汇添富安心中国债券型证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	汇添富安心中国债券	
交易代码	000395	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年11月22日	
报告期末基金份额总额	203,924,179.35份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过重点投资于高信用等级债券,力争实现资产的稳健增值。	
投资策略	本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产净值的80%,其中投资于高等级信用债券的投资比例不低于基金资产净值的70%;持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。	
业绩比较基准	中债综合指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,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	
下属分级基金的基金简称	汇添富安心中国债券A	汇添富安心中国债券C
下属分级基金的交易代码	000395	000396
报告期末下属分级基金的份额总额	178,584,224.36份	25,339,954.99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)	
	汇添富安心中国债券A	汇添富安心中国债券C
1. 本期已实现收益	2,311,408.62	517,915.33
2. 本期利润	3,681,702.74	872,831.44
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0202	0.0199
4. 期末基金资产净值	198,426,894.90	28,140,534.40
5. 期末基金份额净值	1.111	1.111

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

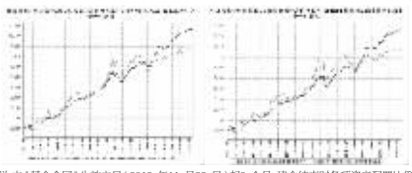
汇添富安心中国债券A

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	1.83%	0.07%	1.12%	0.06%	0.71%	0.01%

汇添富安心中国债券C

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	1.93%	0.07%	1.12%	0.06%	0.81%	0.01%

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11月22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		
何旻	汇添富安心中国债券基金、汇添富信用债债券基金的基金经理。	2013年11月22日	-	17年	国籍:中国。学历:英国伦敦政治经济学院金融经济学硕士。相关业务资格:基金从业资格、特许金融分析师(CFA)、财务风险经理人(FRM)。从业经历:曾任国泰基金管理有限公司行业研究员、综合研究小组负责人、基金经理助理,固定收益部负责人;金元比联基金管理有限公司基金经理。2004年10月28日至2006年11月11日担任国泰金龙债券基金的基金经理,2005年10月27日至2006年11月11日担任国泰金象保本基金的基金经理,2006年4月28日至2006年11月11日担任国泰金鼎保本基金的基金经理。2007年8月15日至2010年12月29日担任金元比联宝石动力双利债券基金的基金经理,2008年9月3日至2009年3月10日担任金元比联成长动力混合基金的基金经理,2009年3月29日至2010年12月29日担任金元比联丰利债券基金的基金经理。2011年1月加入汇添富资产管理(香港)有限公司,2012年2月17日至今任汇添富人民币债券基金的基金经理。2012年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,2013年11月22日至今任汇添富安心中国债券基金的基金经理,2014年1月21日至今任汇添富信用债债券基金的基金经理。

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。本基金无违大违法、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,并贯穿立项权、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

回顾三季度,宏观经济持续疲弱,投资、出口均未见好转,在资金去杠杆和市场悲观情绪的共同影响下,七八月份市场延续了从六月中旬开始的急跌行情。下跌过程中,场外场内杠杆逐步降低,市场估值逐步回归合理,加之监管层的救市举措,市场悲观情绪有所缓解。到九月份,场外配资去杠杆已告一段落,货币宽松政策和微刺激措施持续出台,同时,市场利率持续下行,部分资金表现出了追求收益的诉求,在此背景下,市场进入震荡整理状态。

报告期内,本基金遵循量化基金投资原则,保持了较为均衡的成长风格。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内成长多因子基准下跌28.26%,本基金在报告期内累计收益率为-30.63%,收益率落后业绩比较基准2.37%,落后主要源于申购赎回影响及基金估值调整等因素。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前宏观经济仍在寻底过程中,投资端,传统增长道路不可持续,去产能令投资增速持续下滑,但经济下台阶的直接原因在于工业投资增速下滑,根源在于经济转型,此角度看,投资端增速下滑恰恰反映了经济转型的定力;出口端,在外需疲软环境下,人民币小幅贬值并无法直接刺激出口,四季度仍存压力,但伴随经济转型升级,中国制造竞争力仍将持续;处在中国经济转型和全球资产去泡沫的背景下,四季度宏观环境仍不乐观,但积极的因素正在逐渐体现。

政策面上,各项有利于解放生产力的改革措施正在逐步推进,混合所有制改革将在企业层面激发改革活力,十三五规划将对转型关键期的国民经济发展进行全面布局,改革的推进有可能点燃资本市场热情,引发主题性投资机会。

资金面上,长期资本回报率下降与中期流动性的充裕决定了短期市场风险偏好的大幅波动,改革牛的逻辑依然存在,一旦市场热度被点燃,在资金的追捧下,有可能出现较大幅度的反弹;但另一方面,大跌形成的悲观预期仍需要一定的时间来消化,加之套牢资金的离场,市场仍可能持续震荡反复的格局。在市场震荡背景下,利用量化策略获得超额收益大有可为,成长多因子基金配置均衡,使用量化策略筛选基本面较为良好,估值较为合理的公司,未来可能会有一定表现。

作为量化投资基金,汇添富成长多因子量化策略基金将严格遵守基金合同,继续坚持既定的量化投资策略,追求相对业绩比较基准的较为稳定的超额收益。我们非常期望汇添富成长多因子量化策略基金能继续与投资者一起分享中国经济的美好未来。

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	220,242,444.96	96.95
	其中:债券	220,242,444.96	96.95
	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	2,606,124.53	1.15
7	其他资产	4,328,845.49	1.91
8	合计	227,177,414.98	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	26,100,285.60	11.52
	其中:政策性金融债	26,100,285.60	11.52
4	企业债券	39,561,159.36	17.46
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	154,581,000.00	68.23
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	220,242,444.96	97.21

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	101456009	14北车MTN002	100,000	10,680,000.00	4.71
2	140303	14进出03	100,000	10,637,000.00	4.69
3	101459034	14中航集MTN001	100,000	10,517,000.00	4.64
4	101552006	15三峡MTN001	100,000	10,485,000.00	4.63
5	101456060	14国开投MTN002	100,000	10,475,000.00	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

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

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	2,369.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,119,886.22
5	应收申购款	206,590.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,328,845.49

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

项目	汇添富安心中国债券A	汇添富安心中国债券C
报告期期初基金份额总额	177,784,423.36	30,437,984.54
报告期期间基金总申购份额	75,975,723.90	75,733,857.73
减:报告期期间基金总赎回份额	75,175,922.90	80,831,887.28
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	178,584,224.36	25,339,954.99

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安心中国债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富安心中国债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富安心中国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、报告期内汇添富安心中国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

汇添富策略回报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	汇添富策略回报混合
交易代码	470008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月22日
报告期末基金份额总额	1,112,106,049.25份
投资目标	本基金采用"自上而下"的投资方式,灵活运用资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略,构建有效的投资组合,并在科学严格的投资风险管理前提下,力求为基金份额持有人实现持续稳健的较高投资回报。
投资策略	本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的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占基金资产的5%—40%,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%。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×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	-542,517,136.41
2.本期利润	-1,003,735,892.93
3.加权平均基金份额本期利润	-0.8771
4.期末基金资产净值	1,556,048,799.47
5.期末基金份额净值	1.399

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。

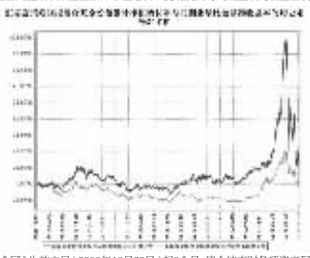
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-35.65%	5.06%	-22.45%	2.67%	-13.20%	2.39%

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12月22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		
顾耀强	汇添富策略回报混合基金、汇添富逆向投资混合基金、汇添富均衡增长混合基金的基金经理。	2009年12月22日	-	11年	国籍:中国。学历:清华大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任高级行业分析师、基金经理助理,2009年12月22日至今任汇添富策略回报混合基金的基金经理,2012年3月9日至今任汇添富逆向投资混合基金的基金经理,2014年4月8日至今任汇添富均衡增长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,并贯穿立项权、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

2009年上半年,国内经济在政府一揽子刺激政策的作用下,呈现出逐步企稳的态势,但是,经济复苏的基础并不牢固,企业盈利的改善主要来自于政府投资的拉动,而非市场需求的自发增长。下半年,随着经济的企稳,政府开始逐步退出刺激政策,经济增长的内生动力不足的问题将逐步显现。

报告期内,本基金在坚持自下而上选股的基础上,适当参与了一些受益于政府刺激政策的行业,如钢铁、有色、煤炭、机械等,同时,对于一些受益于经济复苏的行业,如金融、地产等,也进行了适当的配置。

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为1.469元,三季度净值下跌-35.65%,成立以来累积收益率为46.9%。

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、连锁药店、医药流通等领域都有一批公司有望脱颖而出,实现稳定较快增长。(3)一些细分行业如养殖、化工等因为供求关系改善而带来的景气回升。

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	1,439,419,677.64	92.10
	其中:股票	1,439,419,677.64	92.10
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	119,138,430.00	7.62
8	其他资产	4,398,886.32	0.28
9	合计	1,562,956,993.96	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	544,342,421.37	34.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,488,356.97	2.73
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	381,131,423.67	24.49
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	19,198,536.00	1.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	289,298,858.10	18.59
J	金融业	-	-
K	房地产业	130,348,736.35	8.38
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,524,000.00	0.36
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	27,087,345.18	1.74
	合计	1,439,419,677.64	92.50

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	600172	黄河旋风	8,700,000	126,324,000.00	8.12
2	600845	宝信软件	2,392,000	118,284,400.00	7.60
3	300212	易华录	2,990,000	101,959,000.00	6.55
4	002556	辉隆股份	6,599,765	95,300,606.60	6.12
5	002584	西陇化工	3,699,800	93,197,962.00	5.99
6	002285	世联行	7,290,000	90,250,200.00	5.80
7	603939	益丰药房	1,326,150	80,444,259.00	5.17
8	300009	安科生物	2,999,891	65,427,622.71	4.20
9	600180	瑞茂通	2,599,877	53,115,487.11	3.41
10	002044	江苏三友	1,999,930	52,158,174.40	3.35

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本期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	1,184,123.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,464.97
5	应收申购款	671,590.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,876,179.03

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	600754	锦江股份	18,496,502.36	1.23	重大资产重组停牌
2	000876	新希望	17,046,648.00	1.13	重大资产重组停牌
3	600219	南山铝业	14,531,272.00	0.96	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	2,087,580,296.61
报告期期间基金总申购份额	1,134,385,860.55
减:报告期期间基金总赎回份额	1,540,702,242.30
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	1,681,263,914.86

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:本报告期内本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成长多因子量化策略股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富成长多因子量化策略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、报告期内汇添富成长多因子量化策略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10月27日

汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金

【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	汇添富成长多因子量化策略股票
交易代码	001050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月16日
报告期末基金份额总额	1,681,263,914.86份
投资目标	本基金通过多因子量化模型方法,精选股票进行投资,在严格控制风险的前提下,力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资于成长型行业的股票,采用基金管理人的金融工程团队开发的多因子量化策略进行选股。
业绩比较基准	中证500指数收益率×90%+活期存款利率(税后)×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的基金产品。
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	-324,775,243.00
2.本期利润	-780,480,951.90
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4376
4.期末基金资产净值	1,508,602,717.06
5.期末基金份额净值	0.897

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。

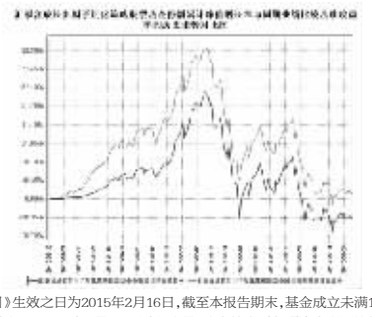
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-30.63%	4.57%	-28.26%	3.62%	-2.37%	0.95%

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《基金合同》生效之日为2015年2月16日,截至本报告期末,基金成立未满1年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2015年2月16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		
吴振翔	汇添富上证综合指数、汇添富中证主要消费ETF、汇添富中证医药卫生ETF、汇添富中证能源ETF、汇添富中证金融地产ETF、汇添富沪深300安中指数基金、汇添富成长多因子股票基金、汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理,指数与量化投资部副总监。	2015年2月16日	-	9年	国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理,现任指数与量化投资部副总监。2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理,2011年9月16日至2013年11月7日任汇添富保证300ETF基金的基金经理,2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富保证300ETF基金联接基金的基金经理,2013年8月23日至今任中