

汇添富沪深300指数型发起式证券投资基金(LOF)

2017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:中国国际金融股份有限公司
送出行日期:2018年3月28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，应阅读年度报告全文。

本报告期自2017年9月6日至2017年9月6日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富沪深300指数(LOF)
基金主代码	501043
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2017年9月6日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国国际金融股份有限公司
报告期末基金份额总额	141,619,224.54份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2017年10月9日
下属分级基金的基金简称:	汇添富沪深300指数(LOF)A
下属分级基金的场内简称:	沪深300A
下属分级基金的交易代码:	501043
报告期末下属分级基金的份额总额	86,997,683.61份
总资产	54,621,540.93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，追求跟踪误差和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照所选指数的成份股及权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及权重的变化定期进行调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+人民币活期存款利率(税后)
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，低于股票型基金；本基金为股票基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的产品。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险和收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国国际金融股份有限公司
姓名	李鹏	张智
信息披露负责人	021-28932988	010-65051166-1953
电子邮箱	service@99fund.com	CICC_AC@icc.com.cn
客户服务电话	400-888-9918	010-65051166
传真	021-28932998	010-65050973

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人	www.99fund.com
互联网网址	上海市嘉定区城北路99号震旦国际大楼21-23层 汇添富基金管理有限公司

3.1 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

3.1.1 期间数据和指标	2017年9月6日(基金合同生效日)-2017年12月31日
汇添富沪深300指数(LOF)A	汇添富沪深300指数(LOF)C
本期已实现收益	2,608,795.71
加权平均基金份额本期利润	0.0346
本期基金份额净值增长率为	3.26%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末
期末可供分配基金份额利润	0.0221
期末基金资产净值	89,833,296.90
期末基金份额净值	1.0326

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)扣减相关费用后的余额,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(例如:基金的申购赎回费等),计算费用时未考虑费用对申购赎回价格的影响,因而可能影响实际收益水平而低于示列数字。

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之和除以总份额数。

4. 本基金的《基金合同》生效日为2017年9月6日,至本期报告期末,因此主要会计数据和财务指标只列入从基金合同生效日至2017年12月31日数据,特此说明。

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

汇添富沪深300指数(LOF)A

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富沪深300指数(LOF)A基金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

3.2.3 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

汇添富沪深300指数(LOF)C

3.2.4 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.5 基金份额净值

3.2.6 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

汇添富沪深300指数(LOF)C

3.2.7 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.8 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.9 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.10 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.11 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.12 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.13 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.14 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.15 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.16 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.17 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.18 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.19 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.20 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.21 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.22 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.23 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.24 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.25 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.26 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.27 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.28 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.29 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.30 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.31 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.32 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.33 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.34 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.35 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.36 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

汇添富沪深300指数(LOF)C基金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

3.2.37 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

汇添富