浦银安盛价值成长股票型证券投资基金

【2015】第一季度报告

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
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4月21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4月17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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛价值成长股票
场内简称	–
基金主代码	519110
交易代码	519110
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年4月16日
报告期末基金份额总额	2,419,165,825.06份
投资目标	以追求长期资本增值为目的,通过投资于被市场低估的具有价值属性或可预期的具有持续成长属性的股票,在充分控制风险的前提下,分享中国经济快速增长的成果,进而实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资策略,在投资策略上充分体现"价值"和"成长"的主导思想。在基本面分析的基础上,结合深入的实地调研和估值研究,对于符合本基金理念的标的股票进行精选投资。 "价值"是指甄别公司的核心价值,通过自下而上的研究,以基本面研究为核心,力求卓有远见地挖掘出被市场忽视的价值低估型公司。价值因素主要表现在相对市场股价比较高的自由现金流、比较高的每股收益和净资产。 "成长"主要表现在可持续性、可预见性的增长。寻找成长型公司重点在于对公司成长性的客观评价和比较上,不仅仅需要关注成长的数量,同时还要关注成长的质量,希望上市公司的成长能给上市公司股东带来实际收益的增长,而非简单粗放的规模增长。此外我们还要关注上市公司成长的可持续性和可预见性。
业绩比较基准	沪深300指数×75%+中信标普国债指数×25%。
风险收益特征	本基金为主动操作的股票型证券投资基金,坚持长期和基于基本面研究的投资理念,属于证券投资基金中的高收益、高风险品种。一般情形下,其风险和收益均高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金资产的安全和增值。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
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

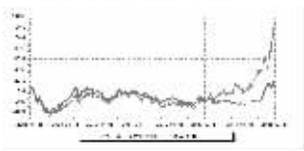
主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	114,379,691.06
2.本期利润	1,781,722,764.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.9150
4.期末基金资产净值	5,482,518,272.50
5.期末基金份额净值	2.266

注:1、上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。
2、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。
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
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	64.49%	1.93%	11.16%	1.37%	53.33%	0.56%

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

浦银安盛价值成长股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2008年4月16日-2015年3月31日)



§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		
蒋建伟	公司旗下浦银安盛价值成长股票基金、浦银安盛新经济结构混合基金以及浦银安盛增长动力混合基金基金经理	2010年7月21日	-	14	蒋建伟先生,毕业于上海财经大学。2001年至2007年就职于上海东新国际投资管理有限公司担任研究员、投资经理助理。2007年加盟浦银安盛基金管理有限公司先后担任行业研究员,股票基金经理助理。2010年7月起,担任浦银安盛价值成长股票基金基金经理。2012年6月至2013年9月兼任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年5月起兼任浦银安盛新经济结构混合基金基金经理。2015年3月起兼任浦银安盛增长动力混合基金基金经理。

注:1、此处的"任职日期"指公司决定确定的聘任日期。
2、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遵规守信情况的说明
本报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。
4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立并健全了有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个基金组合。
在具体执行中,在投资决策流程上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的提供研究支持。同时,在投资决策过程中,严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度,保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制;在交易执行环节上,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定,以保证投资执行交易过程的公平性;从事后监控角度上,一方面是定期对股票交易情况进行分析,对不同时间窗口(同日、3日、5日和10日)发生的不同组合对同一股票的同向交易及反向交易进行价差分析,并进行统计显著性的检验,以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度;同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析;另一方面是公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查,并对发现的问题进行及时的报告。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件中认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下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成交量的5%的情形。
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
今年1季度,市场延续了去年年底的趋势,继续上涨。在结构上,以创业板为代表的成长股一扫去年12月份的阴霾,加速上涨,上涨幅度达到了57.8%,而同期沪深300上涨14.6%。其中表现较好的板块有互联网金融、计算机、大数据、在线教育、智慧城市等。市场进入轮动上涨的节奏,资金开始持续流入股市。
本基金1季度加大了成长股的配置,收到了较好的效果。
4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内业绩比较基准上涨11.16%,基金净值上涨64.49%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形;
2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§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	5,072,220,654.54	87.61
	其中:股票	5,072,220,654.54	87.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	519,437,519.79	8.97
8	其他资产	197,993,755.89	3.42
9	合计	5,789,651,930.22	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	138,780,706.50	2.53
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,845,643,807.75	33.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	794,768.86	0.01
E	建筑业	288,600.92	0.01
F	批发和零售业	299,652,575.95	5.47
G	交通运输、仓储和邮政业	61,572.14	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,004,720,652.59	36.57
J	金融业	79,373,431.80	1.45
K	房地产业	205,218,142.28	3.74
L	租赁和商务服务业	161,182,180.98	2.94
M	科学研究和技术服务业	9,504,000.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	68,097,419.69	1.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	257,980,114.56	4.71
S	综合	922,680.52	0.02
	合计	5,072,220,654.54	92.52

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	300085	银之杰	2,390,420	322,443,753.80	5.88
2	300033	同花顺	2,279,938	275,872,498.00	5.03
3	300226	上海钢联	1,994,481	231,758,692.20	4.23
4	000516	国际医学	7,074,037	143,461,470.36	2.62
5	600120	浙江东方	4,349,647	142,102,967.49	2.59
6	300207	欣旺达	2,980,858	141,262,860.62	2.58
7	000673	当代东方	5,805,625	140,147,787.50	2.56
8	000066	长城电脑	8,029,499	139,954,167.57	2.55
9	000592	平潭发展	5,389,542	138,780,706.50	2.53
10	002410	广联达	3,320,035	137,781,452.50	2.51

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
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
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十名资产支持证券投资明细
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
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
本基金本报告期末未持有权证。
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
本基金本报告期末未持有股指期货。
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
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。
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中,没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。
5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,112,229.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	86,813.90
5	应收申购款	196,794,712.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	197,993,755.89

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
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
本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,918,932,505.81
报告期期间基金总申购份额	2,557,068,026.92
减:报告期期间基金总赎回份额	2,056,834,707.67
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	2,419,165,825.06

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

根据上海市政府的要求,经上海国盛(集团)有限公司批准,本基金管理人原股东上海盛融投资有限公司(以下简称"上海盛融")由其母公司上海国盛集团资产有限公司(以下简称"上海国盛")吸收合并,上海盛融持有的本基金管理人10%的股权由上海国盛承继,本基金管理人股东因此由上海盛融变更为上海国盛。本基金管理人正在就此事项履行相关工商变更手续。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、 中国证监会批准浦银安盛价值成长股票型证券投资基金设立的文件
2、 浦银安盛价值成长股票型证券投资基金基金合同
3、 浦银安盛价值成长股票型证券投资基金招募说明书
4、 浦银安盛价值成长股票型证券投资基金托管协议
5、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
6、 基金托管人业务资格批件和营业执照
7、 本报告期内在中国证监会指定报刊上披露的各项公告
8、 中国证监会要求的其他文件
9.2 存放地点
上海市淮海中路381号中环广场38楼基金管理人办公场所。
9.3 查阅方式
投资者可登录基金管理人网站(www.py-axa.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。
投资者对本报告书如有疑问,可咨询基金管理人。
客户服务中心电话:400-8828-999 或 021-33079999 。

浦银安盛基金管理有限公司
二〇一五年四月二十一日

中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第一季度报告

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4月21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4月17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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富中证主要消费ETF
场内简称	消费ETF
交易代码	159928
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年8月23日
报告期末基金份额总额	74,657,260.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要采取完全复制法,在正常市场情况下,日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%,年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中证主要消费指数
风险收益特征	属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本系列基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

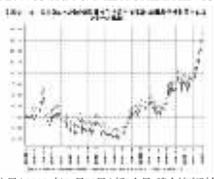
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	2,167,850.69
2.本期利润	19,158,720.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.2368
4.期末基金资产净值	104,145,713.48
5.期末基金份额净值	1.3950

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	21.24%	1.37%	21.61%	1.37%	-0.37%	0.00%

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(2013年8月23日)起3个月,建仓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		
吴振翔	汇添富上证综合指数、汇添富中证主要消费ETF、汇添富中证医药卫生ETF、汇添富中证能源ETF、汇添富中证金融地产ETF、汇添富沪深300安中指数基金、汇添富成长多因子股票基金、汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理,指数与量化投资部副总监。	2013年8月23日	-	9年	国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师,现任指数与量化投资部副总监。2010年1月8日至2010年2月4日任汇添富上证综合指数基金的基金经理助理,2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理,2011年9月16日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金的基金经理,2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理,2013年8月23日至今任中证主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金的基金经理,2013年11月6日至今任汇添富沪深300安中指数基金的基金经理,2015年2月16日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理,2015年3月24日至今任汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理。
汪洋	汇添富中证主要消费ETF、汇添富中证医药卫生ETF、汇添富中证能源ETF、汇添富中证金融地产ETF、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。	2013年9月13日	2015年1月6日	6年	国籍:中国。学历:金融工程及计算机科学双硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任华泰联合证券有限责任公司金融工程高级研究员、华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理助理。2013年5月6日加入汇添富基金管理股份有限公司,从事指数及ETF产品的投资、研究工作,2013年9月13日至2015年1月6日任汇添富中证主要消费ETF、汇添富中证医药卫生ETF、汇添富中证能源ETF、汇添富中证金融地产ETF基金的基金经理,2013年11月7日至2015年1月6日任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理。

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遵规守信情况的说明
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。本基金无违大违法、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,基金管理人对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,基金管理人对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。
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交易所公开竞价交易中,未发生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
一季度经济延续下滑趋势,频出的利好政策和增量资金的进入成为主导市场的决定性因素。周期性政策方面,节后迅速启动的降息和两会政府工作报告中都体现了对经济增长速度的托底诉求。财政部主导的债务置换正在逐步化解存量债务的风险问题,债务风险的降低除了可以稳定银行的估值底线外,也有利于市场的风险偏好提高。同时,放松性房地产政策逐步兑现,基础设施投资也似乎有加快启动的迹象,这些都让市场感受到"稳增长"的政策努力。主题政策上,"一带一路"在春节后也获得了突破性进展。大量欧洲国家及部分原本观望的亚洲国家纷纷加入这一中国主导的亚洲投资银行,超过了市场原来的预期,"一带一路"再次带动了蓝筹股估值的再一轮上升;克强总理在两会中提出"互联网+"概念,使得互联网相关产业在前期大幅上涨的基础上进一步上涨。三月末,国务院常务会议部署推进实施"中国制造2025",大量传统企业借由"触网"实现信息的透明化和个性化从而实现产业升级已是大势所趋,受到了投资者的追捧。
本基金在报告期内遵循了ETF基金的被动投资原则,保持了指数基金的本质属性,股票投资仓位在考察期内始终保持在98%-100%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。
本基金日常管理中非常重视风险管理,对股票和现金头寸严格管理、实时监控,基本实现了ETF平稳运作管理的目的。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
报告期内中证医药指数上涨29.93%,本基金在报告期内累计收益率为29.45%,收益率落后业绩比较基准-0.37%。收益率的差异因素主要来源于期间成份股分红、日常申购赎回等因素。本基金日均跟踪误差为0.0089%,这一跟踪误差水平远低于合同约定上限,在报告期达到了投资目标。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
2015年一季度,大盘蓝筹行情暂时休整,而主要消费行业属于弱周期板块,在大盘蓝筹休整阶段表现较好。一季度以来,消费行业中的食品饮料子行业表现稳健,白酒板块和乳制品板块持续上行;而农林牧渔子行业亦表现较好。
从行业基本面角度来看,白酒行业复苏正在进行中,在国企改革的大背景之下将会迎来新的成长机遇,乳制品行业依然保持稳健的增长态势,相关个股的表现也较为稳健;农林牧渔行业方面,农业信息化等转型浪潮正在兴起,这将对行业的基本面产生深刻影响。总体来看,消费行业作为关系到国计民生的重要行业,其景气度的回升是大概率事件,投资消费行业将对资产组合起到稳定作用。
作为被动投资的交易所上市指数型基金,汇添富中证消费ETF将严格遵守基金合同,继续坚持既定的指数化投资策略,积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。
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	103,882,226.16	99.56
	其中:股票	103,882,226.16	99.56
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	454,210.11	0.44
7	其他资产	4,216.56	0.00
8	合计	104,340,652.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末指数投资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	10,030,812.42	9.63
B	采矿业	-	-
C	制造业	75,034,295.36	72.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,309,175.69	15.66
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,507,942.69	2.41
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	103,882,226.16	99.75

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
注:本基金本报告期末未进行积极投资。
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
5.3.1 报告期末指数投资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	600887	伊利股份	317,297	9,788,612.45	9.40
2	600519	贵州茅台	47,915	9,389,423.40	9.02
3	600518	康美药业	188,136	5,834,097.36	5.60
4	000858	五粮液	231,992	5,377,574.56	5.16
5	002304	洋河股份	39,491	3,213,382.67	3.09
6	000895	双汇发展	80,682	2,977,165.80	2.86
7	600315	上海家化	65,868	2,801,366.04	2.69
8	601933	永辉超市	238,738	2,752,649.14	2.64
9	601607	上海医药	117,561	2,670,985.92	2.56
10	000061	农产品	165,979	2,507,942.69	2.41

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
注:本基金本报告期末未进行积极投资。
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:本基金本报告期末未持有债券投资。
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
注:本基金本报告期末未持有债券投资。
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投资。
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:本基金本报告期内未投资国债期货。
5.10.3 本期国债期货投资评价
报告期末本基金无国债期货持仓。
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	4,151.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	64.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,216.56

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
5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。
5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未进行积极投资,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	83,157,260.00
报告期期间基金总申购份额	500,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	9,000,000.00
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	74,657,260.00

§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 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,自2015年4月3日起,本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。详情请见2015年4月4日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会批准中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;
2、《中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
3、《中证主要消费交易型开放式指数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、报告期内中证主要消费交易型开放式指数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。
9.2 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
9.3 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4月21日

中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第一季度报告

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4月21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4月17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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富中证医药ETF
场内简称	医药ETF
交易代码	159929
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年8月23日
报告期末基金份额总额	109,704,203.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要采取完全复制法,在正常市场情况下,日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%,年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中证医药卫生指数
风险收益特征	属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本系列基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	11,164,069.67
2.本期利润	42,890,209.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.3136
4.期末基金