

汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金(LOF) 2018年度报告摘要

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2019年03月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证全指证券公司指数(LOF)
基金主要代码	500407
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2017年12月14日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额(单位：份)	139,159,249.72份
基金合同存续期间	不定期
基金类别	上证证券交易所
上市日期	2018年1月18日
下属分级基金的基本信息	汇添富中证全指证券公司指数(LOF) A 汇添富中证全指证券公司指数(LOF) C
下属分级基金的场内简称	全指证券
下属分级基金的场内代码	500407 600408
基金类别	股票型基金
基金规模	90,400,341.51份 48,758,908.21份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争在扣除管理费后的净值增长率超过0.35%，跟踪误差不超过0.3%。
投资策略	本基金采用指数化投资策略，按照标的指数的构成比例及权重投资于成份股、现金类资产以及权证等金融工具，同时通过定期调整和不定期的临时调整，对基金的资产配置进行适当的调整，以期获得与标的指数相一致的回报。对于标的指数成份股的调整，本基金将根据调整方案，对成份股的头寸进行适当的调整，以使基金的头寸符合新的成份股的配置要求。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率×95%+人民币银行存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为投资者提供较高的资金增值与风险回报。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中信建投证券股份有限公司
住所	上海市	朱光明
法定代表人	赵栩嘉	3008-088-108
联系人	客户服务部	service@zfxfund.com
客户服务电话	4000-888-9918	955571
传真	021-28020008	010-61300075

2.4 信息披露方式

基金份额年度报告的管理人互联网网址	www.zfxfund.com
基金份额年度报告的地点	上海市嘉定区弓箭路1号国际大陆20楼 汇添富基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间	2010年初	2017年12月31日	基金合同生效日—2017年12月31日
本期初净资产	-697,091.62	-3,128.40	137,736.27
本期末净资产	-16,641,991.07	-3,240,820.08	-1,030,360.40
加权平均基金份额净值	-0.4237	-0.0769	-0.0111
本期基金份额变动率	-20.76%	-30.81%	-1.11%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	
期末可供分配利润	-0.2766	-0.0264	-0.0111
期末可供分配利润	60,495,182.85	35,262,335.05	91,472,281.40
期末可供分配利润净额	0.7344	0.0726	0.0889

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利润。

2.上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(例如：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.期初可供分配利润采用期末资产净值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 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准为“中证全指证券公司指数(LOF)A”。

注：本基金业绩比较基准为“中证全指证券公司指数(LOF)C”。

注：本基金合同生效以来基金份额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对比图

注：本基金合同生效以来基金每年净值增长率率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金合同生效以来基金每年净值增长率率及其与同期业绩比较基准收益率的比较