汇添富全额宝货币市场基金

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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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	汇添富全额宝货币
交易代码	000397
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月13日
报告期末基金份额总额	11,039,751,141.14份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略,力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§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	107,252,483.25
2.本期利润	107,252,483.25
3.期末基金资产净值	11,039,751,141.14

注: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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

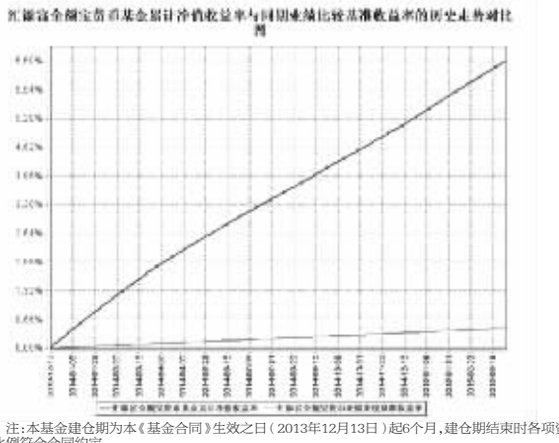
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1827%	0.0017%	0.0863%	0.0000%	1.0964%	0.0017%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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12月13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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陆文磊	汇添富增强收益债券基金、汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富互利分级债券基金、汇添富双月盈债券基金、汇添富多利宝货币基金、汇添富现金宝货币基金、汇添富收益快钱货币基金、汇添富收益快钱货币基金的基金经理、固定收益投资总监。	2013年12月13日	2015年3月31日	13年	国籍:中国,学历:华东师范大学金融学博士,相关业务资格:基金从业资格,从业经历:曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师,2007年8月加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益高级经理,现任固定收益投资总监。2008年3月6日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理,2009年1月21日至2011年6月21日任汇添富货币基金的基金经理,2011年1月26日至2013年2月7日任汇添富保本混合基金的基金经理,2012年7月26日至今任汇添富季季红定期开放债券基金的基金经理,2012年12月31日至2014年11月20日任汇添富收益快钱货币基金的基金经理期限,2013年11月6日至今任汇添富互利分级债券基金的基金经理,2013年12月13日至2015年3月31日任汇添富全额宝货币基金的基金经理,2014年11月21日至2015年3月31日任汇添富收益快钱货币基金的基金经理,2014年12月23日至今任汇添富收益快钱货币基金的基金经理。
汤从珊	汇添富货币基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金、汇添富和宝货币基金、汇添富添福货币基金的基金经理。	2013年12月13日	-	7年	国籍:中国,学历:上海财经大学管理学硕士,相关业务资格:基金从业资格,从业经历:2008年5月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任固定收益交易员、固定收益交易主管。2013年7月31日至今任汇添富货币基金的基金经理。2013年12月13日至今任汇添富全额宝货币基金的基金经理。2014年11月21日至今任汇添富理财30天债券、理财60天债券基金的基金经理。2014年5月28日至今任汇添富和聚宝货币基金的基金经理。2015年1月16日至今任汇添富汇添通货币基金(原汇添富新收益债券基金)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,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

2015 一季度经济下行压力仍然较大,3月金融数据比较疲弱,出口数据较弱,社融的非信贷部分继续萎缩。整个一季度来看,货币条件没有如市场预期放松甚至继续收紧,包括货币增速仍处于下滑通道,叠加综合有效汇率偏强以及实际利率偏高,对经济不利,前期的稳增长政策对经济周期的影响不足。

一季度虽然央行采取宽松的货币政策,但实际利率并未如预期引导下行,且受到股票IPO和股市上涨的挤压效应影响,银行间流动性较紧,协议存款利率持续较高。现券方面,由于资金成本较高和流动性冲击的影响,短融收益率逐步上行,信用利差有所扩大。

本基金在报告期安排了较大比例的流动性于IPO期间和月末等可能发生流动性紧张的时点滚动操作,在短融收益率高企的时点战略性建仓,并持续改善组合持仓中短融的流动性。通过短融的波段性操作和合理错配存款到期日,在保证组合整体流动性的前提下,抓住资金利率高企的时间窗口锁定高息存款和优质短融提高组合收益率。通过这些前瞻性的操作,本基金有效应对了组合的规模变化,确保了组合的流动性和和合法合规运作,并抓住关键时点锁定了一部分较高收益的同业存款和短期债券获取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

一季度本基金净值收益率为1.1827%,业绩比较基准收益率为0.0863%。

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年二季度,4月起,随着1季度经济数据低于预期,央行开始改变1季度资金面整体偏紧的局面,积极引导利率下行,稳定流动性宽松预期,降低社会资金成本,未来可能还需要其他货币政策工具进一步引导中长端利率下行,政策加码进行时。短期债券在这个过程中会首先受益,二季度债市有较好的交易性机会。但二季度货币政策放松的幅度和速度仍需要观察经济复苏情况,且新股发行等对短期资金面扰动因素增多,要更加关注流动性风险和波段操作机会。短融方面,由于外围信托产品已出现多起大额的风险事件,二季度要更加注重信用风险的防范和由信用风险衍生的资金面压力和流动性风险,在严防信用风险的前提下,适时调整短融的配置比例和改善组合中短融持仓的流动性,进行波段操作。

有鉴于此,本基金将在密切跟踪基本面、政策面和资金面前提下,综合分析本基金的份额变动,提前做好债券与存款之间的配置计划,保持组合的较高流动性和安全性,积极把握市场结构性机会,通过在合适的时点锁定高收益的存款和灵活控制短融仓位博取资本利得收入为投资者创造更多额外收益。

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	固定收益投资	3,480,026,654.35	30.22
	其中:债券	3,480,026,654.35	30.22
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	100,000,270.00	0.87
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	7,830,178,923.26	68.00
4	其他资产	105,205,315.10	0.91
5	合计	11,515,411,162.71	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1.68
	其中:买断式回购融资	0.05

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	469,992,445.00	4.26
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期未投资组合平均剩余期限	100
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	90

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.73	4.26
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	15.39	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	23.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	19.00	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.28	-
5	180天(含)-397天(含)	20.55	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	103.36	4.26

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	摊余成本(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	640,720,000.36	5.80
	其中:政策性金融债	640,720,000.36	5.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,839,306,653.99	25.72
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,480,026,654.35	31.52
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	30,580,793.82	0.28

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140218	14国开18	1,700,000	169,974,605.31	1.54
2	140443	14农发43	1,300,000	130,016,297.82	1.18
3	140223	14国开23	1,100,000	110,118,306.30	1.00
4	071524002	15东兴证券CP002	1,000,000	99,979,370.45	0.91
5	011599010	15豫能源SCP001	1,000,000	99,946,609.01	0.91
6	011590003	15苏交通SCP003	1,000,000	99,940,467.33	0.91
7	071541002	15恒泰证券CP002	700,000	69,985,971.92	0.63
8	041454066	14西南水起CP001	600,000	59,996,514.08	0.54
9	041460084	14中金集CP001	500,000	50,158,551.40	0.45
10	140230	14国开30	500,000	49,996,261.85	0.45

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0872%
报告期内偏离度的最低值	0.0320%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0634%

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 投资组合报告附注

5.8.1 本基金估值采用摊余成本法计价,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	105,188,815.10
4	应收申购款	-
5	其他应收款	16,500.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	105,205,315.10

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	6,517,417,515.64
报告期期间基金总申购份额	14,510,567,414.55
减:报告期期间基金总赎回份额	9,988,233,789.05
报告期期末基金份额总额	11,039,751,141.14

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 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》。

汇添富基金管理股份有限公司
2015年4月21日

汇添富上证综合指数证券投资基金

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	汇添富上证综合指数
交易代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月1日
报告期末基金份额总额	2,246,241,664.16份
投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于6%,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性,主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%且年化跟踪误差小于6%的投资目标。
业绩比较基准	上证综合指数收益率×95% + 银行活期存款利率(税后)×5%
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风险较高收益的品种。
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	374,212,281.97
2.本期利润	397,403,178.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.1341
4.期末基金资产净值	2,845,190,435.99
5.期末基金份额净值	1.267

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。

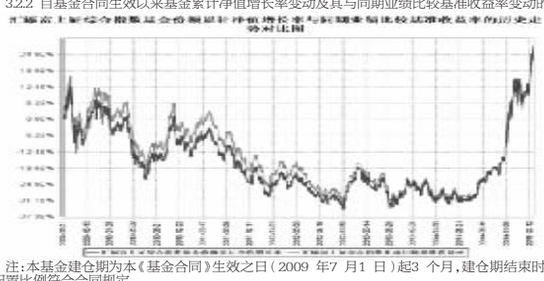
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	14.25%	1.81%	15.08%	1.77%	-0.83%	0.04%

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(2009年7月1日)起3个月,建仓期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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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、汇添富上证金融地产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。	2010年2月5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日任汇添富沪深300ETF基金的基金经理。2011年9月26日至2013年11月7日任汇添富沪深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。

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,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。

报告期内,本基金遵循指数基金的被动投资原则,保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位在报告期内基本保持在92%-95%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。本基金对抽样复制组合继续采取缓冲式调整,降低了冗余的交易量。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内上综指基准上涨15.08%,本基金在报告期内累计收益率为14.25%,收益率落后业绩比较基准-0.83%。收益率的差异因素主要来源于日常申购赎回等因素。本基金日均跟踪误差为0.0640%,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

目前蓝筹股市场估值水平已经超过历史平均水平,以创业板为代表的成长股估值接近历史峰值。当前情况而言,不断深化的改革转型预期成为风险偏好不断提升的主要动力来源。政策面上,接下来一段时间各项政策仍可能继续密集出台。周期性政策上可能有进一步稳增长的努力,广受关注的京津冀一体化、国企改革的综合性指引文件,以及各种产业政策均有可能快速推出。在这样政策背景下,考虑到当前市场热度和跑步进场的新增资金,市场在短期内多主题轮番上涨的可能性仍较高。但如果政策预期兑现或政策不及预期,那么基本面和流动性对市场的负面压力将逐渐显现。

基本面上,实体经济能否触底反转,形成"经济底"是本轮牛市能否长期延续的决定因素。如企业盈利不达预期而市场回归基本面,当前A股高企的估值可能承受一定的压力。

资金面上,尽管从中长期趋势来看,居民大类资产配置由楼市向股市转移的方向明确,但新股发行加速、新三板及港股通对资金的分流加大、杠杆交易增速放缓使得市场资金面逐渐进入供需平衡阶段。站在当前时点,增量资金的配置将是决定未来走势的关键因素。对于公募基金的新增资金,从估值角度或流动性角度看,继续配置小盘微盘股票将面临较大的风险,选择大中盘股票可能会是更安全的选择。

基于以上因素,A股市场在接下来的一段时期内震荡上行的概率较大。上证指数作为市场蓝筹标杆,很可能会有较好的表现。

作为被动投资的指数型基金,汇添富上证综合指数基金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	2,668,134,854.04	92.55
	其中:股票	2,668,134,854.04	92.55
2	固定收益投资	3,790,332.00	0.13
	其中:债券	3,790,332.00	0.13
	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	150,614,599.23	5.22
7	其他资产	60,222,159.68	2.09
8	合计	2,882,761,944.95	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11,995,243.32	0.42
B	采矿业	345,361,674.47	12.14
C	制造业	790,425,986.66	27.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	119,774,277.00	4.21
E	建筑业	129,608,895.46	4.56
F	批发和零售业	94,617,420.50	3.33
G	交通运输、仓储和邮政业	138,288,880.49	4.86
H	住宿和餐饮业	5,207,630.72	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	89,463,322.68	3.14
J	金融业	788,953,710.63	27.73
K	房地产业	103,735,552.13	3.65
L	租赁和商务服务业	14,392,830.96	0.51
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,438,849.83	0.23
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	22,075,298.17	0.78
S	综合	7,795,281.02	0.27
	合计	2,668,134,854.04	93.78

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	601857	中国石油	14,779,752	173,366,490.96	6.09
2	601288	农业银行	26,998,824	99,085,684.08	3.48
3	601988	中国银行	20,995,777	91,961,503.26	3.23
4	601628	中国人寿	1,901,188	70,439,015.40	2.48
5	600036	招商银行	3,860,081	60,101,461.17	2.11
6	600028	中国石化	8,714,723	55,861,374.43	1.96
7	601328	交通银行	7,897,548	50,465,331.72	1.77
8	601166	兴业银行	2,541,563	46,663,096.68	1.64
9	600000	浦发银行	2,822,784	44,571,759.36	1.57
10	601318	中国平安	437,049	34,194,713.76	1.20

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

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,790,332.00	0.13
8	其他	-	-
9	合计	3,790,332.00	0.13

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	113008	电气转债	27,300	3,790,332.00	0.13

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。

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、处罚的情形。

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	1,281,580.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,982.50
5	应收申购款	58,907,597.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,222,159.68

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	3,874,253,436.73
报告期期间基金总申购份额	433,706,420.42
减:报告期期间基金总赎回份额	2,061,718,192.99
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	2,246,241,664.16

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 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