

# 汇添富美丽 30 股票型证券投资基金 2014 年第 3 季度报告

2014 年 9 月 30 日

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：2014 年 10 月 24 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 2014 年 12 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 2014 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	汇添富美丽 30 股票
交易代码	000173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 6 月 25 日
报告期末基金份额总额	1,727,286,281.99 份
投资目标	本基金通过精选个股和集中投资，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金为股票型基金。股票投资的主要策略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拥有优秀管理层、盈利能力高于行业平均水平、增长可持续且估值水平相对合理的优质上市公司，辅以严格的风险管理，以获得中长期的较高投资收益。投资策略的重点是个股精选策略。
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（2014 年 7 月 1 日 — 2014 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	78,126,084.97
2. 本期利润	282,708,491.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1517
4. 期末基金资产净值	2,326,206,316.97
5. 期末基金份额净值	1.347

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。

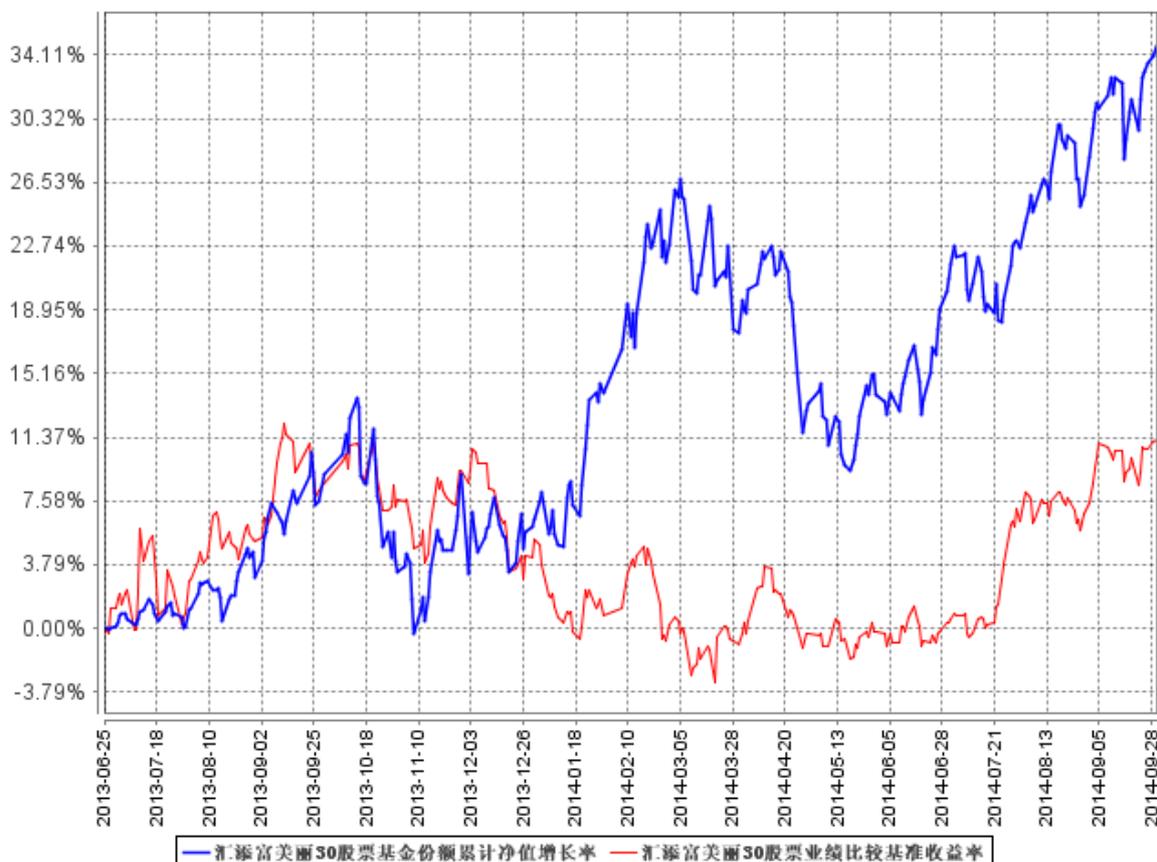
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	12.25%	1.00%	10.87%	0.72%	1.38%	0.28%

### 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

汇添富美丽30股票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（2013年6月25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		
王栩	汇添富优势精选混合基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富美丽30股票	2013年6月25日	-	12年	国籍：中国。学历：同济大学管理学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任上海永嘉投资管理有限公司研究员。2004年11月加入汇添富基

	基金的基金经理。			金管理股份有限公司任高级行业研究员，2009 年 11 月 30 日至 2010 年 2 月 4 日任汇添富优势精选混合基金的基金经理助理，2010 年 2 月 5 日至今任汇添富优势精选混合基金的基金经理，2010 年 9 月 21 日至 2013 年 5 月 10 日任汇添富医药保健股票基金的基金经理，2012 年 7 月 10 日至今任汇添富理财 14 天债券基金的基金经理，2013 年 6 月 25 日至今任汇添富美丽 30 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合规守信情况的说明

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

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》，公司制定了同日反向交易控制的规则，同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易分析。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，由于专户到期清盘导致。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

2014 年三季度国内经济出现加速下滑的迹象，房地产行业的衰退带动多项经济指标创下本轮经济调整以来的新低。与之相对应的是，央行加大了货币放松的力度，主要政策措施包括向国开行发放了 1 万亿元的三年期抵押补充贷款（PSL），对房地产信贷的态度由抑制转为积极支持。虽然适度宽松的货币政策无法阻止宏观经济的下滑趋势，但对于稳定投资者信心无疑是有帮助的。而且随着无风险利率的持续下降，居民逐渐加大在股票市场的资产配置力度，推动 A 股市场在三季度大幅上涨，传统企业转型、资产并购是市场最重要的投资主题。三季度沪深 300 上涨 13.20%，中小板指数上涨 25.25%，创业板指数上涨 9.69%。分行业来看，国防军工、纺织服装、钢铁、农林牧渔、交通运输等行业涨幅居前，而金融、传媒、家用电器、食品饮料、医药生物等行业的表现相对较差。

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。股票资产比例较二季度末大幅上升，从 83.4% 上升至 93.3%。行业配置方面，主要增持了互联网、交运设备、券商、教育等行业，主要减持了食品饮料、家用电器等行业。个股投资上重点增持了在商业模式创新中具备突出竞争力的优质个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年三季度本基金的收益率为 12.25%，比业绩比较基准高 1.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，本基金的观点如下。第一，国内货币政策转向宽松的大趋势已经确立，市场无风险利率在未来一、两年仍将持续下降，推动居民的资产配置向股票市场转移，这是 A 股市场最大的支撑力量。第二，尽管宏观经济在加速下滑，但目前的市场仍然存在比较清晰的投资机会。自上而下来看，本届政府执行力非常强，政府主导的结构转型使得部分行业出现爆发式增长，例如新能源汽车、光伏、环保等。自下而上来看，互联网与传统产业的融合在国内渐入佳境，形成了非常好的长期投资机遇，例如家居、金融、医疗、汽车服务等行业。另外，大多数蓝筹股目前处于非常低的估值水平，无论是周期性行业还是稳定成长行业，这对市场整体而言也是一个重要支撑。第三，四季度市场存在阶段性调整的压力，波动幅度可能会加大，可预见的负面冲击将来自两个方面。一是，美联储正在逐步收缩极度宽松的货币政策，美元走强已经对全球的风险资产价格产生负面影响，这无疑不利于 A 股市场的风险偏好上升，尤其是海外资金通过沪港通流入 A 股的预期可能会阶段性落空。二是，今年绝大多数 A 股投资者都获得了较好的收益，临近年末部分机构投资者可能会减仓止盈。

本基金在四季度重点关注以下方面的投资机会。第一，长期受益于人口老龄化的医疗服务行业；第二，能够成功与互联网融合的传统行业，例如家居、金融、汽车服务等；第三，政府强力推动的行业，例如新能源汽车、环保；第四，国企改革的相关机会。

## § 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	2,169,164,842.10	90.41
	其中：股票	2,169,164,842.10	90.41
2	固定收益投资	70,053,000.00	2.92
	其中：债券	70,053,000.00	2.92
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	99,528,253.88	4.15
7	其他资产	60,560,851.19	2.52
8	合计	2,399,306,947.17	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	-	-
B	采矿业	15,610,000.00	0.67
C	制造业	1,042,710,349.50	44.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	116,902,567.56	5.03
F	批发和零售业	260,050,525.35	11.18
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	252,078,101.13	10.84
J	金融业	83,749,213.50	3.60
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	17,737,496.00	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	81,038,320.60	3.48
Q	卫生和社会工作	39,919,637.50	1.72
R	文化、体育和娱乐业	259,368,630.96	11.15
S	综合	-	-
	合计	2,169,164,842.10	93.25

## 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	002390	信邦制药	6,800,000	155,380,000.00	6.68
2	300144	宋城演艺	4,716,668	125,935,035.60	5.41
3	300168	万达信息	3,754,654	103,628,450.40	4.45
4	002018	华星化工	8,900,158	95,142,689.02	4.09
5	300059	东方财富	5,756,717	90,322,889.73	3.88
6	002094	青岛金王	5,754,600	86,088,816.00	3.70
7	300291	华录百纳	2,149,804	85,562,199.20	3.68

8	600867	通化东宝	6,000,000	83,820,000.00	3.60
9	000906	物产中拓	5,000,000	82,000,000.00	3.53
10	600661	新南洋	2,883,926	81,038,320.60	3.48

#### 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	70,053,000.00	3.01
	其中：政策性金融债	70,053,000.00	3.01
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	70,053,000.00	3.01

#### 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	140444	14 农发 44	300,000	30,033,000.00	1.29
2	140204	14 国开 04	200,000	20,048,000.00	0.86
3	140213	14 国开 13	200,000	19,972,000.00	0.86

#### 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。

#### 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投资。

#### 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

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

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：报告期末本基金无国债期货持仓。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

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	1,037,453.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,074,763.20
5	应收申购款	58,448,634.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,560,851.19

### 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

注：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

报告期期初基金份额总额	1,942,731,321.64
报告期期间基金总申购份额	1,724,589,866.51
减：报告期期间基金总赎回份额	1,940,034,906.16
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	1,727,286,281.99

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 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美丽 30 股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富美丽 30 股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富美丽 30 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、报告期内汇添富美丽 30 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](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。

汇添富基金管理股份有限公司  
2014 年 10 月 24 日