汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF） 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:中国建设银行股份有限公司
送出日期: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

基金简称	汇添富中证中药指数(LOF)	
基金主代码	501011	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月29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	52,408,372.24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2月20日	
下属分级基金的基金简称:	汇添富中证中药指数A	汇添富中证中药指数C
下属分级基金的场内简称:	中药基金	中药C
下属分级基金的交易代码:	501011	501012
报告期末下属分级基金的份额总额	34,337,091.65份	18,071,280.59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，紧密跟踪中证中药指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证中药指数收益率×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，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	田青
	联系电话	021-23932888	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		021-23932998	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	上海市浦城路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12月29日(基金合同生效日)-2016年12月31日	
	汇添富中证中药指数A	汇添富中证中药指数C	汇添富中证中药指数A	汇添富中证中药指数C
本期已实现收益	1,834,993.51	865,187.45	-51,976.16	-70,221.28
本期利润	1,689,039.04	621,099.45	238,548.81	303,308.55
加权平均基金份额本期利润	0.0324	0.0155	0.0020	0.0020
本期基金份额净值增长率	0.87%	0.64%	0.20%	0.20%
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	0.0107	0.0084	0.0000	0.0000
期末基金资产净值	34,703,072.01	18,222,365.64	120,947,130.29	155,499,114.82
期末基金份额净值	1.0107	1.0084	1.0020	1.0020

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(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

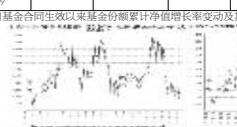
汇添富中证中药指数A

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	-0.74%	0.84%	-0.72%	0.84%	-0.02%	0.00%
过去六个月	-6.02%	0.74%	-5.97%	0.75%	-0.05%	-0.01%
过去一年	0.87%	0.71%	-1.37%	0.74%	2.24%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	1.07%	0.71%	0.16%	0.74%	0.91%	-0.03%

汇添富中证中药指数C

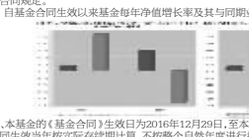
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.79%	0.84%	-0.72%	0.84%	-0.07%	0.00%
过去六个月	-6.11%	0.74%	-5.97%	0.75%	-0.14%	-0.01%
过去一年	0.64%	0.71%	-1.37%	0.74%	2.01%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	0.84%	0.71%	0.16%	0.74%	0.68%	-0.03%

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12月29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12月29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

注:本基金成立于2016年12月29日,2016年,2017年未进行利润分配。

§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。

汇添富基金自成立以来,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和一流的客户服务,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5500亿元,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收益率分别达到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”、“二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22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保健混合基金市场海外市场,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自有平台建设,不断引领行业创新。全年推出多款树立行业标杆的拳头功能:添富智投、添富养老、汇闪付、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80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推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,营销培训活动机制展到银行和券商的网点、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,搭建了囊括投顾式服务、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,香港子公司在加强母公司投研一体化基础上,深入发掘港股价值洼地,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,公司以“共享共建激励发展,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,并成立“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结合,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助予帮助。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苏州参加专业教师培训;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合历、参加护上知名的群众性公益活动——一个鸡蛋的暴走等款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A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		
过蓓蓓	汇添富中证主要消费ETF、汇添富中证医药卫生ETF、汇添富中证能源ETF、汇添富中证金融地产ETF、汇添富深证300ETF基、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富主要消费ETF联接基金、汇添富中证生物科技指数(LOF)基金、汇添富中证中药指数(LOF)基金的基金经理。	2016年12月29日	-	6年	国籍:中国,学历:中国科学技术大学金融工程博士研究生,相关业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015年6月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理,2015年8月31日至今任中证主要消费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、汇添富中证主要消费ETF联接基金的基金经理,2015年8月18日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理,2016年12月22日至今任汇添富中证生物科技指数(LOF)基金的基金经理,2016年12月29日至今任汇添富中证中药指数(LOF)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 管理人对投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 管理人对投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权益。(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。对应纳入稽核范围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,公司按季度向所有投资组合经理、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6%宣告区间下差价率的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 管理人对投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

2017年,中国经济保持平稳运行,全国居民人均可支配收入保持平稳较快增长,经济增长主要靠内需拉动,其中消费需求起到了主要拉动作用。规模以上工业企业利润总额增速比2016年明显加快,在销售加快、价格上涨等因素作用下,煤炭开采和洗选业、石油和天然气开采业、黑色金属矿采选业、黑色金属冶炼和压延加工业等行业利润大幅增加,拉动全部规模以上工业利润增速明显加快。反映在A股市场上,2017年全年市场投资风格持续分化,资金流入以沪深300、上证50为代表的蓝筹价值股,而高估值、成长不确定性大的股票被资金抛弃。受益于宏观经济持续复苏及供给侧改革,带动大盘蓝筹业绩大幅回暖,而并购融资受限使得创业板公司扩张步伐受阻,业绩增速明显放缓,全年食品饮料、家电、煤炭行业涨幅居前,纺织服装、传媒、计算机跌幅最大。

医药行业自2017年8月份起出现反弹,医药工业景气度回升并维持高位。四季度伊始,国务院出台了一系列重要的医药行业政策,自上而下发文推进医药创新所有环节的优化,将对我国医药行业产生深远影响。四季期间,新政已经展现出其对行业尤其创新品种更加高效的审批速度、更大的支持力度,市场对于医药行业投资的将更为看好。

报告期内,本基金完成建仓期阶段。建仓期结束后,本基金股票投资仓位基本保持在90%-95%之间,以实现对业绩比较基准的跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富中证中药指数(LOF)基金份额净值为1.0107,本报告期基金份额净值增长率为0.87%,同期业绩比较基准收益率为-1.37%,收益率超越业绩比较基准2.24%。收益率的差异因素主要来源于期间成份股分红、日常申购赎回等因素。本基金日均跟踪误差为0.0707%,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年市场投资风格反映的是背后业绩的相对变化,2018年全球经济仍在复苏过程中,净出口和投资对GDP的支撑作用将比2017年有所增加,而城市化的持续和人均收入的稳步增长决定了消费升级是今后我国经济增长的一个长期主线,因此,2018年我国宏观经济面值得期待。在货币政策方面,金融去杠杆、严监管和国民去杠杆在2018年仍然是重要工作,防范金融风险也是十九大以来的首要工作之一,因此,在全球进入加息周期的背景下,守住不发生系统性金融风险的底线上,货币政策的操作空间并不大,更多的是结构的调整。

A股市场风格轮换的大趋势,在短期内,随着业绩兑现的时间窗口的不断推进,中小创股票中有良性业绩增长、估值调整到位的股票在2018年将获得较好的投资机会,但中小创整体趋势性机会还是很难见到。资金在股市的配置将继续看重公司基本面因素,低估值、稳定高成长的股票将继续受到青睐。

从长期来看,不论是美股还是A股,医药板块都是长牛板块,也是10倍股出现最多的行业。关于中药的整体思路是国家鼓励中医药的发展,用现代科技支持中医药的传承和创新,培育传统名方、大品种,中药行业受益于估值偏低、产品提价、中药消费品打开成长空间,以及大型国有中药企业混合所有制改革,是很好的长期投资品种。

作为被动投资的指数型基金,汇添富中证中药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。

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》、《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,自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:本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式。具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定,基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,国基金收益分配基准日某一类的基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于其面值。

本基金本报告期未进行利润分配。

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,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,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 露、陈军于2018年3月27日签字出具了安永华明(2018)审字第60466941_B76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:汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)

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	3,570,433.70	225,722,398.13
结算备付金	13,130.82	-
存出保证金	5,347.82	-
交易性金融资产	50,001,809.15	105,228,805.46
其中:股票投资	50,001,809.15	105,228,805.46
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	-	-
应收利息	703.13	20,065.09
应收股利	-	-
应收申购款	268,622.97	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	53,860,047.59	330,971,268.68

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	633,878.21	54,392,028.40
应付赎回款	54,926.17	-
应付管理人报酬	34,109.07	11,317.44
应付托管费	4,547.86	1,509.00
应付销售服务费	6,555.54	3,396.22
应付交易费用	20,593.09	96,447.42
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	180,000.00	20,326.09
负债合计	934,609.94	54,525,023.57
所有者权益:		
实收基金	52,408,372.24	275,904,387.75
未分配利润	517,065.41	541,857.36
所有者权益合计	52,925,437.65	276,446,245.11
负债和所有者权益总计	53,860,047.59	330,971,268.68

注:报告截止日2017年12月31日,基金份额净值1.0099元,基金份额总额52,408,372.24份,其中下属A类基金份额参考净值1.0107元,份额总额34,337,091.65份;下属C类基金份额参考净值1.0084元,份额总额18,071,280.59份。

7.2 利润表

会计主体:汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)

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12月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入	3,877,864.17	684,486.80
1.利息收入	430,940.95	14,546.99
其中:存款利息收入	91,506.34	14,546.99
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	339,434.61	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	3,696,223.40	-
其中:股票投资收益	3,133,317.92	-
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	562,905.48	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-390,042.47	664,054.80
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	140,742.29	5,885.01
减:二、费用	1,567,725.68	142,629.44
1. 管理人报酬	728,777.90	11,317.44
2. 托管费	97,170.42	1,509.00
3. 销售服务费	14,109.07	3,396.22
4. 交易费用	354,978.97	105,721.69
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	216,253.38	20,686.09
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	2,310,138.49	541,857.36

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)

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)	275,904,387.75	541,857.36	276,446,245.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	2,310,138.49	2,310,138.49
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)	-223,496,015.51	-2,334,930.44	-225,830,945.95
其中:1.基金申购款	105,746,468.27	4,835,032.41	110,581,500.68
2.基金赎回款	-329,242,483.78	-7,169,962.85	-336,412,446.63
四、本期内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)	52,408,372.24	517,065.41	52,925,437.65

项目	上年度可比期间 2016年12月29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)	275,904,387.75	-	275,904,387.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	541,857.36	541,857.36
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期内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)	275,904,387.75	541,857.36	276,446,245.11

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

张晖 李鹏 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 报告附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2962号文《关于准予汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)注册的批复》以及中国证券监督管理委员会机构部函[2016]2898号文《关于汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)延期募集备案的回函》准予注册,由汇添富基金管理股份有限公司于2016年11月28日起至2016年12月23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_B28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12月29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275,780,093.52元,在募集期间产生的存款利息为人民币124,294.23元,以上实收基金(本息)合计为人民币275,904,387.75元,折合275,904,387.75份基金份额。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司,基金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,包括中证中药指数的成份股、备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、固定收益品种(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、中小企业私募债券、质押及买断式回购等法律法规或中国证监会允许基金投资的固定收益类金融工具)、银行存款(包括定期存款及协议存款)、衍生工具(股指期货、权证、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)。本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪中证中药指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,以便为投资者带来长期收益。本基金绩比较基准为:中证中药指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。

7.4.2 会计政策的编制基础

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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依据企业会计准则、《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,即每年自1月1日起至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;

(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。

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

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。

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的股票,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的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