汇添富可转换债券债券型证券投资基金

【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	汇添富可转换债券	
交易代码	470058	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月17日	
报告期末基金份额总额	141,337,679.16份	
投资目标	本基金重点投资于可转换债券(含可分离交易可转债),努力在控制投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金80%以上的基金资产投资于固定收益类金融工具,并在严格控制风险的基础上,通过对全球经济形势、中国经济发展(包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况)、证券市场估值水平等的研判,适度参与权益类资产配置,适度把握市场时机力争为基金资产获取稳健回报。类属资产配置由本基金管理人根据宏观经济分析、债券基准收益率研究、不同类属债券利差水平研究,判断不同类属债券的相对投资价值,并确定不同债券类属在组合资产中的配置比例。	
业绩比较基准	天相转债指数收益率×70%+中债综合指数收益率×20%+沪深300指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富可转换债券A	汇添富可转换债券C
下属分级基金的交易代码	470058	470059
报告期末下属分级基金的份额总额	63,936,503.99份	77,401,175.17份

§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)	
	汇添富可转换债券A	汇添富可转换债券C
1. 本期已实现收益	-2,478,801.94	-3,033,765.26
2. 本期利润	9,379,104.87	10,965,541.78
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1354	0.1326
4. 期末基金资产净值	92,154,498.30	109,636,267.36
5. 期末基金份额净值	1.441	1.416

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

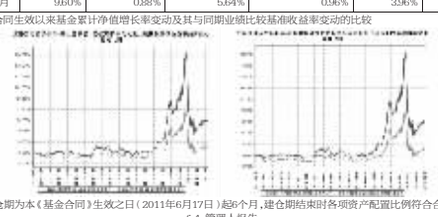
汇添富可转换债券A

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	9.67%	0.90%	5.64%	0.96%	4.03%	-0.06%

汇添富可转换债券C

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	9.60%	0.88%	5.64%	0.96%	3.96%	-0.08%

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(2011年6月17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		
曾刚	汇添富多元收益债券基金、可转换债券基金、实业债债券基金、双利增强债券基金、汇添富安鑫智选混合基金的基金经理,固定收益投资副总监。	2013年2月7日	-	14年	国籍:中国。学历:中国科技大学学士,清华大学MBA。业务资格:基金从业资格。从业经历:2008年5月15日至2010年2月5日任华富货币基金的基金经理,2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强基金的基金经理,2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报基金的基金经理。2011年11月加入汇添富基金,历任金融工程部高级经理,基金经理助理,现任固定收益投资副总监。2012年5月9日至2014年1月21日任汇添富理财30天基金的基金经理,2012年6月12日至2014年1月21日任汇添富理财60天基金的基金经理,2012年9月18日至今任汇添富多元收益基金的基金经理,2012年10月18日至2014年9月17日任汇添富理财28天基金的基金经理,2013年1月24日至2015年3月31日任汇添富理财21天基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理,2013年5月29日至2015年3月31日任汇添富理财7天基金的基金经理,2013年6月14日至今任汇添富实业债基金的基金经理,2013年9月12至2015年3月31日任汇添富现金宝货币基金的基金经理,2013年12月3日至今任汇添富双利增强债券基金的基金经理,2015年11月26日至今任汇添富安鑫智选混合基金的基金经理。
吴江宏	汇添富可转换债券基金的基金经理。	2015年7月17日	-	4年	国籍:中国,学历:厦门大学金融工程硕士,4年证券从业经验。2011年加入汇添富基金管理股份有限公司任债证收益分析师。2015年7月17日至今任汇添富可转换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

四季度,国内经济继续在底部徘徊,工业增加值、投资、进口等指标保持弱势,显示内需增长回升乏力。报告期内,货币市场利率变动不大,但债券收益率继续大幅下行,背后是实体融资需求萎缩和金融机构债券配置压力共同驱动的结果。股票市场经历三季度大幅调整后,杠杆率降低到合理水平,估值泡沫也逐渐被消化。随着汇率的企稳,市场情绪的修复,大盘蓝筹和创业板均迎来一波反弹行情。

具体来看,中债综合财富指数当季涨幅3.1%,沪深300当季上涨16.5%,中证可转债指数上涨5.2%。

报告期内,考虑到可转债溢价率过高,本组合降低了可转债的比例,提高了分离债比例。股票市场经历三季度的调整后,部分个股已体现较好的投资价值,本组合在四季度提高了股票的仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金A级净值收益率为9.67%,C级净值收益率为9.6%,同期业绩比较基准收益率为5.64%。

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	29,128,614.50	13.54
	其中:股票	29,128,614.50	13.54
2	固定收益投资	180,897,906.67	84.12
	其中:债券	180,897,906.67	84.12
	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	2,249,362.80	1.05
7	其他资产	2,783,880.86	1.29
8	合计	215,059,764.83	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	1,537,104.00	0.76
C	制造业	17,763,582.50	8.80
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	3,213,200.00	1.59
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	841,960.00	0.42
J	金融业	3,441,768.00	1.71
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,331,000.00	1.16
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	29,128,614.50	14.44

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	600271	航天信息	85,800	6,131,268.00	3.04
2	300285	国瓷材料	65,481	2,979,385.50	1.48
3	600867	通化东宝	93,300	2,534,961.00	1.26
4	002510	天汽模	140,000	2,482,200.00	1.23
5	600138	中青旅	100,000	2,331,000.00	1.16
6	600755	厦门国贸	250,000	2,330,000.00	1.15
7	000758	中色股份	103,300	1,537,104.00	0.76
8	601336	新华保险	25,000	1,305,250.00	0.65
9	601166	兴业银行	67,400	1,150,518.00	0.57
10	600172	黄河旋风	40,200	1,017,462.00	0.50

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	20,014,000.00	9.92
	其中:政策性金融债	20,014,000.00	9.92
4	企业债券	54,984,070.50	27.25
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	105,899,836.17	52.48
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	180,897,906.67	89.65

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	126018	08江铜债	556,350	54,984,070.50	27.25
2	113008	电气转债	248,500	34,210,995.00	16.95
3	150219	15国开19	200,000	20,014,000.00	9.92
4	132001	14宝钢EB	118,750	18,377,750.00	9.11
5	128009	歌尔转债	119,300	16,758,071.00	8.30

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国债期货交易情况说明
5.9.1 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。
5.9.2 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。
5.9.3 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。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1 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。
5.10.2 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。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	155,128.16
2	应收证券清算款	2,224,260.59
3	应收股利	-
4	应收利息	357,148.42
5	应收申购款	47,343.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,783,880.86

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	34,210,995.00	16.95
2	128009	歌尔转债	16,758,071.00	8.30
3	110031	航信转债	6,367,353.60	3.16
4	110030	格力转债	3,064,535.80	1.52
5	132001	14宝钢EB	18,377,750.00	9.11

5.10.5 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	600271	航天信息	6,131,268.00	3.04	重大资产重组停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富可转换债券A	汇添富可转换债券C
报告期期初基金份额总额	74,518,060.84	90,442,645.59
报告期期间基金总申购份额	5,618,155.41	6,973,054.64
减:报告期期间基金总赎回份额	16,199,712.26	20,014,525.06
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	63,936,503.99	77,401,175.17

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可转换债券债券型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富可转换债券债券型证券投资基金合同》;
3、《汇添富可转换债券债券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、报告期内汇添富可转换债券债券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

汇添富蓝筹稳健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	汇添富蓝筹稳健混合
交易代码	519066
前端交易代码	519066
后端交易代码	519067
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月8日
报告期末基金份额总额	379,054,719.34份
投资目标	通过投资于价值相对低估的蓝筹公司股票,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为灵活配置混合型基金,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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-4,315,392.24
2.本期利润	167,779,759.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.4525
4.期末基金资产净值	840,740,656.61
5.期末基金份额净值	2.218

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	25.10%	1.70%	10.66%	1.01%	14.44%	0.69%

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(2008年7月8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		
雷鸣	汇添富成长焦点混合基金、汇添富蓝筹稳健混合、汇添富新兴消费股票基金的基金经理。	2015年1月6日	-	8年	国籍:中国。学历:华中科技大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2007年6月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任行业分析师、高级行业分析师,2014年3月27日至今任汇添富成长焦点混合基金的基金经理,2015年1月6日至今任汇添富蓝筹稳健混合股票基金的基金经理,2015年12月2日至今任汇添富新兴消费股票基金的基金经理。

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

经历了三季度大幅调整后四季度市场迎来反弹。尽管市场再次上涨,但市场整体风格复制了二季度市场大跌前的走势,中小板和创业板涨幅居前,分别上涨30.3%、23.8%。

本季度组合操作上,在延续以往自下而上选股集中持有策略的同时,逐步兑现期间反弹幅度较大未来成长性不确定而估值水平超出理解的标的兑现收益。考虑到成长股再次出现整体泡沫化趋势,而中央经济工作会议定调2016年去产能,年底组合增加了部分低估值周期品种和价值股配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金2015年四季度实现收益率为25.1%,同期沪深300指数上涨16.5%。

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	632,045,108.19	74.49
	其中:股票	632,045,108.19	74.49
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	215,209,345.12	25.36
8	其他资产	1,280,030.13	0.15
9	合计	848,534,483.44	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	-	-
B	采矿业	21,280,000.00	2.53
C	制造业	379,289,241.99	45.11
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	32,406,000.00	3.85
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	86,572,238.20	10.30
J	金融业	112,497,628.00	13.38
K	房地产业	-	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	632,045,108.19	75.18

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	3,200,000	97,984,000.00	11.65
2	002127	新民科技	3,199,950	59,903,064.00	7.13
3	600585	海螺水泥	3,447,752	58,956,559.20	7.01
4	300324	旋极信息	1,000,024	49,251,182.00	5.86
5	600666	奥瑞德	749,993	35,429,669.32	4.21
6	300285	国瓷材料	700,000	31,850,000.00	3.79
7	600016	民生银行	3,000,000	28,920,000.00	3.44
8	601318	中国平安	800,000	28,800,000.00	3.43
9	300050	世纪鼎利	699,918	25,127,056.20	2.99
10	000333	美的集团	750,000	24,615,000.00	2.93

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。
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	676,780.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	40,564.45
5	应收申购款	562,684.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,280,030.13

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的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	97,984,000.00	11.65	重大事项停牌
2	300324	旋极信息	49,251,182.00	5.86	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	375,532,670.19
报告期期间基金总申购份额	97,957,689.93
减:报告期期间基金总赎回份额	94,435,640.78
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	379,054,719.34

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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,207,812.50
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,207,812.50
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.37

注:1、其中"申购/买入"含红利再投、转换入份额;"赎回/卖出"含转换出份额。
2、本基金于2008年7月8日成立。本公司于2015年7月6日用固有资金10,000,000.00元申购本基金份额5,207,812.50份,申购费用1,000.00元。符合招募说明书规定的申购费率。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
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蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金合同》;
3、《汇添富蓝筹稳健灵活配置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、报告期内汇添富蓝筹稳健灵活配置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

汇添富理财7天债券型证券投资基金

【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	汇添富理财7天债券
交易代码	471007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月29日
报告期末基金份额总额	574,142,201.12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127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	本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场型证券投资基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B
下属分级基金的交易代码	471007	472007
报告期末下属分级基金的份额总额	167,265,238.20份	167,265,962.92份

§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)	
	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B
1. 本期已实现收益	2,881,352.86	2,228,665.36
2. 本期利润	2,881,352.86	2,228,665.36
3. 期末基金资产净值	406,876,238.20	167,265,962.92

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

汇添富理财7天债券A

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	0.7756%	0.0055%	0.3403%	0.0000%	0.4353%	0.0055%

注:1、本表