

汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金

[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

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别法律责任。

本基金的基金管理人和基金托管人根据有关法律法规及基金合同的约定,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的内容,保证不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

基金过往业绩并不代表未来表现。投资人投资于基金时应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§ 4 基金产品概况

基金简称 汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金

交易代码 000668

运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

投资目标 本基金通过行业轮动指数化投资,紧密跟踪沪深300安中动态策略指数,力争在扣除相关费用后实现基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的长期偏离度不超过±0.3%。即跟踪误差不超过4%。

业绩比较基准 沪深300中证行业轮动指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)×5%

基金收益分配方式 现金

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

§ 5 基金产品概况

基金简称 汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金

交易代码 000668

运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

投资目标 本基金通过行业轮动指数化投资,紧密跟踪沪深300安中动态策略指数,力争在扣除相关费用后实现基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的长期偏离度不超过±0.3%。即跟踪误差不超过4%。

业绩比较基准 沪深300中证行业轮动指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)×5%

基金收益分配方式 现金

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

§ 6 基金产品概况

基金简称 汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金

交易代码 000668

运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

投资目标 本基金通过行业轮动指数化投资,紧密跟踪沪深300安中动态策略指数,力争在扣除相关费用后实现基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的长期偏离度不超过±0.3%。即跟踪误差不超过4%。

业绩比较基准 沪深300中证行业轮动指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)×5%

基金收益分配方式 现金

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

§ 7 基金产品概况

基金简称 汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金

交易代码 000668

运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

投资目标 本基金通过行业轮动指数化投资,紧密跟踪沪深300安中动态策略指数,力争在扣除相关费用后实现基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的长期偏离度不超过±0.3%。即跟踪误差不超过4%。

业绩比较基准 沪深300中证行业轮动指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)×5%

基金收益分配方式 现金

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

§ 8 基金产品概况

基金简称 汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金

交易代码 000668

运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

投资目标 本基金通过行业轮动指数化投资,紧密跟踪沪深300安中动态策略指数,力争在扣除相关费用后实现基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的长期偏离度不超过±0.3%。即跟踪误差不超过4%。

业绩比较基准 沪深300中证行业轮动指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)×5%

基金收益分配方式 现金

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

§ 9 基金产品概况

基金简称 汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金

交易代码 000668

运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

投资目标 本基金通过行业轮动指数化投资,紧密跟踪沪深300安中动态策略指数,力争在扣除相关费用后实现基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的长期偏离度不超过±0.3%。即跟踪误差不超过4%。

业绩比较基准 沪深300中证行业轮动指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)×5%

基金收益分配方式 现金

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

§ 10 基金产品概况

基金简称 汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金

交易代码 000668

运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

投资目标 本基金通过行业轮动指数化投资,紧密跟踪沪深300安中动态策略指数,力争在扣除相关费用后实现基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的长期偏离度不超过±0.3%。即跟踪误差不超过4%。

业绩比较基准 沪深300中证行业轮动指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)×5%

基金收益分配方式 现金

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

§ 11 基金产品概况

基金简称 汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金

交易代码 000668

运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

投资目标 本基金通过行业轮动指数化投资,紧密跟踪沪深300安中动态策略指数,力争在扣除相关费用后实现基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的长期偏离度不超过±0.3%。即跟踪误差不超过4%。

业绩比较基准 沪深300中证行业轮动指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)×5%

基金收益分配方式 现金

基金合同生效日 2013年1月6日

报告期末基金份额总额 164,481,609.07份

§ 12 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动情况及其与同期业绩比较基准变动的比较

注:1. 本公司已披露收益分配方案,投资人收益以其所持有的基金份额为限,投资人收益的计算公式为:收益=份额×单位净值×(1+收益分配比例)-单位净值。

2. 所述期间内基金利润不包括持有人认购或申购基金所产生的费用,计入费用时以实际收取费用列示。

3. 基金净值表现表表明基金净值增长率为每份基金资产净值增加或减少1元人民币对应的百分比。

4. 期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

5. 本报告期无申购赎回费用。

6. 本报告期无申购赎回费用。

7. 本报告期无申购赎回费用。

8. 本报告期无申购赎回费用。

9. 本报告期无申购赎回费用。

10. 本报告期无申购赎回费用。

11. 本报告期无申购赎回费用。

12. 本报告期无申购赎回费用。

13. 本报告期无申购赎回费用。

14. 本报告期无申购赎回费用。

15. 本报告期无申购赎回费用。

16. 本报告期无申购赎回费用。

17. 本报告期无申购赎回费用。

18. 本报告期无申购赎回费用。

19. 本报告期无申购赎回费用。

20. 本报告期无申购赎回费用。

21. 本报告期无申购赎回费用。

22. 本报告期无申购赎回费用。

23. 本报告期无申购赎回费用。

24. 本报告期无申购赎回费用。

25. 本报告期无申购赎回费用。

26. 本报告期无申购赎回费用。

27. 本报告期无申购赎回费用。

28. 本报告期无申购赎回费用。

29. 本报告期无申购赎回费用。

30. 本报告期无申购赎回费用。

31. 本报告期无申购赎回费用。

32. 本报告期无申购赎回费用。

33. 本报告期无申购赎回费用。

34. 本报告期无申购赎回费用。

35. 本报告期无申购赎回费用。

36. 本报告期无申购赎回费用。

37. 本报告期无申购赎回费用。

38. 本报告期无申购赎回费用。

39. 本报告期无申购赎回费用。

40. 本报告期无申购赎回费用。

41. 本报告期无申购赎回费用。

42. 本报告期无申购赎回费用。

43. 本报告期无申购赎回费用。

44. 本报告期无申购赎回费用。

45. 本报告期无申购赎回费用。

46. 本报告期无申购赎回费用。

47. 本报告期无申购赎回费用。

48. 本报告期无申购赎回费用。

49. 本报告期无申购赎回费用。

50. 本报告期无申购赎回费用。

51. 本报告期无申购赎回费用。

52. 本报告期无申购赎回费用。

53. 本报告期无申购赎回费用。