

## 汇添富逆向投资混合型证券投资基金

## [2015] 第四季度报告

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:2016年1月21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2016年1月19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报告中的风险揭示。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

汇添富逆向投资混合型证券投资基金			
基金简称	汇添富逆向投资混合型证券投资基金	基金代码	470008
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	2016年1月21日	联系人	王海峰
基金类型	混合型	联系电话	021-50537700
报告期末基金份额总额	613,762,706.84份	客户服务电话	400-888-9918
报告期损益分配情况	无	传真	021-50537705
报告期每基金单位收益	0.0000元	网站	www.99tfund.com
报告期每基金份额净值	1.139,482,300.00元	其他	汇添富基金管理股份有限公司
报告期基金份额净值增长率	1.174,603,889.43%		
报告期基金份额净值增长率标准差	2.296%		

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期利润	-46,064,734.00
2.本期利润	360,945,676.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.6207
4.期末基金资产净值	1,174,603,889.43
5.期末基金份额净值	1.139,482,300.00

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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算用费后实际收益水平将有所下降。

3.基金净值表现

3.1 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值收益率(①) 净值收益率差额(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率差额(④)  
过去三个月 0.012% 0.0360% 0.0000% 0.0400% 0.012%

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《基金合同》生效之日起6个月，建仓结束时各

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 在本基金的基金管理期间 证券从业年限 说明

顾晓波 汇添富逆向投资混合型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。 2012年3月9日 - 11年

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 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内严格遵守《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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平等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场

所等投资品种，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、监督稽查等各个环节的公平交易机制。

本基金期内，基金管理人严格按照公平交易制度的规定执行，实现了流程优化和进一步系

统化，确保全程嵌入风险管理体系，包括投资独立决策、研究公开分享，集中交易公平执行、交易、严重监控和报告及分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本基金期内，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

本基金期内基金管理人所有的投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成

交较少的单边成交量超过该证券当日成交量5%的交易次数为2次，是组合投资策略原因导致，经检查未发现异常情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

经历三个季度连续下跌之后，第四季度市场企稳回升，沪深300指数和创业板指数本

季度涨幅均超16%和30.32%，IP、VR、精准医疗等主题活跃，以万科为代表的保险类股

类公司也带动了价值型公司的上涨，而对大小非减持限制将要到期、注册制临近和人民币升贬值等因素，股价则反应不一。

本基金本季度进行了较大调整，以纠正前期因流动问题而导致的结构性扭曲。主要

是适度增加价值型公司的配置，减少了部分估值高偏高的小公司，组合整体仍以经营

拐点型公司为主。本基金将继续坚持逆向投资策略，积极灵活动态调整组合，并加强风险控

制和流动性管理，努力持有公司稳健的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2015年12月31日，本基金累计单位净值2.436元，四季度净值上涨35.43%，成立以来累积收益率为143.6%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## 汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金

## [2015] 第四季度报告

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:2016年1月21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2016年1月19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报告中的风险揭示。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

§ 3 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 1,070,670,067,661 90.76

其中:股票 1,070,670,067,661 90.76

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

4 货币市场工具 - -

5 其他 - -

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 85,743,100,322 7.26

8 其他资产 24,003,224.90 0.24

9 合计 1,390,402,300.00 100.00

§ 4 投资组合报告

§ 5 投资组合报告

§ 6 开放式基金份额变动

报告期各月份的净值表现

单位:人民币元

报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

汇添富年年利定期开放债券A 汇添富年年利定期开放债券C

1.本期已实现收益 9,069,486.76 1,813,078.70

2.本期利润 18,725,502.34 3,089,020.39

3.加权平均基金份额本期利润 0.0161 0.0031

4.期末基金资产净值 1,040,670,784.62 233,601,427.09

5.期末基金份额净值 1.016 1.019

6.报告期最后一个交易日基金份额净值 1,040,670,784.62 233,601,427.09

7.报告期基金份额变动情况

8.报告期基金份额变动情况

9.报告期基金份额变动情况

10.报告期基金份额变动情况

11.报告期基金份额变动情况

12.报告期基金份额变动情况

13.报告期基金份额变动情况

14.报告期基金份额变动情况

15.报告期基金份额变动情况

16.报告期基金份额变动情况

17.报告期基金份额变动情况

18.报告期基金份额变动情况

19.报告期基金份额变动情况

20.报告期基金份额变动情况

21.报告期基金份额变动情况

22.报告期基金份额变动情况

23.报告期基金份额变动情况

24.报告期基金份额变动情况

25.报告期基金份额变动情况

26.报告期基金份额变动情况

27.报告期基金份额变动情况

28.报告期基金份额变动情况

29.报告期基金份额变动情况

30.报告期基金份额变动情况

31.报告期基金份额变动情况

32.报告期基金份额变动情况

33.报告期基金份额变动情况

34.报告期基金份额变动情况

35.报告期基金份额变动情况</p