为 3.94%, 现金类资产占基金资产净值为 9.99%。

### 第三节 管理人报告

#### 一、基金管理人及基金经理情况

##### 1、基金管理人及其基金管理的经验

基金管理人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，注册资本金为1亿元人民币。截止到2007年6月30日，本基金管理人管理四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、汇添富货币市场基金、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。

##### 2、基金经理简介

张晖先生，上海财经大学数量经济学硕士，十二年证券从业经验。曾任申银万国研究所高级行业研究员、富国基金管理公司研究主管、汉盛基金基金经理和天益价值基金基金经理。2005年4月加入汇添富基金管理有限公司，现任公司副总经理兼投资总监、投资决策委员会副主席、兼任汇添富均衡增长基金基金经理。

庞飒先生，浙江大学生命科学院理学硕士，七年证券从业经验。曾任申银万国证券研究所行业分析师、富国基金管理有限公司行业分析师及投资策略小组成员。2005年4月加入汇添富基金管理有限公司，现任汇添富优势精选基金和汇添富均衡增长基金基金经理、投资决策委员会成员。

#### 二、报告期内基金运作遵规守信情况声明

基金管理人声明：在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

#### 三、报告期内基金投资策略和业绩表现说明与解释

2007年上半年，中国证券市场延续2006年的牛市状态，走出单边上涨行情。1-5月份市场整体表现出比较强的资金推动特征，相当数量的股票的上涨缺乏基本面的支持，主要体现在级差股和小盘股。5月底开始，以政府突然出台印花税率大幅度上调为导火索，A股市场出现大幅度向下修正。正如我们预期一样，资金推动型的投机行情结束，股票市场定价结构性问题得到有效纠正。

本基金的运作始终坚持从基本面出发，进行中长期投资，从组合特征看，股票换手率较低，持有周期长。这一策略在 1-4 月份遇到了意想不到的压力，A 股市场存在较多的非理性投资和错误定价行为。由于本基金对年初的资金推动行情的心理准备不足，导致组合中部分股票的相对表现落后，直接导致基金短期业绩不理想。我们通过分析，坚信结构性错误定价会得到纠正。令人欣慰的是，5 月下旬到 6 月份，市场表现印证了我们的判断。我们坚持“实施均衡配置和个股适度集中”的策略，积极在大盘蓝筹股和中盘绩优股进行布局，在二季度取得了非常良好的业绩表现，本基金的排名也稳步上升。

#### **四、宏观市场、证券市场及行业走势简要展望**

展望未来，外汇储备快速增加持续给国内金融系统注入流动性，并且强有力地支持着人民币升值预期。同时，宽松的货币政策和实体经济的强劲需求不断加强潜在通货膨胀压力。虽然存在宏观调控预期和目前整体市场估值水平大幅度提升的现状，但是我们认为下半年 A 股市场的整体表现依然看好，同时 2 季度出现的结构性分化趋势也会持续下去。

下一阶段，我们将坚持“以基本面分析为立足点，挑选高质量的证券做中长期投资布局”的投资理念，坚持“行业相对均衡、个股适度集中、适时动态调整”的配置思路。在行业选择上，我们依然看好消费服务业和稀缺性资源行业，以及制造业中的优势企业。个股选择方面，我们偏好于战略清晰、管理规范、财务透明等具有持续竞争优势的企业。

#### **第四节 托管人报告**

2007年上半年，本基金托管人在对汇添富均衡增长基金的托管过程中，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。

2007年上半年，汇添富均衡增长基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富均衡增长基金的投资运作、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。

本托管人依法对汇添富基金管理有限公司在2007年上半年所编制和披露的

汇添富均衡增长基金半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2007年8月20日

## 第五节 财务会计报告（未经审计）

### 一、半年度会计报表

#### （一）资产负债表

单位：元

| 项目        | 附注   | 2007年6月30日       | 2006年12月31日      |
|-----------|------|------------------|------------------|
| 资产        |      |                  |                  |
| 银行存款      | （四）1 | 314,869,720.95   | 260,241,133.16   |
| 清算备付金     |      | 8,018,372.89     | 10,282,907.34    |
| 交易保证金     |      | 2,535,484.68     | 1,000,000.00     |
| 应收证券清算款   | （四）2 | 5,532,603.47     | 27,045,521.17    |
| 应收股利      |      | 162,000.00       | —                |
| 应收利息      | （四）4 | 3,455,390.05     | 1,961,895.16     |
| 应收申购款     |      | 7,279,409.85     | 38,372,747.22    |
| 其他应收款     |      | —                | —                |
| 股票投资市值    | （四）5 | 4,683,201,015.57 | 7,374,604,432.26 |
| 其中：股票投资成本 | （四）5 | 2,612,216,403.61 | 4,813,379,975.61 |
| 债券投资市值    | （四）5 | 204,872,820.00   | 148,412,375.65   |
| 其中：债券投资成本 | （四）5 | 204,872,820.00   | 148,412,375.65   |
| 权证投资市值    | （四）5 | —                | 17,673,000.00    |
| 其中：权证投资成本 | （四）5 | —                | —                |
| 买入返售证券    |      | —                | —                |
| 待摊费用      |      | —                | —                |
| 资产总计      |      | 5,229,926,817.46 | 7,879,594,011.96 |
| 负债        |      |                  |                  |
| 应付证券清算款   | （四）3 | —                | 6,635,291.13     |
| 应付赎回款     |      | 12,925,585.30    | 48,193,268.91    |
| 应付赎回费     |      | 48,714.48        | 181,632.77       |
| 应付管理人报酬   |      | 6,408,605.66     | 9,112,308.18     |
| 应付托管费     |      | 1,068,100.95     | 1,518,718.01     |
| 应付佣金      | （四）6 | 6,484,561.54     | 2,666,640.28     |
| 应付利息      |      | —                | 4940.28          |
| 应付收益      |      | —                | —                |

|            |        |                  |                  |
|------------|--------|------------------|------------------|
| 其他应付款      | (四) 7  | 1,250,837.50     | 1,007,739.80     |
| 卖出回购证券款    |        |                  | 19,600,000.00    |
| 预提费用       | (四) 8  | 303,151.28       | 230,000.00       |
| 负债合计       |        | 28,489,556.71    | 89,150,539.36    |
| 持有人权益      |        |                  |                  |
| 实收基金       | (四) 9  | 2,331,976,426.79 | 5,098,980,440.33 |
| 未实现利得      | (四) 10 | 788,738,998.26   | 2,534,847,297.32 |
| 未分配收益      |        | 2,080,721,835.70 | 156,615,734.95   |
| 持有人权益合计    |        | 5,201,437,260.75 | 7,790,443,472.60 |
| 负债及持有人权益总计 |        | 5,229,926,817.46 | 7,879,594,011.96 |
| 基金份额净值     |        | 2.2305           | 1.5278           |

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## (二) 经营业绩表

单位：元

| 项目       | 附注     | 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日 |
|----------|--------|---------------------------------|
| 收入：      |        | 3,340,369,076.39                |
| 股票差价收入   | (四) 11 | 3,287,879,402.48                |
| 债券差价收入   | (四) 12 | -219,655.30                     |
| 权证差价收入   | (四) 13 | 17,534,720.71                   |
| 债券利息收入   |        | 2,432,801.78                    |
| 存款利息收入   |        | 1,608,696.40                    |
| 股利收入     |        | 19,722,210.81                   |
| 买入返售证券收入 |        | —                               |
| 其他收入     | (四) 14 | 11,410,899.51                   |
| 费用：      |        | 59,811,785.65                   |
| 基金管理人报酬  |        | 51,002,516.49                   |
| 基金托管费    |        | 8,500,419.37                    |
| 卖出回购证券支出 |        | 66,731.28                       |
| 其他费用     | (四) 15 | 242,118.51                      |
| 其中：信息披露费 |        | 178,520.30                      |
| 审计费用     |        | 44,630.98                       |
| 基金净收益：   |        | 3,280,557,290.74                |
| 加：未实现利得  |        | -507,912,844.69                 |
| 基金经营业绩   |        | 2,772,644,446.05                |

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### (三) 收益分配表

单位：元

| 项目           | 附注    | 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日 |
|--------------|-------|---------------------------------|
| 本期基金净收益      |       | 3,280,557,290.74                |
| 加：期初基金净收益    |       | 156,615,734.95                  |
| 加：本期损益平准金    |       | -920,290,967.90                 |
| 可供分配基金净收益    |       | 2,516,882,057.79                |
| 减：本期已分配基金净收益 | (四)16 | 436,160,222.09                  |
| 期末基金净收益      |       | 2,080,721,835.70                |

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### (四) 基金净值变动表

单位：元

| 项目                   | 附注    | 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日 |
|----------------------|-------|---------------------------------|
| 期初基金净值               |       | 7,790,443,472.60                |
| 本期经营活动               |       |                                 |
| 基金净收益                |       | 3,280,557,290.74                |
| 未实现利得                |       | -507,912,844.69                 |
| 经营活动产生的基金净值变动数       |       | 2,772,644,446.05                |
| 本期基金份额交易             |       |                                 |
| 基金申购款                |       | 4,203,230,546.62                |
| 基金赎回款                |       | 9,128,720,982.43                |
| 基金份额交易产生的基金净值变动数     |       | -4,925,490,435.81               |
| 本期向持有人分配收益           |       |                                 |
| 向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数 | (四)16 | 436,160,222.09                  |
| 期末基金净值               |       | 5,201,437,260.75                |

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

注：由于本基金于 2006 年 8 月 7 日成立，无比较式经营业绩表、收益分配表以及基金净值变动表的上年度可比期间，因此经营业绩表、收益分配表和基金净值变动表只列示本报告期数据，特此说明。

## 二、会计报表附注

### (一) 基金基本情况

汇添富均衡增长股票型证券投资基金（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[2006]125号文《关于同意汇添富均衡增长股票型证券投资基金募集的批复》批准，由汇添富基金管理有限公司作为基金发起人，向社会公开发行募集并于2006年8月7日正式成立。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为4,935,775,576.48份基金份额。本基金的基金管理人为汇添富基金管理有限公司，注册登记人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。

## （二）主要会计政策、会计估计和重大会计差错

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。本报告期末发生重大会计差错。

## （三）主要税项

### 1、印花税

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》，基金管理人运用基金买卖股票按照2‰的税率征收印花税。

根据财税[2005]11号文《财政部、国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》，从2005年1月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由现行的2‰调整为1‰。

根据财税[2007]84号文《财政部、国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》，从2007年5月30日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由现行1‰调整为3‰。即对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据，由立据双方当事人分别按3‰的税率缴纳证券（股票）交易印花税。

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，自2005年6月13日起，基金作为流通股股东在股权分置改革中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

### 2、营业税、企业所得税

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，以发行基金方式募集资金不属于营业税的征

税范围，不征收营业税；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》，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。

### 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》，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。

#### （四）会计报表重要项目说明（单位：元）

##### 1、银行存款

| 项目   | 2007年6月30日     |
|------|----------------|
| 活期存款 | 314,869,720.95 |
| 定期存款 | —              |
| 合计   | 314,869,720.95 |

本基金在本报告期末投资于定期存款。

##### 2、应收证券清算款

| 项目                  | 2007年6月30日   |
|---------------------|--------------|
| 中国证券登记结算有限责任公司上海分公司 | 1,163,823.16 |
| 中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司 | 4,368,780.31 |

##### 3、应付证券清算款

| 项目                  | 2007年6月30日 |
|---------------------|------------|
| 中国证券登记结算有限责任公司上海分公司 | —          |
| 中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司 | —          |

##### 4、应收利息

| 项目 | 2007年6月30日 |
|----|------------|
|----|------------|

|           |              |
|-----------|--------------|
| 应收银行存款利息  | 66,800.11    |
| 应收清算备付金利息 | 3,247.47     |
| 应收债券利息    | 3,385,342.47 |
| 合计        | 3,455,390.05 |

#### 5、投资估值增值

2007年6月30日

| 项目   | 市值               | 成本               | 估值增值             |
|------|------------------|------------------|------------------|
| 股票投资 | 4,683,201,015.57 | 2,612,216,403.61 | 2,070,984,611.96 |
| 债券投资 | 204,872,820.00   | 204,872,820.00   | — —              |
| 权证投资 | — —              | — —              | — —              |
| 合计   | 4,888,073,835.57 | 2,817,089,223.61 | 2,070,984,611.96 |

#### 6、应付佣金

| 项目           | 2007年6月30日   |
|--------------|--------------|
| 东方证券股份有限公司   | 1,532,815.34 |
| 海通证券股份有限公司   | 688,482.41   |
| 申银万国证券股份有限公司 | 641,450.03   |
| 平安证券有限责任公司   | 404,476.27   |
| 中信建投证券有限责任公司 | 614,142.64   |
| 光大证券有限责任公司   | 138,354.90   |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 440,472.73   |
| 招商证券股份有限公司   | 732,295.67   |
| 兴业证券股份有限公司   | 464,621.29   |
| 中信证券股份有限公司   | 827,450.26   |
| 合计           | 6,484,561.54 |

#### 7、其他应付款

| 项目        | 2007年6月30日   |
|-----------|--------------|
| 券商垫付交易保证金 | 1,250,000.00 |
| 银行间结算费用   | 387.50       |
| 银行间帐户维护费  | 450.00       |
| 合计        | 1,250,837.50 |

#### 8、预提费用

| 项目    | 2007年6月30日 |
|-------|------------|
| 信息披露费 | 178,520.30 |
| 审计费用  | 124,630.98 |
| 合计    | 303,151.28 |

#### 9、实收基金

| 项目     | 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------------------|
| 期初数    | 5,098,980,440.33                |
| 加：本期申购 | 2,360,492,393.19                |
| 减：本期赎回 | 5,127,496,406.73                |
| 期末数    | 2,331,976,426.79                |

#### 10、未实现利得

| 项目              | 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---------------------------------|
| 期初数             | 2,534,847,297.32                |
| 加：投资估值增值        | -507,912,844.69                 |
| 加：本期申购的未实现利得平准金 | 1,446,257,721.71                |
| 减：本期赎回的未实现利得平准金 | 2,684,453,176.08                |
| 期末数             | 788,738,998.26                  |

#### 11、股票差价收入

| 项目         | 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 9,252,759,997.50                |
| 减：应付佣金     | 7,764,018.07                    |
| 减：卖出股票成本总额 | 5,957,116,576.95                |
| 股票差价收入     | 3,287,879,402.48                |

#### 12、债券差价收入

| 项目         | 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------|
| 卖出债券成交总额   | 614,461,920.41                  |
| 减：卖出债券成本总额 | 604,488,165.84                  |
| 减：应收利息总额   | 10,193,409.87                   |
| 债券差价收入     | -219,655.30                     |

#### 13、权证差价收入

| 项目         | 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------|
| 卖出权证成交总额   | 17,534,720.71                   |
| 减：卖出权证成本总额 | —                               |
| 权证差价收入     | 17,534,720.71                   |

#### 14、其他收入

| 项目      | 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 11,410,899.51                   |
| 合计      | 11,410,899.51                   |

#### 15、其他费用

| 项目      | 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------|
| 信息披露费   | 178,520.30                      |
| 审计费用    | 44,630.98                       |
| 银行账户维护费 | 11,610.00                       |

|         |            |
|---------|------------|
| 银行划款费用  | 4,639.63   |
| 银行间结算费用 | 2,717.60   |
| 合计      | 242,118.51 |

#### 16、本期已分配基金净收益

|          | 分红公告日      | 权益登记日、<br>除息日 | 每10份基金份额<br>收益分配数 | 收益分配金额         |
|----------|------------|---------------|-------------------|----------------|
| 第一次分红    | 2007年2月26日 | 2007年2月28日    | 1.00              | 436,160,222.09 |
| 本期累计收益分配 |            |               | 1.00              | 436,160,222.09 |

#### (五) 关联方关系及其交易

##### 1、主要关联方关系

| 企业名称         | 与本基金的关系                    |
|--------------|----------------------------|
| 汇添富基金管理有限公司  | 基金发起人、基金管理人、基金直销机构、基金份额持有人 |
| 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             |
| 东航金控控股有限责任公司 | 基金管理人股东                    |
| 文汇新民联合报业集团   | 基金管理人股东                    |

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。(由于本基金于2006年8月7日成立，无上年度可比期间的关联交易，特此说明)

##### 2、通过主要关联方席位进行的交易

通过关联方东方证券股份有限公司席位进行交易的情况如下：

单位：元

| 东方证券     |           | 2007年1月1日至2007年6月30日 |
|----------|-----------|----------------------|
| 股票<br>投资 | 本期成交金额    | 3,324,578,194.67     |
|          | 占本期成交总额比例 | 25.55%               |
| 债券<br>投资 | 本期成交金额    | ——                   |
|          | 占本期成交总额比例 | ——                   |
| 债券<br>回购 | 本期成交金额    | ——                   |

|    |           |              |
|----|-----------|--------------|
|    | 占本期成交总额比例 | ——           |
| 佣金 | 本期发生额     | 2,676,061.57 |
|    | 占本期佣金总额比例 | 25.44%       |

上述佣金按市场佣金率计算，并以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

### 3、关联方报酬

#### (1) 基金管理人报酬

##### 基金管理费

A 基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

B 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

本基金的基金管理人报酬计提与支付情况如下：

单位：元

|      | 2007年1月1日至2007年6月30日 |
|------|----------------------|
| 期初余额 | 9,112,308.18         |
| 本期计提 | 51,002,516.49        |
| 本期支付 | 53,706,219.01        |
| 期末余额 | 6,408,605.66         |

#### (2) 基金托管人报酬

##### 基金托管费

A 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：

$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

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

B 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付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

本基金的基金托管费计提与支付情况如下：

单位：元

|      | 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日 |
|------|---------------------------------|
| 期初余额 | 1,518,718.01                    |
| 本期计提 | 8,500,419.37                    |
| 本期支付 | 8,951,036.43                    |
| 期末余额 | 1,068,100.95                    |

#### 4、由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，并按银行间同业存款利率计息，由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入情况如下：

单位：元

| 项目     | 2007 年 6 月 30 日 |
|--------|-----------------|
| 银行存款余额 | 314,869,720.95  |

| 项目          | 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------|
| 银行存款产生的利息收入 | 1,373,489.07                    |

#### 5、与关联方银行间同业市场的债券（含回购）交易

本报告期本基金与关联方未发生银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6、关联方持有基金份额（单位：份）：

##### （1）基金管理人所持有的本基金份额

| 项目         | 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------|
| 期初持有基金份额   | 0.00                            |
| 加：本期认购/申购  | 2,937,017.62                    |
| 其中：基金分红再投资 |                                 |
| 减：本期赎回     |                                 |

|                           |                     |
|---------------------------|---------------------|
| 期末持有基金份额                  | 2,937,017.62        |
| 基金管理人期末持有份额<br>占年末基金总份额比例 | 0.1259%             |
| 认购/申购费率                   | ≥1000 万元每笔收取 1000 元 |
| 赎回费率                      | 1 年以内每笔收取 0.5 %     |

(2) 基金管理人主要股东及其控制的机构所持有的本基金份额

本报告期内，基金管理人主要股东及其控制的机构未持有本基金份额。

(3) 基金管理人的基金从业人员持有本基金份额的总量及占该只基金总份额的比例。

本报告期内，基金管理人的基金从业人员未持有本基金份额

(六) 报告期末流通转让受到限制的基金资产

截至2007年6月30日止，本基金无流通转让受到限制的基金资产。

(七) 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

(八) 资产负债表日后事项

根据中国证监会的相关规定，本基金于2007年7月1日起实施新会计准则。实施新会计准则后，基金将全面采用公允价值进行会计计量，基金估值方法及个别会计政策方面的变更不会对投资者利益造成实质性影响。

除上述事项外，截至本财务报表批准报出日，本基金并无其他需要作披露的资产负债表日后事项。

(九) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的承诺事项。

(十) 其他重要事项

根据《关于 2006 年度证券投资基金和基金管理公司年度报告编制及审计工作有关事项的通知》（证监会计字[2007]11 号）以及《关于证券投资基金执行《企业会计准则》有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15 号）的要求，暂存于以基金管理公司名义开立的相关账户中的基金认购、申购款等资金在 2006 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日期间（简称利息期间）生成的利息，按以下公式在各基金之间分摊，并于 2007 年 6 月 30 日前划入基金资产。（对最后一次结息日至 6 月 30 日期间的利息，于实际收到后入账）：

某只基金应摊得的利息 = 该基金在利息期间认申购金额占全部基金在利息期间认申购总金额的百分比 × (利息期间相关账户生成的利息总额 - 已支付的相关手续费和账户维护费等费用)

根据上述要求和计算公式, 本基金应摊得的利息为人民币 187,208.06 元, 并于 2007 年 6 月 28 日划入基金资产, 占当日基金资产净值的 0.0035%。

## 第六节 投资组合报告

### 一、报告期末基金资产组合情况

| 项目名称         | 项目市值(元)          | 占基金资产总值比例 |
|--------------|------------------|-----------|
| 股 票          | 4,683,201,015.57 | 89.55%    |
| 债 券          | 204,872,820.00   | 3.92%     |
| 权 证          | ——               | ——        |
| 银行存款及清算备付金合计 | 322,888,093.84   | 6.17%     |
| 其他资产         | 18,964,888.05    | 0.36%     |
| 资产总值         | 5,229,926,817.46 | 100.00%   |

### 二、报告期末按行业分类的股票投资组合

| 分 类              | 股票市值(元)          | 占基金资产净值比例 |
|------------------|------------------|-----------|
| A 农、林、牧、渔业       | 144,092,076.00   | 2.77%     |
| B 采掘业            | 275,407,933.91   | 5.29%     |
| C 制造业            | 2,062,937,267.15 | 39.66%    |
| C0 食品、饮料         | 780,925,022.88   | 15.01%    |
| 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   | 632,400,109.72   | 12.16%    |
| C5 电子            | 20,516,606.07    | 0.39%     |
| C6 金属、非金属        | 91,011,136.50    | 1.75%     |
| C7 机械、设备、仪表      | 380,759,140.78   | 7.32%     |
| C8 医药、生物制品       | 157,325,251.20   | 3.02%     |
| 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       | 50,776,302.52    | 0.98%     |
| G 信息技术业          | 172,295,333.81   | 3.31%     |

|           |                  |        |
|-----------|------------------|--------|
| H 批发和零售贸易 | 464,870,202.88   | 8.94%  |
| I 金融、保险业  | 913,097,235.43   | 17.55% |
| J 房地产业    | 558,585,545.87   | 10.74% |
| K 社会服务业   | ——               | ——     |
| L 传播与文化产业 | ——               | ——     |
| M 综合类     | 41,139,118.00    | 0.79%  |
|           |                  |        |
| 合计        | 4,683,201,015.57 | 90.04% |

三、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数 量        | 期末市值（元）        | 市值占基金资产净值比例 |
|----|--------|-------|------------|----------------|-------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台  | 3,989,300  | 477,439,424.00 | 9.18%       |
| 2  | 600036 | 招商银行  | 14,800,000 | 363,784,000.00 | 6.99%       |
| 3  | 002024 | 苏宁电器  | 7,532,000  | 353,702,720.00 | 6.80%       |
| 4  | 600143 | 金发科技  | 5,921,709  | 228,222,664.86 | 4.39%       |
| 5  | 000869 | 张 裕 A | 3,523,466  | 216,622,689.68 | 4.16%       |
| 6  | 600048 | 保利地产  | 4,579,929  | 210,356,138.97 | 4.04%       |
| 7  | 601318 | 中国平安  | 2,301,053  | 164,548,300.03 | 3.16%       |
| 8  | 002007 | 华兰生物  | 3,781,857  | 157,325,251.20 | 3.02%       |
| 9  | 600066 | 宇通客车  | 5,643,526  | 153,729,648.24 | 2.96%       |
| 10 | 600030 | 中信证券  | 2,802,566  | 148,451,921.02 | 2.85%       |
| 11 | 000829 | 天音控股  | 4,301,256  | 144,092,076.00 | 2.77%       |
| 12 | 000755 | 山西三维  | 5,269,134  | 136,365,187.92 | 2.62%       |
| 13 | 600000 | 浦发银行  | 3,717,001  | 136,005,066.59 | 2.61%       |
| 14 | 000983 | 西山煤电  | 4,747,481  | 134,021,388.63 | 2.58%       |
| 15 | 000002 | 万 科 A | 7,004,200  | 133,920,304.00 | 2.57%       |
| 16 | 000402 | 金 融 街 | 3,913,627  | 113,495,183.00 | 2.18%       |
| 17 | 600028 | 中国石化  | 8,050,000  | 106,421,000.00 | 2.05%       |
| 18 | 601628 | 中国人寿  | 2,439,989  | 100,307,947.79 | 1.93%       |
| 19 | 600875 | 东方电机  | 1,392,416  | 88,947,534.08  | 1.71%       |
| 20 | 000568 | 泸州老窖  | 2,063,252  | 86,862,909.20  | 1.67%       |
| 21 | 600406 | 国电南瑞  | 2,718,297  | 81,956,654.55  | 1.58%       |
| 22 | 600331 | 宏达股份  | 1,609,072  | 77,959,538.40  | 1.50%       |
| 23 | 600315 | 上海家化  | 1,809,804  | 73,966,689.48  | 1.42%       |
| 24 | 000024 | 招商地产  | 1,239,407  | 60,854,883.70  | 1.17%       |
| 25 | 600309 | 烟台万华  | 1,100,000  | 58,916,000.00  | 1.13%       |
| 26 | 000792 | 盐湖钾肥  | 1,283,687  | 56,970,029.06  | 1.10%       |
| 27 | 600729 | 重庆百货  | 2,054,992  | 55,772,482.88  | 1.07%       |
| 28 | 600694 | 大商股份  | 900,000    | 55,395,000.00  | 1.07%       |
| 29 | 600879 | 火箭股份  | 2,081,194  | 55,338,948.46  | 1.06%       |
| 30 | 600271 | 航天信息  | 1,201,053  | 53,242,679.49  | 1.02%       |

|    |        |       |           |               |       |
|----|--------|-------|-----------|---------------|-------|
| 31 | 600585 | 海螺水泥  | 900,000   | 53,064,000.00 | 1.02% |
| 32 | 000951 | 中国重汽  | 966,100   | 49,174,490.00 | 0.95% |
| 33 | 600548 | 深高速   | 4,972,910 | 43,861,066.20 | 0.84% |
| 34 | 600415 | 小商品城  | 407,318   | 41,139,118.00 | 0.79% |
| 35 | 600383 | 金地集团  | 1,167,710 | 39,959,036.20 | 0.77% |
| 36 | 000878 | 云南铜业  | 1,099,917 | 37,947,136.50 | 0.73% |
| 37 | 600973 | 宝胜股份  | 1,307,067 | 35,695,999.77 | 0.69% |
| 38 | 600508 | 上海能源  | 2,550,368 | 34,965,545.28 | 0.67% |
| 39 | 600475 | 华光股份  | 2,022,200 | 33,568,520.00 | 0.65% |
| 40 | 002076 | 雪莱特   | 1,126,667 | 20,516,606.07 | 0.39% |
| 41 | 000429 | 粤高速 A | 895,756   | 6,915,236.32  | 0.13% |
| 42 | 000839 | 中信国安  | 50,000    | 1,400,000.00  | 0.03% |

#### 四、报告期内股票投资组合的重大变动

##### 1、累计买入价值超出期初基金资产净值 2% 前二十名的股票明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 累计买入金额（元）      | 占期初基金资产净值比例 |
|----|--------|-------|----------------|-------------|
| 1  | 601628 | 中国人寿  | 361,452,984.66 | 4.64%       |
| 2  | 600030 | 中信证券  | 249,770,521.96 | 3.21%       |
| 3  | 601318 | 中国平安  | 226,788,619.75 | 2.91%       |
| 4  | 600000 | 浦发银行  | 217,701,789.53 | 2.79%       |
| 5  | 000755 | 山西三维  | 183,265,844.95 | 2.35%       |
| 6  | 600048 | 保利地产  | 162,380,006.55 | 2.08%       |
| 7  | 600879 | 火箭股份  | 132,735,884.60 | 1.70%       |
| 8  | 000983 | 西山煤电  | 130,687,728.00 | 1.68%       |
| 9  | 600066 | 宇通客车  | 130,559,274.44 | 1.68%       |
| 10 | 600508 | 上海能源  | 107,319,899.56 | 1.38%       |
| 11 | 600331 | 宏达股份  | 93,559,868.81  | 1.20%       |
| 12 | 000869 | 张裕 A  | 92,471,171.81  | 1.19%       |
| 13 | 000829 | 天音控股  | 88,972,705.94  | 1.14%       |
| 14 | 600271 | 航天信息  | 87,371,705.39  | 1.12%       |
| 15 | 000878 | 云南铜业  | 85,238,314.39  | 1.09%       |
| 16 | 000429 | 粤高速 A | 84,547,549.29  | 1.09%       |
| 17 | 600406 | 国电南瑞  | 76,989,523.03  | 0.99%       |
| 18 | 000568 | 泸州老窖  | 76,499,465.54  | 0.98%       |
| 19 | 600009 | 上海机场  | 76,414,843.02  | 0.98%       |
| 20 | 600675 | 中华企业  | 72,579,592.14  | 0.93%       |

##### 2、累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 前二十名的股票明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 累计卖出金额（元）      | 占期初基金资产净值比例 |
|----|--------|------|----------------|-------------|
| 1  | 002024 | 苏宁电器 | 696,660,108.96 | 8.94%       |

|    |        |      |                |       |
|----|--------|------|----------------|-------|
| 2  | 600030 | 中信证券 | 546,764,303.49 | 7.02% |
| 3  | 600143 | 金发科技 | 506,729,039.85 | 6.50% |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 447,632,732.82 | 5.75% |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 442,296,914.19 | 5.68% |
| 6  | 600016 | 民生银行 | 347,157,188.63 | 4.46% |
| 7  | 000002 | 万科 A | 343,727,593.55 | 4.41% |
| 8  | 600028 | 中国石化 | 323,946,172.52 | 4.16% |
| 9  | 601628 | 中国人寿 | 246,929,837.62 | 3.17% |
| 10 | 600066 | 宇通客车 | 219,827,410.51 | 2.82% |
| 11 | 600549 | 厦门钨业 | 205,675,674.72 | 2.64% |
| 12 | 600050 | 中国联通 | 201,947,595.39 | 2.59% |
| 13 | 000869 | 张裕 A | 193,934,249.73 | 2.49% |
| 14 | 600048 | 保利地产 | 191,059,285.25 | 2.45% |
| 15 | 002069 | 獐子岛  | 190,978,722.64 | 2.45% |
| 16 | 000063 | 中兴通讯 | 189,849,865.06 | 2.44% |
| 17 | 600887 | 伊利股份 | 184,907,629.79 | 2.37% |
| 18 | 000538 | 云南白药 | 183,535,418.20 | 2.36% |
| 19 | 000858 | 五粮液  | 159,210,334.61 | 2.04% |
| 20 | 000792 | 盐湖钾肥 | 153,227,354.76 | 1.97% |

### 3、报告期内买入股票成本总额及卖出股票的收入总额

| 项目            | 金额（元）            |
|---------------|------------------|
| 报告期内买入股票的成本总额 | 3,755,953,004.95 |
| 报告期内卖出股票的收入总额 | 9,252,759,997.50 |

### 五、报告期末按券种分类的债券投资组合

| 债券类别 | 市值（元）          | 市值占基金净值比例 |
|------|----------------|-----------|
| 金融债  | 204,872,820.00 | 3.94%     |
| 合计   | 204,872,820.00 | 3.94%     |

### 六、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

| 序号 | 债券名称     | 市值（元）         | 市值占基金净值比例 |
|----|----------|---------------|-----------|
| 1  | 06 农发 14 | 99,958,700.00 | 1.92%     |
| 2  | 07 农发 02 | 45,011,710.00 | 0.87%     |
| 3  | 06 农发 08 | 30,012,300.00 | 0.58%     |
| 4  | 05 国开 09 | 29,890,110.00 | 0.57%     |

### 七、投资组合报告附注

（一）本报告期内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，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（二）基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

（三）报告期末基金其他资产的构成

| 其他资产    | 金额（元）         |
|---------|---------------|
| 交易保证金   | 2,535,484.68  |
| 应收股利    | 162,000.00    |
| 应收利息    | 3,455,390.05  |
| 应收申购款   | 7,279,409.85  |
| 应收证券清算款 | 5,532,603.47  |
| 其它应收款   | ——            |
| 买入返售    | ——            |
| 待摊费用    | ——            |
| 合计      | 18,964,888.05 |

（四）报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

（五）报告期内本基金未投资权证。

（六）报告期内本基金未投资资产支持证券。

（七）报告期内本基金未投资非公开发行证券。

## 第七节 基金份额持有人情况

截止日期：2007 年 6 月 30 日

|   |               |           |
|---|---------------|-----------|
| 1 | 本基金份额持有人户数（户） | 71,335    |
| 2 | 平均每户持有基金份额（份） | 32,690.49 |

| 序号 | 项目          | 份额（份）            | 占总份额比例% |
|----|-------------|------------------|---------|
| 1  | 机构投资者持有基金份额 | 313,456,596.62   | 13.44%  |
| 2  | 个人投资者持有基金份额 | 2,018,519,830.17 | 86.56%  |
|    | 合计          | 2,331,976,426.79 | 100%    |

## 第八节 基金份额变动情况

| 序号 | 项目           | 份额(份)            |
|----|--------------|------------------|
| 1  | 合同生效日的份额总额   | 4,935,775,576.48 |
| 2  | 期初基金份额总额     | 5,098,980,440.33 |
| 3  | 加：本期申购基金份额总额 | 2,360,492,393.19 |
| 4  | 减：本期赎回基金份额总额 | 5,127,496,406.73 |
| 5  | 期末基金份额总额     | 2,331,976,426.79 |

## 第九节 重大事件揭示

一、本报告期没有举行基金份额持有人大会。

二、本报告期基金管理人的重大人事变动：

1、2007年1月8日管理人公告经汇添富基金管理有限公司第一届董事会第九次会议审议通过，决定聘任张晖先生、林军女士为公司副总经理。

2、2007年4月19日管理人公告本公司 2007年度股东会会议审议通过了关于独立董事变更的议案，决定聘请韦杰夫（Jeffrey R. Williams）先生担任公司独立董事，周荣亚（Joseph W. Chow）先生因个人原因不再担任独立董事。

三、本报告期内基金托管人中国工商银行的专门基金托管部门无重大人事变动。

四、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。

五、本报告期内基金投资策略未发生改变。

六、基金收益分配事项。

本报告期内本基金 1 次公告分红，情况如下：

|       | 分红公告日      | 权益登记日、除息日  | 每10份基金份额<br>收益分配数（元） |
|-------|------------|------------|----------------------|
| 第一次分红 | 2007年2月26日 | 2007年2月28日 | 1.00                 |
| 累计分红  |            |            | 1.00                 |

七、本报告期本基金未改聘会计师事务所，安永大华会计师事务所有限责任公司为本基金的审计事务所。

八、本报告期内没有发生本基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形。

九、基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

1、报告期内租用各证券公司席位进行证券交易情况：

| 交易席位 | 席位<br>数量 | 合计股票金额（元）        | 占股票总交易<br>量比例 | 合计债券<br>金额（元） | 占债券总交<br>易量比例 |
|------|----------|------------------|---------------|---------------|---------------|
| 东方证券 | 2        | 3,324,578,194.67 | 25.55%        | -             | -             |

|      |    |                   |         |   |   |
|------|----|-------------------|---------|---|---|
| 海通证券 | 1  | 839,616,017.43    | 6.45%   | - | - |
| 申银万国 | 2  | 1,679,229,336.08  | 12.90%  | - | - |
| 平安证券 | 1  | 516,898,571.42    | 3.97%   | - | - |
| 中信建投 | 1  | 748,963,065.51    | 5.76%   | - | - |
| 光大证券 | 1  | 617,649,997.99    | 4.75%   | - | - |
| 国泰君安 | 2  | 2,173,042,244.02  | 16.70%  | - | - |
| 招商证券 | 1  | 1,208,682,019.66  | 9.29%   | - | - |
| 兴业证券 | 1  | 566,616,161.30    | 4.35%   | - | - |
| 中信证券 | 1  | 1,337,701,683.44  | 10.28%  | - | - |
| 合计   | 13 | 13,012,977,291.52 | 100.00% | - | - |

| 交易席位 | 权证合计          | 占权证<br>总交易<br>量比例 | 合计回<br>购金额<br>(元) | 占回购<br>总交易<br>量比例 | 佣金(元)         | 占总佣<br>金比例 |
|------|---------------|-------------------|-------------------|-------------------|---------------|------------|
| 东方证券 | -             | -                 | -                 | -                 | 2,676,061.57  | 25.44%     |
| 海通证券 | -             | -                 | -                 | -                 | 688,482.41    | 6.55%      |
| 申银万国 | -             | -                 | -                 | -                 | 1,362,809.58  | 12.96%     |
| 平安证券 | -             | -                 | -                 | -                 | 404,476.27    | 3.85%      |
| 中信建投 | -             | -                 | -                 | -                 | 614,142.64    | 5.84%      |
| 光大证券 | -             | -                 | -                 | -                 | 506,473.73    | 4.81%      |
| 国泰君安 | -             | -                 | -                 | -                 | 1,764,137.57  | 16.77%     |
| 招商证券 | 17,536,079.88 | 100.00%           | -                 | -                 | 991,117.93    | 9.42%      |
| 兴业证券 | -             | -                 | -                 | -                 | 464,621.29    | 4.42%      |
| 中信证券 | -             | -                 | -                 | -                 | 1,046,760.03  | 9.95%      |
| 合计   | 17,536,079.88 | 100.00%           | -                 | -                 | 10,519,083.02 | 100.00%    |

## 2、报告期内租用证券公司席位的变更情况:

本报告期新增 2 家证券公司的 2 个席位: 中信证券股份有限公司(深圳席位)以及中国国际金融有限公司(上海席位)。

## 十、其他重要事项

除上述事项之外,已在临时报告中披露过本报告期内发生的其他重要事项如下:

| 序号 | 事项名称                               | 信息披露方式           | 披露日期            |
|----|------------------------------------|------------------|-----------------|
| 1  | 汇添富基金管理有限公司旗下各基金 2006 年年度资产净值公告    | 公司网站             | 2007 年 1 月 4 日  |
| 2  | 汇添富基金管理有限公司关于通过上海银行开展基金定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 1 月 18 日 |

|    |                                               |                  |                 |
|----|-----------------------------------------------|------------------|-----------------|
| 3  | 汇添富基金管理有限公司关于通过上海银行开展基金定期定额投资业务的提示公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 1 月 19 日 |
| 4  | 汇添富均衡增长股票型证券投资基金季度报告（2006 年第 4 季度）            | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 1 月 20 日 |
| 5  | 关于对通过中国工商银行网上银行申购汇添富优势精选基金、汇添富均衡增长基金开展费率优惠的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 1 月 26 日 |
| 6  | 汇添富基金管理有限公司关于开通中国建设银行龙卡（储蓄卡）网上交易业务的公告         | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 1 月 31 日 |
| 7  | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金调整最低赎回份额和最低保留份额的公告           | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 2 月 6 日  |
| 8  | 汇添富基金管理有限公司关于将公司自有资金投资旗下汇添富均衡增长股票型证券投资基金的公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 2 月 6 日  |
| 9  | 汇添富基金管理有限公司关于通过招商银行开展基金定期定额投资业务的公告            | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 2 月 8 日  |
| 10 | 汇添富均衡增长股票型证券投资基金第一次分红公告                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 2 月 26 日 |
| 11 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金增加代销机构的公告                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 3 月 19 日 |
| 12 | 汇添富均衡增长股票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 | 2007 年 3 月 23 日 |
| 13 | 汇添富基金管理有限公司关于通过浦发银行开展基金定期定额投资业务的公告            | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 3 月 30 日 |

|    |                                                                        |                  |                 |
|----|------------------------------------------------------------------------|------------------|-----------------|
| 14 | 汇添富均衡增长股票型证券投资基金 2006 年年度报告摘要                                          | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 3 月 31 日 |
| 15 | 汇添富均衡增长股票型证券投资基金季度报告(2007 年第 1 季度)                                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 4 月 18 日 |
| 16 | 关于调整汇添富优势精选混合型证券投资基金、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申购费用及申购份额计算方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 5 月 15 日 |
| 17 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下基金在中国工商银行开展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 | 2007 年 6 月 20 日 |
| 18 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金调整最低赎回份额和最低保留份额的公告                                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 6 月 20 日 |
| 19 | 汇添富基金管理有限公司关于开通上海浦东发展银行东方卡(借记卡)网上交易业务的公告                               | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 6 月 22 日 |
| 20 | 汇添富基金管理有限公司旗下各基金 2007 年半年度资产净值公告                                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2007 年 6 月 30 日 |

## 第十节 备查文件目录

### 一、备查文件目录

- (一)《汇添富均衡增长股票型证券投资基金基金合同》
- (二)《汇添富均衡增长股票型证券投资基金更新招募说明书》
- (三)《汇添富均衡增长股票型证券投资基金托管协议》
- (四)报告期内汇添富均衡增长股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

### 二、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

三、文件查阅方式:

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,或登陆本基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 查阅。

汇添富基金管理有限公司

2007年8月28日