汇添富民营活力混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:2017年10月25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2017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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富民营活力混合
交易代码	470009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月5日
报告期末基金份额总额	1,742,169,201.22份
投资目标	本基金采用自下而上的方法,精选与中国经济发展密切相关的优秀民营企业上市公司股票进行投资布局,在科学严格管理风险的前提下,力求基金资产的中长期增值。
投资策略	股票资产比例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资产比例5%—40%。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%。 按本基金《基金合同》中有关民营企业上市公司的定义,本基金投资于民营企业上市公司股票的资产占股票资产的比例不低于80%。
业绩比较基准	中证民营企业综合指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金
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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	303,978,346.49
2.本期利润	404,349,514.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.2214
4.期末基金资产净值	5,393,596,563.87
5.期末基金份额净值	3.096

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	7.80%	0.73%	4.03%	0.66%	3.77%	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(2010年5月5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		
马翔	汇添富民营活力混合基金的基金经理。	2016年3月11日	-	6年	国籍:中国。学历:清华大学工学硕士。从业经历:2011年加入汇添富基金任行业分析师,2016年3月11日至今任汇添富民营活力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,形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理,涉及交易所市场、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的公平交易机制良好。

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未出现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%的情况,经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

今年三季度,市场整体上行,代表行业龙头的蓝筹股表现较强,以沪深300指数表现优于创业板指数,中证民企指数上涨5%。

本基金以企业基本面分析为立足点,顺应中国经济发展阶段,力求寻找能够成长为行业领袖的公司,中长期持股,分享企业成长增值。重点布局的行业包括:具有国际竞争力的中国制造业企业;具有品牌溢价,且处于扩张阶段的大消费行业公司;商业模式出现向上拐点的互联网和科技公司。

报告期内,资金进一步向优质龙头企业集中;我们维持了以成长股龙头为主的均衡配置,重仓股小幅变动,增加了新能源汽车、通信产业和电子产业的配置比例;降低了地产产业链相关股票的配置,取得了一定的正收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为3.0960元;本报告期基金份额净值增长率为7.80%,业绩比较基准收益率为4.03%。

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	4,853,163,711.56	89.41
	其中:股票	4,853,163,711.56	89.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	99,800,000.00	1.84
	其中:债券	99,800,000.00	1.84
	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	99,750,289.63	1.84
	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	368,408,987.10	6.79
8	其他资产	6,702,271.63	0.12
9	合计	5,427,825,223.92	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	39,793.60	0.00
C	制造业	2,808,909,051.40	52.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	92,799,424.64	1.72
F	批发和零售业	548,228,453.17	10.16
G	交通运输、仓储和邮政业	3,470,571.91	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	268,996,818.92	4.99
J	金融业	796,540,981.65	14.77
K	房地产业	-	-
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	176,217,492.00	3.27
Q	卫生和社会工作	157,897,030.33	2.93
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,853,163,711.56	89.98

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

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	002236	大华股份	21,763,559	523,848,868.13	9.71
2	601318	中国平安	8,500,028	460,361,516.48	8.54
3	603589	口子窖	8,000,082	391,044,057.04	7.25
4	601933	永辉超市	44,999,908	359,549,264.92	6.67
5	000063	中兴通讯	11,006,987	311,497,732.10	5.78
6	601601	中国太保	5,999,991	221,579,667.63	4.11
7	002217	合力泰	18,999,886	213,748,368.75	3.96
8	603368	柳州医药	3,500,052	188,652,802.80	3.50
9	601717	郑煤机	23,903,716	185,492,836.16	3.44
10	603799	华友钴业	2,000,000	182,940,000.00	3.39

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	99,800,000.00	1.85
	其中:政策性金融债	99,800,000.00	1.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	99,800,000.00	1.85

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	170204	17国开04	1,000,000	99,800,000.00	1.85

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

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

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	1,762,921.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,900,368.01
5	应收申购款	3,038,981.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,702,271.63

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	601717	郑煤机	185,492,836.16	3.44	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	1,906,296,132.25
报告期期间基金总申购份额	76,856,097.41
减:报告期期间基金总赎回份额	229,984,028.44
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	1,742,169,201.22

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富民营活力混合型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富民营活力混合型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富民营活力混合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、报告期内汇添富民营活力混合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。

9.2 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

9.3 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

2017年10月25日

汇添富民营新动力股票型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:2017年10月25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2017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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富民营新动力股票
交易代码	001541
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月7日
报告期末基金份额总额	677,700,750.97份
投资目标	本基金采用自下而上的方法,精选与中国经济发展密切相关的优秀民营企业上市公司股票进行投资布局,在科学严格管理风险的前提下,力求基金资产的中长期增值。
投资策略	本基金为股票型基金,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;个股精选策略用于或长线较高且估值有吸引力的优秀民营企业上市公司以获取超额收益。
业绩比较基准	中证民营企业综合指数×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的较高风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,高于混合型基金和债券型基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	56,525,822.34
2.本期利润	68,352,323.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.0936
4.期末基金资产净值	690,887,274.54
5.期末基金份额净值	1.019

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。

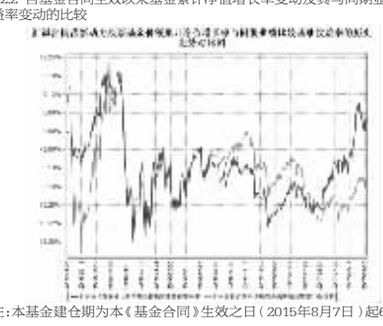
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	9.92%	0.99%	3.99%	0.66%	5.93%	0.33%

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(2015年8月7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		
谭志强	汇添富民营新动力股票基金的基金经理。	2015年8月7日	-	8年	国籍:中国。学历:复旦大学金融学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2009年3月加入汇添富基金任汇添富基金管理股份有限公司行业分析师。2015年8月7日至今任汇添富民营新动力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,形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理,涉及交易所市场、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的公平交易机制良好。

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未出现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%的情况,经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度市场整体表现均衡,各类风格指数都上涨,上半年的风格极度分化格局有所收敛。单三季度,上证50上涨4.80%,沪深300指数上涨4.63%,中小板综合指数上涨5.31%,创业板指数上涨2.69%,中证民企上涨5%。三季度宏观经济企稳回升得到数据确认,重卡和工程机械数据持续向好显示经济韧性足,供给侧改革初见成效。市场风险偏好有所上升,三季度周期类资产有色,煤炭和钢铁等板块表现较好,成长类新能源汽车和消费电子表现居前。但是前三季度来看,业绩确定性较高的家电、白酒和保险为代表的低估值蓝筹股仍然涨幅居前,海外资金持续流入稳定类个股。

本基金在三季度根据经济和市场环境的变化对资产配置结构做出调整。仓位方面,本基金最低仓位限制是80%,组合贝塔的调整主要通过组合结构来控制,仓位绝对值基本没有变化。虽然跑赢了基准,但是白酒和家电配置较少,严重影响业绩表现。三季度重点加仓了消费电子股和资源类个股,取得一定的收益。行业配置方面,坚守契约,集中于符合中国产业经济转型升级的行业,新能源汽车如医疗服务、环保新材料、安防等,在成长类资产配置有所收缩,主要集中在消费电子和新能源汽车。个股投资上对成长股进行严格筛选,集中投资于盈利模式清晰、成长路径确定的优质成长股,同时增加了对低估值蓝筹股和稳定成长类股票的配置,降低组合贝塔。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.019元;本报告期基金份额净值增长率为9.92%,业绩比较基准收益率为3.99%。

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	620,651,982.22	89.35
	其中:股票	620,651,982.22	89.35
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	73,249,351.20	10.54
8	其他资产	736,033.96	0.11
9	合计	694,637,367.38	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	33,162,380.84	4.80
C	制造业	438,605,222.48	63.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,815,756.83	5.04
J	金融业	64,878,469.02	9.39
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	17,136,980.00	2.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,773,944.99	3.01
R	文化、体育和娱乐业	11,116,863.54	1.61
S	综合	-	-
	合计	620,651,982.22	89.83

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

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	300285	国瓷材料	2,815,912	64,850,453.36	9.39
2	002384	东山精密	2,241,111	64,364,707.92	9.32
3	002236	大华股份	2,411,628	58,047,885.96	8.40
4	601600	中国铝业	4,903,900	37,122,523.00	5.37
5	601601	中国太保	924,313	34,134,879.09	4.94
6	000983	西山煤电	2,881,604	29,709,337.24	4.30
7	002466	天齐锂业	399,661	28,092,171.69	4.07
8	300338	开元股份	965,907	24,099,379.65	3.49
9	300115	长盈精密	649,454	22,451,624.78	3.25
10	600388	龙净环保	1,279,200	21,644,064.00	3.13

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十名权证投资明细

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

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

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

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	308,846.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,046.57
5	应收申购款	411,147.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	736,033.96

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	300285	国瓷材料	64,850,453.36	9.39	重大资产重组停牌
2	601600	中国铝业	37,122,523.00	5.37	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	769,607,563.55
报告期期间基金总申购份额	24,375,719.53
减:报告期期间基金总赎回份额	116,282,532.11
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	677,700,750.97

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富民营新动力股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富民营新动力股票型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富民营新动力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、报告期内汇添富民营新动力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。

9.2 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

9.3 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

2017年10月25日

汇添富逆向投资混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:2017年10月25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2017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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富逆向投资混合
交易代码	470098
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月9日
报告期末基金份额总额	706,901,398.46份
投资目标	本基金主要采用逆向投资策略进行主动投资管理,在科学严格的投资风险管理前提下,谋求基金资产长期稳健回报。
投资策略	本基金主要采用逆向投资策略进行主动投资管理。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×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	中国农业银行股份有限公司

§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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	41,269,276.08
2.本期利润	66,159,673.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0722
4.期末基金资产净值	1,272,646,979.40
5.期末基金份额净值	1.800

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。

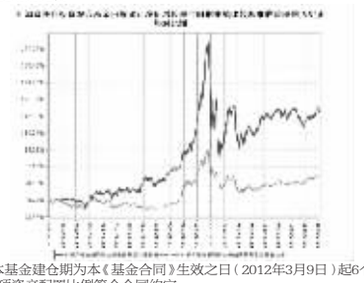
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	3.93%	0.68%	3.82%	0.47%	0.11%	0.21%

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3月9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	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、汇添富护鼎新价值股票基金、汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理。	2012年3月9日	-	13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:曾任杭州永福集团公司技术员、海通证券投行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。2008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9日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合基金的基金经理。2016年7月27日至今任汇添富护鼎新价值股票基金的基金经理。2017年3月15日至今任汇添富绝对收益定开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,形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理,涉及交易所市场、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的公平交易机制良好。

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的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公