

## 汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金

## [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、监事及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和基金管理公司根据基金合同约定，于2015年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等信息，确认复核结果不存在虚假记载、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基金未来表现，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。

本基金未进行份额分级，因此未涉及其未来表现。

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	汇添富沪深300安中指数
交易代码	000668
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年1月6日
报告期末基金份额总额	209,539,966.95份
投资目标	本基金为被动式指数化投资，紧密跟踪沪深300安中动态策略指数，力求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以度量投资带来的长期超额回报。
投资策略	本基金通过分析宏观经济、行业景气度、上市公司基本面等指标，结合对股票的估值、盈利能力、成长性等指标的综合评估，精选出具有代表性的股票构建投资组合。在正常情况下，本基金力争净值增长率与单一股票指数收益率在扣除适当费用后相比较不超过±0.3%，年度跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	沪深300中证动量指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款利息率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，在所有基金中属中较高风险等级，较高预期收益的品种，本基金采用完全复制法跟踪标的指数的资产，有较高的指数跟踪误差的可能且存在系统性风险。
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

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.本期末基金资产

2.本期利润

3.加权平均基金份额本期利润

4.期末基金资产净值

5.期末基金份额净值

注:1.本期实现收益指报告期内基金已实现的收入，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的收入加上本期公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

2.所列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指标。

3.基金的业绩表现

4.2.1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 业绩比较基准差③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 17.80% 1.66% 18.22% 1.66% -0.42% 0.09%

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:本基金合同生效之日(2013年1月6日)起6个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

## § 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间 证券从业年限 说明

任职日期 离任日期

吴振丽 汇添富上证综指ETF、汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金基金经理 2013年11月6日 - 9年

注:1.基金的首任基金经理,其“任职日期”即为基金合同生效日,其“离任日期”即为根据公司决议确定的解聘日期;

2.非基金经理,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、证监会及基金业协会制定的基金合同、基金宣传推介材料以及其他法律法规、规章及自律规则的规定,不存在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 平公正交易制度的执行情况

基金管理人公平公正交易制度的执行情况,根据中国证监会《证券投资基金公平交易制度指引(试行)》,基金管理人制定了《公平交易制度》,并严格执行,确保旗下各基金公平对待所有客户,遵守公平交易原则,合理安排旗下各基金的买卖时机和买卖价格,在保证公平交易的前提下,促进旗下各基金的均衡发展。

本基金管理人对公平交易制度的执行情况,包括定期报告和不定期报告,并贯穿于授权、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。

4.3.2 对旗下基金公平交易的专项说明

本基金管理人对旗下基金公平交易制度的执行情况,根据中国证监会《证券投资基金公平交易制度指引(试行)》,基金管理人制定了《公平交易制度》,并严格执行,确保旗下各基金公平对待所有客户,遵守公平交易原则,合理安排旗下各基金的买卖时机和买卖价格,在保证公平交易的前提下,促进旗下各基金的均衡发展。

4.4 报告期内基金的定期报告和临时公告的披露情况

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金定期报告和临时公告的披露情况,在定期报告中分析了宏观经济形势、行业政策、市场环境、资金供求状况、估值水平、流动性、风险收益特征等影响因素,并结合基金自身的投资策略、资产配置、操作方法等,对基金的未来走势做出了展望。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

4.4.3 报告期内基金的资产配置情况

4.4.4 报告期内基金的杠杆倍数

4.4.5 报告期内基金的债券投资情况

4.4.6 报告期内基金的股票投资情况

4.4.7 报告期内基金的股指期货投资情况

4.4.8 报告期内基金的国债期货投资情况

4.4.9 报告期内基金的资产支持证券投资情况

4.4.10 报告期内基金的黄金交易情况

4.4.11 报告期内基金的融资融券业务情况

4.4.12 报告期内基金的其他投资情况

4.5 管理人对本基金的评价

4.6 报告期内基金管理人内部管理情况

4.7 报告期内基金管理人对旗下基金的风险提示

4.8 报告期内基金管理人对旗下基金的估值政策

4.9 报告期内基金管理人对旗下基金的费用计提方法

4.10 报告期内基金管理人对旗下基金的收益分配政策

4.11 报告期内基金管理人对旗下基金的暂停赎回或巨额赎回的安排

4.12 报告期内基金管理人对旗下基金的重新定价安排

4.13 报告期内基金管理人对旗下基金的暂停申购或限制申购的安排

4.14 报告期内基金管理人对旗下基金的暂停赎回或限制赎回的安排

4.15 报告期内基金管理人对旗下基金的冻结、融券、解冻、融券的安排

4.16 报告期内基金管理人对旗下基金的质押赎回的安排

4.17 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.18 报告期内基金管理人对旗下基金的质押登记的安排

4.19 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.20 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.21 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.22 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.23 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.24 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.25 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.26 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.27 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.28 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.29 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.30 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.31 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.32 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.33 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.34 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.35 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.36 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.37 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.38 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.39 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.40 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.41 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.42 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.43 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.44 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.45 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.46 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.47 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.48 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.49 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.50 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.51 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.52 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.53 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.54 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.55 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.56 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.57 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.58 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.59 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.60 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.61 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.62 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.63 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.64 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.65 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.66 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.67 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.68 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.69 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.70 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.71 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.72 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.73 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.74 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.75 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.76 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.77 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.78 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.79 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.80 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.81 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.82 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.83 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.84 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.85 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.86 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.87 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.88 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.89 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结的安排

4.90 报告期内基金管理人对旗下基金的质押冻结