汇添富优势精选混合型证券投资基金

【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	汇添富优势精选混合
交易代码	519008
前端交易代码	519008
后端交易代码	519009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年8月25日
报告期末基金份额总额	524,454,196.77份
投资目标	本基金投资于具有持续竞争优势的企业,分享其在中国经济持续成长背景下的长期优异业绩,为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。
投资策略	在投资顾问的指导下,本基金管理人根据中国证券市场的特点,创建了汇添富持续竞争优势企业评估系统,它以企业竞争优势评估为核心,以行业背景分析为竞争优势分析提供切入点,以财务分析验证竞争优势分析的结果。 本基金采用适度动态资产配置策略,同时运用汇添富持续竞争优势企业评估系统自下而上精选个股,并对投资组合进行积极而有效的风险管理。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金是精选股票、并且进行积极风险控制的混合型基金,本基金的风险和预期收益比较均衡,在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。
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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	183,959,910.34
2.本期利润	536,681,255.79
3.加权平均基金份额本期利润	1.0546
4.期末基金资产净值	2,459,408,435.98
5.期末基金份额净值	4.6895

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	29.47%	2.17%	12.12%	1.17%	17.35%	1.00%

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(2005年8月25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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王栩	汇添富优势精选混合基金、汇添富美丽30混合基金的基金经理,股票投资副总监。	2010年2月5日	-	13年	国籍:中国。学历:同济大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任上海永嘉投资管理有限公司研究员,2004年11月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任固定收益分析师、高级行业研究员和基金经理助理,现任股票投资副总监。2010年2月5日至今任汇添富优势精选混合基金的基金经理,2010年9月21日至2013年5月10日任汇添富医药保健混合基金的基金经理,2012年7月10日至2015年3月31日任汇添富理财14天债券基金的基金经理,2013年6月25日至今任汇添富美丽30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 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,形成涵盖外汇敞口、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,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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年四季度国内经济引未见明好转迹象,部分经济数据甚至继续创出新低。人民银行在四季度进一步加大货币放松的力度,基准存贷款利率下降了0.25个百分点,存款准备金率下降了0.5个百分点。国际方面,美联储在12月首度加息,但由于投资者对此已有比较充分的预期,全球资本市场基本没有受到冲击。A股市场在四季度迎来大幅反弹,沪深300上涨16.49%,中小板指数上涨23.81%,创业板指数上涨30.32%。市场反弹的动力来自于以下两个方面:第一,6月份以来的去杠杆在三季度末已基本结束;第二,人民币汇率的投性稳定之后,投资者的风险偏好从极度厌恶恢复至正常状态。但由于宏观经济环境不佳、成长股整体的估值仍处于较高水平,市场的投资机会并不清晰,仍以新股性的投资主题为主。分行业来看,电子、房地产、计算机、通信、综合等行业表现相对较好,商贸都超过35%;黑色金属、交通运输、国防军工、银行、建筑装饰等行业的表现相对较差。

本基金在四季度根据经济和市场环境的变化对资产配置结构做出调整。期末股票资产比例为89.5%,与三季度末基本持平。行业配置方面,主要增持了家用电器、金融、建筑材料等行业,主要减持了生物医药、TMT、餐饮旅游等行业。个股上增加了对低估值、行业竞争力突出的价值股的投资,对于商业模式不够清晰、估值过高的成长股进行了系统性减持。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年四季度本基金的净值增长率为28.47%,比业绩比较基准高17.35个百分点。

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	2,202,995,239.86	89.29
	其中:股票	2,202,995,239.86	89.29
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	248,498,853.29	10.07
8	其他资产	15,851,943.08	0.64
9	合计	2,467,346,036.23	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,048,724,340.67	42.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,675,000.00	0.47
F	批发和零售业	140,496,241.84	5.71
G	交通运输、仓储和邮政业	37,191,000.00	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	329,686,456.13	13.41
J	金融业	186,687,602.64	7.59
K	房地产业	27,667,441.35	1.12
L	租赁和商务服务业	-	-
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	57,915,000.00	2.35
Q	卫生和社会工作	120,653,992.83	4.91
R	文化、体育和娱乐业	242,298,164.40	9.85
S	综合	-	-
	合计	2,202,995,239.86	89.57

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	002018	华信国际	9,500,000	290,890,000.00	11.83
2	002390	信邦制药	11,000,000	157,850,000.00	6.42
3	600867	通化东宝	5,000,000	135,850,000.00	5.52
4	300168	万达信息	3,720,000	123,243,600.00	5.01
5	300144	宋城演艺	3,912,868	110,734,164.40	4.50
6	300359	全通教育	1,261,009	108,598,095.08	4.42
7	600763	通策医疗	2,000,000	98,040,000.00	3.99
8	601318	中国平安	2,449,980	88,199,280.00	3.59
9	000156	华数传媒	2,300,000	75,440,000.00	3.07
10	000651	格力电器	3,300,000	73,755,000.00	3.00

注:本基金持有的华信国际处于停牌状态,受基金净值波动影响,华信国际占基金资产净值比被动超过10%,本基金管理人将在该股票复牌后,按照法律法规及基金合同的相关规定及时做出调整。

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。

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 本期股指期货投资政策

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

注: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

注: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

注: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	731,878.99
2	应收证券清算款	13,661,668.64
3	应收股利	-
4	应收利息	55,684.78
5	应收申购款	1,402,710.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,851,943.08

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

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	002018	华信国际	290,890,000.00	11.83	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	510,286,545.11
报告期期间基金总申购份额	92,283,598.79
减:报告期期间基金总赎回份额	78,115,948.13
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	524,454,195.77

注:其中"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优势精选混合型证券投资基金募集的文件;

2.《汇添富优势精选混合型证券投资基金基金合同》;

3.《汇添富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.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

汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金

【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。

汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金由汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金转型而来。2015年11月23日,汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金以现场方式召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金转型相关事项的议案》,内容包括汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金调整基金投资目标、投资范围、投资策略、基金费用、收益分配方式、估值方法以及修订基金合同等,并同意将汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金更名为汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金,上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自2015年12月22日起,《汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,《汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金基金合同》同日起失效。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中,原汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金报告期自2015年10月1日至2015年12月21日止,汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金报告期自2015年12月22日(基金合同生效日)至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况(转型后)

基金简称	汇添富优选回报混合
交易代码	470021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月22日
报告期末基金份额总额	51,453,273.72份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过积极主动的资产配置,充分挖掘各大类资产投资机会,力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	投资策略主要包括资产配置策略和股票投资策略。其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险;股票投资策略用于精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的股票,科学构建股票投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,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	中国银行股份有限公司

注:上表中"报告期末"指2015年12月31日。

2.2 基金产品概况(转型前)

基金简称	汇添富理财21天债券发起式	
交易代码	470021	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月24日	
报告期末基金份额总额	51,301,690.08份	
投资目标	本基金在追求本金安全,保持资产流动性的基础上,努力追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。	
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期控制在141天内。在控制利率风险的,尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率	
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金,预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金及普通债券型证券投资基金。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富理财21天债券发起式A	汇添富理财21天债券发起式B
下属分级基金的交易代码	470021	471021
报告期末下属分级基金的份额总额	14,986,930.18份	36,314,759.90份

注:上表中"报告期末"指2015年12月21日。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 主要财务指标(转型后)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年12月22日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-6,532.17
2.本期利润	7,597.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0001
4.期末基金资产净值	51,460,871.09
5.期末基金份额净值	1.000

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。

3.1.2 主要财务指标(转型前)

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21日)	
	汇添富理财21天债券发起式A	汇添富理财21天债券发起式B
1. 本期已实现收益	148,475.61	264,185.41
2. 本期利润	148,475.61	264,185.41
3. 期末基金资产净值	14,986,930.18	36,314,759.90

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,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。

2.本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

3.净值相关数据计算中涉及大数的,包括所有交易日以及转型前最后一个交易日。

4.期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

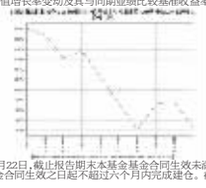
3.2.1 基金净值表现(转型后)

3.2.1.1 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
自基金合同生效日至今	0.00%	0.00%	-1.56%	0.58%	1.56%	-0.58%

注:汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金从2015年12月22日起正式转型为汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金,《汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的生效日为2015年12月22日。本表所示的是本报告期基金转型后的基金净值表现,转型后基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

3.2.1.2 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:1.本基金基金合同生效于2015年12月22日,截止报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2.按照基金合同的约定,本基金应自基金合同生效之日起不超过六个月内完成建仓。截至本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

3.2.2 基金净值表现(转型前)

3.2.2.1 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

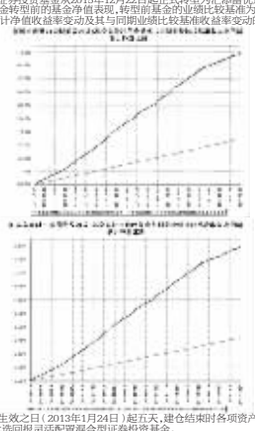
阶段	汇添富理财21天债券发起式A					
	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5658%	0.0175%	0.3033%	0.0000%	0.2625%	0.0175%

注:汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金从2015年12月22日起正式转型为汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金,本表所示的是本报告期基金转型前的基金净值表现,转型前基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

阶段	汇添富理财21天债券发起式B					
	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	0.6320%	0.0175%	0.3033%	0.0000%	0.3287%	0.0175%

注:汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金从2015年12月22日起正式转型为汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金,本表所示的是本报告期基金转型前的基金净值表现,转型前基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

3.2.2.2 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1月24日)起五天,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定;本基金从2015年12月22日起正式转型为汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

4.1.1 基金经理(或基金经理小组)简介(转型后)

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		
蒋文玲	汇添富现金宝、理财14天、优选回报混合基金的基金经理,汇添富多元收益债券、实业债债券基金的基金经理助理。	2015年3月10日	-	9年	国籍:中国。学历:上海财经大学经济学硕士。业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员,2012年11月30日至2014年1月7日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014年1月加入汇添富基金,历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理,2014年4月8日至今任汇添富多元收益债券基金、汇添富实业债债券基金的基金经理助理,2015年3月10日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富优选回报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。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)简介(转型前)

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		
蒋文玲	汇添富现金宝、理财14天、理财21天基金的基金经理,汇添富多元收益债券、实业债债券基金的基金经理助理。	2015年3月10日	-	9年	国籍:中国。学历:上海财经大学经济学硕士。业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员,2012年11月30日至2014年1月7日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014年1月加入汇添富基金,历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理,2014年4月8日至今任汇添富多元收益债券基金、汇添富实业债债券基金的基金经理助理,2015年3月10日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富理财21天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,形成涵盖外汇敞口、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22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年宽松的货币政策并没有引导资金入流实体经济,四季度宏观经济基本面维持底部徘徊,工业增加值、投资、进口等指标保持弱势,显示内需增长回升依旧乏力。2015年通货持续低位,尽管下半年开始猪肉价格反弹带动了CPI的短期回升,但到了4季度猪肉价格上升乏力,CPI持续走低,而PPI在全球需求疲弱、强势美元、大宗商品价格持续创新大幅下跌的带动下,全年跌幅显著,四度不改颓势。为应对经济下滑和通胀回落,四季度货币政策进一步放松,央行10月下旬双降,政策和中趋松的基调更加明确。四季度债券收益率整体明显下行,信用债与利率债均获得不错表现,长端表现显著好于短端,10年期金融债收益率下行40-45bp,中等评级的信用债下行60-100bp;由于市场预期四季度下滑可能加速,叠加新股IPO取闸预期放,四季度债券收益率曲线平坦化下行。

本基金四季度规模波动较大,操作上相对灵活,整体上增持了中长期限利率债和部分信用债配置,并适度参与了可转债的阶段性操作,适度提高了组合久期,组合杠杆相较三季度末结束也有所上升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金 A 级净值增长率为2.00%,C 级净值增长率为2.04%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,011,000.00	11.41
	其中:债券	10,011,000.00	11.41
	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	36,000,000.00	41.03
	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	41,423,348.70	47.22
8	其他资产	298,881.57	0.34
9	合计	87,733,230.27	100.00

注:上表中"报告期末"指2015年12月31日。

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.1.3 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.1.4 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	10,011,000.00	19.45
	其中:政策性金融债	10,011,000.00	19.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,011,000.00	19.45

注:上表中"报告期末"指2015年12月31日。

5.1.5 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	150413	15农发13	100,000	10,011,000.00	19.45

注:上表中"报告期末"指2015年12月31日。

5.1.6 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。

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 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。

5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:报告期末本基金无股指期货持仓。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 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。

5.1.10.3 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。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 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	应收股利	-
4	应收利息	172,337.90
5	应收申购款	126,543.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	298,881.57

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 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的情况。

5.2 投资组合报告(转型前)

5.2.1 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	9,996,870.46	19.40
	其中:债券	9,996,870.46	19.40
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	41,364,001.05	80.26
4	其他资产	178,097.06	0.35
5	合计	51,538,968.57	100.00

注:上表中"报告期末"指2015年12月21日。

5.2.2 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	1.44
	其中:买断式回购融资	0.00
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	0.00 / 0.00
	其中:买断式回购融资	0.00 / 0.00

注:1.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个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值;

2.上表中"报告期末"指2015年12月21日。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.2.3 基金投资组合平均剩余期限

5.2.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	30
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	69
报告期内投资组合平均剩余期限最低值