汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月18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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富季季红定期开放债券
场内简称	添富季红
交易代码	164702
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月26日
报告期末基金份额总额	621,973,406.75份
投资目标	本基金主要投资于债券类固定收益品种,在严格管理投资风险的基础上,追求资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金80%以上的基金资产投资于债券资产,并在严格控制风险的基础上,通过对全球经济形势、中国经济发展(包括宏观经济运行、周期、财政及货币政策、资金供需情况)、证券市场估值水平等的研判,适度参与权益类资产配置,适度把握市场时机,力争为基金资产获取稳健回报。
业绩比较基准	银行三年期定期存款税后利率+1%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

注:本基金自基金合同生效后,每封闭运作三年,集中开放一次申购和赎回。每三年(含三年)为一个封闭期。在此期间,投资者不能申购、赎回基金份额,但本基金可以在深圳证券交易所上市交易。每个封闭期到期日的次一工作日起(含该工作日),本基金将进入开放期。开放期不少于一周、不超过一个月,在此期间,投资者可以申购、赎回基金份额。开放期结束的次日(含该日)起,本基金进入下一个为期三年的封闭期。依此类推,循环运作。

§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4月1日 — 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	19,249,074.78
2.本期利润	16,922,966.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0272
4.期末基金资产净值	666,902,926.80
5.期末基金份额净值	1.072

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。

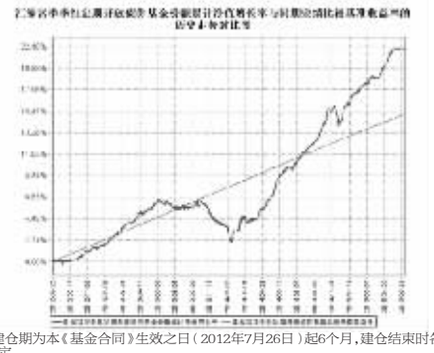
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.58%	0.08%	1.15%	0.01%	1.43%	0.07%

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7月26日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

本基金自基金合同生效后,每封闭运作三年,集中开放一次申购和赎回。每三年(含三年)为一个封闭期。在封闭期内,本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%(但在开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内,不受前述投资组合比例的限制)。权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%。在开放期内,本基金持有的现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§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		
陆文磊	汇添富增强收益债券基金、汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富互利分级债券基金、汇添富收益快钱货币基金的基金经理,固定收益投资总监。	2012年7月26日	-	13年	国籍:中国。学历:华东师范大学金融学博士。相关业务资格:基金从业资格。从业经历:曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。2007年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,任固定收益高级经理,现任固定收益投资总监。2008年3月6日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理。2009年1月21日至2011年6月21日任汇添富货币基金的基金经理,2011年1月26日至2013年2月7日任汇添富保本混合基金的基金经理,2012年7月26日至今任汇添富季季红定期开放债券基金的基金经理,2012年12月31日至2014年1月20日任汇添富收益快钱货币基金的基金经理助理,2013年11月6日至今任汇添富互利分级债券基金的基金经理,2013年12月13日至2015年3月31日任汇添富全额宝货币基金的基金经理,2014年1月21日至2015年3月31日任汇添富收益快钱货币基金的基金经理,2014年12月23日至今任汇添富收益快钱货币基金的基金经理。

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,是由于投资流动性的需求导致。

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

二季度宏观经济基本面依然维持底部徘徊,工业增加值、投资、进口等指标保持弱势,显示内需增长回升乏力。二季度通胀压力进一步减弱,大宗商品价格在二季度前期迅速反弹,但之后再次开始缓慢下行,国内铁矿石、动力煤等价格更是大幅下跌,生产资料价格通缩的趋势更加严重。为应对经济下滑和通胀回落,二季度货币政策进一步放松,央行多次降息、降准,政策稳中趋松的基调更加明确。二季度债券收益率先降后升,信用债表现好于利率债,10年期金融债收益率下行10-15bp,中等评级的信用债下行40-50bp;由于资金持续保持宽松,二季度债券收益率曲线陡峭化突出。

考虑本基金本次封闭运作周期在7月即将打开,本基金二季度适度降低了组合久期,对利率债进行一定的波段操作;另外,可转债采取了一级市场积极申购的策略,对收益也有一定的贡献。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为2.58%,业绩比较基准收益率为1.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,全球流动性有望继续保持宽松,特别是希腊问题升级,美元加息步伐或有所放缓,而欧洲央行因希腊问题也有望继续推行QE。从国内来看,目前基本面对债券影响相对之前出现了积极变化:首先是一、二线房地产销售出现疲软不利后期房地产投资接企稳;二是股市暴跌、新股暂停等对国内融资环境存在负面影响,不利整体经济复苏;三是近期海外市场变化,特别是希腊事件,可能不利全球经济复苏。我们判断三季度货币市场资金利率仍应保持宽松,整体货币政策还有空间,债券市场不存在明显的系统性风险,债券收益率总体出现下行的可能性较大。在本基金的操作上,我们将坚持价值投资的理念,重视绝对收益目标,积极调整组合结构,控制组合下行风险,力争为投资者创造持续稳定的收益。

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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	730,642,867.16	95.35
	其中:债券	730,642,867.16	95.35
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	13,537,377.04	1.77
7	其他资产	22,077,878.13	2.88
8	合计	766,258,122.33	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

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

注:本基金本报告期末未持有股票。

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	公允价值(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	40,832,000.00	6.12
	其中:政策性金融债	40,832,000.00	6.12
4	企业债券	665,345,759.56	99.77
5	企业短期融资券	20,198,000.00	3.03
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,267,107.60	0.64
8	其他	-	-
9	合计	730,642,867.16	109.56

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112097	12亚厦债	513,380	51,389,338.00	7.71
2	140220	14国开20	400,000	40,832,000.00	6.12
3	122182	12九州通	320,190	32,659,380.00	4.90
4	122881	10吴江债	300,000	31,065,000.00	4.66
5	122207	12骆驼集	300,000	30,834,000.00	4.62

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,572.54
2	应收证券清算款	731,850.54
3	应收股利	-
4	应收利息	21,336,455.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,077,878.13

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	621,973,407.12
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	0.37
报告期期末基金份额总额	621,973,406.75

注:转托管业务发生后导致场外份额不足最低保留份额5份的要求,引发强制赎回。

§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季季红定期开放债券型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富季季红定期开放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、报告期内汇添富季季红定期开放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7月18日

汇添富价值精选股票型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月18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7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富价值精选股票
交易代码	519069
前端交易代码	519069
后端交易代码	519070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年1月23日
报告期末基金份额总额	2,935,133,024.82份
投资目标	本基金精选价值相对低估的优质公司股票,在有效管理风险的前提下,追求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金采用灵活积极的资产配置和股票投资策略。在资产配置中,通过以宏观经济及宏观经济政策分析为核心的情景分析法来确定投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例,并结合对市场估值、市场资金、投资主体行为和市场信心影响等因素的综合判断进行灵活调整;在股票投资中,采取"自下而上"的策略,优选价值相对低估的优质公司股票构建投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得长期持续稳健的投资收益。本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
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	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。
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4月1日 — 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	2,237,157,311.37
2.本期利润	1,770,865,980.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.5266
4.期末基金资产净值	8,272,775,329.12
5.期末基金份额净值	2.819

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	22.41%	2.45%	8.56%	2.09%	13.85%	0.36%

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(2009年1月23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		
陈晓翔	汇添富价值精选股票基金的基金经理,股票投资副总监。	2009年1月23日	-	14年	国籍:中国。学历:南京理工大学产业经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任宁波中银国际仓储运输有限公司业务员、华泰证券有限责任公司行业研究员、上海申银万国研究所有限责任公司行业研究员、建信基金管理有限公司行业研究员。2007年4月加入汇添富基金管理股份有限公司任行业研究员,现任股票投资副总监。2009年1月23日至今任汇添富价值精选股票基金的基金经理。2010年1月8日至2012年3月2日任汇添富均衡增长股票型基金的基金经理。

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,是由于投资流动性的需求导致。

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

二季度,A股市场跌宕起伏,四五两月市场延续大幅上涨的牛市格局,六月中旬开始受大小非大量减持、高杠杆产品减仓导致互相踩踏、中小盘股票估值过高难以持续等因素影响,市场出现大幅快速下跌。当季沪深300指数上涨10.4%,创业板上涨22.4%。

添富价值在本季度延续了以自下而上选股为主的投资策略,并在市场上涨过程中逐步降低了组合中高估值成长股所占的比重,相对比较基准获得了较好的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年2季度,添富价值收益22.4%,同期沪深300指数收益10.4%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,我们认为国内宏观经济有望逐步企稳,市场经历崩溃式暴跌后,部分股票已回到合理估值区间。虽然近期市场急剧下跌超出我们的预期,但我们相信随着杠杆率的降低,投资者情绪从此前的狂热回归理性乃至出现恐惧,未来几个月市场将逐步企稳并出现结构性的投资机会。

2015年在中国资本市场历史中必将成为令人难以忘却的一年。在短短几个月中,我们见证了极度的疯狂和贪婪,也经历了可怕的暴跌和恐慌。作为专业的投资者,我们希望能够时刻保持良好且积极的心态,发挥自身在选股和风险控制方面的优势,通过深入研究并寻找具有良好盈利模式、优秀管理团队、合理估值水平的公司,并通过中长期持股来获取长期较好的回报。

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	7,606,891,472.70	87.43
	其中:股票	7,606,891,472.70	87.43
2	固定收益投资	208,259,407.80	2.39
	其中:债券	208,259,407.80	2.39
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	850,320,676.66	9.77
7	其他资产	35,007,535.60	0.40
8	合计	8,700,479,092.76	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	128,918,637.55	1.56
C	制造业	3,310,518,199.24	40.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	274,470.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	570,787,861.52	6.90
G	交通运输、仓储和邮政业	161,098,340.67	1.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	490,133,324.00	5.92
J	金融业	2,193,786,865.38	26.52
K	房地产业	173,127,543.22	2.09
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	395,889,848.12	4.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	182,356,383.00	2.20
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,606,891,472.70	91.95

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	601318	中国平安	10,000,000	819,400,000.00	9.90
2	601166	兴业银行	31,999,976	551,999,586.00	6.67
3	601601	中国太保	15,999,941	482,878,219.38	5.84
4	002415	海康威视	10,000,000	448,000,000.00	5.42
5	600422	昆药集团	11,914,164	439,990,076.52	5.32
6	002018	华信国际	10,800,000	354,888,000.00	4.29
7	300168	万达信息	7,200,000	353,664,000.00	4.28
8	600000	浦发银行	20,000,000	339,200,000.00	4.10
9	600511	国药股份	5,499,936	277,141,775.04	3.35
10	601717	郑煤机	24,500,000	267,295,000.00	3.23

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	公允价值(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	201,084,000.00	2.43
	其中:政策性金融债	201,084,000.00	2.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	7,175,407.80	0.09
8	其他	-	-
9	合计	208,259,407.80	2.52

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140230	14国开30	1,000,000	100,480,000.00	1.21
2	150403	15农发03	800,000	80,488,000.00	0.97
3	150301	15进出01	200,000	20,116,000.00	0.24
4	110031	航信转债	49,380	7,175,407.80	0.09

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

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中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,819,194.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,678,507.71
5	应收申购款	28,509,833.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,007,535.60

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	354,888,000.00	4.29	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	3,158,593,266.71
报告期期间基金总申购份额	2,110,756,194.18
减:报告期期间基金总赎回份额	2,334,216,436.07
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	2,935,133,024.82

注:其中"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价值精选股票型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富价值精选股票型证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富价值精选股票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、报告期内汇添富价值精选股票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7月18日

汇添富均衡增长股票型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月18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7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富均衡增长股票
交易代码	519018
前端交易代码	519018
后端交易代码	519010
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	7,036,129,125.87份
投资目标	本基金采用"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,同时通过二级过滤模型(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。
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。
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4月1日 — 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	4,465,945,693.48
2.本期利润	3,431,812,381.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.3450
4.期末基金资产净值	8,936,318,482.85
5.期末基金份额净值	1.2701

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	22.31%	3.26%	8.56%	2.09%	13.75%	1.17%

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(2006年8月7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		
韩贤旺	汇添富外延增长主题股票基金、汇添富均衡增长股票基金的基金经理,研究总监。	2012年3月2日	-	17年	国籍:中国。学历:复旦大学经济学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任君安证券有限责任公司分析师、天同证券有限责任公司研究所所长助理、行业副经理、国联安基金管理有限公司研发主管、平安资产管理有限公司股票研究主管。2007年5月加入汇添富基金管理股份有限公司任研究总监,2012年3月2日至今任汇添富均衡增长股票基金的基金经理,2014年12月8日至今任汇添富外延增长主题股票基金的基金经理。
叶从飞	汇添富均衡增长股票基金、汇添富蓝筹稳健混合基金、汇添富环保行业股票的基金经理。	2012年3月2日	-	11年	国籍:中国。学历:南京大学经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任中原证券股份有限公司资产管理部交易员、投资经理助理。2005年10月加入汇添富基金管理股份有限公司任交易主