

汇添富香港优势精选混合型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	汇添富香港优势精选混合(QDII)
交易代码	470888
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年06月25日
报告期末基金份额总额	159,110,327.62份
投资目标	在香港证券市场精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的公司股票等证券，通过有效的资产配置和组合管理，进行中长期投资布局，在有效管理风险的前提下，追求持续稳健的较高投资回报。
投资策略	本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出具有持续竞争优势，且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。
业绩	MSCI中华指数（MSCI;ZhongHua;Index）。

比较基准	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。
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

注：

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	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		NY 10005

§ 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	7,949,042.67
2. 本期利润	13,085,417.07
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0880
4. 期末基金资产净值	157,466,164.23
5. 期末基金份额净值	0.990

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	10.00%	0.75%	16.30%	0.89%	6.30%	0.14%

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：本基金建仓期为自《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

4.1.1 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
		任期日期	离任日期		
棘中立	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)	2015-06-01	2016-07-06	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。

基金、 汇添富 深证30 OETF基 金、汇 添富深 证300E TF联接 基金、 汇添富 香港优 势精选 混合基 金的基 金经理 。				
汇添富 香港优 势精选 混合基 金的基 金经理 。	2 0 1 5 - 1 0 - 2 7	1 3 年		国籍：中国，学历：美国哥伦比亚大学公共管理硕士，清华大学工程硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任中国银河证券有限责任公司投资银行总部、股票发行部业务经理，中信证券国际资产管理（香港）有限公司投资分析员，五矿资本（香港）有限公司投资组合经理。2015年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，2015年10月27日起任汇添富香港优势精选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遵规守信情况说明

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

2016年三季度，香港市场迎来了一个强劲的单边上漲，也符合我们之前较为乐观的预期。恒生指数在2016年6月底为20794点，9月底为23297点，涨幅为12.0%，区间振幅为20.0%。7月，市场出现明显的资金流入的迹象，推动市场在中下旬出现较好涨幅，本月本基金提升了整体股票的仓位，主要配置在符合政策方向、并预期可以有较好半年业绩的环保、电子产品、及轨道交通等行业；8月，市场继续强劲的表现，由于人民币贬值的预期升温，通过沪港通机制南下的资金越来越踊跃，推动港股尤其是蓝筹权重股有较好的表现。本月本基金也增加了大盘蓝筹股的权重，并兑现了一些半年度业绩超预期导致涨幅较大、估值较充分的持仓；9月，市场在月初进一步冲高，在突破24000点后回调，并在23000~24000点一线震荡整理，本月本基金对行业配置进行了一些调整，更多的配置到一些受益于深港通开通的个股，以及一些前期涨幅不大，估值更有安全边际的中小市值成长股，尤其是一些深港通的潜在标的，预期在未来正式开通之前能有超过市场的表现。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金三季度上涨10.0%，同期基准上涨16.3%，超额收益为-6.3%。

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	138,137,212.41	86.33
	其中：普通股	138,137,212.41	86.33
	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	21,326,300.23	13.33
8	其他资产	553,629.06	0.35
9	合计	160,017,141.70	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85,865,054.7人民币，占期末净值比例54.53%。

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	138,137,212.41	87.73
合计	138,137,212.41	87.72

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

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	1,485,173.25	0.94
20 工业	9,658,189.27	6.13
25 非必需消费品	23,979,392.05	15.23
30 必需消费品	4,463,268.48	2.83
35 医疗保健	11,807,342.58	7.50
40 金融	22,835,765.61	14.50
45 信息技术	29,945,828.06	19.02
50 电信服务	4,040,101.73	2.57
55 公用事业	2,608,739.10	1.66
合计	110,823,800.13	70.38

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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 HOLDINGS LTD	腾讯控股	00700 HG	沪港通联合市场	香港	70,000	12,837,062.70	8.15
2	GUANGZHOU AUTO	广汽集团	2238 HK	香港联合交易所	香港	800,000	6,867,096.72	4.36
3	AIA GROUP	友邦保险	01299 HG	沪港通联合市场	香港	150,000	6,657,450.53	4.23
4	CHINA RAILWAY SIGNAL&COM	中国通号	03969 HG	沪港通联合市场	香港	1,300,000	6,514,099.02	4.14
5	SINOPHARM GROUP CO	国药控股	01099 HG	沪港通联合市场	香港	200,000	6,414,226.50	4.07
6	HONG KONG EXCHANGE&CLEAR	香港交易所	00388 HG	沪港通联合市场	香港	36,000	6,316,764.70	4.01
7	CHINA MINSHENG BANK	民生银行	1988 HK	香港联合交易所	香港	800,000	6,157,657.44	3.91
8	China Software International Ltd	中国软件国际(香港)	354 HK	香港联合交易所	香港	2,000,000	6,147,325.80	3.90
9	BEIJING RIVER WATER GROUP	北控水务集团	00371 HG	沪港通联合市场	香港	1,300,000	5,864,927.64	3.72
10	NETDRAGON WEBOFT	网龙网络	777 HK	香港联合交易所	香港	250,000	5,800,785.38	3.68

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

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	229,430.94
4	应收利息	3,963.59
5	应收申购款	320,234.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	553,629.06

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不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	133,594,226.40
报告期期间基金总申购份额	36,729,197.99

减:报告期期间基金总赎回份额	11,213,096.77
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	159,110,327.62

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香港优势精选混合型证券投资基金募集的文件。
- 2、《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富香港优势精选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、报告期内汇添富香港优势精选混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;
- 6、《关于汇添富香港优势精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》
- 7、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