汇添富社会责任混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	汇添富社会责任混合
交易代码	470028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月29日
报告期末基金份额总额	2,284,592,313.28份
投资目标	精选积极履行社会责任,并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司,谋求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金,本基金投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略,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;个股精选策略用于挖掘积极履行社会责任的优质上市公司,以谋求基金资产稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80% + 中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,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	中国农业银行股份有限公司

§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	679,443,610.83
2.本期利润	1,295,891,007.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.6231
4.期末基金资产净值	4,832,826,711.87
5.期末基金份额净值	2.115

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。

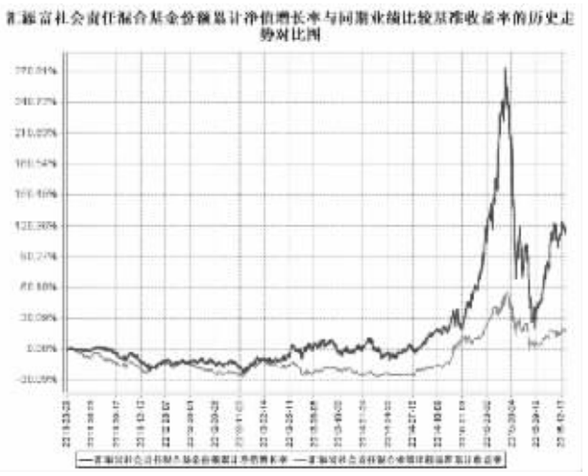
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	48.32%	2.54%	13.76%	1.34%	34.56%	1.20%

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3月29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		
欧阳沁春	汇添富社会责任混合基金、汇添富移动互联股票基金的基金经理。	2014年8月26日	-	14年	国籍:中国,学历:卫生部武汉生物制品研究所医学硕士、中欧国际工商学院工商管理硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任卫生部武汉生物制品研究所助理研究员、中国网络《百鹤大》有限公司项目经理、大成基金管理有限公司行业研究员、国联安基金管理有限公司行业研究员,2006年9月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任高级行业分析师、基金经理助理,2007年6月18日至2012年3月2日任汇添富均衡增长混合基金的基金经理,2011年3月29日至今任汇添富社会责任混合基金的基金经理,2014年8月26日至今任汇添富移动互联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,并贯穿办工授权、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

2015年四季度的A股市场大幅度反弹,上证指数上涨15.93%,创业板指数上涨30.32%。市场表现分化依然十分明显,传媒和娱乐等细分市场的投资主题表现十分出色,大数据和云计算等部分股票创出历史新高,价值类资产整体表现比较平淡。

我们在四季度逐步调整了投资结构,加大了投资力度,社会责任基金投资一直遵循个股适度集中,行业相对均衡配置的原则,在行业配置方面,我们在互联网各个相关的行业做了一定的布局;我们也重点配置了传媒行业。我们把握了核电和军工等方面的主题投资机会,取得了不错收益。我们在医疗信息化方面的投资也取得了比较满意的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

四季度本基金收益率48.32%,同期业绩比较基准收益率13.76%。

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	4,009,220,027.66	80.70
	其中:股票	4,009,220,027.66	80.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	54,532.80	0.00
	其中:债券	54,532.80	0.00
	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	936,587,366.67	18.85
8	其他资产	21,899,887.47	0.44
9	合计	4,967,761,814.60	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	-	-
C	制造业	1,826,135,555.95	37.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	338,748,992.05	7.01
F	批发和零售业	306,203,466.42	6.34
G	交通运输、仓储和邮政业	32,339,805.96	0.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,235,139,114.74	25.56
J	金融业	90,442,470.57	1.87
K	房地产业	59,800,692.32	1.24
L	租赁和商务服务业	28.40	0.00
M	科学研究和技术服务业	2,000,664.00	0.04
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	77.22	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	758,945.75	0.02
S	综合	117,650,214.28	2.43
	合计	4,009,220,027.66	82.96

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	002175	东方网络	5,063,391	305,119,941.66	6.31
2	300113	顺网科技	2,089,859	211,849,006.83	4.38
3	600498	烽火通信	7,190,517	205,001,639.67	4.24
4	300147	香雪制药	8,053,854	201,426,888.54	4.17
5	300168	万达信息	5,679,982	188,177,803.66	3.89
6	002717	岭南园林	4,028,632	176,856,944.80	3.66
7	300333	兆日科技	3,516,341	168,784,368.00	3.49
8	000831	五矿稀土	8,006,690	165,738,483.00	3.43
9	300010	立思辰	4,000,704	127,622,457.60	2.64
10	300379	东方通	1,037,888	127,338,478.72	2.63

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	54,532.80	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	54,532.80	0.00

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	110031	航信转债	420	54,532.80	0.00

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 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

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:本基金本报告期末无国债期货持仓。

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	6,462,193.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	162,499.45
5	应收申购款	15,275,194.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,899,887.47

5.11.4 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	110031	航信转债	54,532.80	0.00

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	300010	立思辰	127,622,457.60	2.64	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	1,780,720,395.34
报告期期间基金总申购份额	1,968,783,897.93
减:报告期期间基金总赎回份额	1,464,911,979.99
报告期期末基金份额总额	2,284,592,313.28

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社会责任混合型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富社会责任混合型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富社会责任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、报告期内汇添富社会责任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

深证300交易型开放式指数证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12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: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	汇添富深证300ETF
场内简称	深300ETF
交易代码	159912
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月16日
报告期末基金份额总额	55,948,991.00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	本基金主要采取完全复制法。正常情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%,年跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	深证300指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、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,紧密跟踪标的指数,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	-2,878,239.08
2.本期利润	19,020,421.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.3314
4.期末基金资产净值	86,931,539.99
5.期末基金份额净值	1.5538

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。

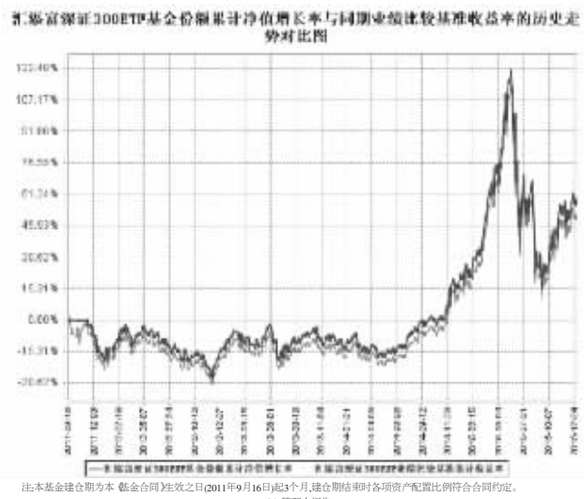
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	25.76%	2.03%	25.42%	2.03%	0.34%	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(2011年9月16日)起3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		
赖中立	汇添富黄金及贵金属基金《LOF》的基金经理、汇添富恒生指数分级《QDII》基金、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富香港优势精选混合基金的基金经理。	2015年1月6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,相关业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属基金《LOF》的基金经理,2014年3月6日至今任汇添富恒生指数分级《QDII》基金的基金经理,2015年1月6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,2015年5月26日至今任汇添富香港优势混合基金的基金经理。
过蓓蓓	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。	2015年8月18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,并贯穿办工授权、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。

本基金在报告期内遵循了ETF基金的被动投资原则,保持了指数基金的本质属性,股票投资仓位在考察期内始终保持在95%-100%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。本基金日常管理中非常重视风险管理,对股票和现金头寸严格管理、实时监控,基本实现了ETF平稳运作管理的目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内深证300指数上涨25.42%,本基金在报告期内累计收益率为25.76%,收益率超越业绩比较基准0.34%。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0.0220%,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	85,281,096.35	97.78
	其中:股票	85,281,096.35	97.78
2	固定收益投资	13,600.00	0.02
	其中:债券	13,600.00	0.02
	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	1,842,680.01	2.11
7	其他资产	79,461.75	0.09
8	合计	87,216,838.11	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	911,578.76	1.05
B	采矿业	1,264,040.28	1.45
C	制造业	45,614,812.15	52.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,599,711.02	1.84
E	建筑业	1,208,503.33	1.39
F	批发和零售业	2,339,010.19	2.69
G	交通运输、仓储和邮政业	100,836.76	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,588,810.57	12.18
J	金融业	6,955,475.42	8.00
K	房地产业	7,611,671.73	8.76
L	租赁和商务服务业	2,182,922.89	2.51
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,628,679.38	1.87
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	368,359.58	0.42
R	文化、体育和娱乐业	2,504,110.89	2.88
S	综合	402,573.40	0.46
	合计	85,281,096.35	98.10

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	000002	万科A	157,698	3,852,562.14	4.43
2	000651	格力电器	79,548	1,777,897.80	2.05
3	000001	平安银行	110,284	1,322,305.16	1.52
4	000725	京东方A	412,208	1,224,257.76	1.41
5	000333	美的集团	35,838	1,176,203.16	1.35
6	300104	乐视网	17,873	1,050,932.40	1.21
7	300059	东方财富	19,578	1,018,643.34	1.17
8	000776	广发证券	50,692	985,959.40	1.13
9	002024	苏宁云商	72,925	980,841.25	1.13
10	000858	五粮液	30,868	842,079.04	0.97

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

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	13,600.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,600.00	0.02

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	123001	蓝标转债	136	13,600.00	0.02

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 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

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

5.11.2

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	4,589.96
2	应收证券清算款	74,497.91
3	应收股利	-
4	应收利息	373.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,461.75

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 报告期末按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	3,852,562.14	4.43	重大资产重组停牌
2	300104	乐视网	1,050,932.40	1.21	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	60,748,991.00
报告期期间基金总申购份额	11,200,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	16,000,000.00
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	55,948,991.00

§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、中国证监会批准深证300交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

2、《深证300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3、《深证300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、报告期内深证300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

汇添富上证综合指数证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12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: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	汇添富上证综合指数
交易代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月1日
报告期末基金份额总额	1,414,386,675.29份
投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于6%,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性,主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%且年化跟踪误差小于6%的投资目标。
业绩比较基准	上证综合指数收益率×95% + 银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,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	7,784,869.60
2.本期利润	220,723,240.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.1510
4.期末基金资产净值	1,607,876,385.06
5.期末基金份额净值	1.137

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 |
|---|---|---|---|---|---