

信息披露 disclosure

汇添富恒生指数分级证券投资基金

2014 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:2014年10月24日

基金管理人、基金托管人共同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约定,于2014年10月22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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或者本金不受其他实质性损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	汇添富恒生指数分级(QDII)
交易代码	154760
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2014年3月18日
报告期末基金份额总额	460,352,405.40份
投资目标	紧密跟踪恒生指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用指数复制法跟踪恒生指数的表现,力争实现日均跟踪偏离度不超过0.2%,跟踪误差控制在1%以内。
业绩比较基准	恒生指数收益率(含分红再投资)×95%+商业银行人民币活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,风险收益特征高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金主要投资于恒生指数的成份股及备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金为境内上市证券投资的基金,主要投资于中国内地证券市场,面临中国内地证券市场特有的投资风险。此外,本基金还投资于境外证券市场,面临海外市场特有的投资风险。此外,本基金还投资于境外证券市场,面临海外市场特有的投资风险。此外,本基金还投资于境外证券市场,面临海外市场特有的投资风险。
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
下属二级基金名称	汇添富恒生指数分级(QDII)
报告期末二级基金名称	汇添富恒生指数分级(QDII)
报告期末二级基金名称	汇添富恒生指数分级(QDII)

§3 主要财务指标	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本期已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§4 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§5 主要财务指标	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本期已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§6 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§7 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§8 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§9 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§10 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§11 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§12 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§13 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§14 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§15 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§16 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§17 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§18 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§19 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§20 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§21 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§22 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§23 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§24 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§25 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§26 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§27 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§28 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§29 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

注:本基金的(基金合同)生效日为2014年3月18日,本基金建仓期为自(基金合同)生效之日(2014年3月18日)起6个月,建仓结束时间以各项资产配置比例符合合同约定为准。

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:2014年10月24日

基金管理人、基金托管人共同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约定,于2014年10月22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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或者本金不受其他实质性损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	汇添富恒生指数分级(QDII)
交易代码	154760
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2014年3月18日
报告期末基金份额总额	460,352,405.40份
投资目标	紧密跟踪恒生指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用指数复制法跟踪恒生指数的表现,力争实现日均跟踪偏离度不超过0.2%,跟踪误差控制在1%以内。
业绩比较基准	恒生指数收益率(含分红再投资)×95%+商业银行人民币活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,风险收益特征高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金主要投资于恒生指数的成份股及备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金为境内上市证券投资的基金,主要投资于中国内地证券市场,面临中国内地证券市场特有的投资风险。此外,本基金还投资于境外证券市场,面临海外市场特有的投资风险。此外,本基金还投资于境外证券市场,面临海外市场特有的投资风险。
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
下属二级基金名称	汇添富恒生指数分级(QDII)
报告期末二级基金名称	汇添富恒生指数分级(QDII)
报告期末二级基金名称	汇添富恒生指数分级(QDII)

§3 主要财务指标	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本期已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§4 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§5 主要财务指标	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本期已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§6 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§7 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§8 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§9 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§10 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§11 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§12 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§13 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	1.036

§14 投资组合报告	
项目	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本基金已实现收益	4,492,785.11
2.本期利润	2,928,750.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364
4.期末基金资产净值	62,381,757.59
5.期末基金份额净值	