汇添富香港优势精选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03月28日

§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01月01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	汇添富香港优势精选混合(QDII)
基金主代码	470888
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年06月25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	250,064,012.27份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在香港证券市场精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的公司股票等证券,通过有效的资产配置和组合管理,进行中长期投资布局,在有效管理风险的前提下,追求持续稳健的较高投资回报。
投资策略	本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中,根据宏观经济和证券市场状况,通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征,确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中,采用"自下而上"的策略,精选出具有持续竞争优势,且估值有吸引力的股票,精心科学构建股票投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。
业绩比较基准	MSCI中华指数(MSCI ZhongHua Index)。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。

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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	布朗兄弟哈里曼银行
	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
注册地址		140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		NY 10005

注:本基金无境外投资顾问。

2.5 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	2015年
本期已实现收益	32,952,920.29	-12,565,966.46	7,147,937.74
本期利润	66,947,305.01	-9,644,820.68	64,423.09
加权平均基金份额本期利润	0.3068	-0.0689	0.0008
本期基金份额净值增长率	32.08%	-6.01%	-3.43%
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	0.1393	-0.0458	0.0153
期末基金资产净值	284,896,917.04	241,713,628.10	119,718,028.40
期末基金份额净值	1.139	0.954	1.015

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。

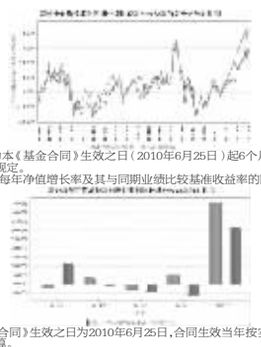
3.2 基金净值表现

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	净值增长率①	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	8.91%	1.13%	7.24%	0.90%	1.67%	0.23%
过去六个月	19.66%	0.97%	19.14%	0.82%	0.52%	0.15%
过去一年	32.08%	0.84%	45.90%	0.74%	-13.82%	0.10%
过去三年	19.89%	1.16%	32.34%	1.16%	-12.45%	0.00%
过去五年	32.76%	1.05%	34.21%	1.08%	-1.45%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	29.54%	0.99%	42.33%	1.16%	-12.79%	-0.17%

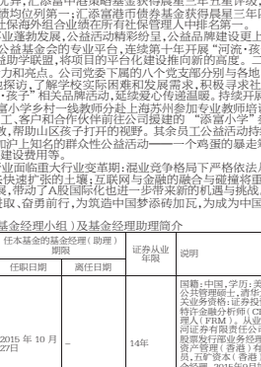
注:本基金的《基金合同》生效日为2010年6月25日。

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6月25日)起6个月,建仓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、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。

4.1.3 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

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;贯穿了投权、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、场外证券业务等。(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,香港市场全年走出了强劲的单边上升趋势,中间的波动和回撤较小。其中一方面是资金流入的推动,另一方面也有企业盈利增长的部分。从对恒生指数上涨的贡献而言,来自盈利提升的贡献度还高过了来自估值的贡献度,显示本次牛市行情还是较为健康和可持续的。

资金层面,港股市场在全年大部分时间里流动性相对充裕,我们看到有来自全球增配港股的资金,在全球经济缓慢复苏、各个主要经济体逐渐加息或走出负利率的环境下,资金对于收益率的要求提升,使其在权益资产、大宗商品和新兴市场等风险资产上的配置都有所增加。香港市场也是其中加配的方向之一。另一方面,我们看到来自内地的投资者越来越多的通过港股通渠道南下配置港股,成交量占比也在全年逐步抬升,到年尾已经基本稳定在了10%左右水平。未来我们预期这个比例还会继续增加。本基金一回贯彻的投资风格是基于深入的基本面分析,精选行业和个股来做中长期的投资,因此我们近年来比较偏好价值没有完全体现的大盘蓝筹股,并也取得了不错的效果。我们认为,上述两种资金中的机构投资者也都带有较为中长期的投资特征,从去年下半年一直持续至今,在背后的投资逻辑没有出现明显反转的迹象情况下,和我们在这些理念上是有共通之处的。

同时,我们也看到中国的经济增长活力出现了回暖趋势,企业盈利增长良好,中期业绩表现在近年来都处于较快水平。在供给侧改革、环保监管趋严等政策推动下,一些工业原材料与周期品行业持续复苏,产成品价格和利润率都处于近年高峰,我们还在观察需求层面是否有相应的提升,这会是行业基本面能够持续表现的重要前提。因此我们在周期品投资上相对比较谨慎。

另外,一些优质的成长股也在市场活跃的情况下,持续得到资金的追捧。全年体现出明显的盈利叠加估值的戴维斯双升趋势。如汽车、手机电子、地产、医药等板块的龙头股全年涨幅较大。本组合根据对于基本面的判断,也对其中一些优质品种进行了配置,并紧密观察市场预期与后面实际基本面的变化,我们会优先选择确定性较高,估值安全边际相对合理的进行投资。在估值已经比较充分体现乐观预期的时候,我们也会择时离场。

从基金运作情况来看,整体选股上把握住了部分强势的板块和优质的个股,我们在二季度对于市场的相对谨慎,在6月市场风险事件较多的情况下提前降低了组合仓位水平,损失了一些市场收益。但在四季度我们改变了操作思路,仓位上还是保持较高,而在品种上根据市场脉络进行了调整配置,在年尾的市场波动中效果较好,我们也会继续总结和反思在操作上的经验和不足。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金2017年全年收益率为32.08%,同期基准收益率为45.90%,超额收益为-13.82%。

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,整体我们仍然保持相对乐观的判断,虽然经过了2017年较大幅度的上涨,但目前香港市场的整体估值还处在合理的范围,并未有明显的过热迹象。企业盈利预期将继续良性增长,来自内地和海外的资金也会持续流向这个具有吸引力的市场。虽然市场还将面临剩许多风险因素的挑战,如海外市场利率提升边际效应递增,国内金融降杠杆对资金面的持续作用等,因此波动会比之前更大更频繁,但在波动中也会出现更多机会。我们很难对短期的市场完全准确地把握,可以做的是通过更深入的基本面研究,去判断一个公司中长期的发展趋势,而价格的短期起伏应该可以给我们创造更好的交易时点。另外今年也是各种国内外政策交织作用的一年,对市场的边际影响会高过去年,因此我们也会留意国内外资金流动的变化趋势,这个会是影响港股市场大方向的关键因素。

接下来重点方向仍然会重点关注景气度提升的行业,包括受益于产业政策、科技发展、以及行业竞争优势等,我们认为未来这样一些行业中的龙头会大概率产生超过市场甚至穿越牛熊的超额收益。另外今年也面临政府的换届,我们也会预期一些政策和监管的变化,很多也是影响行业发展的关键性因素。行业方面也会继续维持均衡,同时重仓我们坚定看好的个股。近期比较关注的方向包括互联网+、地产、新兴消费、环保新能源以及医药相关的板块,同时对于一些短期有负面因素影响的行业如燃气、汽车、电子硬件等,我们会非常关注行业拐点的出现,因为其中的龙头公司还是长期具有投资价值的。持有一家公司最核心的因素,还是会着眼看未来是不是值得持有6个月甚至更久而获得超额收益。

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,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致性。

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: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12次,最少一次,每份基金份额收次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的25%,若(基金合同)生效不满3个月可不进行收益分配。

本基金于2017年11月14日实施利润分配,每份基金份额派发红利0.12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,本基金托管人在对汇添富香港优势精选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,汇添富香港优势精选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香港优势精选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回的格计算、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,汇添富香港优势精选混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为26,206,984.81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汇添富香港优势精选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,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_B13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:汇添富香港优势精选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	22,386,169.29	37,483,494.90
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	262,908,574.20	203,807,036.87
其中:股票投资	262,908,574.20	203,807,036.87
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	-	1,295,164.05
应收利息	5,438.28	7,154.19
应收股利	-	-
应收申购款	575,249.39	162,422.14
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	285,875,431.16	242,755,272.15
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	37.27	29.45
应付赎回款	248,423.60	280,874.15
应付管理人报酬	376,421.96	321,774.24
应付托管费	70,579.11	60,332.69
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	132,132.84	227,618.89
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	150,919.34	151,014.63
负债合计	978,514.12	1,041,644.05
所有者权益:		
实收基金	250,064,012.27	253,315,358.54
未分配利润	34,832,904.77	-11,601,730.44
所有者权益合计	284,896,917.04	241,713,628.10
负债和所有者权益总计	285,875,431.16	242,755,272.15

注:报告截止日2017年12月31日,基金份额净值1.139元,基金份额总额250,064,012.27份。

7.2 利润表

会计主体:汇添富香港优势精选混合型证券投资基金

本报告期:2017年01月01日 至 2017年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2017年01月01日 至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日 至 2016年12月31日
一、收入	73,791,367.50	-5,429,658.24
1.利息收入	230,896.81	144,957.63
其中:存款利息收入	230,896.81	144,957.63
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	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	40,601,230.88	-9,168,145.39
其中:股票投资收益	38,087,092.72	-10,392,273.90
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	2,514,138.16	1,224,128.51
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	33,994,384.62	2,921,135.78
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-1,199,376.68	559,367.24
5.其他收入(损失以"-"号填列)	164,231.80	113,026.50
减:二、费用	6,844,062.49	4,215,162.44
1. 管理人报酬	3,781,168.24	2,104,580.83
2. 托管费	708,969.12	394,608.93
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,193,440.58	1,560,473.50
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	160,484.55	155,499.18
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	66,947,305.01	-9,644,820.68

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富香港优势精选混合型证券投资基金

本报告期:2017年01月01日 至 2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年01月01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)	253,315,358.54	-11,601,730.44	241,713,628.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	66,947,305.01	66,947,305.01
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)	-3,251,346.27	5,694,315.01	2,442,968.74
其中:1.基金申购款	141,536,722.79	9,062,589.16	150,589,311.95
2.基金赎回款	-144,788,069.06	-3,368,274.15	-148,146,343.21
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)	-	-26,206,984.81	-26,206,984.81
五、期末所有者权益(基金净值)	250,064,012.27	34,832,904.77	284,896,917.04

项目	上年度可比期间 2016年01月01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、上年初所有者权益(基金净值)	117,916,501.58	1,801,526.82	119,718,028.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-9,644,820.68	-9,644,820.68
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)	135,398,856.96	-3,758,436.58	131,640,420.38
其中:1.基金申购款	235,677,003.56	-11,973,877.73	223,703,125.83
2.基金赎回款	-100,278,146.60	8,215,441.15	-92,062,705.45
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)	253,315,358.54	-11,601,730.44	241,713,628.10

报表附注为财务报表的组成部分。

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

汇添富香港优势精选混合型证券投资基金(以下简称"本基金",原汇添富香港优势精选股票型证券投资基金,是由汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金转型而来。汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金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[2009]1221号文《关于核准汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选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6月25日正式生效,首次设立募集规模为522,636,079.14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,境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)。

2014年1月8日,汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开,大会讨论通过了关于修改基金名称及投资细节的议案。在基金管理人向中国证监会履行相应备案手续,并经中国证监会书面确认后,基金份额持有人大会决议生效。2014年1月17日,中国证监会基金部函[2014]23号文《关于汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》书面确认后,原《汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金基金合同》失效,《汇添富香港优势精选股票型证券投资基金基金合同》生效,"汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金"更名为"汇添富香港优势精选股票型证券投资基金",同时基金投资目标、投资范围等投资细节相应调整。根据中国证券监督管理委员会于2014年8月8日实行的《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》。

本基金投资范围为香港证券市场公开上市的股票、固定收益产品、基金、货币市场工具以及相关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构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,可以将其纳入投资范围。本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中,根据宏观经济和证券市场状况,通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征,确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中,采用"自下而上"的策略,精选出具有持续竞争优势,且估值有吸引力的股票,精心科学构建股票投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。本基金的业绩比较基准为:MSCI中华指数(MSCI ZhongHua Index)。

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编报规则》第3号《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及其他有关规定的要求,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

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。

7.4.5 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

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《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》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的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有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]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税;

基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

7.4.6.1 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题,根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("工商银行")	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司(""东方证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
上海上投资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚全投资管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brother Harriman & Co.)("布朗兄弟")	基金境外托管人

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

关联方名称	本期 2017年01月01日 至 2017年12月31日		上年度可比期间 2016年01月01日 至 2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
东方证券股份有限公司	-	-	16,825,664.51	2.34

7.4.8.1.2 债券交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 基金交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.8.1.5 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日 至 2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	-	-	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2016年01月01日 至 2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	16,863.01	2.37%	-	-

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017年01月01日 至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日 至 2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,781,168.24	2,104,580.83
其中:支付销售机构的客户维护费	132,081.63	99,506.97

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.60%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.60%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2017年01月01日 至 2017年12月31日 | 上年度可比