

汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证
券投资基金（LOF）
2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 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：2020 年 10 月 28 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 2020 年 10 月 26 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 2020 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇添富中证精准医指数（LOF）
基金主代码	501005
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 21 日
报告期末基金份额总额	1,042,262,880.03 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(LOF) A	汇添富中证精准医指数(LOF) C
下属分级基金的场内简称	精准医疗	精准医 C
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	729,310,465.99 份	312,952,414.04 份

注：汇添富中证精准医指数（LOF）A 的扩位证券简称为精准医疗 LOF。

§ 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（2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日）	
	汇添富中证精准医指数（LOF）A	汇添富中证精准医指数（LOF）C
1. 本期已实现收益	89,907,817.32	38,407,171.38
2. 本期利润	-8,033,009.49	4,010,592.37
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0118	0.0135
4. 期末基金资产净值	1,227,369,383.65	517,698,932.77
5. 期末基金份额净值	1.6829	1.6542

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（LOF）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	6.30%	2.18%	3.17%	2.23%	3.13%	-0.05%
过去六个月	45.48%	1.92%	41.63%	1.96%	3.85%	-0.04%
过去一年	75.08%	1.77%	68.15%	1.80%	6.93%	-0.03%
过去三年	76.48%	1.79%	78.02%	1.82%	-1.54%	-0.03%
自基金合同生效日起至	68.29%	1.54%	57.91%	1.69%	10.38%	-0.15%

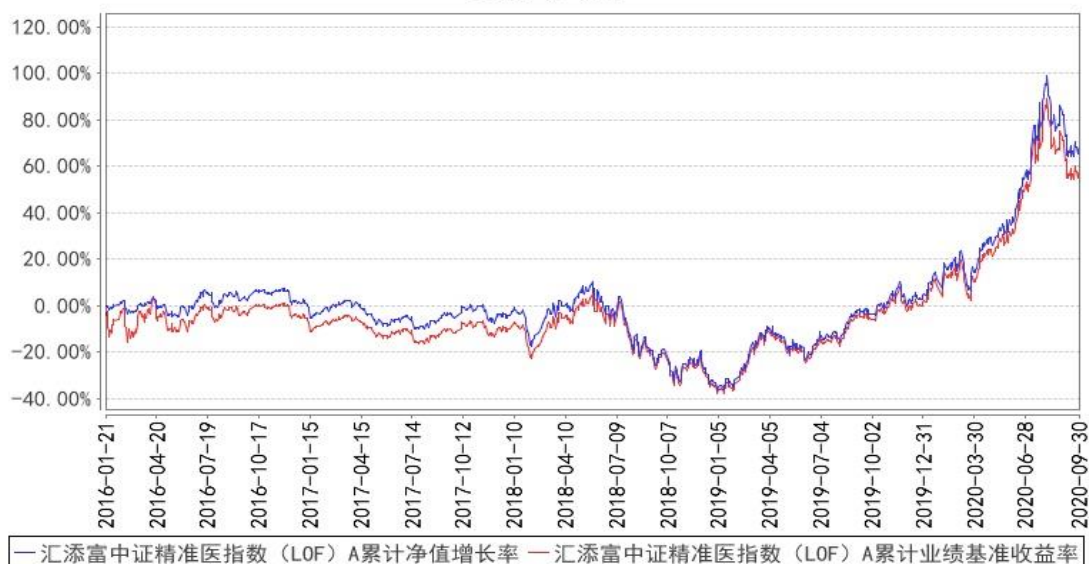
今						
---	--	--	--	--	--	--

汇添富中证精准医指数（LOF）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	6.19%	2.18%	3.17%	2.23%	3.02%	-0.05%
过去六个月	45.18%	1.92%	41.63%	1.96%	3.55%	-0.04%
过去一年	74.44%	1.77%	68.15%	1.80%	6.29%	-0.03%
过去三年	74.64%	1.79%	78.02%	1.82%	-3.38%	-0.03%
自基金合同生效日起至 今	65.42%	1.54%	57.91%	1.69%	7.51%	-0.15%

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（LOF）A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（LOF）C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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016年1月21日）起6个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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	本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监	2016年1月21日	-	14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，2017年8月10日至今任汇添富中证500指数（LOF）的基金经理，2018年3月23日至今任添富价值多因子股票的基金经理，2019年7月26日至今任添富中证长三角ETF的基金经理，2019年9月24日至今任汇添富中证长三角ETF联接的基金经理，2019年11月6日任添富中证国企一带一路ETF的基金经理，2020年3月5日任添富中证国企一带一路ETF联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作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。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、

营运、风险管理以及合规稽核等相关部门组成，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。

对于同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3 日内和 5 日内）同买或者同卖同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。根据 95%置信区间下平均价差率的 T 检验显著程度、同向交易占优比等方面进行综合分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。本报告期内，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本公司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成交量的 5%的情况有 1 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

7 月初市场在金融板块的带动下出现短暂快速上涨行情，但未能持续，整个三季度行情震荡缺乏主线。

全球疫情仍有反复，欧美及部分发展中国家病例数据表现出二次爆发的迹象。但市场已经对疫情数据已经有较为充分的预期，风险因素大多已被定价，市场情绪整体具备一定韧性。政策角度，美联储、欧央行等受疫情影响，将多项缓释型政策执行期限延期至年底，但并没有出现大幅宽松的态势。

国内来看，经济数据体现出经济稳步修复，未来前景可期。经济增长三驾马车出口、消费、投资累计增速均持续回升。其中以投资的回升最为显著，8 月累计城镇固定资产投资增速已接近与去年同期持平，三季度末预计大概率回正。社会消费品零售总额年初以来同比累计降幅不断收窄，8 月单月同比数据已实现年内首次正增长。贸易数据前三季度整体超预期，进出口总额较去年同期增长 0.7%，年内首次转正，进出口、出口、进口国际市场份额均创下历史新高。工业企业盈利增速、PMI 等数据持续回升，且 PMI 的各分项指标均有不同程度回升。其中产成品库存的回

升体现企业开始主动补库存，表明对经济活动的信心显著修复。

国内政策面角度，七月底召开的政治局会议将十四五计划、2035 年远景目标提上日程，并计划在 10 月召开十九届五中全会。政策定调“国内大循环为主体、国内国际双循环”的发展格局，以应对持久战。此次政治局会议体现了我国宏观政策一贯的长期性和持久性，不因短期冲击压力而进行过度调节。在货币政策方面，仍然要确保金融支持实体经济，推动综合融资成本的下降，整体基调上维持稳健，强调了结构性调整和精准滴灌。

在海外动荡的环境的对比之下，国内经济恢复及政策层面的确定性更强、预期更为乐观。尽管数据显示三季度北上资金有部分流出，但流出主要来自交易型资金，配置型资金仍保持了相对稳健的流入。

从中期来看，防范疫情将带来对医药板块尤其是疫苗、检测、设备的常态化需求；长期来看，精准医疗所涵盖的肿瘤创新药、细胞治疗、基因诊断、疫苗等新型医疗手段，是当下医药行业升级发展的方向。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位基本保持在 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

截至本报告期末，本基金 A 份额净值为 1.6829 元，本报告期 A 份额净值增长率为 6.30%；截至本报告期末，本基金 C 份额净值为 1.6542 元，本报告期 C 份额净值增长率为 6.19%；同期业绩比较基准增长率为 3.17%。

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	1,648,878,144.50	93.71
	其中：股票	1,648,878,144.50	93.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,970,604.40	0.79
	其中：债券	13,970,604.40	0.79
	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	86,507,210.30	4.92
8	其他资产	10,113,324.77	0.57
9	合计	1,759,469,283.97	100.00

注：本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 58,447,687.00 元，占基金资产净值比例 3.35%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	1,120,948,670.44	64.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	241,160,678.95	13.82
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	278,671,040.64	15.97
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,640,780,390.03	94.02

5.2.2 报告期末积极投资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	7,552,527.31	0.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	28,264.03	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	30,812.50	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	346,020.51	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,813.40	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	112,287.60	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,097,754.47	0.46

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	300122	智飞生物	768,035	106,994,955.85	6.13
2	600196	复星医药	2,070,367	101,675,723.37	5.83
3	300601	康泰生物	528,926	96,269,821.26	5.52
4	603259	药明康德	874,369	88,748,453.50	5.09
5	300760	迈瑞医疗	247,542	86,144,616.00	4.94
6	300347	泰格医药	822,030	84,627,988.50	4.85
7	002044	美年健康	5,925,705	84,026,496.90	4.82
8	600276	恒瑞医药	855,811	76,868,944.02	4.40
9	000661	长春高新	205,510	75,964,716.40	4.35
10	300142	沃森生物	1,427,800	72,646,464.00	4.16

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	688065	凯赛生物	17,809	1,621,331.36	0.09
2	300896	爱美客	4,730	1,527,946.09	0.09
3	300999	金龙鱼	57,083	1,467,033.10	0.08
4	688086	紫晶存储	9,361	455,038.21	0.03
5	688408	中信博	4,450	411,091.00	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	13,970,604.40	0.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,970,604.40	0.80

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019627	20 国债 01	86,980	8,689,302.00	0.50
2	010107	21 国债(7)	51,920	5,281,302.40	0.30

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投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：报告期末本基金无国债期货持仓。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	400,944.33
2	应收证券清算款	170,022.63
3	应收股利	1,884.00
4	应收利息	214,804.54
5	应收申购款	9,325,669.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,113,324.77

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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	688065	凯赛生物	1,621,331.36	0.09	新股流通受限
2	300999	金龙鱼	1,467,033.10	0.08	新股流通受限
3	688408	中信博	411,091.00	0.02	新股流通受限

§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 (LOF) A	汇添富中证精准医指数 (LOF) C
报告期期初基金份额总额	439,066,216.20	235,604,555.03
报告期期间基金总申购份额	990,128,219.97	425,459,701.73
减:报告期期间基金总赎回份额	699,883,970.18	348,111,842.72
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	729,310,465.99	312,952,414.04

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

注：本报告期内基金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

注：本基金成立后有 9,999,900.00 份为发起式份额，发起份额承诺的持有期限为 2016 年 1 月 21 日至 2019 年 1 月 21 日。截至本报告期末，发起资金持有份额为 0.00 份。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

§ 10 备查文件目录

10.1 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。

10.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

10.3 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

2020 年 10 月 28 日