中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2016年年度报告摘要

2016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
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。

基金托管人中国工商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9月18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	上海国企ETF联接
基金主代码	003194
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月18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
报告期末基金份额总额	2,566,688,263.32份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510810
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2016年7月28日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016年8月29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

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于目标ETF,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金不参与目标ETF的投资管理。
业绩比较基准	中证上海国企指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%。
风险收益特征	本基金为中证上海国企ETF的联接基金,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证券市场相似的风险收益特征。同时,本基金为被动式投资的股票型指数基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法,本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数,即中证上海国企指数。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@cbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半度报告备置地点	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9月18日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	-85,499,430.82
本期利润	-96,468,808.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0404
本期基金份额净值增长率	-3.72%
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	-0.0372
期末基金资产净值	2,471,278,261.09
期末基金份额净值	0.9628

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.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.期末可供分配利润采用期末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。

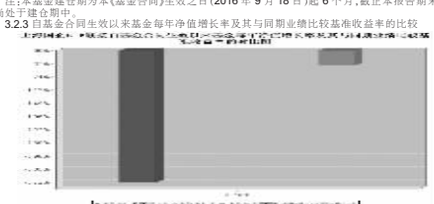
3.2 基金净值表现

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	-4.35%	0.65%	-4.34%	0.66%	-0.01%	-0.01%
过去三个月	-3.78%	0.43%	-0.09%	0.58%	-3.69%	-0.15%
自基金合同生效起至今	-3.72%	0.40%	-0.42%	0.59%	-3.30%	-0.19%

注:本基金的(基金合同)生效日为2016年9月18日,至本报告期末未满六个月。

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9月18日)起6个月,截止本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

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9月18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9月18日,2016年度未进行利润分配。

§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,做中长期投资布局,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、汇添富金额宝获得"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只保本基金,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,搭建了囊括投顾式服务、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名名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"阿诺·孩子"项目筹得善款近7万元。5月,公司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沙源县兰大庄添富小学,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,上海国际马拉松善的"全马完善公益捐赠活动"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,财富管理行业正混业竞争、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,为巩固中国梦添砖加瓦,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		
楚天舒	中证上海国企ETF、上海国企ETF联接的基金经理,指数与量化投资部副总监。	2016年9月18日	-	16年	国籍:中国。学历:南开大学经济学博士。从业经历:曾任职于深圳商业银行、华安证券、华富基金管理公司、深圳证券交易所、上海证券交易所、华宝兴业基金管理公司,2014年5月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任指数与量化投资部副总监,2016年8月8日至今任中证上海国企ETF的基金经理,2016年9月18日至今任上海国企ETF联接的基金经理。

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 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,贯穿了投权、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。各投资组合经理在授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控制,确保公平交易制度执行和实现。

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年沪深300指数下跌11.28%,熔断政策影响了开年行情,之后市场企稳反弹,消费、金融、大宗商品类股票反弹明显。我国经济数据,企业盈利数据,价格数据全年呈现企稳回升势头,稳增长的任务基本达成。房地产市场在严格的调控政策后出现环比下降,初现效果。债券市场在四季度经历了剧烈调整,利率快速攀升,资金紧张态势在接近年末时才稍有缓解。资金在房市、股市、债市、汇市、黄金五大资产配置工具的博弈,在境内外之间的流动驱动了市场的变化,货币政策转向中性偏紧,积极财政政策值得期待,金融去杠杆成为共识。

报告期内,本基金遵循指数基金的被动投资原则,通过投资于目标ETF,基本保持目标ETF投资仓位在90%以上,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,保持了指数基金的本质属性,实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内国企联接基准下跌-0.43%,本基金在报告期内累计收益率为-3.72%,收益率落后业绩比较基准-3.29%。收益率的差异因素主要来源于建仓期间指数上涨。本基金日均跟踪误差为0.2490%,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 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年经济下行压力可能有所缓解,随着供给侧改革的逐步推进,过剩产能逐步出清,经济总量企稳,微观层面持续改善。财政政策更加积极有效,在推进经济结构改革、脱虚向实、降低企业税负、改善民生方面更为着重。一些具备长期竞争优势的企业可能因此获益。

在汇率和通胀存在压力背景下,货币政策可能保持稳健中性,重点转向防风险和抑泡沫。不确定性仍主要源于外部环境,如特朗普新政的实施力度、欧洲黑天鹅事件和美联储加息频率都可能会对全球流动性和风险偏好产生影响。

2017年A股市场情绪面较为乐观,但整体趋势性机会很难见到,大小盘风格、成长价值风格的分化可能日趋明显。资金在股市的配置将更加看重公司基本面因素,低估值、稳定高成长的股票可能受到青睐。汇添富中证上海国企ETF联接基金将严格遵守基金合同,继续坚持既定的指数化投资策略,积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差,实现有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

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根据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,确保基金运作的公司经营合法合规

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,可以提议调整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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金(基金合同)约定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金进行收益分配,若(基金合同)生效不满3个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内,本基金托管人在对中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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的义务。

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

本报告期内,中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金2016年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§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_B69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:中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	82,163,184.87
结算备付金	31,379,306.21
存出保证金	709,587.77
交易性金融资产	2,331,048,706.47
其中:股票投资	97,669,180.47
基金投资	2,233,379,526.00
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	-
应收证券清算款	31,025,739.34
应收利息	33,198.42
应收股利	-
应收申购款	386,672.09
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	2,476,746,395.17
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	-
应付赎回款	1,562,814.61
应付管理人报酬	853,011.95
应付托管费	170,602.39
应付销售服务费	-
应付交易费用	2,595,815.07
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	285,890.06
负债合计	5,468,134.08
所有者权益:	
实收基金	2,566,688,263.32
未分配利润	-95,410,002.23
所有者权益合计	2,471,278,261.09
负债和所有者权益总计	2,476,746,395.17

注:1.后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2.报告截止日2016年12月31日,基金份额净值0.9628元,基金份额总额2,566,688,263.32份。

7.2 利润表

会计主体:中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期:2016年9月18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9月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一.收入	-89,220,497.59
1.利息收入	9,490,371.07
其中:存款利息收入	4,209,199.04
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	5,281,172.03
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-87,885,988.05
其中:股票投资收益	-87,316,628.23
基金投资收益	-569,359.82
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	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-10,969,377.54
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	144,496.93
减:二.费用	7,248,310.77
1.管理人报酬	3,165,477.84
2.托管费	633,095.57
3.销售服务费	-
4.交易费用	3,167,897.36
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	281,840.00
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-96,468,808.36
减:所得税费用	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	-96,468,808.36

注:后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期:2016年9月18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9月18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)	2,254,384,901.31	-	2,254,384,901.31
二.本期经营活动产生的基金净值变动(本期净利润)	-	-96,468,808.36	-96,468,808.36
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	312,303,362.01	1,058,806.13	313,362,168.14
其中:1.基金申购款	427,905,735.36	1,051,589.60	428,957,324.96
2.基金赎回款	-115,602,373.35	7,216.53	-115,595,156.82
四.本期向基金份额持有人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)	2,566,688,263.32	-95,410,002.23	2,471,278,261.09

注:报告附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告"至"财务报表由下列负责人签署:

_____张晖_____ _____李骁_____ _____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

中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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]1780号文《关于准予中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》准予注册,由汇添富基金管理股份有限公司作为基金管理人于2016年8月23日至2016年9月12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_B15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9月18日生效,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2,253,881,866.90元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币503,034.41元,以上实收基金(本息)合计为人民币2,254,384,901.31元,折合2,254,384,901.31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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于目标ETF,标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非成分股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具(包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等)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的相关规定)。本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。业绩基准:中证上海国企指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及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,对于在具体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》、《关于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)》及其他中国证监会颁布的相关规定。

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9月18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9月18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、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和基金投资;

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、结算备付金、存出保证金和各类应收款项等。

(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划分为其他金融负债,主要包括各类应付款项。

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,按照摊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融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确入为投资收益,同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已转金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层级:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值;估值日无市价,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易市价确定公允价值;如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,参考类似投资品种的现行市价及重大变化