汇添富医药保健混合型证券投资基金 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

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

基金简称	汇添富医药保健混合
基金主代码	470006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月21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	1,855,005,644.35份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用自下而上的投资方法,精选医药保健行业的优质上市公司,在保证严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例;以效规避系统性风险;个股精选策略用于挖掘医药保健行业中具有长期持续增长模式、估值水平相对合理的优质上市公司。
业绩比较基准	中证医药卫生指数 × 80% + 上证国债指数 × 20%
风险收益特征	本基金是混合型基金,本基金的风险和预期收益比较均衡,在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。

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	上海市淮城路99号囍目国际大楼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	2015年
本期已实现收益	-202,097,000.52	-488,706,669.13	2,103,831,926.12
本期利润	-132,681,687.53	-1,012,433,303.54	2,551,486,226.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0525	-0.3721	0.6417
本期基金份额净值增长率	-3.26%	-16.82%	46.09%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.2893	0.3480	0.7794
期末基金资产净值	2,419,546,411.34	3,906,709,206.64	6,026,628,669.99
期末基金份额净值	1.304	1.348	1.924

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。

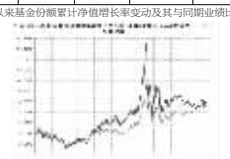
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

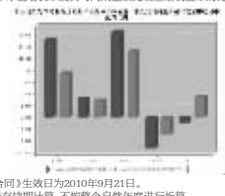
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率标准差③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.27%	1.00%	5.89%	0.83%	-3.62%	0.17%
过去六个月	0.38%	0.82%	4.49%	0.69%	-4.11%	0.13%
过去一年	-3.26%	0.74%	11.14%	0.62%	-14.40%	0.12%
过去三年	17.55%	2.01%	36.22%	1.47%	-18.67%	0.54%
过去五年	83.63%	1.74%	85.52%	1.32%	-1.89%	0.42%
自基金合同生效日起至今	61.60%	1.59%	56.99%	1.28%	4.61%	0.31%

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(2010年9月21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 过去五年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2010年9月21日。

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	-	-	-	-	
2016	2.510	588,456,228.59	130,132,353.98	718,587,582.57	
2015	-	-	-	-	
合计	2.510	588,456,228.59	130,132,353.98	718,587,582.57	

注:本基金2017年、2015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"、"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挚头功能: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,营销培训活动形成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,搭建了囍抵顾式服务、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、五年间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"河流·孩子"公益助学计划,并成立"河流·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竞建结合,催生出新活力和亮点,公司竞委下属的八个竞支部分别与各地"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"河流·孩子"相关品牌活动,延续爱心传递温暖。持续开展"河流·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台历、参加护上知名的群众性公益活动——一个鸣蛋的暴走等就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		
周睿	汇添富医药保健混合基金的基金经理,医药行业投资总监。	2012年3月2日	-	10年	国籍:中国。学历:上海交通大学工商管理硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:管任海通证券研究所医药行业研究员,2009年9月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任医药行业投资总监。2012年3月2日至今任汇添富医药保健混合基金的基金经理。

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资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

2017年是价值投资的回归年,A股资金状况和投资者结构的变化导致了市场风格的大变化,特别是北上资金的加入改变了部分A股的定价方式,股票市场二八现象明显,以贵州茅台、中国平安、格力电器以及恒瑞医药为代表的中国核心资产备受市场追捧,另供给侧改革也推动了钢铁、水泥等周期类股票的上涨,而中小创等高估值股票被市场抛弃。2017年上证50指数涨幅最大,全年上涨25.08%,上证综指涨幅为6.56%,深证成指涨幅为8.48%,创业板指涨幅为-10.67%,中证医药指数上涨13.75%。

回顾2017年,本基金运作不如人意,调仓不够彻底,虽然本人意识到市场风格的变化,但对于部分中小盘股票心存幻想,没有能及时止损,严重拖累了基金业绩表现。本年度基于医药行业变化,我们按照创新、消费升级和供给侧改革三条主线作局个股,目下而上精选个股,抓住了片仔癀、丽珠集团和益丰药房等个股机会,但没有能重仓恒瑞医药、复星医药等个股。2017年股票仓位控制在85-95%之间。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富医药保健混合基金份额净值为1.304元,本报告期基金份额净值增长率为-3.26%;同期业绩比较基准收益率为11.14%。

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,我们认为医药板块延续结构化行情。过去三年,医药政策频出,行业正在发生巨变,特别是"国36条"的颁布吹响了医药改革的号角,创新、质优和临床急需成为药品上市审批的鼓励方向,并且国家提高了行业准入门槛和监管标准,医药行业的供给侧改革顺利推进,行业的优胜劣汰正在加速,现行政策下呈现强者恒强的态势趋势。2018年看好三大投资机会:1)创新药带来的估值和业绩的双提升,过去几年的新药研发投入将进入收获期,将驱动公司业绩增长;2)以一致性评价为代表的医药供给侧改革正席来的市场格局的重塑,仿制药市场有望形成寡头企业,与慢病相关的优质仿制药将取得较大的市场份额;3)居民消费结构升级以及医疗商业险的导入正在催生新的医药消费市场,院外市场有望成长为数千亿的市场规模,连锁药店、体检机构正成为传统医院之外的最重要的居民健康消费场所。

2018年,本基金将紧跟行业变化趋势,努力把握行业发展方向,精选具有核心竞争优势、长期成长性明确的优质医药企业,力争为基金持有人带来持续的良好回报。个股配置上,我们继续看好创新药、创新技术、以及消费升级、技术升级的相关个股。

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积极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,确保基金运作和公司经营合法合规

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有实和优化。

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》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,可以提议测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:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)可供分配利润的10%,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

本报告期内,本基金托管人在对汇添富医药保健混合型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,汇添富医药保健混合型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富医药保健混合型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,汇添富医药保健混合型证券投资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汇添富医药保健混合型证券投资基金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,认上内容真实、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_B12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:汇添富医药保健混合型证券投资基金

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	275,633,505.60	356,732,165.64
结算备付金	7,358,340.05	8,944,062.16
存出保证金	1,065,285.41	1,448,980.84
交易性金融资产	2,147,960,691.34	3,569,672,203.42
其中:股票投资	2,147,678,870.54	3,569,672,203.42
基金投资	-	-
债券投资	271,820.80	-
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	13,027,675.79	17,355,163.69
应收利息	66,575.48	83,506.30
应收股利	-	-
应收申购款	1,298,200.54	1,188,091.14
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,446,400,274.21	3,955,424,173.19
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	17,117,364.87	35,636,760.17
应付赎回款	1,342,157.12	1,717,903.05
应付管理人报酬	3,637,532.35	5,395,406.46
应付托管费	606,255.40	899,234.38
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,758,620.46	4,651,756.88
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	391,932.67	413,905.61
负债合计	26,853,862.87	48,714,966.55
所有者权益:		
实收基金	1,855,005,644.35	2,898,127,479.12
未分配利润	564,540,766.99	1,008,581,727.52
所有者权益合计	2,419,546,411.34	3,906,709,206.64
负债和所有者权益总计	2,446,400,274.21	3,955,424,173.19

注:报告截止日2017年12月31日,基金份额净值1.304元,基金份额总额1,855,005,644.35份。

7.2 利润表

会计主体:汇添富医药保健混合型证券投资基金

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1月1日至2016年12月31日
一、收入	-49,870,540.21	-907,689,297.83
1.利息收入	3,099,655.38	4,595,106.14
其中:存款利息收入	2,986,017.78	3,462,651.54
债券利息收入	54.99	1,078,584.60
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	113,582.61	53,870.00
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-123,625,713.22	-390,808,072.94
其中:股票投资收益	-144,513,096.14	-406,908,473.05
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-533,746.66
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	20,887,382.92	16,634,146.77
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	69,415,312.99	-523,726,634.41
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,240,204.64	2,250,303.38
减:二、费用	82,811,147.32	104,744,005.71
1、管理人报酬	49,335,798.97	64,679,916.72
2、托管费	8,222,633.25	10,779,986.10
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	24,823,596.39	28,833,672.32
5、利息支出	-	755.14
其中:卖出回购金融资产支出	-	755.14
6、其他费用	429,118.71	449,675.43
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-132,681,687.53	-1,012,433,303.54

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富医药保健混合型证券投资基金

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)	2,898,127,479.12	1,008,581,727.52	3,906,709,206.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-132,681,687.53	-132,681,687.53
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)	-1,043,121,834.77	-311,359,273.00	-1,354,481,107.77
其中:1.基金申购款	582,261,231.89	176,925,547.17	759,186,779.06
2.基金赎回款	-1,625,383,066.66	-488,284,820.17	-2,113,667,886.83
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)	1,855,005,644.35	564,540,766.99	2,419,546,411.34

项目	上年度可比期间 2016年1月1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)	3,132,041,026.71	2,894,587,643.28	6,026,628,669.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-1,012,433,303.54	-1,012,433,303.54
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)	-233,913,547.59	-154,985,029.66	-388,898,577.24
其中:1.基金申购款	1,432,816,979.44	836,373,542.76	2,269,190,522.20
2.基金赎回款	-1,666,730,527.03	-991,358,572.41	-2,658,089,099.44
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)	-	-718,587,582.57	-718,587,582.57
五、期末所有者权益(基金净值)	2,898,127,479.12	1,008,581,727.52	3,906,709,206.64

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

汇添富医药保健混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),原汇添富医药保健股票型证券投资基金,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[2010]1067号文《关于核准汇添富医药保健股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人汇添富基金管理有限公司(现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2010年9月21日正式生效,首次设立募集规模为4,084,719,054.44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和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。

根据中国证券监督管理委员会于2014年8月8日颁行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定,经与基金托管人协商一致,汇添富基金管理股份有限公司决定自2015年8月5日起将本基金变更为混合基金,并相应修改本基金的《基金合同》。

本基金采用自下而上的投资方法,精选医药保健行业的优质上市公司,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期稳健增值。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。本基金以医药保健行业上市公司为股票主要投资对象,投资于医药保健行业上市公司股票的资产占股票资产的比例不低于80%。本基金的业绩比较基准为:中证医药卫生指数×80%+上证国债指数×20%。

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 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布(证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行))的通知》(以下简称"估值业务指引"),自2017年12月1日起,本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。该会计估计变更对本基金本期末的基金资产净值及本期损益影响不重大。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策