

汇添富恒生指数分级证券投资基金2016年 第3季度报告

2016年09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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2016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2016年10月21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2016年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富恒生指数分级(QDII)
交易代码	164705
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年03月06日
报告期末基金份额总额	1,394,995,842.61份
投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资

业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额；积极收益类的恒生B份		
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		
下属分级基金的基金简称	恒生A	恒生B	添富恒生
下属分级基金的场内简称	添富恒生A	添富恒生B	添富恒生
下属分级基金的交易代码	150169	150170	164705
报告期末下属分级基金的份额总额	630,481,808.00份	630,481,808.00份	134,032,226.61份

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.
	中文	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼
邮政编码		-

注：本基金无境外投资顾问。

§ 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(2016年07月01日 - 2016年09月30日)
1. 本期已实现收益	77,401,133.22
2. 本期利润	174,305,720.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1153

4. 期末基金资产净值	1,433,494,495.13
5. 期末基金份额净值	1.028

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	11.98%	0.92%	12.20%	0.91%	-0.22%	0.01%

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6月25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	离		

		职 日 期	任 日 期	限	
赖 中 立	汇添富黄金及贵金属基金(LOF)的基金经理、汇添富恒生指数分级(QDII)基金、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富香港优势精选混合基金的基金经理。	20 14 - 03 - 06		9 年	国籍：中国，学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属基金(LOF)的基金经理，2014年3月6日至今任汇添富恒生指数分级(QDII)基金的基金经理，2015年1月6日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理，2015年5月26日至2016年7月13日任汇添富香港优势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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾16年三季度，香港市场迎来了较为可观的一轮上涨行情，海内外投资者对港股的关注日益提升。本轮上涨的驱动因素主要来自于以下两个方面：首先，经历了此前市场的下跌，香港市场整体估值已经非常便宜，风险也得到了充分释放，其投资价值在全球范围内较为突出；其次，深港通稳步推进给予市场情绪较大催化，市场预期在未来两地互联互通的新环境下，香港市场将大大受到青睐。报告期内，本基金按照基金合同，按照完全复制法进行恒生指数成份股指数化投资，严控基金跟踪误差，以期给投资者带来与恒生指数一致的收益。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金净值上涨11.98%，业绩比较基准上涨12.00%，超额收益为-0.22%。

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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,025,962,258.30	71.29
	其中：普通股	1,025,962,258.30	71.29
	优先股	-	0.00
	存托凭证	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中：远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	389,262,101.78	27.05
8	其他资产	23,960,272.52	1.66
9	合计	1,439,184,632.60	100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为418,546,423.96人民币，占期末净值比例29.20%。

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
香港	1,025,962,258.30	71.57
合计	1,025,962,258.30	71.57

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	67,163,598.16	4.69

20 工业	36,179,069.04	2.52
25 非必需消费品	28,442,126.73	1.98
30 必需消费品	16,305,480.35	1.14
40 金融	613,948,112.55	42.83
45 信息技术	118,365,875.79	8.26
50 电信服务	85,960,760.12	6.00
55 公用事业	59,597,235.56	4.16
合计	1,025,962,258.30	71.57

5.4

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及存托凭证投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在证券 市场	所属 国家 (地区)	数量 (股)	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值 比例 (%)
1	TENCENT HOLDING S LTD	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	香港	575,300	105,502,316.74	7.36
2	HSBC HOLDING S PLC	汇丰控股	5 HK	香港联合交易所	香港	2,096,400	103,152,178.59	7.20
3	AIA GROUP LTD	友邦保险	1299 HK	香港联合交易所	香港	1,902,800	84,451,979.06	5.89
4	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香港联合交易所	香港	970,000	78,377,973.47	5.47
5	CHINA CONSTRUCTION B	建设银行	939 HK	香港联合交易所	香港	15,186,000	75,179,469.92	5.24
6	IND & COMM BK OF CHI	工商银行	1398 HK	香港联合交易所	香港	11,650,000	48,646,957.42	3.39
7	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	3988 HK	香港联合交易所	香港	12,545,000	38,235,075.03	2.67
8	CHEUNG KONG HOLDING S	长和	1 HK	香港联合交易所	香港	426,848	36,235,827.61	2.53
9	HONG	香港	388	香港联合	香港	182,6	32,040,034.	2.24

	KONG EXCHAN GES	交易 所	HK	交易所		00	27	
1 0	PING AN INSURAN CE GR	中国 平安	2318 HK	香港联合 交易所	香港	823,5 00	28,502,153. 56	1.99

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8

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金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值（人民币元）	占基金资产净值 比例（%）
1	期货品种_股指	HSI1610	321,148,697.76	22.40

5.9 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基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	19,657,667.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,674,442.30
4	应收利息	40,448.44
5	应收申购款	1,587,714.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,960,272.52

5.10.4 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。

5.10.5 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存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	恒生A	恒生B	添富恒生
报告期期初基金份额总额	774,686,037.00	774,686,037.00	400,318,020.30
报告期期间基金总申购份额	-	-	274,307,274.73
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-	829,001,526.42
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	144,204,229.00	144,204,229.00	288,408,458.00
报告期期末基金份额总额	630,481,808.00	630,481,808.00	134,032,226.61

注：总申购份额含红利再投份额。

§ 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恒生指数分级证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富恒生指数分级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、报告期内汇添富恒生指数分级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

2016年10月25日