

汇添富美丽 30 股票型证券投资基金 2015 年第 2 季度报告

2015 年 6 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：2015 年 7 月 18 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 7 月 15 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 2015 年 4 月 1 日起至 6 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	1,857,561,293.70 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 $\times$ 80% + 中证全债指数收益率 $\times$ 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（ 2015 年 4 月 1 日 — 2015 年 6 月 30 日 ）
1. 本期已实现收益	2,133,274,470.77
2. 本期利润	2,157,215,384.66
3. 加权平均基金份额本期利润	0.7892
4. 期末基金资产净值	5,146,182,019.67
5. 期末基金份额净值	2.770

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。

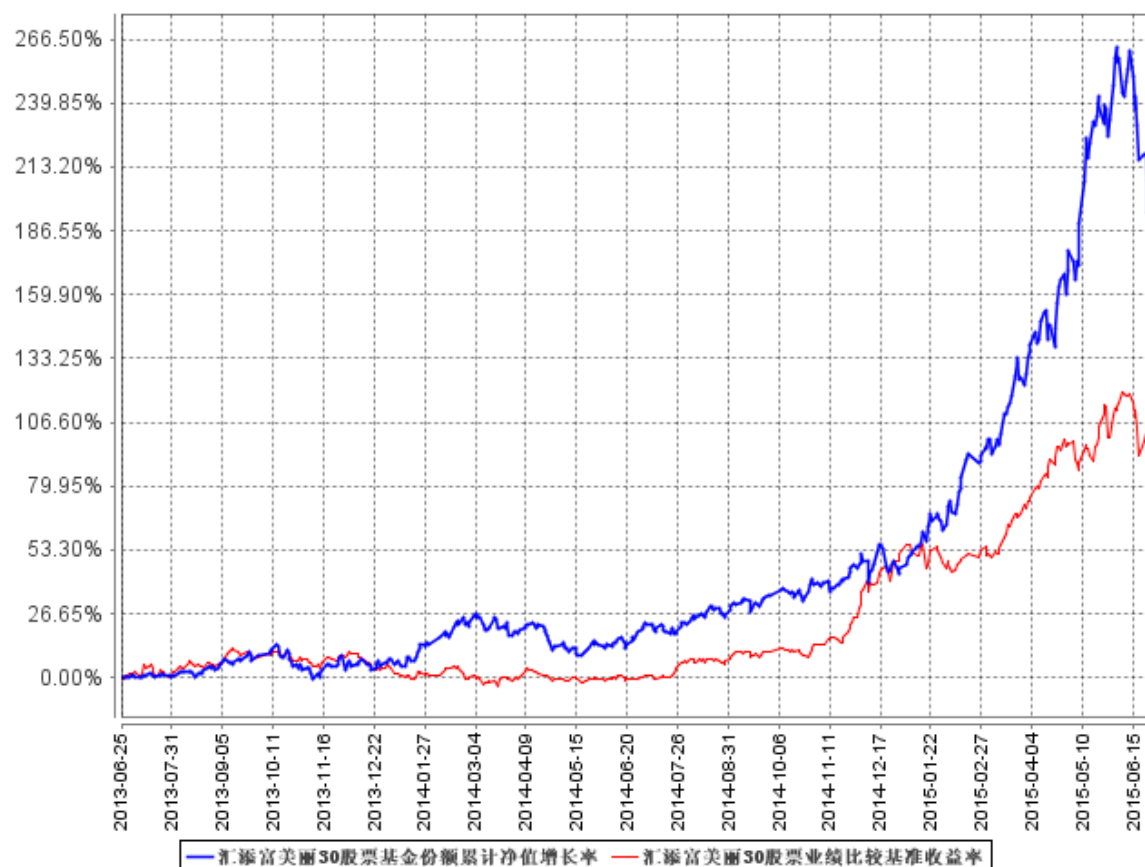
3.2 基金净值表现

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	22.13%	2.79%	8.77%	2.09%	13.36%	0.70%

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、汇添富美丽30股票基金的基金经理，股票投资	2013年6月25日	—	13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

	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 2015 年 3 月 31 日任汇添富理财 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

2015 年二季度国内经济延续低迷趋势，多项经济数据创下 2008 年金融危机以来的最低点。政府宏观调控的主要工具依然是货币政策，人民银行在二季度两次下调了基准存贷款利率以及存款准备金率。财政政策方面，中央政府略微加大了基建投资的力度，但对于总需求的刺激作用并不明显。A 股市场二季度总体上延续了一季度的涨势，但在 6 月中旬开始大幅下跌。居民提高股票资产配置是市场上涨的主要推动力，沪深两市融资融券余额从一季度末 1.5 万亿增加至 2 万亿，周新增开户数一度超过 400 万户。二季度沪深 300 上涨 10.41%，中小板指数上涨 15.32%，创业板指数上涨 22.42%。分行业来看，轻工制造、国防军工、交通运输、纺织服装、综合以及公用事业等行业表现较好，涨幅都超过 30%，非银金融逆市下跌，银行、有色、建筑装饰、建筑材料等行业的表现也相对较差。

本基金在二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。股票资产比例较一季度末小幅上升，从 90.0% 上升至 92.8%。行业配置方面，主要增持了医药生物、交运设备、商业、环保等行业，主要减持了 TMT、非银金融、军工等行业。个股投资上重点增持了盈利模式清晰、行业地位突出、具备扩张潜力的优质成长股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年二季度本基金的收益率为 22.13%，比业绩比较基准高 13.36 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

展望下半年，本基金认为在前期的大幅波动之后市场可能进入一个平稳期。第一，货币政策方面依然较大的放松空间，这对于国内的资产价格是一个重要支撑。第二，在经历暴涨暴跌的风险教育之后，投资者对于新经济方向的预期会更加现实，对于交易杠杆的使用也会更加谨慎，从而会改变上半年过于偏向中小盘成长股的市场风格。第三，在最近的下落之后，大部分价值股以及部分成长股的估值已经回落到相对合理的水平，考虑未来货币政策的放松空间，市场总体估值水平可望获得支撑。市场的风险因素主要来自于：在上半年的上涨行情中，投资者对于并购转型的公司寄予非常乐观的预期，而其中大部分公司的商业模式、管理能力并未经过时间验证，在市场整体预期发生变化之后这类公司的估值泡沫会遭受挤压。

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、新型消费领域寻找商业模式清晰、管理层优秀的优质成长股；第二，前期市场的大幅下跌使得部分稳定成长类型公司的估值水平已经非常有吸引力；第三，传统行业中估值水平低、质地可靠的蓝筹股。

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	4,773,074,626.04	88.33
	其中：股票	4,773,074,626.04	88.33
2	固定收益投资	30,105,000.00	0.56
	其中：债券	30,105,000.00	0.56
	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	302,536,528.10	5.60
7	其他资产	297,965,449.34	5.51
8	合计	5,403,681,603.48	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	-	-
C	制造业	2,059,515,808.08	40.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,100,000.00	0.25
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	590,610,052.45	11.48
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	1,474,236,261.35	28.65
J	金融业	-	-
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	150,746,000.00	2.93
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	44,889,000.00	0.87
Q	卫生和社会工作	129,913,848.46	2.52
R	文化、体育和娱乐业	310,063,655.70	6.03
S	综合	-	-
	合计	4,773,074,626.04	92.75

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	19,000,000	624,340,000.00	12.13
2	002044	江苏三友	9,391,500	516,532,500.00	10.04
3	300359	全通教育	3,850,000	482,289,500.00	9.37
4	300377	赢时胜	1,777,800	333,817,506.00	6.49
5	300168	万达信息	6,251,600	307,078,592.00	5.97
6	002466	天齐锂业	4,350,000	268,830,000.00	5.22
7	600180	瑞茂通	8,000,000	229,280,000.00	4.46
8	002095	生意宝	3,467,580	221,543,686.20	4.31
9	002589	瑞康医药	1,926,389	180,791,607.65	3.51
10	002640	跨境通	2,599,920	180,538,444.80	3.51

注：本基金持有的华信国际、江苏三友处于停牌状态，受基金净值波动影响，华信国际、江苏三友占基金资产净值比均被动超过 10%，本基金管理人将在该股票复牌后，按照法律法规及基金合同的相关规定及时做出调整。

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	30,105,000.00	0.58
	其中：政策性金融债	30,105,000.00	0.58
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	30,105,000.00	0.58

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	30,105,000.00	0.58

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	2,248,159.23
2	应收证券清算款	273,520,792.90
3	应收股利	—
4	应收利息	1,205,119.59
5	应收申购款	20,991,377.62
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	297,965,449.34

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	002018	华信国际	624,340,000.00	12.13	重大资产重组停牌
2	002044	江苏三友	516,532,500.00	10.04	重大资产重组停牌

3	300377	赢时胜	333,817,506.00	6.49	重大事项停牌
4	002589	瑞康医药	180,791,607.65	3.51	非公开发行停牌

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,835,066,644.96
报告期期间基金总申购份额	3,541,274,201.35
减:报告期期间基金总赎回份额	4,518,779,552.61
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	1,857,561,293.70

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 7 月 18 日