# 汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金 2016年年度报告摘要

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2017 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示

1.1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 3 月 27 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 2016 年 7 月 27 日(基金合同生效日)起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富沪港深新价值股票 |
| 基金主代码 | 001685 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年7月27日 |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,613,296,308.34份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金精选相对低估的优质企业进行中长期投资,采用自下而上的投资方法,以基本面分析为立足点,在科学严格管理风险的前提下,谋求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个股精选策略。其中,在资产配置中,在综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素的基础上,结合全球宏观经济形势,研判国内外经济的发展趋势,并在严格控制投资组合风险的前提下,对投资组合中股票、债券、货币市场工具盘法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种进行战略配置和动态调整,以规避或分散市场风险;在股票投资中,采取"自下而上"的策略,优选价值相对低估的优质公司股票构建投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得长期持续稳健的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×60%+恒生指数收益率×(使用估值汇率折算)×20%+中债综合指数收益率×20% |
| 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预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 |

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李鹏 | 田静 |
| | 联系电话 | 021-28932888 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | service@99fund.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-9918 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-28932998 | 010-66275853 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.99fund.com |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |

## § 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 期间数据和指标 | 2016年7月27日(基金合同生效日)-2016年12月31日 |
|---|---|
| 本期已实现收益 | -5,564,617.46 |
| 本期利润 | -26,110,669.88 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0282 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.70% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0075 |
| 期末基金资产净值 | 1,641,044,015.33 |
| 期末基金份额净值 | 1.017 |

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.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润中已实现部分的孰低数。

4.本基金的(基金合同)生效日为 2016 年 7 月 27 日,至本报告期末未满一年,故表中只列示基金合同生效日至 2016 年 12 月 31 日期间的数据。

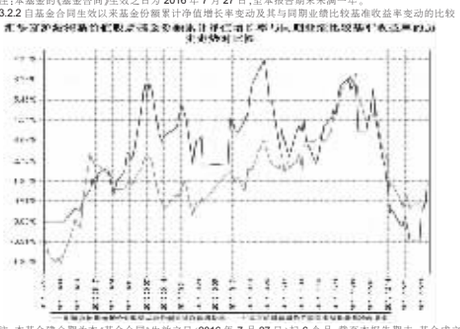
3.2 基金净值表现

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

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -4.15% | 0.83% | -4.69% | 0.60% | 0.54% | 0.23% |
| 过去三个月 | -0.78% | 0.75% | 0.24% | 0.56% | -1.02% | 0.19% |
| 自基金合同生效日起至今 | 1.70% | 0.70% | 1.12% | 0.57% | 0.58% | 0.13% |

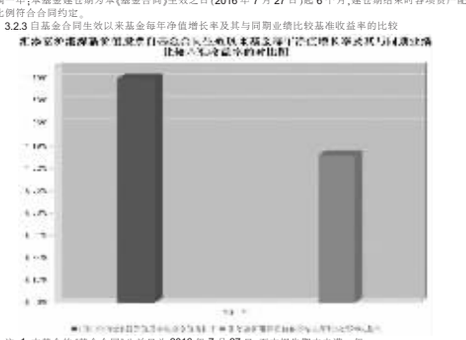
注:本基金的(基金合同)生效之日为 2016 年 7 月 27 日,至本报告期末未满一年。

3.2.2 自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比较



注:本基金建仓期为本(基金合同)生效之日(2016 年 7 月 27 日)起 6 个月,截至本报告期末,基金成立未满一年,本基金建仓期为本(基金合同)生效之日(2016 年 7 月 27 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。

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



注:1.本基金的(基金合同)生效日为 2016 年 7 月 27 日,至本报告期末未满一年。

2.合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金成立于 2016 年 7 月 27 日(基金合同生效日),2016 年 7 月 27 日(基金合同生效日)起至 12 月 31 日止期间未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司成立于 2005 年 2 月,总部设在上海陆家嘴,公司旗下设立了北京、南方、上海虹桥机场及成都四个分公司,以及两个子公司—汇添富资产管理(香港)有限公司 (China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited)和汇添富资本管理有限公司。

汇添富是中国第一批获得 QDII 业务资格、专户业务资格、设立海外子公司并且获得 RQFII 业务资格的基金公司,同时是全国社会保障基金投资管理人,基本养老保险基金委托投资管理人,截至目前,汇添富已经构建起公募、专户、社保基金、养老金、国际业务等投融资业务以及互联网金融业务协同发展的统一的资产管理服务平台。

汇添富始终坚持"以企业基本分析为立足点,挑选高质量的证券,把握市场脉络,做中长期投资市局,以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益"这一长期价值投资理念,并在投资研究中坚定有效地贯彻和执行。2016 年,汇添富保持了优秀的投资业绩:截至 2016 年年底,汇添富基金旗下权益主动管理型基金过去 5 年平均收益率 139%,在大型基金公司中持续排名第一(数据来源:银河证券基金研究中心)。优秀的投资业绩获得了行业高度认可。2016 年,公司先后获得"年度十大明星基金公司"、"五年持续回报明星基金公司"、"金基金·TOP 公司"等多项荣誉;汇添富民营活力、汇添富价值精选、汇添富全额宝获得"金牛基金"大奖。

2016 年,汇添富基金新发 16 只基金,包括 2 只股票型基金、5 只指数基金、3 只债券型基金、4 只货币基金、以及 2 只混合型基金。其中,上海国企 ETF 首募规模达 152 亿元,位居今年所有权益类产品发行规模首位。全年,公司公募基金产品达到 75 只,涵盖权益、固定收益、混合、灵活配置、指数、货币基金等风险程度和预期收益从高到低的各类产品,为投资者提供更加全面的资产配置选择。

2016 年,汇添富基金在规范电子商务运作的基础上,陆续完成安全中心体系、快捷支付渠道及新版手机 APP 建设,加强优化客户体验,提升客户服务能力。公司电子商务平台保有规模排名行业前列。

2016 年,汇添富基金稳步推行大机构战略,截至年底,公司机构理财总部保有规模达 2250 亿元。12 月,公司成功竞获基本养老保险基金管理人资格,未来将为做好做大养老金投资业务而努力。

2016 年,公司积极开展渠道销售和培训工作。优秀的投资业绩、专业的投顾服务以及良好的渠道维护口碑带来了汇添富品牌在渠道影响力的显著提升。在传统大中型银行和券商渠道的基础上,公司进一步拓展了中小型银行及券商渠道,助力新基金发行。2016 年,公司所有新发基金规模在同期同类新基金中排名均位居前列。公司大力开展"汇定投·汇添富"系列定投推广活动,营销培训活动拓展到银行和券商的网点、营业部,全力打造汇添富定投品牌。

2016 年,汇添富基金继续提升客户服务能力,全方位优化客户服务体系。公司通过完善大客户平台建设,搭建了集括投顾式服务、理财基金、高端客户、现金宝的全新客服体系,为公司各项销售业务提供全方位支持。

2016 年,香港子公司的国际业务取得较大进展。香港子公司顺利成为韩国退休教师基金 KTCU 选聘的 A 股投资管理人,并获得台湾第一金证券投资信托股份有限公司委任,成为其两只公募基金的投资顾问。

2016 年,公司持续加强公益事业建设,践行企业社会责任,公益活动影响力得到进一步提升。1 月,公司开展第二期"添富之爱"员工与贫困地区学生一对一结对帮扶认领活动,160 名乡村学子与汇添富员工完成结对。3 月,南京山地马拉松通过报名筹款为"河流·孩子"项目筹得善款近 7 万元,5 月公员工参加"一个鸡蛋的暴走"筹得善款 12 万元。6 月,公司首次开展海外学子支教活动,组织优秀中国留学生赴宁夏沿黄县三大庄添富小学,开展为期 1 周的公益支教活动。志愿者们充分借鉴海外教学的授课方式,帮助乡村小学生打开视野。8 月,南方多省遭遇严重洪涝灾害,公司员工自发地发起赈灾捐款,成功募集 20 余万元善款,全部用于为受灾地区学校捐赠图书、教学和生活用品。10 月,上海国际马拉松赛的"全马完赛公益捐赠活动"累计筹集 17 万善款。

2017 年是实施"十三五"规划的重要一年,资本市场改革进一步深化,财富管理行业在混业竞争、互联网金融、两地基金互认的多重推动下将面临更大的挑战与机遇,汇添富基金将始终坚信长期的力量,拥抱变革、奋勇拼搏、砥砺前行,为筑造中国梦添砖加瓦,为成为中国最优秀的资产管理公司的梦想努力奋斗!

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 顾耀强 | 汇添富策略回报混合基金、汇添富逆向投资混合基金、汇添富均衡增长混合基金、汇添富沪港深新价值股票基金的基金经理。 | 2016年7月27日 | - | 12年 | 国籍:中国,学历:清华大学管理学硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任杭州永磁集团公司技术员,海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理,2009年3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,2009年12月22日至今任汇添富策略回报混合基金的基金经理,2012年3月9日至今任汇添富逆向投资混合基金的基金经理,2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合基金的基金经理,2016年7月27日至今任汇添富沪港深新价值股票基金的基金经理。 |
| 赵鹏程 | 汇添富沪港深新价值股票基金的基金经理。 | 2016年7月27日 | - | 5年 | 国籍:中国,学历:浙江大学高分子化学与物理硕士。曾任天相投资股份有限公司研究员、信诚基金管理有限公司研究员。2011年8月加入汇添富基金管理有限公司任高级行业分析师。2016年7月27日至今任汇添富沪港深新价值股票基金的基金经理。 |
| 余中强 | 汇添富沪港深新价值股票基金、汇添富均衡增长混合基金的基金经理。 | 2016年8月1日 | - | 9年 | 国籍:中国,学历:香港城市大学博士、清华大学MBA学位。从业经历:曾任香港邦盟汇骏基金管理有限公司研究主任、香港朗宁投资有限公司投资经理、东兴证券股份有限公司投资经理、齐鲁证券有限公司北京证券资产管理分公司执行总经理、华商盛世成长股票型基金基金经理助理、华商产业升级混合型基金基金经理。2016年1月加入汇添富基金管理股份有限公司。2016年8月1日至今任汇添富沪港深新价值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、证监会规定的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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》,本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》,建立了健全、有效的公平交易制度体系,覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合;涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动;贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括:(1)在研究环节,公司建立了统一的投研平台信息管理系统,公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时,通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。(2)在投资环节,公司针对基金、专户、社保、境外投资分别设立了投资决策委员会,各委员会根据各自议事规则分别召开会议,在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在投权范围内根据投资组合的风格和投资策略,独立制定资产配置计划和组合调整方案,并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。(3)在交易环节,公司实行集中交易,所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式,按照"时间优先、价格优先、比例分配"的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理,严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配,确保交易的公平性。(4)在交易监控环节,公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式,对投资交易全过程实施监督,对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。(5)在报告分析方面,公司按季度和年度编制公平交易分析报告,并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。同时,投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

4.3.2 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。报告期内,本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度,进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、清算,以及稽核监察等相关部门组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控,确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内,公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下(日内、3 日、5 日)同向交易的样本,根据 95%置信区间下差价率的 T 检验显著程度、差价率均值是否小于 1%、同向交易占优比等方面进行综合分析,未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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 10 次,均是因为投资策略原因,并经过公司内部风控审核。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年,全球经济处于温和复苏的阶段,但是地缘政治的摩擦对全球风险偏好的扰动时有出现。美国作为全球经济温和复苏的领头羊,宏观观察数据验证了经济复苏的可持续性,这既是 12 月 FOMC 加息的基础,也是自年底开始全球大宗商品价格反转的重要因素。当然,17 年的美联储货币政策在此经济趋势的背景下,大概率将加大收紧的节奏。与此同时,日本经济的企稳,以及欧洲经济的不再恶化,也是全球大多数发达资本市场在英国脱欧等事件冲击之后,恢复上行的重要原因。

香港市场在年初受到人民币贬值、机构换仓等因素冲击之下,出现了比较明显的调整。随后,在全球经济回暖且国际资金回流的背景下,市场经历一波震荡行情。年中,在全球风险偏好提升的背景下,香港市场受益于其板估值的特征,进一步得到了中国内地和海外资金的青睐。首先,受到人民币国际化及人民币贬值预期的影响,通过沪港通渠道进行投资,成为了内地投资者在资产配置时规避汇率风险的重要选项之一;9 月初,沪港通每日约 50 亿资金南下,就是最直接的表现;其次,受国际市场影响,在美联不断创历史新高的带动下,蓝筹股仍处于全球成熟资本市场的估值洼地,部分海外资金出于通投"类美元"资产的释征加大了港股的配置比重;同时,政策层面,"深港通"的宣布,以及保监会"允许险资参与沪港通"的表态,进一步利好港股市场,并刺激市场在 16 年 9 月创下了自 2015 年 4 月以来的新高。本基金在 8 月初建仓初期,蓝宇新基金的特点,在控制好风险收益比的前提下,通过低仓位精选个股的策略,积累了部分安全垫。之后,预判市场将出现 Alpha 行情的背景下,加大对于汽车、环保、信息技术,博彩等行业的配置,通过重仓优秀的标的,坚持长期投资,实现投资价值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

基金成立以来,本基金报告期内累计收益率为 1.70%,同期业绩比较基准上涨 1.12%,超越业绩比较基准 0.58%。

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 2017 年,我们认为大致可以分为两个阶段,首先,上半年,全球的经济复苏热度仍将持续,但是,在目前美国经济的发展趋势下,我们预判美联储大概率将于 6 月开始收紧货币政策的举动,而这将对全球经济的前瞻预期和流动性层面有着深刻的影响。同时,由于美联储多位委员的离任,和现任正副主席的任期即将到期,美联储对于货币政策的未来态度和战略,值得重点关注。国内经济将继续保持平稳,一季度相对而言,增长将相对明显。

2017 年的香港资本市场,低估值的特征仍将吸引全球资金的再配置。我们将坚持寻找出商业模式优秀、长期业绩增长稳定、公司治理完善的杰出公司。在关注低估值、高股息的标的同时,我们将更多的将配置重心放在长期成长空间大的优秀标的上。我们的方向有:1.模式成熟、估值合理、增长稳健的行业龙头;2.优势明显、成长空间大的成长股;3.业务覆盖全球范围,且景气度持续上行的行业及其中标的。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,公司以维护基金份额持人利益为宗旨,有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则,认真履行职责,通过常规稽核、专项检查和系统监控等方式方法积极开展工作,强化对基金运作和公司运营的合规性监察,促进内部控制和风险管理的不断改进,并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内,本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面:

(一)完善规章制度,健全内部控制体系

在本报告期内,督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估,并根据各项业务特点、业务发展实际,建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程,进一步明确了内部控制和风险管理责任,公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善,为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

(二)加强稽核监察,确保基金运作和公司经营合法合规

本报告期内,督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据,按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察,包括对基金投资交易行为、投资指标的监控、对投资组合的风险度量、评估和建议,对基金信息披露的审核、监督,对基金销售、营销的稽核、控制,对基金营运、技术系统的稽核、评估,切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

(三)强化培训教育,提高全员合规意识

本报告期内,督察长和稽核监察部门积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流,提升了员工的风险意识、合规意识,提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平,公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作,本报告期内,本基金管理人所管理的基金运作合法合规,充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,继续加强内部控制和风险管理,进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性,充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会,负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金 2016 年 7 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间未进行利润分配。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽职义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师陈露、陈军于 2017 年 3 月 28 日签字出具了安永华明(2017)审字第 60466941_B66 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金

报告截止日:2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2016年12月31日 |
|---|---|
| 资 产: | |
| 银行存款 | 504,104,642.63 |
| 结算备付金 | 1,452,645.55 |
| 存出保证金 | 118,373.02 |
| 交易性金融资产 | 1,013,488,060.38 |
| 其中:股票投资 | 1,013,488,060.38 |
| 基金投资 | - |
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 衍生金融资产 | - |
| 买入返售金融资产 | 100,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | 75,600,234.91 |
| 应收利息 | 206,036.32 |
| 应收股利 | - |
| 应收申购款 | 796,550.39 |
| 递延所得税资产 | - |
| 其他资产 | - |
| 资产总计 | 1,695,766,543.20 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2016年12月31日 |
| 负 债: | |
| 短期借款 | - |
| 交易性金融负债 | - |
| 衍生金融负债 | - |
| 卖出回购金融资产款 | - |
| 应付证券清算款 | 49,984,861.11 |
| 应付赎回款 | 484,691.63 |
| 应付管理人报酬 | 2,097,589.71 |
| 应付托管费 | 349,598.27 |
| 应付销售服务费 | - |
| 应付交易费用 | 1,534,850.78 |
| 应交税费 | - |
| 应付利息 | - |
| 应付利润 | - |
| 递延所得税负债 | - |
| 其他负债 | 270,936.37 |
| 负债合计 | 54,722,527.87 |
| 所有者权益: | |
| 实收基金 | 1,613,296,308.34 |
| 未分配利润 | 27,747,706.99 |
| 所有者权益合计 | 1,641,044,015.33 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,695,766,543.20 |

注:1.由于本基金合同于 2016 年 7 月 27 日生效,无比较式的上年度可比期间,因此资产负债表只列示 2016 年 12 月 31 日数据,特此说明。

2.报告截止日 2016 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.017 元,基金份额总额 1,613,296,308.34 份。

7.2 利润表

会计主体:汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金

本报告期:2016 年 7 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
|---|---|
| 一.收入 | -12,111,600.65 |
| 1.利息收入 | 1,745,640.55 |
| 其中:存款利息收入 | 1,613,148.49 |
| 债券利息收入 | - |
| 资产支持证券利息收入 | - |
| 买入返售金融资产收入 | 132,492.06 |
| 其他利息收入 | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 5,674,712.90 |
| 其中:股票投资收益 | 3,585,335.53 |
| 基金投资收益 | - |
| 债券投资收益 | - |
| 资产支持证券投资收益 | - |
| 贵金属投资收益 | - |
| 衍生工具收益 | - |
| 股利收益 | 2,089,377.57 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -20,546,052.42 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 1,014,098.32 |
| 减:二.费用 | 13,999,069.23 |
| 1.管理人报酬 | 6,009,461.86 |
| 2.托管费 | 1,001,576.94 |
| 3.销售服务费 | - |
| 4.交易费用 | 6,715,004.66 |
| 5.利息支出 | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - |
| 6.其他费用 | 273,025.77 |
| 三.利润总额(亏损总额以"-"号填列) | -26,110,669.88 |
| 减:所得税费用 | - |
| 四.净利润(净亏损以"-"号填列) | -26,110,669.88 |

注:本基金合同于 2016 年 7 月 27 日生效,无比较式的上年度可比期间,因此利润表只列示本期数据,特此说明。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金

本报告期:2016 年 7 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2016年7月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一.期初所有者权益(基金净值) | 408,053,169.08 | - | 408,053,169.08 |
| 二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | -26,110,669.88 | -26,110,669.88 |
| 三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) | 1,205,243,139.26 | 53,858,376.87 | 1,259,101,516.13 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,443,952,081.02 | 62,988,201.62 | 1,506,940,282.64 |
| 2.基金赎回款 | -238,708,941.76 | -9,129,824.75 | -247,838,766.51 |
| 四.本期向基金分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | - | - | - |
| 五.期末所有者权益(基金净值) | 1,613,296,308.34 | 27,747,706.99 | 1,641,044,015.33 |

注:本基金于 2016 年 7 月 27 日成立,无比较式的上年度可比期间,因此所有者权益(基金净值)变动表只列示本期数据,特此说明。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____张晖_____ _____李骏_____ _____韩从慧_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2016]148 号文《关于准予汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金变更注册的批复》准予注册,由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司作为基金管理人于 2016 年 7 月 15 日起至 2016 年 7 月 25 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第 60466941_B12 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 7 月 27 日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 408,022,413.25 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 30,755.83 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 408,053,169.08 元,折合 408,053,169.08 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括依法发行上市的股票(包含中小板、创业板、其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、股票期权、债券、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票资产不低于基金资产的 80%(其中投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%);基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%;每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的保证金以后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率× 60%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)× 20%+中债综合指数收益率× 20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在其会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号《年度报告的内容与格式》》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和半年度报告》》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 7 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 7 月 27 日(基金合同生效日)起至 2016 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项;

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、存出保证金、结算备付金、买入返售金融资产及各类应收款项等。

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债,主要包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债,按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益;应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;应收款项及其他金融负债采用实际利率法,按摊销余成本进行后续计量,其摊销或减值产生的利得或损失,均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认,即从本基金账户和资产负债表内予以转销;当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;处置该金融资产或金