

汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金

[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

§ 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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约定，于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇添富成长多因子量化股票型基金
交易代码	001040
基金的运作方式	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	1,378,523,200.299
报告期期间基金净值增长率	-40.50% -39.00%
报告期期间净值收益率	-40.50% -39.00%
报告期期间净值收益率标准差	0.0361
报告期末基金份额净值	1,637.07% 369.41
报告期末总资产	1108

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益		-40.50% -39.00%
2.本期利润		-40.50% -39.00%
3.加权平均基金份额本期利润		-0.0361
4.期末基金份额净值		1,637.07% 369.41
5.期末基金份额净值		1108

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。

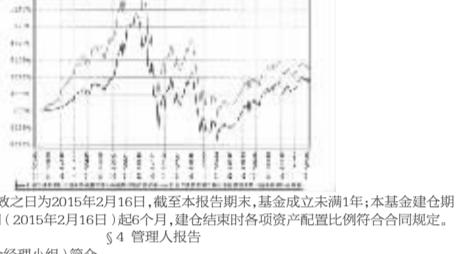
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.基金的净值表现

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(%)	净值增长基准(%)	业绩比较基准(%)	①-③	②-④
过去三个月	32.44%	21.00%	18.04%	10.43%	0.12%

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:《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《基金合同》生效之日起6个月(2015年2月16日至8月16日)，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(基金经理小组)简介		
姓名	职务	任本基金的基金经理期间
吴振瑞	汇添富成长多因子量化股票型基金基金经理	2015年2月16日
许一尊	汇添富成长多因子量化股票型基金基金经理	2015年11月24日

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“离任日期”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指标的说明

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、证监会公告及基金合同的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，不存在被投诉的情形。

4.3.管理人对报告期内基金业绩指标的说明

报告期内，本基金通过公开交易机制实现了流程化和进一步系统化，确保买入式风险管理效果，包括投资独立决策、研究充分平分、投资决策、监督稽查各环节的公平交易机制。

4.4.管理人对报告期内基金费用的说明

本基金管理人严格遵守《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.5.管理人对报告期内基金收益情况的说明

报告期内，本基金超额收益情况良好。

4.6.管理人对报告期内基金估值政策的说明

本基金管理人严格按照《中国证监会关于发布证券投资基金行业估值指引(试行)的通知》(证监基金字[2008]31号)、《中国证监会关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(证监基金字[2013]12号)、《中国证监会关于发布证券投资基金行业估值指引(试行)的通知》(证监基金字[2015]12号)以及中国证券投资基金业协会《基金资产估值指引》等有关规定，对基金持有的股票投资、债券投资、货币市场工具、基金投资、贵金属交易、期权投资等品种进行估值。

4.7.管理人对报告期内基金收益分配政策的说明

本基金管理人严格按照《关于进一步规范证券投资基金收益分配有关事项的通知》(证监基金字[2012]16号)以及中国证监会《关于进一步规范证券投资基金收益分配有关事项的通知》(证监基金字[2013]37号)的规定，对基金收益分配政策进行调整。

4.8.管理人对报告期内基金费用计提方法、计提标准和计提方式的说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.9.管理人对报告期内基金收益分配政策的说明

本基金管理人严格按照《关于进一步规范证券投资基金收益分配有关事项的通知》(证监基金字[2012]16号)以及中国证监会《关于进一步规范证券投资基金收益分配有关事项的通知》(证监基金字[2013]37号)的规定，对基金收益分配政策进行调整。

4.10.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.11.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.12.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.13.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.14.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.15.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.16.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.17.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.18.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.19.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.20.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.21.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.22.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.23.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.24.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.25.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.26.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.27.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.28.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.29.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.30.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.31.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.32.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.33.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.34.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.35.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.36.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.37.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明

本基金管理人严格按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，并严格按照基金合同的约定，规范运作，不存在变相降低费用标准、变相增加费用的情况。

4.38.管理人对报告期内基金投资组合的专项说明