汇添富国企创新增长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	汇添富国企创新股票
交易代码	001490
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月10日
报告期末基金份额总额	3,104,408,914.03份
投资目标	本基金采用自下而上的投资方法,以基本面分析为立足点,精选国企创新主题的优质上市公司,结合市场脉络,做中长期布局,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险;个股精选策略用于挖掘具有持续创新增长动力的国企创新主题上市公司。
业绩比较基准	中证国有企业综合指数×80%+中债综合指数×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预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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10日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-56,006,311.85
2.本期利润	-328,380,743.14
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1058
4.期末基金资产净值	2,776,028,170.89
5.期末基金份额净值	0.894

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。

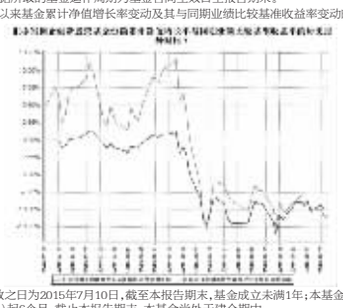
3.2 基金净值表现

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	-10.60%	1.45%	-11.09%	2.74%	0.49%	-1.29%

注:本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日至报告期末。

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7月10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7月10日)起6个月,截止本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

§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		
李威	汇添富国企创新股票基金的基金经理、汇添富外延增长股票基金的基金经理、汇添富可转换债券基金、汇添富双利债券基金、汇添富双利增强债券基金的基金经理助理。	2015年7月10日	-	6年	国籍:中国。学历:清华大学工学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2008年7月加入汇添富基金管理股份有限公司任行业分析师,2015年1月29日至今任汇添富外延增长股票基金的基金经理。2015年5月25日至今任汇添富可转换债券基金、汇添富双利债券基金、汇添富双利增强债券基金的基金经理助理,2015年7月10日至今任汇添富国企创新股票基金的基金经理。
劳杰男	汇添富国企创新股票基金的基金经理。	2015年7月10日	-	4年	国籍:中国。学历:复旦大学经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2010年7月加入汇添富基金管理股份有限公司任金融行业分析师,2015年7月10日至今任汇添富国企创新股票基金的基金经理。

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

三季度市场延续快速下跌的趋势。一方面前期积累了大量杠杆资金,在多种因素下去杠杆过程开启,快速出清是必然结果;另一方面之前的牛市泡沫过大,在市场快速上涨中,大部分投资者忽视了中国经济发展阶段遇到的难题,下跌是对估值泡沫的修正,投资者开始重新审视经济增速、汇率、改革难度等风险因素,在恐慌中把部分问题放大。

本基金三季度初成立,仓位一直控制在40%以下,在持仓上主要注重公司的抗风险性,选择估值较为合理的稳定成长股,中小创配置比例较少,一定程度上规避了系统性风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

三季度,本基金净值收益率为-10.60%,同期比较基准收益率为-11.09%,本基金取得相对比较基准超额收益0.49个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前的经济颓势较难扭转。基建和地产等传统投资增速下滑,出口受到国际形势掣肘,消费增长缺乏亮点,部分传统消费甚至开始下滑体现出后周期的特点。虽然政府不断加大货币宽松力度,开始出台政策刺激汽车和房地产消费,但是经济仍未企稳。

展望未来,我们对市场偏谨慎,但是在资金充裕、无风险利率持续下降的背景下,结构性机会将始终存在。中国经济的增长方式必须改变,通过创新寻找新的经济增长点,通过改革释放活力是必然方向,以创新和改革作为配置的核心,将是最合理的选择。我们也要充分认识其中的困难,创新并不是简单的"+互联网"和讲故事,从行业发展空间、商业模式、管理层能力等维度准确筛选是未来较长时间投资的主要工作;改革也进入深水区,我们将仔细比选,寻找能够快速推进改革的经济领域,能够引起经营效率重大变化的企业。我们期待能够选中其中的代表性企业,为持有人创造回报。

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	1,175,531,045.26	42.07
	其中:股票	1,175,531,045.26	42.07
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	1,617,843,835.53	57.90
8	其他资产	745,210.27	0.03
9	合计	2,794,120,091.06	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	10,324,860.00	0.37
B	采矿业	10,155,231.81	0.37
C	制造业	834,796,186.46	30.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,309,371.16	0.77
E	建筑业	18,322,200.00	0.66
F	批发和零售业	55,207,069.65	1.99
G	交通运输、仓储和邮政业	24,246,420.00	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,183,822.02	1.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	28,276,028.00	1.02
L	租赁和商务服务业	37,304,394.00	1.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	75,636,313.70	2.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	13,779,148.46	0.50
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,175,531,045.26	42.35

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	000967	上风高科	6,422,098	87,340,532.80	3.15
2	000568	泸州老窖	3,961,518	81,369,579.72	2.93
3	000826	桑德环境	2,244,401	75,636,313.70	2.72
4	600172	黄河旋风	4,899,900	71,146,548.00	2.56
5	002037	久联发展	2,910,848	69,511,050.24	2.50
6	600867	通化东宝	2,571,847	57,635,091.27	2.08
7	601222	林洋电子	1,965,928	56,599,067.12	2.04
8	600180	瑞茂通	2,702,255	55,207,069.65	1.99
9	002443	金洲管道	5,105,400	54,780,942.00	1.97
10	600271	航天信息	938,900	50,409,541.00	1.82

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
注:报告期末本基金无股指期货持仓。
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:本基金本报告期内未投资国债期货。
5.10.3 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。
5.11 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	436,009.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	309,200.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	745,210.27

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	002443	金洲管道	54,780,942.00	1.97	重大资产重组停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年7月10日)基金份额总额	3,104,408,914.03
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,104,408,914.03

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

报告期期初管理人持有的本基金份额	50,003,500.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	50,003,500.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.61

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2015年7月10日成立。本公司于2015年7月6日用固有资金50,000,000.00元认购本基金份额50,000,000.00份(基金成立时利息结转的份额为3,500.00份),申购费用0.00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	认购	2015年7月6日	50,000,000.00	50,000,000.00	-
合计			50,000,000.00	50,000,000.00	

§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国企创新增长股票型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富国企创新增长股票型证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富国企创新增长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、报告期内汇添富国企创新增长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

汇添富和聚宝货币市场基金

【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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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	汇添富和聚宝货币
交易代码	000600
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月28日
报告期末基金份额总额	2,113,855,471.55份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略,力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§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	20,574,019.05
2. 本期利润	20,574,019.05
3. 期末基金资产净值	2,113,855,471.55

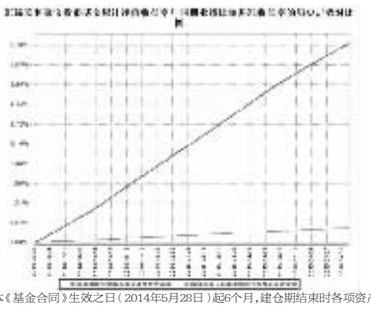
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9913%	0.0025%	0.0882%	0.0000%	0.9031%	0.0025%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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(2014年5月28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		
汤丛珊	汇添富货币基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金、汇添富和聚宝货币基金、汇添富添富通货币基金的基金经理。	2014年5月28日	2015年7月30日	7年	国籍:中国。学历:上海财经大学管理学硕士。相关业务资格:基金从业资格。从业经历:2008年5月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任固定收益交易员、固定收益交易主管。2013年7月31日至今任汇添富货币基金的基金经理,2013年12月13日至今任汇添富全额宝货币基金的基金经理。2014年1月21日至今任汇添富理财30天债券、理财60天债券基金的基金经理。2014年5月28日至2015年7月30日任汇添富和聚宝货币基金的基金经理。2015年1月16日至今任汇添富添富通货币基金(原汇添富新收益债券基金)的基金经理。
徐寅喆	汇添富和聚宝货币基金、汇添富收益快钱货币基金、汇添富收益快钱货币基金、汇添富理财7天债券基金的基金经理。	2014年11月26日	-	7年	国籍:中国。学历:复旦大学法学学士。六年证券从业经验。曾任长江养老保险股份有限公司债券交易员。2012年5月加入汇添富基金管理股份有限公司任债券交易员、固定收益基金经理助理。2014年8月27日至今任汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富理财7天债券型证券投资基金的基金经理,2014年11月26日至今任汇添富和聚宝货币市场基金经理,2014年12月23日至今任汇添富收益快钱货币基金基金经理。

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,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

2015年三季度,国际市场方面,全球经济放缓。强势美元和海外需求疲软对美国经济造成冲击凸显,非农就业数据进一步回落并大幅低于市场预期,美联储加息概率不断下降;国内市场方面,经济依旧低迷,而9月以来物价指数重新回落,通缩风险有所升温。人民币持续贬值对三季度资金面造成持续承压,央行通过降准、SLO、MLF、逆回购等方式投放超万亿流动性,对冲资本外流。

债券市场方面,三季度受股市下跌资金回流以及IPO暂停背景下打新基金加大固定收益类产品配置力度的影响下,银行间货币利率保持低位,各期限债券品种百花齐放,收益率均持续下行,牛市行情得以延续。信用利差也进一步收缩,其中高等级信用债已处于09年以来的历史低位,信用品种收益率下行幅度超过30BP。

操作上,本基金在三季度继续加强了短融的波段性操作,把握住了债券的上涨机会。临近三季末,由积极转为谨慎策略,降低债券久期至中性水平,适度调整了存款的配置期限;保持适度比例的高评级短融的配置作为流动性管理的工具,减低低评级短融的持仓,降低组合的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值收益率为0.9913%。同期业绩比较基准收益率0.0882%。

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2015年第四季度,宏观经济形势仍不容乐观,9月以来物价指数重新回落,通缩风险有所升温,经济下行压力在所难免,为实现全年稳增长的目标,降准降息等宽松货币政策有望再度释放,流动性整体无忧。因此债券市场收益率仍将保持震荡下行为主,收益率曲线将进一步平坦化,但同时不排除年底资金面紧张带来一定调整的可能。在把握交易性机会的同时,警惕一旦快速调整或将引发踩踏所带来的连锁反应,因此配置上仍将着重关注短久期、中高等级品种,保证较高的安全边际。

我们将在密切跟踪基本面、政策面和资金面前提下,综合分析本基金的份额变动,做好债券与存款之间的配置,保持组合的较高流动性和安全性,积极把握市场结构性机会,通过在合适的时点锁定高收益的存款和灵活控制短融仓位择机把握中高等级短融的波动机会,适度提高组合的投资收益。

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	固定收益投资	918,180,454.94	40.42
	其中:债券	898,183,227.26	39.54
	资产支持证券	19,997,227.68	0.88
2	买入返售金融资产	110,000,629.26	4.84
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	30,000,269.26	1.32
3	银行存款和结算备付金合计	1,221,631,029.91	53.78
4	其他资产	21,884,574.45	0.96
5	合计	2,271,696,688.56	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.38	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	156,999,521.50	7.43
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	118
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	84

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明
注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	23.30	7.43
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	16.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	8.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	30.73	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	27.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.42	7.43

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	摊余成本(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	110,067,190.50	5.21
	其中:政策性金融债	110,067,190.50	5.21
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	669,549,702.22	31.67
6	中期票据	-	-
7	同业存单	118,566,334.54	5.61
8	其他	-	-
9	合计	898,183,227.26	42.49
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150211	15国开11	500,000	50,044,264.90	2.37
2	011599669	15南方水泥SCP007	400,000	39,981,061.13	1.89
3	041560032	15鲁晨鸣CP002	300,000	30,101,967.42	1.42
4	041566009	15江铜CP001	300,000	30,032,779.98	1.42
5	011599223	15鲁黄金SCP002	300,000	30,030,976.28	1.42
6	150202	15国开02	300,000	30,022,042.49	1.42
7	150307	15进出07	300,000	30,000,883.11	1.42
8	011510004	15中电投SCP004	300,000	29,995,219.09	1.42
9	041564076	15武山鹰CP002	300,000	29,982,026.27	1.42
10	011599441	15徐工SCP004	300,000	29,965,894.51	1.42

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	36
报告期内偏离度的最高值	0.2956%
报告期内偏离度的最低值	0.2152%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2537%

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十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	期末市值	占基金资产净值比例(%)
1	1589137	15兴银3A2	200,000	2,000,400.00	0.95

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金估值采用摊余成本法计价,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.8.2

本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	21,873,574.45
4	应收申购款	-
5	其他应收款	11,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	21,884,574.45

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,959,453,851.77
报告期期间基金总申购份额	2,230,980,836.78
减:报告期期间基金总赎回份额	2,076,579,217.00
报告期期末基金份额总额	2,113,855,471.55

注:总申购份额含红利再投份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本基金的基金管理人本报告期内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和聚宝货币市场基金募集的文件;
2、《汇添富和聚宝货币市场基金基金合同》;
3、《汇添富和聚宝货币市场基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
5、报告期内汇添富和聚宝货币市场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

汇添富恒生指数分级证券投资基金

【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

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富恒生指数分级(QDII)		
场内简称	添富恒生		
交易代码	164705		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年3月6日		
报告期末基金份额总额	1,565,169,849.54份		
投资目标	紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。		
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。		
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,具有与标的指数及标的指数所表征的股票市场相似的风险收益特征,在股票基金中属于中等风险、中等收益的产品。本基金为境外证券投资的基金,主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。此外,从投资者具体持有的基金份额