

汇添富美丽 30 股票型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告

2014 年 12 月 31 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：2015 年 1 月 22 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 2015 年 1 月 20 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 10 月 1 日起至 12 月 31 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	2,113,588,292.42 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 10 月 1 日 — 2014 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	129,188,565.11
2. 本期利润	222,289,347.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1217
4. 期末基金资产净值	3,075,326,422.45
5. 期末基金份额净值	1.455

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。

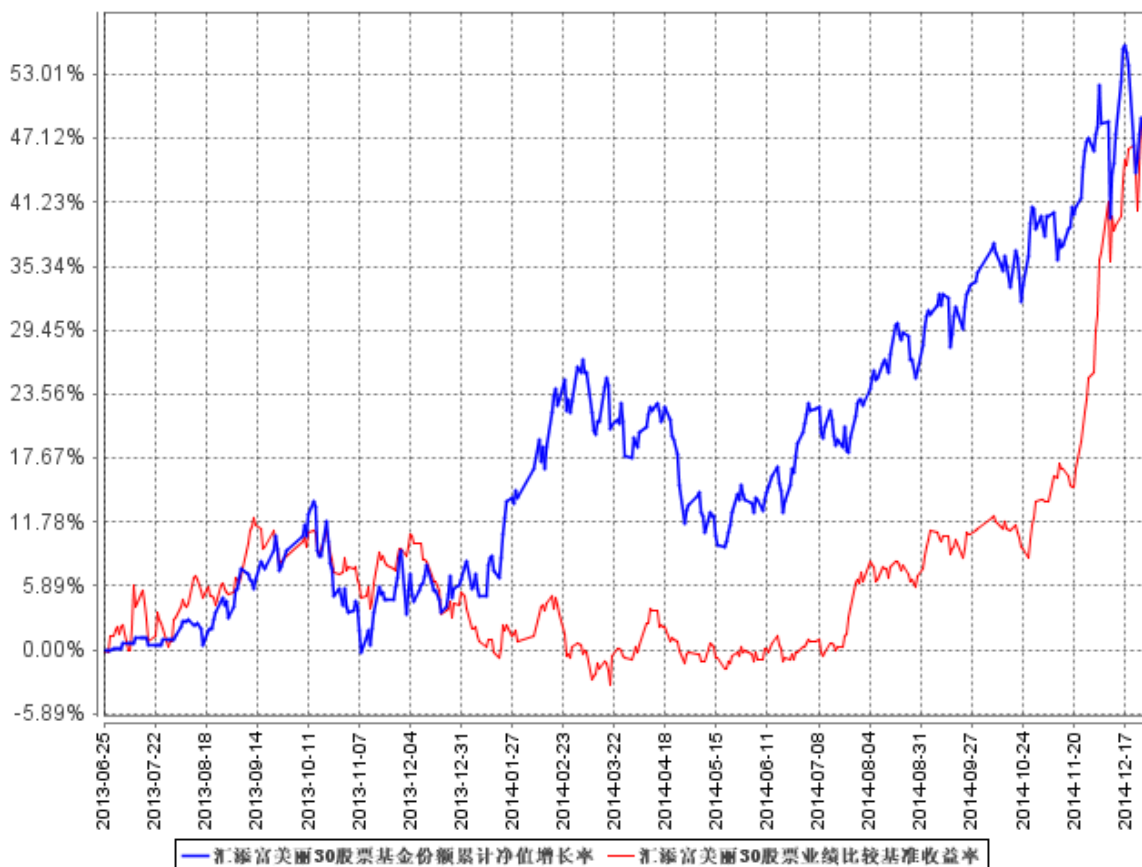
3.2 基金净值表现

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	8.02%	1.69%	35.99%	1.32%	-27.97%	0.37%

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， 股票投资 副总监。				金管理股份有限公司，先后任固定收益分析师和高级行业研究员，现任股票投资副总监。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

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，是由于投资流动性的需求导致。

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 年四季度国内经济延续了今年以来的弱势，房地产以及基建投资的下滑使得总需求持续低迷。政府在四季度也加大了政策刺激的力度。货币政策方面，11 月 21 日人民银行宣布将一年期存、贷款利率分别下调 0.25、0.4 个百分点，这是 2012 年 7 月以来的首次降息，也意味着货币政策放松进入加速阶段。行业政策方面，地方性的房地产政策放松获得许可，刺激了房地产销售在年末有所反弹。尽管这些政策措施对于经济整体的作用仍然需要时间验证，但降息加速了居民增加股票资产配置的过程，推动 A 股市场在四季度大幅上涨并创出 2010 年以来的新高，非银金融和“一路一带”是市场最重要的投资主题，而过去两年表现优异的成长股则遭到抛弃。四季度沪深 300 上涨 44.17%，中小板指数下跌 2.56%，创业板指数下跌 4.49%。分行业来看，非银金融、建筑装饰、银行、黑色金属、房地产等行业涨幅居前，而电子、轻工制造、休闲服务、医药生物、电力设备等行业则逆市下跌。

本基金在四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。股票资产比例较三季度末小幅上升，从 90.4% 上升至 94.5%。行业配置方面，主要增持了商业贸易、房地产、信息服务、金融等行业，主要减持了医药生物、食品饮料、建筑建材等行业。个股投资上重点增持了商业模式具有很大扩张潜力的优质成长股和部分低估值蓝筹股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年四季度本基金的收益率为 8.02%，比业绩比较基准低 27.97 个百分点。

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 2015 年，本基金的观点如下。第一，2015 年中央政府的政策目标中稳增长的重要性会明显上升，尤其是货币政策正在进入加速放松的阶段，央行在 2015 年可能会多次降息、降准，这会继续推动居民增加股票资产的配置。第二，尽管国内经济整体在 2015 年可能仍然会比较疲弱，但经过两年的结构转型之后部分行业、领域的经济效率有明显提升，新的增长亮点也在涌现。首先是互联网与传统产业的融合正在持续深入，在很多领域都会带来非常好的长期投资机遇。其次，部分传统制造业的产能在过去两年显著收缩，行业整体的定价能力增强，在上游资源价格普遍大幅下跌的背景下盈利能力有望大幅提升。最后，过去一年国企改革在部分企业已经收效明显，而在 2015 年的改革关键之年国企改革有望大范围推进，从而提升国有企业整体的经营效率。市场潜在的风险因素主要来自两个方面。首先，IPO 加速、注册制的推出以及新三板快速扩容等因素使得股票供给在 2015 年大幅增加，对部分概念大于实质的所谓成长股会有显著的负面影响。其次，过去两个季度美元指数已经上涨超过 10%，美联储加息可能会加速全球资本从新兴市场国家向美国的流动趋势，对人民币形成贬值压力，对国内整体资产价格形成负面冲击。

本基金在下一阶段重点关注以下方面的投资机会。第一，继续在互联网、医疗服务、新型消费领域寻找长期的优质成长股；第二，在传统制造业中寻找供给格局能够得到显著改善、并且受益于上游资源价格下跌的领域；第三，行业景气度能够平稳甚至向好的低估值蓝筹股；第四，国企改革。

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	2,905,752,967.20	93.34
	其中：股票	2,905,752,967.20	93.34
2	固定收益投资	70,070,000.00	2.25
	其中：债券	70,070,000.00	2.25
	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	112,732,554.48	3.62
7	其他资产	24,552,891.11	0.79
8	合计	3,113,108,412.79	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	69,200,000.00	2.25
C	制造业	892,625,011.57	29.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	66,741,969.00	2.17
F	批发和零售业	301,508,123.64	9.80
G	交通运输、仓储和邮政业	102,316,346.52	3.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	501,105,154.36	16.29
J	金融业	212,462,977.00	6.91
K	房地产业	157,835,989.18	5.13
L	租赁和商务服务业	126,900,000.00	4.13
M	科学研究和技术服务业	72,918,000.00	2.37
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	49,392,982.80	1.61
Q	卫生和社会工作	66,207,602.00	2.15
R	文化、体育和娱乐业	239,919,477.13	7.80
S	综合	46,619,334.00	1.52
	合计	2,905,752,967.20	94.49

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	002018	华信国际	18,471,488	261,556,270.08	8.50
2	300168	万达信息	5,000,000	231,000,000.00	7.51
3	300059	东方财富	7,465,522	208,735,995.12	6.79
4	601318	中国平安	1,939,100	144,870,161.00	4.71
5	600415	小商品城	10,000,000	126,900,000.00	4.13

6	300144	宋城演艺	3,606,704	108,633,924.48	3.53
7	000625	长安汽车	6,584,664	108,186,029.52	3.52
8	000024	招商地产	3,600,000	95,004,000.00	3.09
9	300291	华录百纳	2,743,379	83,261,552.65	2.71
10	002390	信邦制药	4,000,000	80,880,000.00	2.63

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	70,070,000.00	2.28
	其中：政策性金融债	70,070,000.00	2.28
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	70,070,000.00	2.28

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	30,066,000.00	0.98
2	140204	14 国开 04	200,000	20,004,000.00	0.65
3	140213	14 国开 13	200,000	20,000,000.00	0.65

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	1,246,010.20
2	应收证券清算款	7,879,608.40
3	应收股利	-
4	应收利息	1,879,937.63
5	应收申购款	13,547,334.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,552,891.11

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	300168	万达信息	231,000,000.00	7.51	重大事项停牌
2	300144	宋城演艺	108,633,924.48	3.53	重大资产重组停牌
3	002018	华信国际	261,556,270.08	8.50	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	1,727,286,281.99
报告期期间基金总申购份额	2,509,993,654.06
减：报告期期间基金总赎回份额	2,123,691,643.63
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	2,113,588,292.42

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 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
2015 年 1 月 22 日