

汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）2016年第4季度报告

2016年12月31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

报告送出日期：2017年1月19日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2017 年 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇添富中证精准医指数（LOF）
交易代码	501005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 21 日
报告期末基金份额总额	799,063,978.05 份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪中证精准医疗主题指数，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。在正常市场情况下，日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	中证精准医疗主题指数收益率×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。
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

下属分级基金的基金简称	汇添富中证精准医指数 A	汇添富中证精准医指数 C
下属分级基金的场内简称	精准医疗	
下属分级基金的交易代码	501005	501006
报告期末下属分级基金的份额总额	676, 416, 453. 35 份	122, 647, 524. 70 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2016 年 10 月 1 日 — 2016 年 12 月 31 日 ）	
	汇添富中证精准医指数 A	汇添富中证精准医指数 C
1. 本期已实现收益	9, 944, 334. 39	1, 617, 808. 84
2. 本期利润	-18, 499, 676. 83	-3, 553, 633. 76
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0257	-0. 0279
4. 期末基金资产净值	682, 483, 559. 71	123, 283, 730. 80
5. 期末基金份额净值	1. 0090	1. 0052

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

汇添富中证精准医指数 A

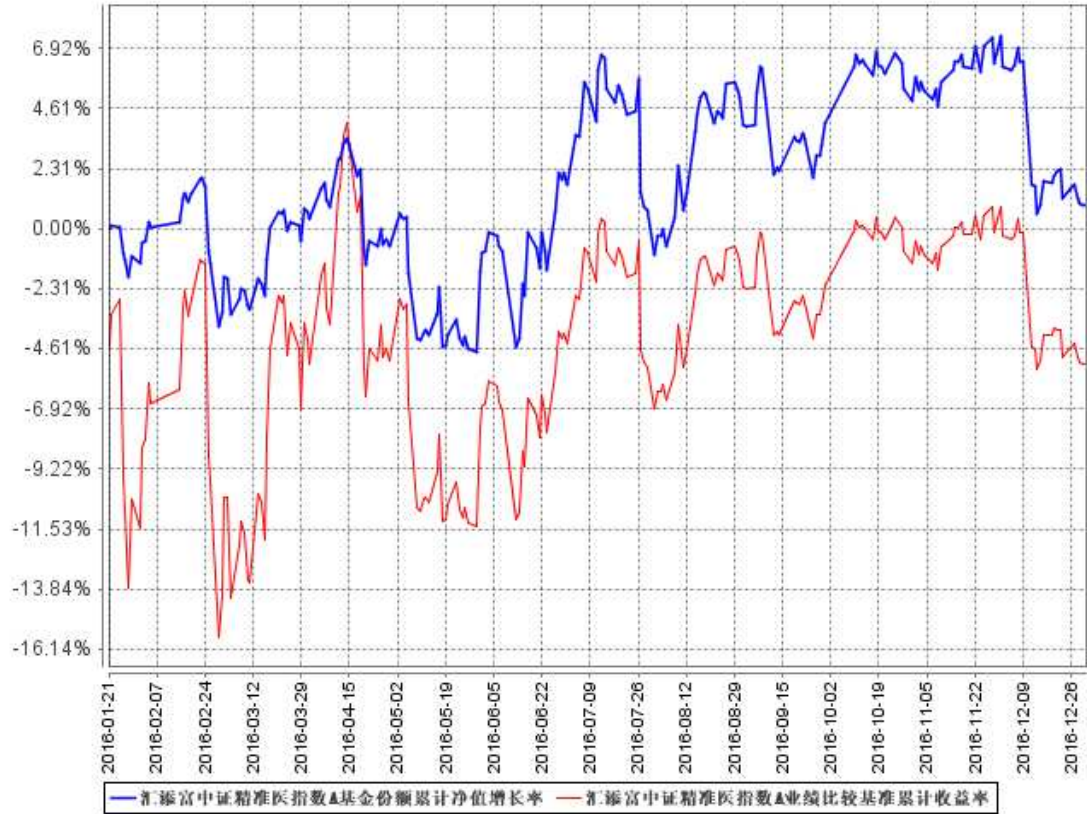
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3. 05%	0. 81%	-3. 14%	0. 80%	0. 09%	0. 01%

汇添富中证精准医指数 C

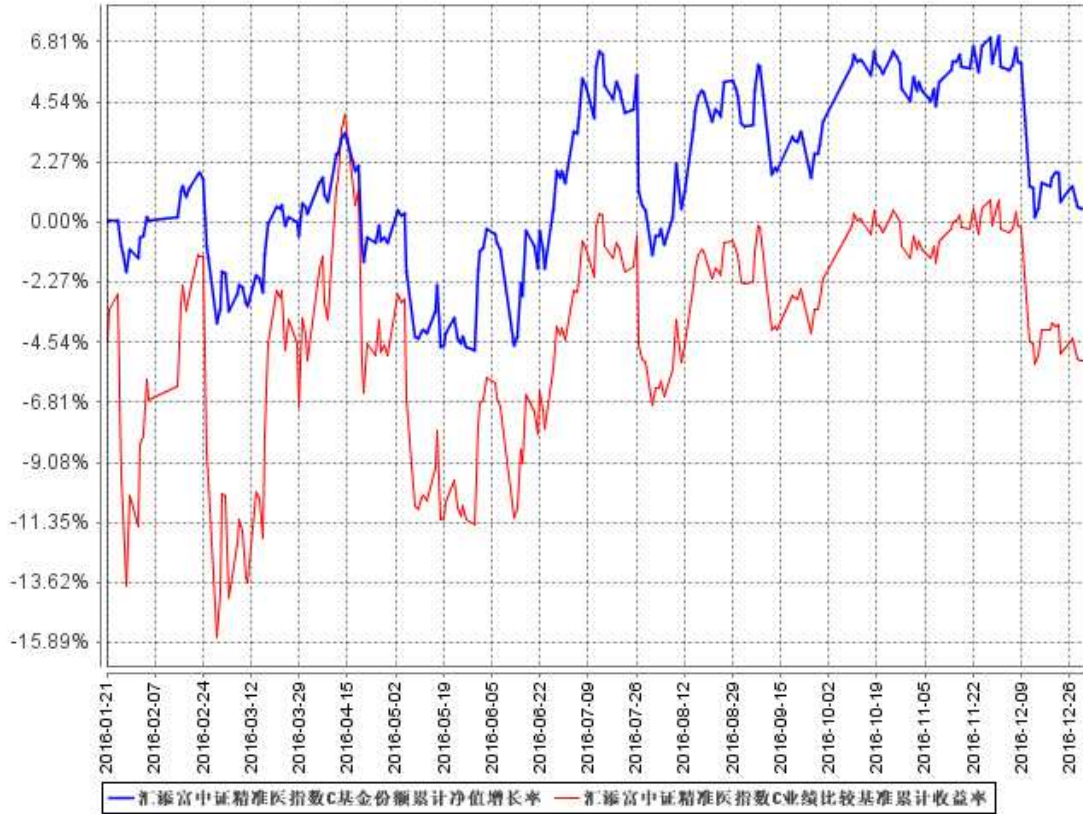
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3. 14%	0. 81%	-3. 14%	0. 80%	0. 00%	0. 01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

汇添富中证精准医指数A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富中证精准医指数C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2016 年 1 月 21 日，截至本报告期末，基金成立未满 1 年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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安中指数基金、汇添富成长多因子股票基金、汇添富主要消费	2016年1月21日	-	10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

	ETF 联接基金、汇添富中证精准医指数基金、中证上海国企 ETF、汇添富中证互联网医疗指数（LOF）的基金经理，指数与量化投资部副总监。			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 8 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 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医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。
--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 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，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》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合，交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 8 次，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年四季度上证指数上涨 3.29%，欧美日股市在四季度均出现较大幅上涨，亚洲股市表现平平。经历美国大选及美联储加息靴子落地后，黄金在四季度大幅下跌。人民币贬值速度在国庆假期后加速。同期，我国经济数据、企业盈利数据、价格数据均呈现企稳回升势头。房地产市场价格指数出现环比下降，严格的房地产调控政策初现效果。债券市场在四季度经历了剧烈调整，利率快速攀升，资金紧张态势在接近年末时才稍有缓解。在债券市场收益率快速下降、房市受政策抑制、黄金被美元加息压制的情况下，A 股市场机会在增加，同时波动性或将继续增大，资金追求布局确定性和流动性较高的资产。

本基金在报告期内遵循了指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性，股票投资仓位在考察期内始终保持在 90%~95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内精准医疗基准下跌-3.14%，本基金在报告期内累计收益率为-3.05%，收益率超越业绩比较基准 0.09%。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 0.0263%，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。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	762,045,407.38	94.38
	其中：股票	762,045,407.38	94.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	43,388,974.09	5.37
8	其他资产	2,015,189.00	0.25
9	合计	807,449,570.47	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	615,040,190.21	76.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	48,324,640.20	6.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,979,148.00	1.98
J	金融业	106,780.00	0.01
K	房地产业	24,308,484.68	3.02

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	25,662,286.40	3.18
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	32,570,368.00	4.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	762,045,407.38	94.57

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资组合。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600196	复星医药	1,729,503	40,020,699.42	4.97
2	600276	恒瑞医药	845,379	38,464,744.50	4.77
3	300003	乐普医疗	2,099,346	37,641,273.78	4.67
4	000516	国际医学	4,583,550	36,210,045.00	4.49
5	002030	达安基因	1,533,596	35,579,427.20	4.42
6	300244	迪安诊断	1,017,824	32,570,368.00	4.04
7	600594	益佰制药	1,950,285	32,472,245.25	4.03
8	600851	海欣股份	2,272,278	29,380,554.54	3.65
9	600572	康恩贝	3,864,542	28,249,802.02	3.51
10	000518	四环生物	3,169,742	28,147,308.96	3.49

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无国债期货持仓。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	207,514.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,623.32
5	应收申购款	1,798,050.92

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,015,189.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000516	国际医学	36,210,045.00	4.49	重大资产重组

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证精准医指数 A	汇添富中证精准医指数 C
报告期期初基金份额总额	808,448,162.60	137,653,680.33
报告期期间基金总申购份额	76,441,259.36	26,875,154.63
减：报告期期间基金总赎回份额	208,472,968.61	41,881,310.26
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	676,416,453.35	122,647,524.70

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

汇添富中证精准医指数 A

注：1、其中“申购/买入”含红利再投、转换入份额；“赎回/卖出”含转换出份额。

2、本公司于2016年1月18日用自有资金10,000,000.00元认购本基金份额9,999,900.00份(含募集期利息结转的份额)，认购费用1,000.00元。符合招募说明书规定的认购费率。

汇添富中证精准医指数 C

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,900.00	1.25	9,999,900.00	1.25	发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,999,900.00	1.25	9,999,900.00	1.25	发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理股份有限公司

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司
2017 年 1 月 19 日