汇添富中证生物科技主题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	汇添富中证生物科技指数(LOF)	
基金主代码	501009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月22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	143,387,731.31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:	汇添富中证生物科技指数A	汇添富中证生物科技指数C
下属分级基金的场内简称:	生物科技	生物科C
下属分级基金的交易代码:	501009	501010
报告期末下属分级基金的份额总额	45,289,534.76份	98,098,196.55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,紧密跟踪中证生物科技主题指数,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,或因基金的申购和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	中证生物科技主题指数收益率×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	021-28932888	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		021-28932998	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12月22日(基金合同生效日)-2016年12月31日	
	汇添富中证生物科技指数A	汇添富中证生物科技指数C	汇添富中证生物科技指数A	汇添富中证生物科技指数C
本期已实现收益	2,760,610.25	1,385,281.67	-76,932.30	-39,453.78
本期利润	7,988,289.54	2,084,728.74	386,572.15	156,825.63
加权平均基金份额本期利润	0.1022	0.0668	0.0023	0.0022
本期基金份额净值增长率	14.94%	14.83%	0.23%	0.22%
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	0.0438	0.0427	0.0000	0.0000
期末基金资产净值	52,172,104.74	112,888,026.06	165,373,897.01	70,028,551.59
期末基金份额净值	1.1520	1.1508	1.0023	1.0022

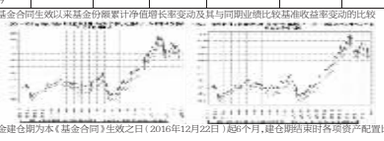
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入,投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
汇添富中证生物科技指数A

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	6.20%	1.17%	6.46%	1.16%	-0.26%	0.01%
过去六个月	9.98%	1.01%	10.35%	0.99%	-0.37%	0.02%
过去一年	14.94%	0.87%	12.49%	0.87%	2.45%	0.00%
自基金合同生效日起至今	15.20%	0.86%	12.56%	0.86%	2.64%	0.00%

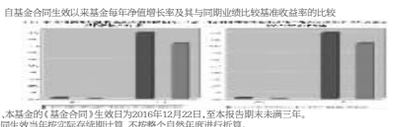
汇添富中证生物科技指数C

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	6.21%	1.17%	6.46%	1.16%	-0.25%	0.01%
过去六个月	10.03%	1.01%	10.35%	0.99%	-0.32%	0.02%
过去一年	14.83%	0.87%	12.49%	0.87%	2.34%	0.00%
自基金合同生效日起至今	15.08%	0.86%	12.56%	0.86%	2.52%	0.00%

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22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22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22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基金管理人等业务牌照。
汇添富基金自成立以来,始终将投资业绩放在首位,形成了规树一根的品牌优势,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,汇添富旗下股票主动管理资产规模位居业内第一,权益类投资业绩排名第一,偏股型基金业绩排名第一,债券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,上证指数发展主题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、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,公司利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,营销培训活动拓展到银行和券商的网点、营业部。
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、现金宝的全新客服基条,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;汇添富港股通市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,社保海外组合资债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,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”建立精对关系,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,向公司员工发售筹款台历、参加2.1知名跑群众性公益活动——一个鸣蛋的慈走等款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:裁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,为巩固中国梦添砖加瓦,为成为中国最优秀的资产管理公司而努努努力奋斗!
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基金、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)基金的基金经理。	2016年12月22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3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、汇添富中证医药卫生ETF联接基金、汇添富中证生物科技指数(LOF)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。

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,覆盖了全面开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合;确定了境内上市股票、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、监督检查的投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括:(1)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独立管理投资组合的风险和投资策略,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,所有交易均在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。所有场外交易均存在集中交易室处理,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,核查的内容包括不同时间窗口下同向交易、反向交易、交易价差、成交量差异、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行检验显著程度,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
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,贵金属、从2017年6月开始,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,医药、传媒、计算机跌幅最大。
医药行业自2015下半年开始起出现反弹,医药工业氣度回升并维持高位。四季度伊始,国务院出台了一系列重要的医药行业政策,自上而下发力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重视。
报告期内,本基金遵循投资基金的被动投资原则,保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位报告期内基本保持在90%-96%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的目标。
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生物科技指数(LOF)基金份额净值为1.1520,本报告期基金份额净值增长率为14.94%,同期业绩比较基准收益率为12.49%,收益率超越业绩比较基准2.45%。收益率的差异来源主要来源于期末资产组合的股票投资,以及期末现金、银行存款等资产的配置。本基金日均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年市场投资风格反转的基础是前期经济的相对变化,2018年全球经济仍在复苏过程中,净出口和投资对GDP的支撑作用将比之前更加明显,而随着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年我国宏观经济面的趋势,在货币政策方面,金融去杠杆、严监管和居民去杠杆在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股市场风格轮换的核心,即顺转变,但对业绩及估值匹配的考量将逐渐加大,中小创股票中有性价比的业绩增长、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、稳定真成长的股票将继续受到青睐。
生物科技行业是同质化不高的行业,具备生物制品研发与生产能力的上市公司可以在细分领域获得生命力,而且生物科技行业是可以纵向延伸的行业,具备细胞的生命力,在这样的环境下,生物科技行业既有稳健的业绩增长,又不断产生新的业务内容,代表未来医学发展方向和未来确定性需求,更是医药新政最受益的行业,是投资时的投资品种。
作为被动投资的指数型基金,汇添富中证生物科技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各级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,确保基金运作和公司经营合法合规
本报告期内,督察长和稽核监察部门根据独立履行职责的原则,对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,对基金投资、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系统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》、《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》)等相关规定和基金合同的约定,日常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。
4.8 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: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,因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。
4.9 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,完全区别于自身的资产管理业务、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_B73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:汇添富中证生物科技主题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	16,312,686.69	110,776,050.73
结算备付金	404,172.17	-
存出保证金	26,146.29	-
交易性金融资产	155,277,602.11	146,391,895.29
其中:股票投资	155,277,602.11	146,391,895.29
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	2,863.40	31,577.20
应收股利	-	-
应收申购款	968,811.39	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	172,992,282.05	257,199,523.22
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	3,474,314.81	21,586,462.87
应付赎回款	3,978,187.24	-
应付管理人报酬	94,806.86	43,329.01
应付托管费	12,640.91	5,777.20
应付销售服务费	32,417.40	6,874.78
应付交易费用	149,784.03	133,475.33
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	190,000.00	21,155.43
负债合计	7,932,151.25	21,797,074.62
所有者权益:		
实收基金	143,387,731.31	234,859,050.82
未分配利润	21,672,399.49	543,397.78
所有者权益合计	165,060,130.80	235,402,448.60
负债和所有者权益总计	172,992,282.05	257,199,523.22

注:报告截止日2017年12月31日,基金份额净值1.1511元,基金份额总额143,387,731.31份,其中下属A类基金份额参考净值1.1520元,份额总额45,289,534.76份;下属C类基金份额参考净值1.1508元,份额总额98,098,196.55份。
7.2 利润表
会计主体:汇添富中证生物科技主题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22日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入	11,908,231.72	767,695.47
1.利息收入	278,888.79	103,034.07
其中:存款利息收入	90,686.64	26,880.02
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	188,202.15	76,154.05
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	5,532,160.36	-
其中:股票投资收益	5,122,305.45	-
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	409,854.91	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	5,927,126.36	659,783.86
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	170,056.21	4,877.54
减:二、费用	1,835,213.44	224,297.69
1. 管理人报酬	866,956.62	43,329.01
2. 托管费	115,594.34	5,777.20
3. 销售服务费	135,626.74	6,874.78
4. 交易费用	488,370.43	146,401.27
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	228,665.31	21,915.43
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	10,073,018.28	543,397.78

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:汇添富中证生物科技主题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)	234,859,050.82	543,397.78	235,402,448.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	10,073,018.28	10,073,018.28
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)	-91,471,319.51	11,055,983.43	-80,415,336.08
其中:1.基金申购款	267,656,085.46	36,816,753.25	304,472,838.71
2.基金赎回款	-359,127,404.97	-25,760,769.82	-384,888,174.79
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)	143,387,731.31	21,672,399.49	165,060,130.80

项目	上年度可比期间 2016年12月22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)	234,859,050.82	-	234,859,050.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	543,397.78	543,397.78
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)	234,859,050.82	543,397.78	235,402,448.60

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:
张晖 李晓 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
汇添富中证生物科技主题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理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2933号文《关于准予汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金(LOF)注册的批复》准予注册,经中国证券监督管理委员会机构部函[2016]2897号文《关于汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金(LOF)延期募集备案的回函》准予延期募集,由汇添富基金管理股份有限公司作为基金发起人于2016年11月28日至2016年12月16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_B24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22日生效。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的折算认购费后的实收基金(本金)为人民币234,773,897.52元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币85,153.30元,以上实收基金(本息)合计为人民币234,859,050.82元,折合234,859,050.82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,注册登记机构为中国证券登记结算有限公司,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,包括中证生物科技主题指数的成份股、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,紧密跟踪中证生物科技主题指数,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。本基金的业绩比较基准为:中证生物科技主题指数收益率×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、解释等以及其他相关规定(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