中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金 2017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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2018年3月28日

§1 重要提示及目录

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2018年3月26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2017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	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证上海国企ETF
场内简称	上海国企
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	10,418,091,004.00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	2016年8月29日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求偏离度和误差最小化。
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@icbc.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21-23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	2017年	2016年7月28日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	318,462,700.37	196,767,857.83
本期利润	456,540,761.04	-224,426,753.68
加权平均基金份额本期利润	0.0341	-0.0163
本期基金份额净值增长率	1.77%	-2.00%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0315	-0.0200
期末基金资产净值	10,089,794,709.43	14,961,051,405.46
期末基金份额净值	0.9685	0.9800

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。

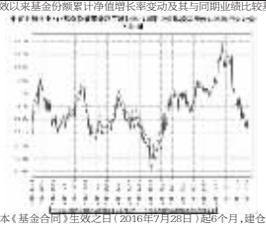
3.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

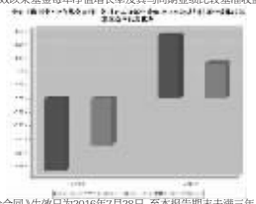
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.36%	0.77%	-3.14%	0.77%	-0.22%	0.00%
过去六个月	-2.50%	0.65%	-3.00%	0.65%	0.50%	0.00%
过去一年	1.77%	0.64%	0.98%	0.64%	0.79%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-0.26%	0.67%	-0.33%	0.68%	0.07%	-0.01%

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28日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

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28日,至本报告期末未满三年。

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

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	0.3000	359,492,730.12	-	359,492,730.12	
2016	-	-	-	-	
合计	0.3000	359,492,730.12	-	359,492,730.12	

注:本基金成立于2016年7月28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

汇添富基金成立于2005年2月,是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设在上海,在北京、上海、广州、成都等地设有分公司,在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全,拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人及QFII基金管理人等业务资格。

汇添富基金目成立以来,始终将投资业绩放在首位,形成了独树一帜的品牌优势,被誉为“选股专家”,并以优秀的长期投资业绩树一流的客户服务,赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

目前,汇添富基金已经发展成为长期业绩优异、产品布局完善、业务领域全面、资产管理规模居前的大型基金公司。截至2017年12月31日,汇添富资产管理总规模超过5600亿元,其中公募资产管理规模(剔除货基口径)1892亿元,位居行业第7;服务客户超过6000万人。根据银河证券基金研究中心数据,汇添富旗下股票基金最近3年,5年的股票投资主动管理平均效益率分别达到89.86%、184.98%,在公募规模(不含货基)前十大基金公司中均排名第一。优秀的业绩赢得了行业与市场的高度认可。2017年,汇添富基金荣获“金基金·TOP公司奖”、“三年持续回报明星基金公司”、“优秀资产管理机构”等奖项,汇添富价值精选、汇添富民营活力荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”,汇添富上海国企ETF荣获“上海金融创新成果奖”、“添富智投”荣登“2017中国智能投顾新锐榜”。

2017年,汇添富基金新发行225只公募基金,包括11只混合型基金,5只指数基金,3只债券基金以及3只QDII基金,其中,上证上海改革发展主题ETF为助力国企改革的创新产品,汇添富全球移动互联混合基金和汇添富全球医疗健康混合基金布局海外市场,进一步丰富完善了公司的国际产品线。全年,公司管理公募基金产品达到97只,涵盖股票型、混合型、债券型、理财、QFII、指数、商品、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。

2017年,汇添富基金大力发展目有平台建设,不断引领行业创新。全年推出多款树立行业标杆的举头功能:添富智投、添富养老、汇内付、工资宝、理财日历、在线客服机器人等。规模稳定在千亿级别,服务客户数量超5000万,处于行业领先水平。与此同时,互联网金融对外合作业务取得重大突破。截至年底,对外合作伙伴数量已超30家,成为业内对外合作最多的公司之一。

2017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2900亿元;获得全国社保基金及基本养老保险基金投资管理人资格,社保基金和基本养老保险基金业务规模快速增长,受托管理组合账户数量持续增加。

2017年,公司积极开展渠道销售和培训工作,专业的投顾服务以及良好的渠道维护口碑不断提升汇添富品牌在渠道影响力和认可度,同时公司持续大力开展定投、投资者教育、添富论坛等系列客户活动,营销培训活动机做到银行机构渠道的网点、营业厅。

2017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,搭建了嘱托投顾式服务、基金理财、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。同时,持续优化电话、在线客服、短信系统等服务通道建设,丰富服务渠道,提高客服体验。

2017年,香港子公司在加强投资业绩的基础上,深入发掘投资价值洼地,港股投资及海外债券投资业绩持续优异,汇添富中港策略基金获得晨星三年五星评级,在最近一年、三年、五年同类港股基金中业绩均位列第一;汇添富港币债券基金获得晨星三年四星评级,在同类型基金中持续名列第一。社保海外组合业绩在所有社保管理人中排名第一。

2017年,公司公益事业蓬勃发展,公益活动精彩纷呈,公益品牌建设更上一个台阶。一是依托公司旗下上海汇添富公益基金会的专业平台,连续第十年开展“同流·孩子”公益助学计划,开成立“同流·孩子”公益助学联盟,将项目的平台化建设推向新的高度,二是将公益事业与公司党建活动、催生出新活力和亮点,公司党委下属的八个党支部分别与各地“添富小学”建立结对关系,党员们通过实地探访,了解学校实际困难和发展需求,积极寻求社会公益资源给予帮助,三是持续开展“同流·孩子”相关品牌活动,延续爱心传递温暖,持续开展“同流·孩子”公益助学计划,组织100名添富小学乡村一线教师分赴上海外林参加专业教师培训;继续组织西部助学公益活动,邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的“添富小学”参加公益服务;继续举办海外留学志愿者支教,帮助山区孩子打开的视野。其余员工公益活动持续精彩纷呈,向公司员工发售等款白历、参加护士知名的群众性公益活动——一个鸣蛋的暴走等款4万多元,作为“添富小学”多媒体教室建设费用等。

2018年,资产管理行业面临重大行业变革期:混业竞争格局下严格依法从严监管;资管业务回归本源,短期业务失去快速扩张的土壤;互联网与金融的融合与碰撞将重构现有行业发展格局;港股通、沪伦通的发展,带动了人股国际化也进一步带来新的机遇与挑战。汇添富基金将始终坚信长期的力量,开拓进取、奋勇前行,为玩造中国梦添砖加瓦,为成为中国最值得信赖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		
吴振翔	汇添富上证综合指数、汇添富沪深300安小指数基金、汇添富成长多因子股票基金、汇添富主要消费ETF联接基金、汇添富中证精准医药指数基金、中证上海国企ETF、汇添富中证互联网医疗指数(LOF)、汇添富中证500指数(LOF)的基金经理,指数与量化投资部副总监。	2016年7月28日	-	11年	国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理,现任指数与量化投资部副总监。2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理,2011年9月16日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金的基金经理,2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理,2013年11月23日至2015年11月2日任中证主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金的基金经理,2013年11月6日至今任汇添富沪深300安中指数基金的基金经理,2015年2月16日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理,2015年3月24日至今任汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理,2016年11月21日至今任汇添富中证精准医药指数基金的基金经理,2016年7月28日至今任中证上海国企ETF的基金经理,2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数(LOF)的基金经理,2017年8月10日至今任汇添富中证500指数(LOF)的基金经理。
楚天舒	中证上海国企ETF、上海国企ETF联接、汇添富沪深300指数(LOF)、上证上海改革发展主题ETF、汇添富中证全指证券公司指数(LOF)的基金经理,指数与量化投资部副总监。	2016年8月8日	-	17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,2017年9月6日至今任汇添富沪深300指数(LOF)的基金经理,2017年12月1日至今担任汇添富上证综合指数、汇添富沪深300安中证全指证券公司指数(LOF)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。本基金无违大违法、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11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

回顾2017年,基本面上,国内经济延续了稳中向好的态势,企业盈利整体改善,经济保持韧性;国际经济继续复苏,贸易维持较高景气度,出口持续好转,政策面上,十九大报告和中央经济工作会议指明了未来发展和改革的方向;金融监管力度增强,持续引导经济去杠杆和资本“脱虚向实”,金融服务实体经济;供给侧改革持续推进,结构性减税降费措施密集推出,混改加速,PPP持续落地,雄安、粤港澳大湾区、长江经济带等协调区域经济协同发展规划陆续出台,稳健的基本面和改革的大力推进为证券市场提供了较好的环境。

结构上,受益于经济整体复苏,叠加供给侧改革和环保督察对低效率、高污染的落后产能的挤出,部分工业品价格上涨,工业企业利润率有所回升;部分周期行业表现出色。消费对经济增长的拉动作用越来越大,消费者信心指数维持高位,消费升级已成为市场的共识,部分业绩确定性强的消费白马股表现出色。北上资金持续流入,国内投资者对A股权益资产配置逐步提升,边际资金的偏好进一步影响了市场风格,加速了A股风格国际化的进程。IPO加速,“类价值”大幅下降;外延式并购得到控制,市场流动性较为紧张,成交活跃度下降,一些估值过高的行业和中小盘股票价格出现了一定程度的回调。

政策面,十九大报告和中央经济工作会议指明了未来发展和改革的方向;金融监管力度增强,持续引导经济去杠杆和资本“脱虚向实”,促使监管政策对短期市场资金面和流动性有所影响,但着眼未来,确定性的提高利潜在风险的降低提升了权益市场的吸引力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内上海国企基准上涨0.98%,本基金在报告期内累计收益率为1.77%,收益率超越业绩比较基准0.79%。收益率的差异因素主要来源于期间成价股分红、日常申购赎回等因素。本基金日均跟踪误差为0.0169%,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

展望2018年,经济基本面大概率仍将保持稳中向好的态势,通过产业升级、经济转型和持续推进的供给侧改革,目前人股浦现出了一批热理优良、内生成长稳定、具有较强竞争力的上市公司,同时国际经济继续复苏也为人股创造了较好的外部环境。政策面上,2018是十九大的开局之年,会议的目标和规划将在今年逐步细化和落实,改革的逐步落地将给中国经济带来新的活力;金融服务实体经济、防控金融风险仍是金融监管的主基调,资管新规等一系列政策的落地有利于化解潜在的经济金融风险,提升市场透明度,改善整体风险偏好,资金面上,在去杠杆、防风险的大背景下,流动性大概率保持中性,但边际上,随着资本市场的进一步开放和机构投资占比的逐步提升,人股市场的机构化特特征愈发明显。

风格上,A股有进一步向成熟市场银换的可能性,推动2017年蓝筹行情的资金面及政策面因素仍然存在,基本面质地优良的股票仍可能存在超额收益。但目前估值水平已经逐步反映基本面,在流动性整体变化不大的背景下,行业和个股表现将从极致化的“二八分化”转向相对均衡,不同风格的收益差异相比2017年可能减少。

2018年将是国企改革逐步落地的时间段,国企改革预期越来越明确,上海地方国企作为全国国企改革的排头兵,结合上海自由贸易港和长三角建设规划,将在经济中发挥更为重要的作用,相关上市公司也将迎来较为确定的投资机会。

作为被动投资的交易所上市指数型基金,汇添富中证上海国企 ETF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。

4.6 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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及2017年9月5日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(2017年9月5日《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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止)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,可以提议调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。

4.7 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:本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金于2017年8月10日实施利润分配,每10份基金份额派发红利0.2元人民币。

本基金于2017年10月25日实施利润分配,每10份基金份额派发红利0.1元人民币。

4.8 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,完全履职资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对基金份额持有人进行了2次利润分配,分配金额为359,492,730.12元。

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2017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,注册会计师陈露、陈军于2018年3月27日签字出具了安永华明(2018)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:中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2017年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资 产:		
银行存款	25,322,354.70	157,740,056.27
结算备付金	136,778.56	7,203,686.97
存出保证金	297,147.75	1,413,730.75
交易性金融资产	10,071,107,349.29	14,806,370,405.76
其中:股票投资	10,071,107,349.29	14,806,370,405.76
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	-	-
应收证券清算款	110,445.76	740,538.81
应收利息	5,236.40	34,397.22
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	10,096,979,312.46	14,973,502,815.78
负债和所有者权益	本期末 2017年12月31日	上年度末 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	3,238.20	3,259,647.27
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,934,202.93	4,899,053.38
应付托管费	874,267.33	1,088,678.54
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,163,801.90	1,932,816.47
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,209,092.67	1,271,214.66
负债合计	7,184,603.03	12,451,410.32
所有者权益:		
实收基金	10,418,091,004.00	15,266,091,004.00
未分配利润	-328,296,294.57	-305,039,598.54
所有者权益合计	10,089,794,709.43	14,961,051,405.46
负债和所有者权益总计	10,096,979,312.46	14,973,502,815.78

注:报告截止日2017年12月31日,基金份额净值0.9685元,基金份额总额10,418,091,004.00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

本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年7月28日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一.收入	548,458,938.18	-159,683,158.78
1.利息收入	815,089.92	2,880,620.75
其中:存款利息收入	812,655.19	2,880,620.75
债券利息收入	2,434.73	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	409,412,686.40	258,092,480.57
其中:股票投资收益	151,551,667.46	250,948,430.18
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,676,342.37	-
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	254,184,676.57	7,144,050.39
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	138,078,060.67	-421,194,611.51
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	153,101.19	538,351.41
减:二.费用	91,918,177.14	64,743,594.90
1.管理人报酬	60,674,270.96	26,702,646.06
2.托管费	13,483,171.29	5,933,921.31
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	12,206,679.49	29,996,285.47
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	5,554,055.40	2,110,742.06
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)	456,540,761.04	-224,426,753.68

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

本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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)	15,266,091,004.00	-305,039,598.54	14,961,051,405.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	456,540,761.04	456,540,761.04
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)	-4,848,000,000.00	-120,304,726.95	-4,968,304,726.95
其中:1.基金申购款	2,227,000,000.00	-11,854,194.67	2,215,145,805.33
2.基金赎回款	-7,075,000,000.00	-108,450,532.28	-7,183,450,532.28
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)	-	-359,492,730.12	-359,492,730.12
五、期末所有者权益(基金净值)	10,418,091,004.00	-328,296,294.57	10,089,794,709.43

项目	上年度可比期间 2016年7月28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)	15,220,091,004.00	-	15,220,091,004.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-224,426,753.68	-224,426,753.68
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)	46,000,000.00	-80,612,844.86	-34,612,844.86
其中:1.基金申购款	19,812,000,000.00	324,820,650.67	20,136,820,650.67
2.基金赎回款	-19,766,000,000.00	-405,433,495.53	-20,171,433,495.53
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)	15,266,091,004.00	-305,039,598.54	14,961,051,405.46

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

张晖 李骁 雷青松

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(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]1265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向社会公开发行募集,基金合同于2016年7月28日正式生效,首次设立募集规模为15,220,091,004.00份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成分股(包括沪市小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、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基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金业绩比较基准为:中证上海国企指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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(以下统称“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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.4.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.5 税项

7.4.5.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

7.4.5.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确金融商品转让税收政策的通知》的规定,经国务院批准,自