

## 汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)

### 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

基金管理人及基金托管人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。

基金管理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,也不保证基金资产净值不致发生较大波动。

基金有风险,投资者投资于本基金可能承担投资风险,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。  
本报告日期2015年1月1日起至3月31日止。

#### §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                          |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金名称       | 汇添富黄金及贵金属基金(QH4-LOF-FOF)                                                                                                 |
| 场内简称       | 富黄金                                                                                                                      |
| 交易代码       | 164701                                                                                                                   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                   |
| 基金合同生效日    | 2011年8月31日                                                                                                               |
| 报告期末基金份额总额 | 480,001,656.47份                                                                                                          |
| 投资目标       | 追求人民币计价的黄金及其贵金属价格升值,黄金、铂金等价格的主要升值,把握大宗商品价格中长期趋势变化和短期波动,通过上述资产下行业务,力争实现其他实物贵金属资产的公允价值与ETF,在严格控制风险的前提下,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。  |
| 投资范围       | 综合考虑国际国内经济、汇率、汇率、通胀、国家政策和利率等因素,贵金属市场供求等多方面因素,本基金资产配置于境外,持有实物黄金或其他实物贵金属资产,主要投资于境外黄金基金(ETF),在严格控制风险的前提下,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 业绩比较基准     | 伦敦黄金现货月日均收市价(伦敦黄金下午收盘后[London Gold Price PM Fix],人民币计价)收益率+人民币一年期定期存款利率(按日计提)×(1-管理费+托管费)×(1-销售服务费)×(1-其他费用)             |
| 风险收益特征     | 本基金为基金中基金,属于证券投资基金中较高风险品种,长期投资回报较高,预期风险水平与黄金价格相关。                                                                        |
| 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:本基金为LOF基金,在场内交易的简称称为“添富黄金”。

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目   | 境外资产托管人                         |
|------|---------------------------------|
| 名称   | Brown Brothers Harriman & Co.   |
| 中文   | 布朗兄弟哈里斯曼公司                      |
| 注册地  | 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

| 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      | -40,686,952.78            |
| 2.本期利润         | -11,062,823.01            |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0200                   |
| 4.期末基金份额净值     | 291,797,808.03            |
| 5.期末基金份额净值     | 0.608                     |

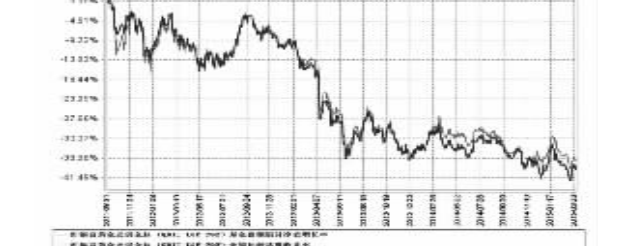
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。  
2.本基金业绩指标不包括有任何人对构成或基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现  
3.1 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3个月 0.00% 1.00% 1.20% 0.00% 2.00% 0.34%

3.2 自基金合同生效以来基金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《基金合同》生效之日起(2011年8月31日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

#### 4.1 基金管理人及基金托管人简介

| 姓名 | 职务                                                  | 任职日期       | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                              |
|----|-----------------------------------------------------|------------|------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 魏立 | 汇添富上证综合指数基金基金经理, 汇添富黄金及贵金属基金基金经理, 汇添富中证500ETF基金基金经理 | 2012年11月1日 | -    | 8年     | 国籍:中国,学历:北京大学中国经济研究中心金融学硕士,相关业务:证券投资,基金投资,从证券行业从业10年,曾任汇添富基金管理股份有限公司基金经理,2009年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,2011年11月担任汇添富上证综合指数基金基金经理,2012年11月担任汇添富黄金及贵金属基金基金经理,2014年11月担任汇添富中证500ETF基金基金经理,2015年1月4日担任汇添富黄金及贵金属基金基金经理,2015年1月4日担任汇添富中证500ETF基金基金经理。 |

注:1.本基金的基金经理魏立,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据《基金合同》约定的解聘日期。  
2.非汇添富基金基金经理,其“任职日期”为“离任日期”分别为根据《基金合同》约定的聘任日期和解聘日期。

3.基金从业年限的计算方法(《证券投资基金法》和《证券投资基金销售管理办法》的相关规定)。

4.2 境外投资顾问和境外资产托管人的主要业务简介

4.3 报告期末基金资产净值变动情况

4.4 报告期末基金资产净值变动情况

4.5 报告期末基金资产净值变动情况

4.6 报告期末基金资产净值变动情况

4.7 报告期末基金资产净值变动情况

4.8 报告期末基金资产净值变动情况

4.9 报告期末基金资产净值变动情况

4.10 报告期末基金资产净值变动情况

4.11 报告期末基金资产净值变动情况

4.12 报告期末基金资产净值变动情况

4.13 报告期末基金资产净值变动情况

4.14 报告期末基金资产净值变动情况

4.15 报告期末基金资产净值变动情况

4.16 报告期末基金资产净值变动情况

4.17 报告期末基金资产净值变动情况

4.18 报告期末基金资产净值变动情况

4.19 报告期末基金资产净值变动情况

4.20 报告期末基金资产净值变动情况

4.21 报告期末基金资产净值变动情况

4.22 报告期末基金资产净值变动情况

4.23 报告期末基金资产净值变动情况

4.24 报告期末基金资产净值变动情况

4.25 报告期末基金资产净值变动情况

4.26 报告期末基金资产净值变动情况

4.27 报告期末基金资产净值变动情况

4.28 报告期末基金资产净值变动情况

4.29 报告期末基金资产净值变动情况

4.30 报告期末基金资产净值变动情况

4.31 报告期末基金资产净值变动情况

4.32 报告期末基金资产净值变动情况

4.33 报告期末基金资产净值变动情况

4.34 报告期末基金资产净值变动情况

4.35 报告期末基金资产净值变动情况

4.36 报告期末基金资产净值变动情况

4.37 报告期末基金资产净值变动情况

4.38 报告期末基金资产净值变动情况

4.39 报告期末基金资产净值变动情况

4.40 报告期末基金资产净值变动情况

4.41 报告期末基金资产净值变动情况

4.42 报告期末基金资产净值变动情况

4.43 报告期末基金资产净值变动情况

4.44 报告期末基金资产净值变动情况

4.45 报告期末基金资产净值变动情况

4.46 报告期末基金资产净值变动情况

4.47 报告期末基金资产净值变动情况

4.48 报告期末基金资产净值变动情况

4.49 报告期末基金资产净值变动情况

4.50 报告期末基金资产净值变动情况

4.51 报告期末基金资产净值变动情况

4.52 报告期末基金资产净值变动情况

4.53 报告期末基金资产净值变动情况

4.54 报告期末基金资产净值变动情况

4.55 报告期末基金资产净值变动情况

4.56 报告期末基金资产净值变动情况

4.57 报告期末基金资产净值变动情况

4.58 报告期末基金资产净值变动情况

4.59 报告期末基金资产净值变动情况

4.60 报告期末基金资产净值变动情况

相对较差,美元贬值有所削弱部分外流压力,黄金价格短期承压;二是欧元区经济有所好转,但通胀情况仍没有明显好转,在低通胀环境下,黄金价格仍将保持较高水平;三是欧元区经济有所好转,但通胀情况仍没有明显好转,在低通胀环境下,黄金价格仍将保持较高水平。

基金管理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,也不保证基金资产净值不致发生较大波动。

基金有风险,投资者投资于本基金可能承担投资风险,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。  
本报告日期2015年1月1日起至3月31日止。

#### §3 投资组合报告

| 序号  | 项目          | 金额(人民币元)       | 占基金资产净值的比例(%) |
|-----|-------------|----------------|---------------|
| 1   | 权益投资        | -              | -             |
| 1.1 | 其中:普通股      | -              | -             |
| 1.2 | 优先股         | -              | -             |
| 1.3 | 存托凭证        | -              | -             |
| 2   | 基金投资        | 238,652,480.90 | 78.67         |
| 3   | 固定收益投资      | -              | -             |
| 3.1 | 其中:债券       | -              | -             |
| 3.2 | 资产支持证券      | -              | -             |
| 4   | 基金投资        | 7,335,000.00   | 2.42          |
| 5   | 资产支持证券      | 7,335,000.00   | 2.42          |
| 6   | 其他资产        | 2,960,270.12   | 0.98          |
| 7   | 其中:买入返售金融资产 | 56,168,353.11  | 18.52         |
| 8   | 其他资产        | 30,345,104.14  | 10.09         |

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

注:1.本基金本报告期末未持有境外股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注:1.本基金本报告期末未持有股票。

5.4 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及存托凭证投资明细

注:1.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按市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:1.本基金本报告期末未持有股票。

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五名基金投资明细

注:1.本基金本报告期末未持有基金。

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基金投资明细

注:1.本基金本报告期末未持有基金。

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基金投资明细

注:1.本基金本报告期末未持有基金。

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五名基金投资明细

| 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  | IFPS PHYSICAL GOLD FUND | ETF基金 | 契约型开放式 | State Street Bank and Trust Company  | 36,046,155.99 | 12.35        |
| 2  | IFPS PHYSICAL GOLD FUND | ETF基金 | 契约型开放式 | State Street Bank and Trust Company  | 35,497,616.46 | 12.17        |
| 3  | SHIHARS GOLD FUND       | ETF基金 | 契约型开放式 | Black Rock Fund Advisors             | 35,140,000.00 | 12.05        |
| 4  | IFPS GOLD TRUST         | ETF基金 | 契约型开放式 | IFPS Securities US (LLC)             | 34,864,109.95 | 11.95        |
| 5  | SPDR GOLD TRUST         | ETF基金 | 契约型开放式 | State Street Bank and Trust Company  | 33,509,877.10 | 11.48        |
| 6  | SPDR PHYSICAL GOLD FUND | ETF基金 | 契约型开放式 | State Street Bank and Trust Company  | 31,817,475.48 | 10.91        |
| 7  | USF ETF GOLD            | ETF基金 | 契约型开放式 | USF Fund Management (Switzerland) AG | 31,719,143.52 | 10.87        |

注:1.本基金“公允价值(人民币元)”所示数据单位为“人民币元”,因为人民币交易不发生交易金额的变动,所以不存在交易金额的公允价值。

2.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

3.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

4.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

6.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

7.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

8.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

9.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

10.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

11.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

12.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

13.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

14.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

15.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

16.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

17.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

18.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

19.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

20.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

21.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

22.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

23.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

24.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

25.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

26.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

27.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

28.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

29.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

30.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

31.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

32.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

33.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

34.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

35.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

36.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

37.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

38.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

39.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

40.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

41.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

42.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

43.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

44.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

45.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

46.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

47.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

48.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

49.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

50.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

51.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

52.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

53.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

54.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

55.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

56.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

57.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

58.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

59.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

60.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

61.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

62.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

63.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

64.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

65.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

66.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

67.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

68.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

69.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

70.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

71.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

72.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

73.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

74.本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

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

基金管理人及基金托管人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。

基金管理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,也不保证基金资产净值不致发生较大波动。

基金有风险,投资者投资于本基金可能承担投资风险,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。  
本报告日期2015年1月1日起至3月31日止。

|            |                                                         |
|------------|---------------------------------------------------------|
| 基金名称       | 汇添富环保行业股票型证券投资基金                                        |
| 场内简称       | 添环保                                                     |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                  |
| 基金合同生效日    | 2014年9月16日                                              |
| 报告期末基金份额总额 | 4,144,460,920.78份                                       |
| 投资目标       | 本基金采用自上而下的策略,以基本面分析为立足点,主要投资于环保行业的优质上市公司,力争实现基金资产的长期增值。 |