

# 汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资 基金 2010 年第 3 季度报告

2010 年 9 月 30 日

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：2010 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 2010 年 10 月 22 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 2010 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	汇添富蓝筹稳健混合
交易代码	519066
前端交易代码	519066
后端交易代码	519067
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 7 月 8 日
报告期末基金份额总额	455,944,420.77 份
投资目标	通过投资于价值相对低估的蓝筹公司股票，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为灵活配置混合型基金，属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。
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

### § 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（2010年7月1日—2010年9月30日）
1. 本期已实现收益	9,320,072.91
2. 本期利润	111,705,756.75
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2229
4. 期末基金资产净值	683,842,281.27
5. 期末基金份额净值	1.500

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。

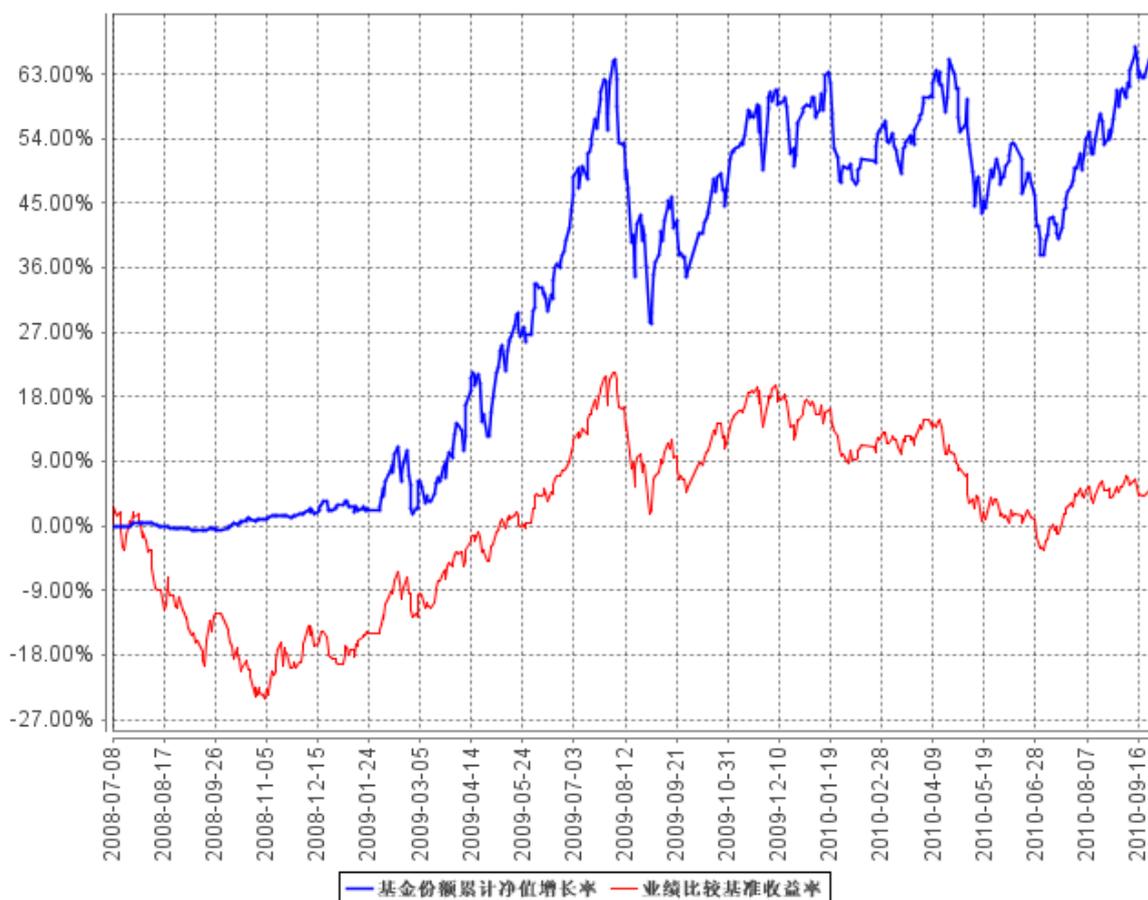
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	17.19%	1.02%	9.04%	0.79%	8.15%	0.23%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2008 年 7 月 8 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		
苏竞	本基金的基金经理、汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理、汇添富均衡增长股	2008 年 7 月 8 日	-	7 年	国籍：中国。学历：上海海事大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任北京中国运载火箭技术研究院助理工程师、上海申银万国证券研究所高级研究员、上投摩根基金管

	票型证券投资基金的基金经理。			理有限公司高级行业研究员、博时基金管理有限公司高级行业研究员。2006 年 9 月加入汇添富基金管理有限公司，任高级行业分析师，2007 年 3 月 6 日至 2007 年 10 月 7 日任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理助理，2007 年 10 月 8 日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理，2007 年 12 月 17 日至今任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，2008 年 7 月 8 日至今任汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	----------------	--	--	--

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

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易机制，涵盖了各投资组合、各投资市场、各投资

标的，贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程，并通过分析报告、监控、稽核保证制度流程的有效执行。

#### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为混合型基金，股票投资对象主要是“价值相对低估的蓝筹公司股票”，与本基金管理人旗下其他基金投资组合风格不同。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司公平交易制度执行情况良好，未发生任何异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，在预期经济回稳和流动性情况好转的共同作用下，前期表现一直低迷的周期性大盘股 7 月率先反弹，后续创业板虽然由于解禁压力逐渐临近整体继续调整，但内需消费、调结构相关的成长股以及中小板和资产重组类个股轮番表现，市场风险偏好和人气显著回升。在季度末，随着美元汇率大幅走低，主要经济体竞相实施宽松的货币政策，通胀预期显著上升，资源、资产成为受市场追捧的新投资主题。

本基金在季度初对市场走势持比较谨慎的态度，坚持以内需消费为组合基本配置，仓位也控制在较低水平，虽然在 7 月周期性大盘股反弹阶段比较被动，但是随着逐步加大对原有组合中优质个股的投资力度，并积极在科技创新、资源等板块寻找新的投资标的，股票仓位也逐渐提升至较高水平，基金净值表现在 8、9 月份有较大程度的改观。总体来看，三季度基金操作基本方向还是与市场走势较为契合，但是季度初股票仓位提升幅度较慢，以及后续在资源、资产这条线上的布局力度有所欠缺是操作中的遗憾。

展望四季度，经济有望进一步回稳，在目前国内外经济和货币政策背景下，流动性宽松的局面将维持，而且国内地产调控以限购为新的主要措施之一，或许也将驱使部分流动性从地产进入资本市场，A 股市场流动性有望进一步宽松，我们对四季度 A 股市场表现持相对乐观的判断，但错综复杂的各种因素交织也会使得市场波动性进一步增大。

我们将围绕内需消费、创新成长、资产资源这几条主线，加大调研和研究力度，积极寻找新的投资标的优化投资组合，在控制组合风险的前提下争取获得较好的基金业绩。

#### 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 17.19%，业绩比较基准收益率为 9.04%，超越比较基准 8.15%。

## § 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	538,895,313.75	78.28
	其中：股票	538,895,313.75	78.28
2	固定收益投资	61,040,000.00	8.87
	其中：债券	61,040,000.00	8.87
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	84,385,790.80	12.26
6	其他资产	4,092,938.06	0.59
7	合计	688,414,042.61	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	19,663,337.08	2.88
B	采掘业	-	-
C	制造业	302,866,495.44	44.29
C0	食品、饮料	87,455,118.86	12.79
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	11,521,209.60	1.68
C4	石油、化学、塑胶、塑料	17,945,230.20	2.62
C5	电子	39,670,890.02	5.80
C6	金属、非金属	15,800,000.00	2.31
C7	机械、设备、仪表	35,671,978.90	5.22
C8	医药、生物制品	86,192,067.86	12.60
C99	其他制造业	8,610,000.00	1.26
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	38,784,000.00	5.67
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	65,434,192.27	9.57
H	批发和零售贸易	89,859,653.96	13.14
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	7,790,000.00	1.14

K	社会服务业	6,687,635.00	0.98
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	7,810,000.00	1.14
	合计	538,895,313.75	78.80

### 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	002081	金螳螂	800,000	38,784,000.00	5.67
2	000669	领先科技	1,000,049	29,231,432.27	4.27
3	000858	五粮液	750,058	25,749,491.14	3.77
4	002007	华兰生物	500,000	25,500,000.00	3.73
5	600280	南京中商	800,044	25,273,389.96	3.70
6	000501	鄂武商A	1,000,012	22,000,264.00	3.22
7	600261	浙江阳光	750,071	19,966,890.02	2.92
8	600354	敦煌种业	700,012	19,663,337.08	2.88
9	600327	大厦股份	1,500,000	19,260,000.00	2.82
10	600079	人福医药	700,003	15,834,067.86	2.32

### 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	39,988,000.00	5.85
	其中：政策性金融债	39,988,000.00	5.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	21,052,000.00	3.08
7	其他	-	-
8	合计	61,040,000.00	8.93

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	090223	09 国开 23	400,000	39,988,000.00	5.85
2	113001	中行转债	200,000	21,052,000.00	3.08

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.8 投资组合报告附注

**5.8.1** 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期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、处罚的情形。

**5.8.2** 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。

#### 5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	986,138.14
2	应收证券清算款	2,157,486.00
3	应收股利	-
4	应收利息	714,325.77
5	应收申购款	234,988.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,092,938.06

#### 5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未有流通受限股票。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	475,562,194.44
本报告期基金总申购份额	54,183,354.84
减：本报告期基金总赎回份额	73,801,128.51
本报告期期末基金份额总额	455,944,420.77

## § 7 备查文件目录

### 7.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富蓝筹稳健灵活配置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、报告期内汇添富蓝筹稳健灵活配置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。

### 7.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理有限公司

### 7.3 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](http://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。

汇添富基金管理有限公司  
2010 年 10 月 27 日