

汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2016年度报告摘要

2016-12-31 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

送出日期:2017年3月29日

§ 1重要提示

基金管理人的董事会、监事会对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法律责任。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并经基金管理人签发。

基金托管人根据法律法规的规定,履行了监督职责,对本基金报告的内容予以复核,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金,但不保证基金一定盈利。

基金过往的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。

本报告期报告摘要自年度报告正文披露之日起,投资人在了解详细内容,应阅读年度报告全文。

本报告期自2016年1月1日起至2016年3月31日止。

§ 2基金的基本情况

基金简称 汇添富深证300ETF联接基金

基金主代码 470008

基金运作方式 约定开放型

基金合同生效日 2011年9月28日

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

基金份额总额 46,441,085.30份

基金管理人对基金的持续监督情况 不定期

21日历基金基本情况

基金名称 深证300交易型开放式指数证券投资基金

基金主代码 159912

基金运作方式 交易型开放式

基金合同生效日 2011年9月28日

基金的上市地 深圳证券交易所

上市日期 2011年11月24日

基金管理人名称 汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人名称 中国工商银行股份有限公司

22基金产品说明

投资目标 通过投资于标的ETF,紧密跟踪标的指标,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

投资策略 本基金主要采取定性与定量相结合的方法,在充分分析宏观经济指标、行业景气度、相关证券价格、证券交易量、资金供求状况、政策导向等的基础上,结合对二级市场价格的跟踪,选择具有投资价值的股票进行投资。

业绩比较基准 深证300指数收益率×95%+银行存款利息(税后)×5%

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,风险收益与货币市场基金、债券型基金相比,本基金通过投资于标的ETF,紧密跟踪标的指标,其与标的指数所代表的股票市场的相似的风险特征。

22.1日历基金产品说明

投资目标 实现对标的指数的跟踪,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

投资策略 本基金主要采取定性与定量相结合的方法,在充分分析宏观经济指标、行业景气度、相关证券价格、证券交易量、资金供求状况、政策导向等的基础上,结合对二级市场价格的跟踪,选择具有投资价值的股票进行投资。

业绩比较基准 深证300指数收益率×95%+银行存款利息(税后)×5%

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,风险收益与货币市场基金、债券型基金相比,本基金通过投资于标的ETF,紧密跟踪标的指标,其与标的指数所代表的股票市场的相似的风险特征。

23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 中国工商银行股份有限公司

姓名 李鹏 郭明

信息披露负责人 021-28932888 010-66105799

电子邮箱 service@99fund.com.custody@icbc.com.cn

客户服务电话 400-888-9918 95588

传真 021-28932998 010-66105798

24巨额赎回公告

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号嘉里国际大厦21楼汇添富基金管理股份有限公司

S 3主要财务指标、基金净值表现、利润分配情况

3.1主要财务指标

3.1.1期间报告和指标

2016年 2015年 2014年

本期已实现收益 -1,896,832.42 18,339,015.94 689,551.37

11,-947,161.33 14,812,223.33 10,518,893.99

加权平均基金份额本期期初 -0.2760 0.3339 0.2304

本期基金份额净值增长 +18.32% 29.04% 26.70%

期末可供分配基金份额利润 0.3000 0.3763 +0.0333

期末基金份额净值 60,373,232.00 67,382,414.16 60,522,694.53

3.2基金净值表现

3.2.1基金净值表现的比较

注:1.本期已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(减去公允价值变动收益)

收益、赎回费用和基金申购费用后的余额,本期为零元,表示变动收益为零。

2.本期份额净值增长率=本期份额净值增长/期初份额净值,单位: %

3.期初可供分配基金份额利润指可供分配利润除以期初基金份额总数量,单位: 元/份。

4.期末可供分配基金份额利润指按期末可供分配利润除以期末基金份额总数量,单位: 元/份。

5.基金净值表现的比较数据截至2016年9月28日,6只基金成立以来总回报率分别为:

汇添富深证300ETF联接基金: 31.51%;

汇添富深证300ETF: 30.35%;

汇添富深证300指数: 29.04%;

沪深300指数: 26.70%;

上证综指: 23.04%;

深证综指: 21.54%;

注:1.期初可供分配收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(减去公允价值变动收益)、收益、赎回费用和基金申购费用后的余额,本期为零元,表示变动收益为零。

2.本期份额净值增长率=本期份额净值增长/期初份额净值,单位: %

3.期初可供分配基金份额利润指可供分配利润除以期初基金份额总数量,单位: 元/份。

4.期末可供分配基金份额利润指按期末可供分配利润除以期末基金份额总数量,单位: 元/份。

5.基金净值表现的比较数据截至2016年9月28日,6只基金成立以来总回报率分别为:

汇添富深证300ETF联接基金: 31.51%;

汇添富深证300ETF: 30.35%;

汇添富深证300指数: 29.04%;

沪深300指数: 26.70%;

上证综指: 23.04%;

深证综指: 21.54%;

注:1.期初可供分配收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(减去公允价值变动收益)、收益、赎回费用和基金申购费用后的余额,本期为零元,表示变动收益为零。

2.本期份额净值增长率=本期份额净值增长/期初份额净值,单位: %

3.期初可供分配基金份额利润指可供分配利润除以期初基金份额总数量,单位: 元/份。

4.期末可供分配基金份额利润指按期末可供分配利润除以期末基金份额总数量,单位: 元/份。

5.基金净值表现的比较数据截至2016年9月28日,6只基金成立以来总回报率分别为:

汇添富深证300ETF联接基金: 31.51%;

汇添富深证300ETF: 30.35%;

汇添富深证300指数: 29.04%;

沪深300指数: 26.70%;

上证综指: 23.04%;

深证综指: 21.54%;

注:1.期初可供分配收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(减去公允价值变动收益)、收益、赎回费用和基金申购费用后的余额,本期为零元,表示变动收益为零。

2.本期份额净值增长率=本期份额净值增长/期初份额净值,单位: %

3.期初可供分配基金份额利润指可供分配利润除以期初基金份额总数量,单位: 元/份。

4.期末可供分配基金份额利润指按期末可供分配利润除以期末基金份额总数量,单位: 元/份。

5.基金净值表现的比较数据截至2016年9月28日,6只基金成立以来总回报率分别为:

汇添富深证300ETF联接基金: 31.51%;

汇添富深证300ETF: 30.35%;

汇添富深证300指数: 29.04%;

沪深300指数: 26.70%;

上证综指: 23.04%;

深证综指: 21.54%;

注:1.期初可供分配收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(减去公允价值变动收益)、收益、赎回费用和基金申购费用后的余额,本期为零元,表示变动收益为零。

2.本期份额净值增长率=本期份额净值增长/期初份额净值,单位: %

3.期初可供分配基金份额利润指可供分配利润除以期初基金份额总数量,单位: 元/份。

4.期末可供分配基金份额利润指按期末可供分配利润除以期末基金份额总数量,单位: 元/份。

5.基金净值表现的比较数据截至2016年9月28日,6只基金成立以来总回报率分别为:

汇添富深证300ETF联接基金: 31.51%;

汇添富深证300ETF: 30.35%;

汇添富深证300指数: 29.04%;

沪深300指数: 26.70%;

上证综指: 23.04%;

深证综指: 21.54%;

注:1.期初可供分配收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(减去公允价值变动收益)、收益、赎回费用和基金申购费用后的余额,本期为零元,表示变动收益为零。

2.本期份额净值增长率=本期份额净值增长/期初份额净值,单位: %

3.期初可供分配基金份额利润指可供分配利润除以期初基金份额总数量,单位: 元/份。

4.期末可供分配基金份额利润指按期末可供分配利润除以期末基金份额总数量,单位: 元/份。

5.基金净值表现的比较数据截至2016年9月28日,6只基金成立以来总回报率分别为:

汇添富深证300ETF联接基金: 31.51%;

汇添富深证300ETF: 30.35%;

汇添富深证300指数: 29.04%;

沪深300指数: 26.70%;

上证综指: 23.04%;

深证综指: 21.54%;

注:1.期初可供分配收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(减去公允价值变动收益)、收益、赎回费用和基金申购费用后的余额,本期为零元,表示变动收益为零。

2.本期份额净值增长率=本期