汇添富美丽30混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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。

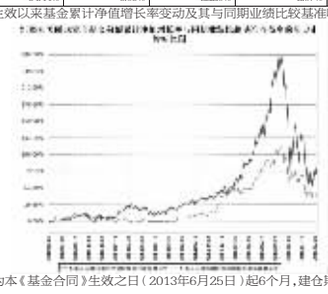
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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:曾任上海永顺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灵活配置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,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

三季度市场风云突变,出现了多次罕见的连续崩盘式下跌。导致市场大跌的因素很多,其中最重要的大概有这么几个:本身已经被杠杆吹得较大的股市泡沫;金融创新与市场相关制度、监管等基础设施的失衡;汇率改革引发的持续贬值预期;对实体经济恶化和改革进程放缓的担忧等。出于股市崩盘可能引发局部金融风险,国家开始干预市场,在降准降息、证金公司直接入市等组合拳作用下,到季度末市场才逐步企稳。

三季度本基金对市场走势的判断出现一定偏差,特别是对市场出现极端情况(去杠杆、大批股票停牌导致流动性冲击等)的预估不足,导致本基金组合结构和操作均出现一定的被动扭曲,阶段性净值损失较大。本基金认为市场最困难的时期已经过去,未来市场将逐步回归正常化,本基金将继续坚持逆向投资策略,并吸取此前教训,加强风险控制和流动性管理,努力为持有人获取稳健的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2015年9月30日,本基金累积单位净值1.838元,三季度净值下跌-32.83%,成立以来累积收益率为83.8%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前时点,本基金认为四季度市场将呈现结构性行情。(1)流动性仍然极为宽松,股市相对配置价值提升。近期公司债和国债收益率的持续下行反映了流动性仍然极为宽裕。在实体经济疲弱、通缩和汇率压力较大的背景下,央行进一步降息降准的可能性也在加大。这将推动无风险收益率继续下行,股市的配置价值相应会不断提升。(2)上市公司整体业绩面临压力,但仍有一些局部亮点,如互联网相关、新能源、新兴消费等,能够实现较快的增长。此外大批上市公司在主业面临困境时积极寻求转型,通过并购等实现外延式增长。这些构成了结构性行情的基础。

从投资角度来看,我们看好三个方向的投资机会。(1)创新:与互联网相关的技术创新和模式创新(大数据、征信、供应链金融等)、工业4.0、新能源汽车等。(2)新消费与医疗服务:动漫、视频、体育等受益于80/90后逐步成长为消费主力带来的消费趋势变化而爆发;而受益于老龄化和医改,民营医院、连锁

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

序号	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投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

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	1,867,561,293.70
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

报告期期初基金份额总额	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
报告期末管理人持有的本基金份额	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

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0%—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%。 按本基金《基金合同》中有关民营企业上市公司的定义,本基金投资于民营企业上市公司股票的资产占股票资产的比例不低于80%。
业绩比较基准	中证民营企业综合指数×80%+上证国债指数×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	-198,732,787.29
2.本期利润	-2,036,668,038.49
3.加权平均基金份额本期利润	-0.9443
4.期末基金资产净值	5,891,921,936.84
5.期末基金份额净值	2.574

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。

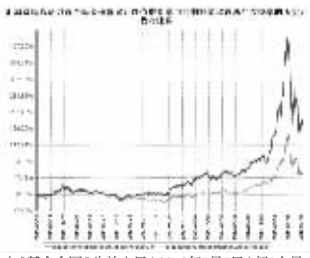
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-26.90%	4.01%	-22.90%	2.81%	-4.00%	1.20%

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(2010年5月5日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§4 管理人报告

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		
朱晓亮	汇添富消费行业混合基金、汇添富均衡增长混合基金、汇添富民营活力混合基金的基金经理。	2014年4月8日	-	8年	国籍:中国。学历:上海财经大学金融学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2007年5月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任行业分析师、高级行业分析师、基金经理助理。2013年5月3日至今任汇添富消费行业混合基金的基金经理,2013年11月22日至2015年8月31日任汇添富均衡增长混合基金的基金经理,2014年4月8日至今任汇添富民营活力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

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,投资需要更加注重自下而上的深入研究,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	4,768,096,171.14	80.62
	其中:股票	4,768,096,171.14	80.62
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	1,116,597,366.91	18.88
8	其他资产	29,275,614.32	0.50
9	合计	5,913,969,152.37	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	1,539,782,838.09	26.13
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	645,132,197.89	10.95
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	1,083,058,814.90	18.38
J	金融业	218,400,000.00	3.71
K	房地产业	128,177,345.16	2.18
L	租赁和商务服务业	433,900,000.00	7.36
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	171,246,927.72	2.91
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	548,398,047.38	9.31
S	综合	-	-
	合计	4,768,096,171.14	80.93

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	002183	怡亚通	10,000,000	433,900,000.00	7.36
2	300144	宋城演艺	17,032,911	384,603,130.38	6.53
3	300166	东方国信	9,600,000	282,720,000.00	4.80
4	002018	华信国际	12,000,000	259,680,000.00	4.41
5	600172	黄河旋风	17,500,188	254,102,729.76	4.31
6	600180	瑞茂通	12,400,193	253,335,942.99	4.30
7	300359	全通教育	2,800,000	219,464,000.00	3.72
8	601166	兴业银行	15,000,000	218,400,000.00	3.71
9	601933	永辉超市	21,000,246	213,152,496.90	3.62
10	002095	生意宝	5,200,092	203,843,606.40	3.46

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投资。

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投资。

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投资。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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	2,794,772.60
2	应收证券清算款	9,873,867.21
3	应收股利	-
4	应收利息	200,038.70
5	应收申购款	16,406,935.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,275,614.32

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	002183	怡亚通	433,900,000.00	7.36	重大事项停牌
2	002018	华信国际	259,680,000.00	4.41	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,725,092,827.57
报告期期间基金总申购份额	2,262,815,582.87
减:报告期期间基金总赎回份额	1,698,510,131.25
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	2,289,398,279.19

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

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民营活力混合型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富民营活力混合型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富民营活力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、报告期内汇添富民营活力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

汇添富逆向投资混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	汇添富逆向投资混合
交易代码	470098
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月9日
报告期末基金份额总额	609,842,845.31份
投资目标	本基金主要采用逆向投资策略进行主动投资管理,在科学严格的投资风险管理前提下,谋求基金资产的长期稳健回报。
投资策略	本基金主要采用逆向投资策略进行主动投资管理。
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	本基金是混合型基金,本基金的风险和预期收益比较均衡,在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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	-254,308,346.54
2.本期利润	-644,654,951.96
3.加权平均基金份额本期利润	-0.9609
4.期末基金资产净值	1,029,485,541.18
5.期末基金份额净值	1.688

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	-32.83%	4.75%	-22.60%	2.67%	-10.23%	2.08%

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(2012年3月9日)起6个月,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		
顾耀强	汇添富策略回报混合基金