# 汇添富理财7天债券型证券投资基金

## 2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 汇添富理财7天债券 | |
| 交易代码 | 471007 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013年5月29日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 727,553,075.29份 | |
| 投资目标 | 本基金在追求本金安全,保持资产流动性的基础上,努力追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。 | |
| 投资策略 | 本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期控制在127天内。在控制利率风险的,尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。 | |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款税后利率 | |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场型证券投资基金。 | |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇添富理财7天债券A | 汇添富理财7天债券B |
| 下属分级基金的交易代码 | 471007 | 472007 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 437,793,599.86份 | 289,759,475.43份 |

§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(2015年7月1日 — 2015年9月30日) | |
|---|---|---|
| | 汇添富理财7天债券A | 汇添富理财7天债券B |
| 1. 本期已实现收益 | 3,729,610.99 | 1,578,049.17 |
| 2. 本期利润 | 3,729,610.99 | 1,578,049.17 |
| 3. 期末基金资产净值 | 437,793,599.86 | 289,759,475.43 |

注: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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富理财7天债券A

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.8359% | 0.0065% | 0.3403% | 0.0000% | 0.4956% | 0.0065% |

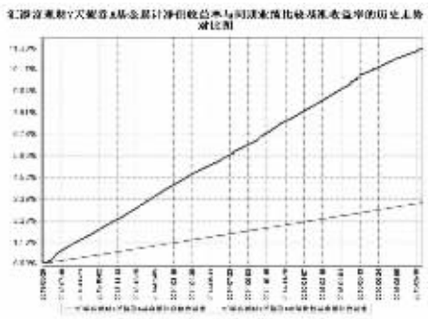
注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

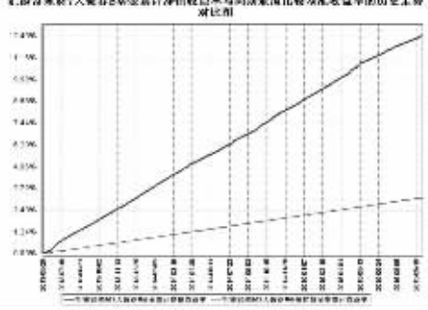
汇添富理财7天债券B

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.9477% | 0.0065% | 0.3403% | 0.0000% | 0.6074% | 0.0065% |

注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2013年5月29日,本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年5月29日)起5天,建仓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 | | |
| 徐寅菡 | 汇添富和聚宝货币基金、汇添富收益快钱货币基金、汇添富收益快钱货币基金、汇添富理财7天债券基金的基金经理。 | 2014年8月27日 | - | 7年 | 国籍:中国。学历:复旦大学法学学士。六年证券从业经验。曾任长江养老保险股份有限公司债券交易员。2012年5月加入汇添富基金管理股份有限公司任债券交易员、固定收益基金经理助理。2014年8月27日至今任汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富理财7天债券型证券投资基金的基金经理。2014年11月26日至今任汇添富和聚宝货币市场基金经理。2014年12月23日至今任汇添富收益快钱货币基金基金经理。 |

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

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1次,是由于合规控制原因调整导致。经检查和分析未发现异常情况。

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

2015年三季度,国际市场方面,全球经济放缓。强势美元和海外需求疲软对美国经济造成冲击凸显,非农就业数据进一步回落并大幅低于市场预期,美联储加息概率不断下降;国内市场方面,经济依旧低迷,市9月以来物价指数重新回落,通缩风险有所升温。人民币持续贬值对三季度资金面造成持续承压,央行通过降准、SLO、MLF、逆回购等方式投放超万亿流动性,对冲资本外流。

债券市场方面,三季度受股市下跌资金回流以及IPO暂停背景下打新基金加大固定收益类产品配置力度的影响下,银行间货币利率保持低位,各期限债券品种百花齐放,收益率均持续下行,牛市行情得以延续。信用利差也进一步收缩,其中高等级信用债已处于09年以来的历史低位,信用品种收益率下行幅度超过30BP。

操作上,本基金在三季度继续加强了短融的波段性操作,把握住了债券的上涨机会。临近三季末,由积极转为谨慎策略,降低债券久期至中性水平,适度调整了存款的配置期限;保持适度比例的高评级短融的配置作为流动性管理的工具,减低低评级短融的持仓,降低组合的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

三季度本基金A级净值收益率为0.8359%,B级净值收益率为0.9477%。

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2015年4季度,宏观经济形势仍不容乐观,9月以来物价指数重新回落,通缩风险有所升温,经济下行压力在所难免,为实现全年稳增长的目标,降准降息等宽松货币政策有望再度释放,流动性整体无忧。因此债券市场收益率仍将保持震荡下行为主,收益率曲线将进一步平坦化,但同时不排除年底资金面紧张带来一定调整的可能。在把握交易性机会的同时,警惕一旦快速调整或将引发踩踏所带来的连锁反应,因此配置上仍将着重关注短久期、中高等级品种,保证较高的安全边际。

我们将在密切跟踪基本面、政策面和资金面前提下,综合分析本基金的份额变动,做好债券与存款之间的配置,保持组合的较高流动性和安全性,积极把握市场结构性机会,通过在合适的时点锁定高收益的存款和灵活控制短融仓位择机把握中高等级短融的波动机会,适度提高组合的投资收益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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 | 固定收益投资 | 369,205,508.29 | 49.47 |
| | 其中:债券 | 369,205,508.29 | 49.47 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 60,000,566.72 | 8.04 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | 20,000,266.72 | 2.68 |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 310,634,826.64 | 41.62 |
| 4 | 其他资产 | 6,474,390.36 | 0.87 |
| 5 | 合计 | 746,315,292.01 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 8.52 | |
| | 其中:买断式回购融资 | 8.52 | |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 17,999,871.00 | 2.47 |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 112 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 114 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 72 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过127天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 23.46 | 2.47 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)-60天 | 17.83 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 2.71 | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | 13.74 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | 21.97 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 24.69 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 101.69 | 2.47 |

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 | 摊余成本(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 | 59,678,729.60 | 8.20 |
| | 其中:政策性金融债 | 59,678,729.60 | 8.20 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 289,872,749.59 | 39.84 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 19,654,029.10 | 2.70 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 369,205,508.29 | 50.75 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 19,723,040.49 | 2.71 |

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 011599167 | 15京投投SCP001 | 300,000 | 30,092,046.04 | 4.14 |
| 2 | 041552008 | 15桂建工CP001 | 200,000 | 20,042,533.76 | 2.75 |
| 3 | 041466027 | 14杭交投CP002 | 200,000 | 20,022,429.96 | 2.75 |
| 4 | 110212 | 11国开12 | 200,000 | 19,991,649.94 | 2.75 |
| 5 | 011599669 | 15南方水泥SCP007 | 200,000 | 19,990,601.70 | 2.75 |
| 6 | 011543003 | 15中核建SCP003 | 200,000 | 19,985,681.01 | 2.75 |
| 7 | 011507004 | 15南电SCP004 | 200,000 | 19,982,630.29 | 2.75 |
| 8 | 011561003 | 15五矿贸SCP003 | 200,000 | 19,966,916.92 | 2.74 |
| 9 | 090205 | 09国开05 | 200,000 | 19,964,039.17 | 2.74 |
| 10 | 041562042 | 15海山集CP001 | 200,000 | 19,956,253.08 | 2.74 |

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | 51 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.3856% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.2261% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.3003% |

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金估值采用摊余成本法计价,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 6,474,390.36 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 6,474,390.36 |

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 汇添富理财7天债券A | 汇添富理财7天债券B |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 430,105,020.59 | 87,240,373.88 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 487,232,161.22 | 340,202,955.83 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 479,543,581.95 | 137,683,854.28 |
| 报告期期末基金份额总额 | 437,793,599.86 | 289,759,475.43 |

注:总申购份额含红利再投份额

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富理财7天债券型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富理财7天债券型证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富理财7天债券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、报告期内汇添富理财7天债券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。

8.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理股份有限公司

8.3 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。

汇添富基金管理股份有限公司
2015年10月27日

# 汇添富美丽30混合型证券投资基金

## 2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富美丽30混合 |
| 交易代码 | 000173 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年6月25日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,514,448,690.81份 |
| 投资目标 | 本基金通过精选个股和集中投资,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金的投资组合比例为:60%以上的基金资产投资于股票;其中投资于基金持仓比例最高的前30只股票的资产不低于非现金基金资产的80%;其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;基金持有单只中小企业私募债,其市值不得超过基金资产净值的10%;每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。 |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 |
| 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(2015年7月1日 — 2015年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -108,284,525.19 |
| 2.本期利润 | -1,756,178,256.56 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -1.1064 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,750,429,865.27 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.816 |

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 | -34.44% | 5.05% | -22.20% | 2.67% | -12.24% | 2.38% |

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

注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年6月25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 | | |
| 王栩 | 汇添富优势精选混合基金、汇添富美丽30混合基金的基金经理,股票投资副总监。 | 2013年6月25日 | - | 13年 | 国籍:中国。学历:同济大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任上海永嘉投资管理有限公司研究员。2004年11月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任固定收益分析师、高级行业研究员和基金经理助理。现任股票投资副总监。2010年2月5日至今任汇添富优势精选混合基金的基金经理,2010年9月21日至2013年5月10日任汇添富医药保健混合基金的基金经理,2012年7月10日至2015年3月31日任汇添富理财14天债券基金的基金经理,2013年6月25日至今任汇添富美丽30混合基金的基金经理。 |

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

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0次,是由于合规控制原因调整导致。经检查和分析未发现异常情况。

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

今年三季度的市场延续了6月后半月的走势,继续大幅下跌。其背景是前期的过度上涨和迅速的去杠杆,所有板块均大幅调整,唯一的办法就是控制仓位。

而我们的投资依然聚焦在了和经济转型相关的成长股上,重点看好互联网对传统行业的渗透。虽然六月底也进行了减仓操作,但由于还是低估了去杠杆对市场流动性的影响,减仓力度不够,本轮调整过程中也出现了明显的回调。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年3季度,本基金净值下跌26.9%,业绩基准下跌22.90%。同期沪深300下跌28.4%,中小板下跌26.57%,创业板下跌27.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们的看法还是偏乐观。短期来看,虽然市场信心的重新积累需要时间,但去杠杆的过程进入尾声,未来市场应该会相对平稳,以结构性机会为主。从中长期来看,我还是认为本届政府在放松行政监管上的不断推进,将激发民间的巨大活力,中国将出现新一轮的创业热潮,从而实现中国经济的最终转型。

策略上,我们依然坚持以经济转型作为未来中国的时代特征而布局,重点看好互联网对传统行业的渗透、工业4.0对传统制造业的改造等能够提高中国整体社会竞争力的行业,以及符合消费趋势、未来消费支出比例会持续提升的行业。

随着本轮市场的大幅调整市场走势会出现分化,投资需要更加注重日下而上的深入研究,考虑估值和企业增速的匹配。所以未来我们的任务就是不断筛选投资标的,在经济转型的更行业中找到能够真正崛起的未来行业领袖。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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 | 2,444,301,319.11 | 88.52 |
| | 其中:股票 | 2,444,301,319.11 | 88.52 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 305,185,502.83 | 11.05 |
| 8 | 其他资产 | 11,946,585.28 | 0.43 |
| 9 | 合计 | 2,761,433,407.22 | 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 | 972,931,783.98 | 35.37 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 495,916,460.03 | 18.03 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 29,575,000.00 | 1.08 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 581,618,734.62 | 21.15 |
| J | 金融业 | 882,700.00 | 0.03 |
| K | 房地产业 | 31,571,160.00 | 1.15 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 101,289,000.00 | 3.68 |
| 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 | 27,620,000.00 | 1.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | 60,329,270.00 | 2.19 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 142,567,210.48 | 5.18 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,444,301,319.11 | 88.87 |

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 | 002018 | 华信国际 | 19,000,000 | 411,160,000.00 | 14.95 |
| 2 | 300359 | 全通教育 | 3,437,030 | 269,394,411.40 | 9.79 |
| 3 | 002044 | 江苏三友 | 8,101,988 | 211,299,847.04 | 7.68 |
| 4 | 600180 | 瑞茂通 | 7,217,116 | 147,445,679.88 | 5.36 |
| 5 | 002640 | 跨境通 | 5,280,000 | 134,059,200.00 | 4.87 |
| 6 | 300168 | 万达信息 | 4,043,861 | 123,135,567.45 | 4.48 |
| 7 | 002589 | 瑞康医药 | 3,852,778 | 122,710,979.30 | 4.46 |
| 8 | 600645 | 中源协和 | 1,900,000 | 101,289,000.00 | 3.68 |
| 9 | 000963 | 华东医药 | 1,199,901 | 83,813,084.85 | 3.05 |
| 10 | 600136 | 道博股份 | 2,500,000 | 82,325,000.00 | 2.99 |

注:本基金持有的华信国际处于停牌状态,受基金净值波动影响,华信国际占基金资产净值比被动超过10%,本基金管理人将在该股票复牌后,按照法律法规及基金合同的相关规定及时做出调整。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 2,889,616.97 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,690,570.46 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 56,333.82 |
| 5 | 应收申购款 | 7,310,064.03 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 11,946,585.28 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002018 | 华信国际 | 411,160,000.00 | 14.95 | 重大资产重组停牌 |
| 2 | 002044 | 江苏三友 | 211,299,847.04 | 7.68 | 重大资产重组停牌 |
| 3 | 300168 | 万达信息 | 123,135,567.45 | 4.48 | 重大资产重组停牌 |
| 4 | 002589 | 瑞康医药 | 122,710,979.30 | 4.46 | 重大事项停牌 |
| 5 | 600645 | 中源协和 | 101,289,000.00 | 3.68 | 重大资产重组停牌 |

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,857,561,293.70 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,082,347,485.13 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 1,425,460,088.02 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,514,448,690.81 |

注: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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 0.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 4,709,844.56 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额 | 4,709,844.56 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.31 |

注:1、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。

2、本基金于2013年6月25日成立。本公司于2015年7月6日用固有资金10,000,000.00元申购本基金份额4,709,844.56份,申购费用1,000.00元。符合招募说明书规定的申购费率。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 申购 | 2015年7月6日 | 4,709,844.56 | 10,000,000.00 | 0.01% |
| 合计 | | | 4,709,844.56 | 10,000,000.00 | |

注:该笔申购金额为10,000,000.00元,适用费率为1000元。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富美丽30混合型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富美丽30混合型证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富美丽30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、报告期内汇添富美丽30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。

8.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理股份有限公司

8.3 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。

汇添富基金管理股份有限公司
2015年10月27日

# 汇添富民营活力混合型证券投资基金

## 2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富民营活力混合 |
| 交易代码 | 470009 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年5月5日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,289,398,279.19份 |
| 投资目标 | 本基金采用自下而上的方法,精选与中国经济发展密切相关的优秀民营企业上市公司股票进行投资布局,在科学严格管理风险的前提下,力求基金资产的中长期增值。 |
| 投资策略 | 股票资产比例60%—95%;债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种资产比例5%—40%。基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%