

汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资 基金 2015 年第 4 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天数的，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

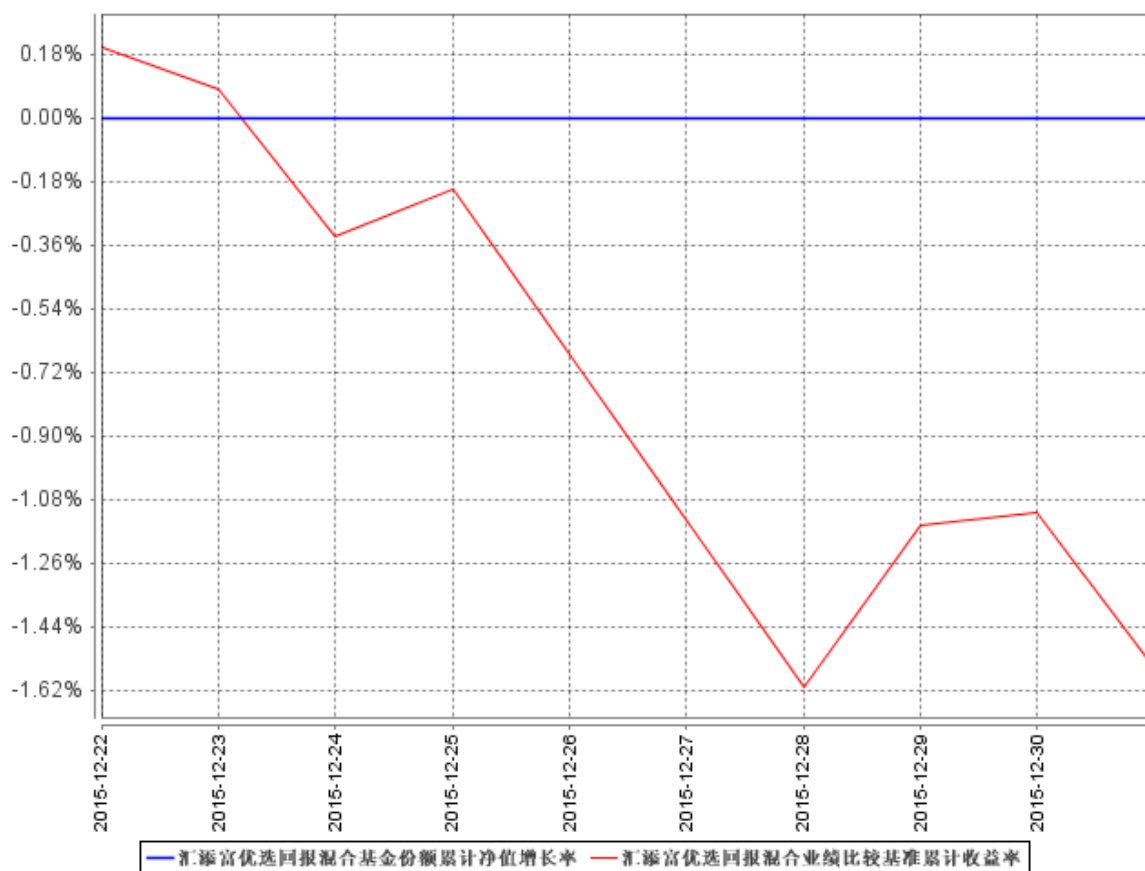
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④

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。本表列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

汇添富优选回报混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

汇添富理财 21 天债券发起式 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	0.5658%	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，本表列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。

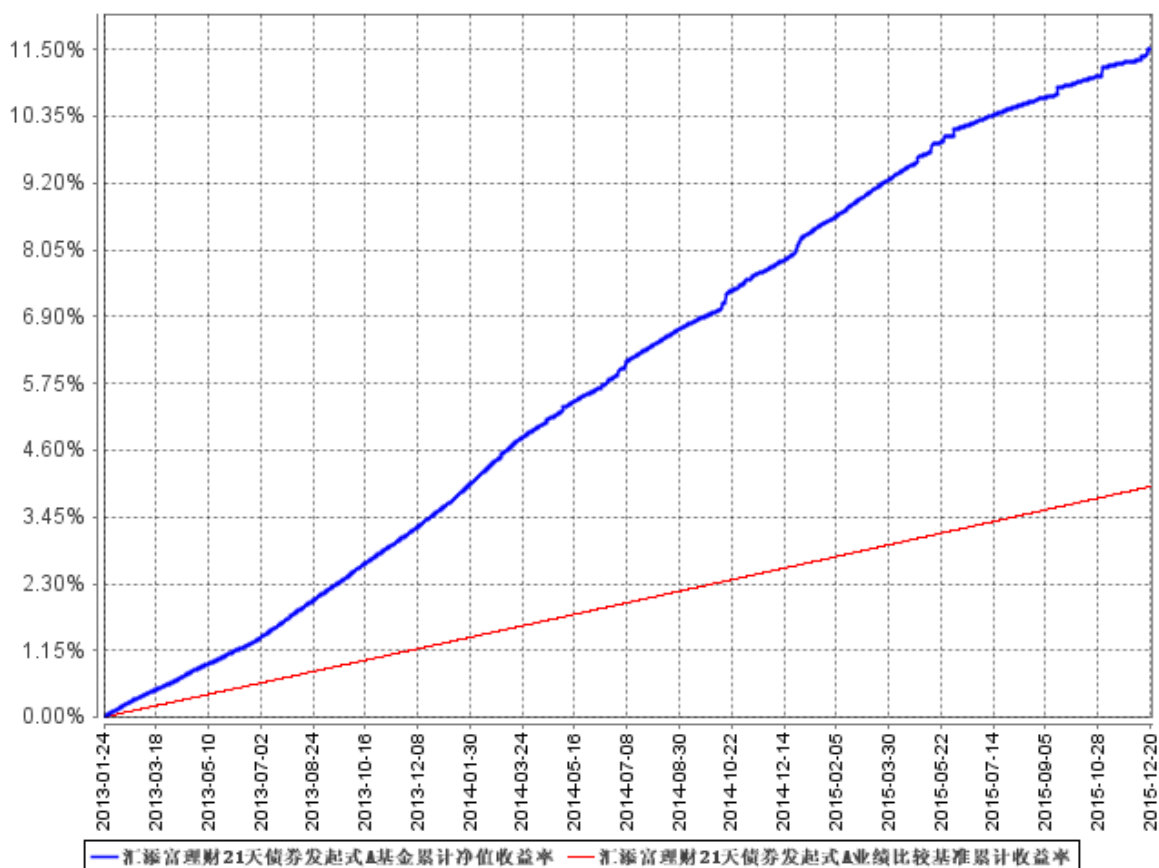
汇添富理财 21 天债券发起式 B

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	0.6320%	0.0175%	0.3033%	0.0000%	0.3287%	0.0175%

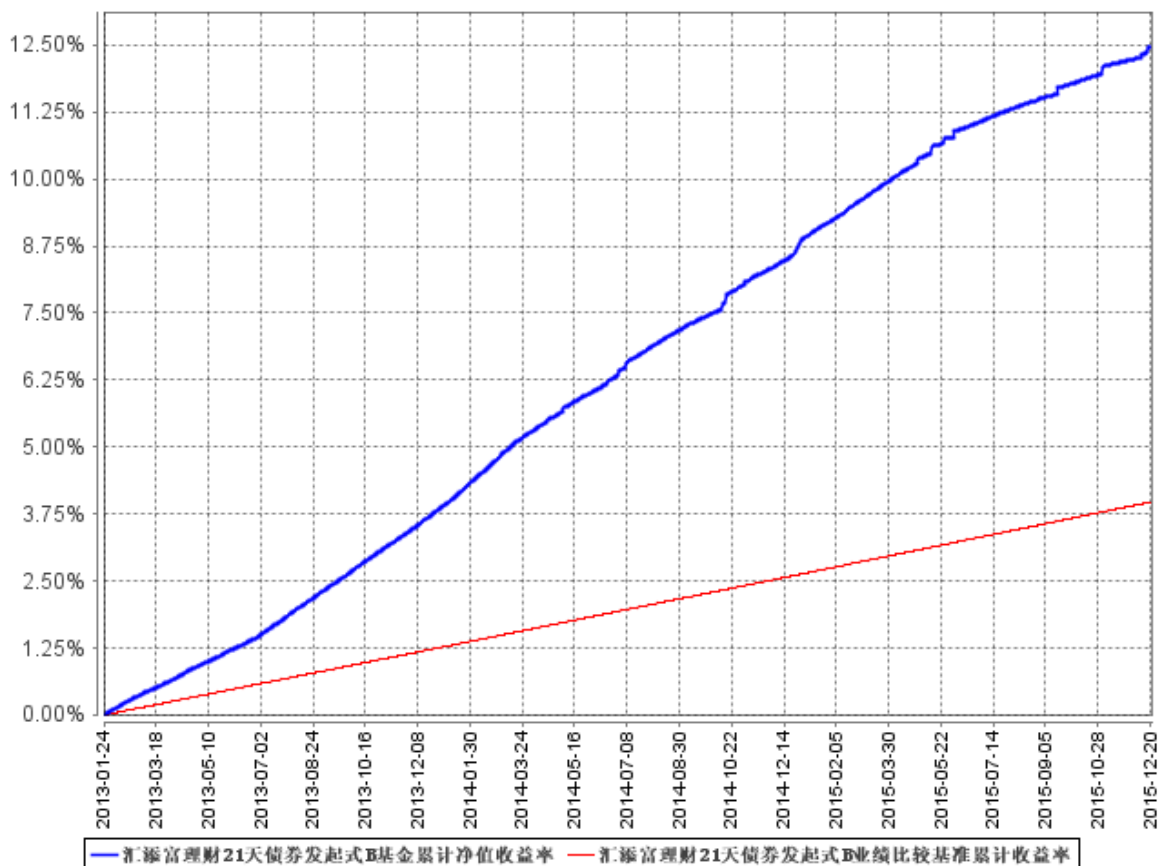
注：汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金从 2015 年 12 月 22 日起正式转型为汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金，本表列示的是本报告期基金转型前的基金净值表现，转型前基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

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

汇添富理财 21 天债券发起式 A 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富理财21天债券发起式B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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	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

	益债券、实业债债券基金的基金经理助理。				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交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交

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

四季度宏观经济基本面仍无好转，工业增加值继续探底，固定资产投资仍在 10% 附近的增长率徘徊，进出口数据有所修复，但对经济拉动作用有限。央行在货币政策上继续推行积极的放松措施，包括“双降”，下调公开市场操作的利率等，四季度债市涨势较好，其中 10 年金融债由 3.7% 大幅下行 60 个基点至 3.1% 左右，创全年新低。

本基金在 12 月 22 日正式转型为混合基金，在此之前仍然按照 21 天短期理财基金运作。受组合规模过低、定存和现券收益下降的影响，组合收益率逐步走低。今年债券市场信用风险事件频发，并伴随大面积的债券评级下调，因此本基金在债券配置上更为谨慎，组合持仓以 AA-AA+ 等中高等级品种为主，提高了组合的流动性和安全性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型后，自基金合同生效日（2015 年 12 月 22 日）至今，汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的净值增长率为 0.00%，业绩比较基准收益率为 -1.56%。

转型前，自 2015 年 10 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日止，原汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 A 级份额的净值收益率为 0.5658%，C 级份额的净值收益率为 0.6320%，业绩比较基准收益率为 0.3033%。

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 投资组合报告（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	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未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	30

注：上表中“报告期末”指 2015 年 12 月 21 日。

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：本基金合同约定：“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 141 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.2.3.2 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	80.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	19.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)-397 天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.12	-

注：上表中“报告期末”指 2015 年 12 月 21 日。

5.2.4 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	9,996,870.46	19.49
	其中：政策性金融债	9,996,870.46	19.49
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	9,996,870.46	19.49
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中“报告期末”指 2015 年 12 月 21 日。

5.2.5 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	150413	15 农发 13	100,000	9,996,870.46	19.49

注：上表中“报告期末”指 2015 年 12 月 21 日。

5.2.6 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1979%
报告期内偏离度的最低值	0.0023%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1067%

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。

5.2.8 投资组合报告附注

5.2.8.1

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。

5.2.8.2

本报告期内本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。

5.2.8.3

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、处罚的情形。

5.2.9 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	应收利息	178,097.06
4	应收申购款	-

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	178,097.06

§ 6 开放式基金份额变动

6.1 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2015年12月22日）基金份额总额	50,456,789.36
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,444,398.34
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	447,913.98
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	51,453,273.72

6.2 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	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
报告期期初基金份额总额	48,775,755.10	42,072,306.69
报告期期间基金总申购份额	22,060,494.50	60,339,601.00
减：报告期期间基金总赎回份额	55,849,319.42	66,097,147.79
报告期期末基金份额总额	14,986,930.18	36,314,759.90

注：总申购份额含红利再投份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期初管理人持有的本基金份额	11,247,092.17
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	11,247,092.17

报告期期末持有的本基金份额占基金总额比例 (%)	21.86
--------------------------	-------

注：1、其中“申购/买入”含红利再投份额。

2、原汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金于 2013 年 1 月 24 日成立。在基金募集期间，本公司于 2013 年 1 月 22 日用自有资金 10,000,000.00 元认购汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 B 级份额 10,000,000.00 份，无认购费用，符合招募说明书规定的认购费率，且认购的基金份额持有期限不低于三年。自 2013 年 1 月 24 日至 2015 年 12 月 21 日止，本公司持有的 B 级份额累计获得分红 1,247,092.17 元。2015 年 12 月 22 日，汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金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。

7.1.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期内未运用自有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用自有资金投资本基金情况（转型前）

7.2.1 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人自有资金	11,247,092.17	21.92	10,000,000.00	19.49	认购的基金份额持有期限不低于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,247,092.17	21.92	10,000,000.00	19.49	认购的基金份额持有期限不低于三年

7.2.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期内未运用自有资金投资本基金。

§ 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选回报灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 5、《汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件；
- 9、报告期内汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金和汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告。

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