汇添富增强收益债券型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

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	汇添富增强收益债券
交易代码	519078
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年3月6日
报告期末基金份额总额	603,268,695.67份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,主要投资于债券等固定收益类品种和其他低风险品种,力求为基金份额持有人谋求持续稳定的投资收益。
投资策略	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、不同类别债券利差水平研究,判断不同类别债券类属的相对投资价值,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	中债总指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。
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	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C
下属分级基金的交易代码	519078	470078
报告期末下属分级基金的份额总额	517,380,454.72份	85,888,240.95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1月1日－2015年3月31日)	
	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C
1.本期已实现收益	17,297,283.17	3,096,539.76
2.本期利润	11,655,394.33	1,913,805.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0212	0.0188
4.期末基金资产净值	606,794,611.07	99,033,559.97
5.期末基金份额净值	1.173	1.153

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

汇添富增强收益债券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	1.91%	0.16%	-0.56%	0.12%	2.47%	0.04%

汇添富增强收益债券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	1.77%	0.16%	-0.56%	0.12%	2.33%	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:1.本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2008年3月6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。

2.本基金自2009年9月15日起增加C类收费模式,该类别基金的累计份额净值增长率和业绩比较基准收益率自2009年9月15日起计算。

§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		
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、汇添富金额宝货币基金、汇添富收益快线货币基金、汇添富收益快线纯货币基金的基金经理,固定收益投资总监。	2008年3月6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:曾任上海中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4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日任汇添富体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1月20日任汇添富收益快线货币基金的基金经理,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日任汇添富金额宝货币基金的基金经理,2014年1月21日至2015年3月31日任汇添富收益快线货币基金的基金经理,2014年1月21日至2015年3月31日任汇添富收益快线货币基金的基金经理,2014年7月31日至今任汇添富增强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金融投资组合、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

一季度宏观经济基本面依然维持底部徘徊,前两个月工业增加值增长率降至6.8%,继续保持回落态势,投资、进口等数据也继续回落,显示内需增长继续放缓,通胀压力进一步减弱,一季度大宗商品价格继续下跌,NYMEX原油期货价格一度跌破43美元,国内铁矿石、动力煤等价格大幅下跌,生产资料价格通缩的趋势更加严重,CPI上涨1.4%,涨幅进一步收窄。为应对经济下滑和通胀回落,一季度货币政策进一步放松,央行在一季度先后降息、降准,公开市场回购利率水平也逐渐下调,政策趋中趋松的基调更加明确。同时,房地产政策也进一步松绑,对改善性需求的鼓励措施逐渐增加。一季度债券市场先扬后抑,1-2月份在宏观基本面数据偏弱、货币政策进一步放松的影响下债券收益率持续下降,10年期金融债收益率一度降至3.7%以下,收益率曲线非常平坦,进入2月下旬以后市场开始由强转弱,主要是受股票市场上涨、债券供给预期加大以及2月末央行降息政策落地以后市场对短期内进一步放松的预期减弱等因素影响,截止一季度末,10年期国债收益率回升至年初水平,10年期金融债收益率则比去年末上升了10-15bp,信用债表现略好于利率债,尤其是中等评级的信用债一季度收益率仍有20bp左右的涨幅,一季度中债综合指数上涨0.7%,信用债持有期回报明显高于利率债,短期债券收益率变化不大,本基金一季度及时降低了组合久期,减持了部分长期限利率债,增持了可转债,组合的杠杆也有所降低。

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1.91%,C级净值增长率为1.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度,全球流动性有望继续保持宽松,由于3月份以来美国就业市场改善速度放缓,市场对美联储加息的预期有所弱化,即便6月份开始加息,未来加息的频率也会较低,美元汇率有望从前期单边升值转为区间震荡,欧洲央行继续推行QE,全球股票市场的情绪可能维持高涨态势,大宗商品可能继续承压,从国内来看,二季度经济是否会纵向较性企稳值得关注,一方面,一季度银行信贷投放规模较高,中长期贷款增长较为明显,其中较大部分流向了前期积极财政政策推动的领域,而投市上涨以后的财富效应对消费也有一定的拉动作用;另一方面,房地产政策进一步放松以后,预计会取得短期的效果,对于刚需释放的积极作用将在二季度集中体现,但政策的中长期效果以及是否会增加开发商的投资意愿仍有待观察。总体上,我们判断经济在二季度继续筑底或小幅回升的可能性偏大,二季度物价受去年低基数和猪肉价格上涨等因素影响,涨幅将有所回升,CPI可能反弹至2%附近,货币政策趋中偏松的基调不会改变,在一季度降息和降准以后,二季度货币将进入观察期,再次降息的可能性不大,但如果外汇占款继续减少,降准仍有可能。从中长期来看,目前经济仍然处于结构调整的大周期之中,经济增速和物价偏低的"新常态"仍会在未来较长时间内存在,因此,宏观基本面对债券市场的支撑有较为坚实的基础,债券市场不存在明显的系统性风险。但在股票市场活跃和债券供给加大的影响下,债券市场仍可能面临的投性的压力。二季度债券收益率曲线有改位倒置的可能性较大,本管理人将坚持价值投资的理念,重视绝对收益目标,积极调整组合结构,控制组合下行风险,力争为投资者创造持续稳定的收益。

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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	893,303,671.35	92.59
	其中:债券	883,274,671.35	91.55
	资产支持证券	10,029,000.00	1.04
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	43,045,891.44	4.46
7	其他资产	28,452,749.65	2.95
8	合计	964,802,312.44	100.00

5.2 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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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	129,259,000.00	18.31
	其中:政策性金融债	129,259,000.00	18.31
4	企业债券	603,281,406.49	85.47
5	企业短期融资券	100,109,000.00	14.18
6	中期票据	-	-
7	可转债	50,625,264.86	7.17
8	其他	-	-
9	合计	883,274,671.35	125.14

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	011599007	15京昊华SCP001	300,000	30,081,000.00	4.26
2	140429	14农发29	300,000	30,009,000.00	4.25
3	140228	14国开28	300,000	29,415,000.00	4.17
4	124534	14渝中债	200,000	21,300,000.00	3.02
5	124763	14昆交发	200,000	20,880,000.00	2.96

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1489014	14开元1A	100,000	10,029,000.00	1.42

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

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:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.9.3 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。

5.10 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、处罚的情形。

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	34,379.70
2	应收证券清算款	9,120,742.87
3	应收股利	-
4	应收利息	18,847,378.73
5	应收申购款	450,248.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,452,749.65

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	110023	民生转债	15,099,700.00	2.14
2	110012	海运转债	5,692,757.60	0.81
3	113007	吉视转债	1,427,757.70	0.20
4	128008	齐峰转债	943,032.44	0.13

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C
报告期期初基金份额总额	452,898,193.50	47,050,282.61
报告期期间基金总申购份额	230,690,729.92	114,745,263.40
减:报告期期间基金总赎回份额	166,208,468.70	75,907,305.06
报告期期末基金份额总额	517,380,454.72	85,888,240.95

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:本报告期内本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》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富增强收益债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富增强收益债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富增强收益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、报告期内汇添富增强收益债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;

6、《关于汇添富基金旗下优势精选股票型证券投资基金分额持有人大会决议备案的回函》

7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 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

9.3 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
2015年4月21日

汇添富香港优势精选股票型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

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	汇添富香港优势精选股票(QDII)
交易代码	470888
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月25日
报告期末基金份额总额	61,390,358.74份
投资目标	在香港证券市场精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的公司股票等证券,通过有效的资产配置和组合管理,进行中长期投资市场,在有效管理风险的前提下,追求持续稳健的资本增值投资回报。
投资策略	本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中,根据宏观经济和证券市场状况,通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征,确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中,采用"自下而上"的策略,精选出具有持续竞争优势,且估值有吸引力的股票,精心科学构建股票投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:MSCI中华指数(MSCIZhongHuaIndex)
风险收益特征	本基金为投资于香港证券市场的主动股票型基金,属于证券投资基金中高收益高风险的品种。
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

注:根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金的基金管理人汇添富基金管理股份有限公司于2014年1月6日以现场方式召开了基金份额持有人大会,会议审议并通过了《将本基金变更为"汇添富香港优势股票型证券投资基金"的议案》(以下简称"持有人大会决议")。

中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")于2014年1月17日印发《关于汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2014]23号),持有人大会决议中国证监会备案手续完成,持有人大会决议生效,自2014年1月17日起,汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金变更为"汇添富香港优势股票型证券投资基金"(以下简称"本基金")。

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

名称	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		NY 10005

§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	1,025,714.00
2.本期利润	2,333,637.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0407
4.期末基金资产净值	67,097,095.27
5.期末基金份额净值	1.093

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。

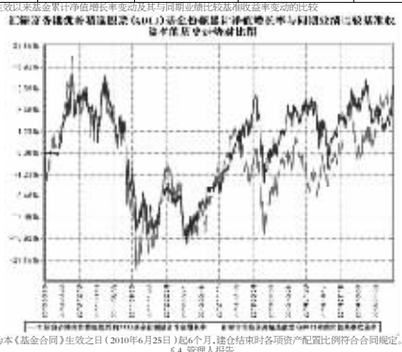
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.00%	0.77%	7.64%	0.77%	-3.64%	0.00%

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(2010年6月25日)起6个月,建仓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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王致人	汇添富香港优势精选股票基金的基金经理。	2010年6月25日	-	15年	国籍:中国台湾,学历:美国波士顿大学财务硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格、特许金融分析师(CFA)、财务风险经理人专(RM),从业经历:曾任日正企管顾问股份有限公司顾问,国票证券投资顾问股份有限公司研究员,美商Financial Science Incorporated研究员,2005年1月1日至2007年9月30日任美商AIG南山人寿亚太策略基金的基金经理,2005年12月1日至2007年9月30日任美商AIG南山人寿价差基金的基金经理,2006年6月1日至2007年9月30日任美商AIG南山人寿亚太不动产证券化基金的基金经理,2007年10月加入汇添富基金管理股份有限公司任国际投资副总监,2010年6月25日至今任汇添富香港优势精选股票基金(铁盒保名称为"汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金"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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要人员简介

注:本基金没有境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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金融投资组合、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。

4.4.2 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0.7484%,B级净值收益率为0.7714%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

产品特型后,本基金将在保持基金资产的低风险前提下,把握好组合流动性和收益性的平衡,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

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 转型后:

5.1.1 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	80,026,731.30	23.02
	其中:债券	80,026,731.30	23.02
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	32,670,169.01	9.40
	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	224,427,557.03	64.56
4	其他资产	10,493,737.93	3.02
5	合计	347,618,195.27	100.00

5.1.2 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	0.73
	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	-	-
	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%。

5.1.3 基金投资组合平均剩余期限

5.1.3.1 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	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	32

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本基金合同规定"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。

5.1.3.2 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	55.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	8.64	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	18.14	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	5.77	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	8.63	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	97.05	-

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	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	30,036,630.10	8.65
	其中:政策性金融债	30,036,630.10	8.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	49,990,101.20	14.39
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	80,026,731.30	23.04
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.1.5 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	140223	14国开23	200,000	20,033,661.24	5.77
2	071540002	15东吴证券CP002	200,000	19,996,978.57	5.76
3	041564010	15四矿集CP001	200,000	19,992,470.41	5.76
4	140430	14农发30	100,000	10,002,968.86	2.88
5	041554009	15北部湾CP001	100,000	10,000,652.22	2.88

5.1.6 "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	0.0067%
报告期内偏离度的最低值	-0.0174%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0037%

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。

5.1.8 投资组合报告附注

5.1.8.1

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。

5.1.8.2

本报告期内货币市场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。

5.1.8.3

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、处罚的情况。

5.1.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,815.19
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,037,591.76
4	应收申购款	8,424,561.65
5	其他应收款	-
6	待摊费用	25,769.33
7	其他	-
8	合计	10,493,737.93

5.2 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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
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	16,725,722.74	99.91
7	其他资产	14,766.76	0.09
8	合计	16,740,489.50	100.00

5.2.2 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。

5.2.3 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。

5.2.4 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。

5.2.5 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。

5.2.6 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。

5.2.7 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。

5.2.8 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。

5.2.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.9.1 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。

5.2.9.2 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。

5.2.9.3 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。

5.2.10 投资组合报告附注

5.2.10.1

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。

5.2.10.2

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。

5.2.10.3 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	2,904,151.56
3	应收股利	11,655.60
4	应收利息	267.36
5	应收申购款	5,148,313.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,064,387.86

5.2.10.4 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。

5.2.10.5 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未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富香港优势精选股票基金A	汇添富香港优势精选股票基金C
报告期期初基金份额总额	49,470,959.90	72.91
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	-	-
报告期期末基金份额总额	49,470,959.90	72.91

注:总申购份额含红利再投、转入份额,总赎回份额含转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本报告期内本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》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文