中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富中证金融地产ETF
场内简称	金融ETF
交易代码	159931
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	32,828,511.00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	中证金融地产指数
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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	2,271,128.02
2.本期利润	11,447,437.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.3140
4.期末基金资产净值	53,190,649.99
5.期末基金份额净值	1.6203

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。

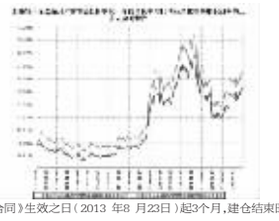
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	22.56%	1.77%	23.14%	1.78%	-0.58%	-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(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	2015年11月2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、基金经理助理,现任指数与量化投资部副总监。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2015年11月2日任中证主要消费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。
过蓉蓉	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联接基金、汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理。	2015年8月3日	-	4年	国籍:中国,学历:中国科学技术大学金融工程博士研究生,相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015年6月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理,2015年8月3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、汇添富中证主要消费ETF联接基金的基金经理,2015年8月18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。

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 管理人对投资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2次,是组合投资策略原因导致。经检查和分析未发现异常情况。

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

四季度工业生产和投资小幅回升,非制造业PMI进一步增强,经济金融总体平稳,但形势错综复杂。美国进入加息周期,对新兴经济体造成一定资本外流压力,国际金融风险隐患增多,国内货币政策操作难度加大。政府通过运用各种政策抵御经济下滑和金融风险,救市措施在四季度显示出明显成效;房地产市场通过降息降首付比例等一系列政策促进房地产销售去库存;人民币成功加入SDR,并在可控范围内对美元贬值1.99%,出口市场份额上升;存款利率上限放开,货币政策利率走廊初步成型。股市去杠杆基本结束,金融地产行业受益政策宽松,在四季度均取得超越大盘的收益。

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。股票投资仓位报告期内基本保持在95%~100%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内中证金融指数上涨23.14%,本基金在报告期内累计收益率为22.56%,收益率落后业绩比较基准0.58%。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0.0179%,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 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	53,070,032.96	99.03
	其中:股票	53,070,032.96	99.03
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	513,022.89	0.96
7	其他资产	4,681.06	0.01
8	合计	53,587,736.91	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
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	42,725,177.25	80.32
K	房地产业	9,873,510.20	18.56
L	租赁和商务服务业	108,382.33	0.20
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	362,963.18	0.68
	合计	53,070,032.96	99.77

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	601318	中国平安	134,970	4,858,920.00	9.13
2	600016	民生银行	368,038	3,547,886.32	6.67
3	601166	兴业银行	166,058	2,834,610.06	5.33
4	000002	万科A	98,431	2,404,669.33	4.52
5	600036	招商银行	128,479	2,311,337.21	4.35
6	600000	浦发银行	116,235	2,123,613.45	3.99
7	600030	中信证券	98,749	1,910,793.15	3.59
8	601328	交通银行	293,337	1,889,090.28	3.55
9	600837	海通证券	101,619	1,607,612.58	3.02
10	601288	农业银行	476,176	1,538,048.48	2.89

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。

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。

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: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 本基金投资前十名证券中的中国平安(601318)控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券")于2014年12月9日收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》([2014]103号)。中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")决定对平安证券给予警告,没收保荐业务收入400万元,没收承销股票违法所得2867万元,并处以440万元罚款,并对韩长风、霍永涛给予警告,并分别处以30万元罚款,撤销证券从业资格。我们经过研究评估,认为此事件对中国平安经营业绩未产生重大的实质影响,对其投资价值未产生实质影响。本基金持有该股经过合理的投资决策授权审批,符合指数基金投资管理规定。

本基金投资前十名证券中的海通证券(600837)于2015年9月12日公告收到《中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书》(处罚字[2015]73号)。中国证券监督管理委员会拟对海通证券涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案做出行政处罚。我们经过研究评估,认为此事件对海通证券经营业绩未产生重大的实质影响,对其投资价值未产生实质影响。本基金持有该股经过合理的投资决策授权审批,符合指数基金投资管理规定。

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	4,593.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	87.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,681.06

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	2,404,669.33	4.52	重大资产重组停牌

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	40,828,511.00
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	8,000,000.00
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	32,828,511.00

§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 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中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富中证金融地产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。

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1月21日

中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1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2016年1月19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10月1日起至12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	839,157,260.00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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-34,814,277.18
2.本期利润	187,973,360.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.2117
4.期末基金资产净值	1,202,828,001.42
5.期末基金份额净值	1.4334

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。

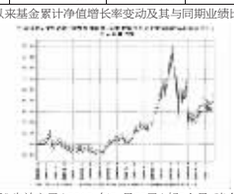
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	16.46%	1.64%	16.92%	1.65%	-0.46%	-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(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	2015年11月2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、基金经理助理,现任指数与量化投资部副总监。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2015年11月2日任中证主要消费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。
过蓉蓉	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联接基金、汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理。	2015年8月3日	-	4年	国籍:中国,学历:中国科学技术大学金融工程博士研究生,相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015年6月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理,2015年8月3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、汇添富中证主要消费ETF联接基金的基金经理,2015年8月18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。

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 管理人对投资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2次,是组合投资策略原因导致。经检查和分析未发现异常情况。

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

四季度工业生产和投资小幅回升,非制造业PMI进一步增强,经济金融总体平稳,但形势错综复杂。美国进入加息周期,对新兴经济体造成一定资本外流压力,国际金融风险隐患增多,国内货币政策操作难度加大。政府通过运用各种政策抵御经济下滑和金融风险,救市措施在四季度显示出明显成效;房地产市场通过降息降首付比例等一系列政策促进房地产销售去库存;人民币成功加入SDR,并在可控范围内对美元贬值1.99%,出口市场份额上升;存款利率上限放开,货币政策利率走廊初步成型。

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。股票投资仓位报告期内基本保持在95%~95%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内消费联接基准上涨16.08%,本基金在报告期内累计收益率为15.68%,收益率落后业绩比较基准-0.40%。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0.0194%,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 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	47,887,046.13	3.86
	其中:股票	47,887,046.13	3.86
2	基金投资	1,123,785,600.00	90.63
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	67,018,731.30	5.40
8	其他资产	1,326,775.38	0.11
9	合计	1,240,018,152.81	100.00

5.2 报告期末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	3,526,076.00	0.28
B	采矿业	-	-
C	制造业	35,345,745.26	2.86
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	8,284,627.87	0.67
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	730,597.00	0.06
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	47,887,046.13	3.87

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	000876	新希望	259,200	4,569,696.00	0.37
2	600887	伊利股份	271,400	4,459,102.00	0.36
3	600519	贵州茅台	17,691	3,859,999.29	0.31
4	600518	康美药业	153,400	2,600,130.00	0.21
5	000858	五粮液	94,400	2,575,232.00	0.21
6	002304	洋河股份	29,515	2,022,958.10	0.16
7	000028	国药一致	23,100	1,528,065.00	0.12
8	600873	梅花生物	136,024	1,243,259.36	0.10
9	601607	上海医药	58,977	1,174,232.07	0.09
10	601933	永辉超市	100,269	1,012,716.90	0.08

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。

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。

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	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	消费ETF	股票型	交易型开放式	汇添富基金管理股份有限公司	1,123,785,600.00	90.82

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11.2 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。

5.11.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	796,763.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,377.92
5	应收申购款	515,633.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,326,775.38

5.13.1 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。

5.13.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000876	新希望	4,569,696.00	0.37	重大事项停牌
2	000028	国药一致	1,528,065.00	0.12	重大事项停牌
3	600873	梅花生物	1,243,259.36	0.10	重大资产重组停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,463,521,330.63
报告期期间基金总申购份额	40,665,139.13
减:报告期期间基金总赎回份额	246,788,864.05
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	1,257,397,605.71

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 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中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件;
2、《汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》;
3、《汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
5、报告期内汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接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1月21日

汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	汇添富中证主要消费ETF联接
交易代码	000248
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月24日
报告期末基金份额总额	1,257,397,605.71份
投资目标	通过投资于目标ETF,紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。
业绩比较基准	中证主要消费指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。
风险收益特征	本基金属联接基金,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。同时本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪业绩比较基准,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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159