

**汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资  
基金联接基金  
2019 年第 4 季度报告**

2019 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：2020 年 1 月 21 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01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2019年10月01日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	添富中证医药ETF联接
基金主代码	007076
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年3月26日
报告期末基金份额总额	118,706,112.77份
投资目标	通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于目标ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金不参与目标ETF的投资管理。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为中证医药卫生ETF的联接基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，

	本基金通过投资目标ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数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	添富中证医药ETF联接A	添富中证医药ETF联接C
下属分级基金的交易代码	007076	007077
报告期末下属分级基金的份额总额	52,433,098.10份	66,273,014.67份

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159929
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年8月23日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013年9月16日
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

### 2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要采取完全复制法，在正常市场情况下，日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中证医药卫生指数
风险收益特征	属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本系列基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

## §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（2019年10月1日-2019年12月31日）	
	添富中证医药ETF联接A	添富中证医药ETF联接C
1. 本期已实现收益	3,646,833.77	4,647,591.50
2. 本期利润	4,876,226.00	4,286,846.32
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0748	0.0542
4. 期末基金资产净值	56,412,289.54	71,090,448.99
5. 期末基金份额净值	1.0759	1.0727

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

添富中证医药ETF联接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	4.09%	1.00%	4.90%	1.01%	-0.81%	-0.01%

添富中证医药ETF联接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	3.99%	1.00%	4.90%	1.01%	-0.91%	-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

添富中证医药ETF联接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



添富中证医药ETF联接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（2019年3月26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		
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	2019年3月26日	-	8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

	<p>物科技指数 (LOF) 基金、汇添富中证中药指数 (LOF) 基金、汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) 基金、中证银行ETF基金、添富中证医药ETF联接基金、添富中证银行ETF联接基金、添富中证800ETF基金的基金经理。</p>			<p>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联接基金的基金经理，2015年8月18日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理，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，2016年12月29日至今任汇添富中证中药指数 (LOF) 基金的基金经理，2018年5月23日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) 基金的基金经理，2018年10月23日至今任中证银行ETF基金的基金经理，2019年3月26日至今任添富中证医药ETF联接</p>
--	---	--	--	--

					基金的基金经理，2019年4月15日至今任添富中证银行ETF联接基金的基金经理，2019年10月8日至今任添富中证800ETF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，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、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

本基金本报告期内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场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11次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年4季度大盘及机构重仓板块以盘整为主，以建筑材料、房地产、有色为代表的周期板块出现补涨行情，单季度涨幅超10%。中证800涨7.21%，创业板涨10.48%。

四季度，政策以稳增长出发，以基建为重要抓手，以降低实体经济融资成本为方向，推进利率市场化改革，流动性合理充裕。12月中央经济工作会议，对2020年经济工作的总体要求仍是稳字当头，实现量的合理增长和质的稳步提升。中美贸易摩擦在四季度有明显缓解迹象，为资本市场提供了较好的情绪环境。

资本市场改革稳步推进，资本市场的重要性进一步提升。新修订的证券法将于2020年3月1日起开始施行。此次证券法修订从证券发行制度、强化投资者保护、强化信息披露等多方面进行了修订和完善，对打造一个规范、透明、开放、有活力、有韧性的资本市场，具有深远的意义。银保监会发布《中国银保监会关于推动银行业保险业高质量发展的指导意见》，提出要大力发展直接融资市场。银行保险机构要健全与直接融资发展相适应的服务体系，运用多种方式为直接融资提供配套支持，提高直接融资比重。

中证医药指数在四季度上涨5.14%，稍弱于市场大盘指数。一方面是前三季度涨幅较大，估值优势相对减弱；另一方面是带量采购和医保谈判方向明确，仿制药价格下降速度较快，市场出现一定担忧。未来，研发创新（创新药、生物科技）、消费升级（品牌中药、疫苗、肿瘤药）、制造升级（仿制药龙头集中）依然是医药行业的大趋势。中证医药投资于中药、化药、生物药、器械、服务、商业六大医药子板块，从子板块中选择龙头公司组成指数，是做医药行业全面配置的好品种。

报告期内，本基金仍处于建仓期阶段，9月末建仓期结束后，股票与标的ETF投资仓位基本保持在90%~95%之间，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，汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接A级份额净值为1.0759元，本报告期基金份额净值增长率为4.09%；汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券



投资基金联接C级份额净值为1.0727元，本报告期基金份额净值增长率为3.99%；同期业绩比较基准收益率为4.90%。

#### 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	5,944,073.19	4.60
	其中：股票	5,944,073.19	4.60
2	基金投资	116,051,429.00	89.87
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	6,593,748.81	5.11
8	其他资产	544,374.86	0.42
9	合计	129,133,625.86	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	4,444,916.99	3.49
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	390,061.00	0.31
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	83,888.00	0.07
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	392,182.00	0.31
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	633,025.20	0.50
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,944,073.19	4.66

### 5.2.2 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

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	600276	恒瑞医药	9,046	791,705.92	0.62
2	000661	长春高新	1,000	447,000.00	0.35
3	603259	药明康德	4,000	368,480.00	0.29
4	300015	爱尔眼科	4,900	193,844.00	0.15
5	000538	云南白药	2,100	187,803.00	0.15
6	002044	美年健康	11,280	167,959.20	0.13
7	600436	片仔癀	1,461	160,520.07	0.13
8	300142	沃森生物	4,900	158,956.00	0.12
9	300003	乐普医疗	4,200	138,936.00	0.11
10	300347	泰格医药	2,100	132,615.00	0.10

### 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投资。

### 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投资。

### 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投资。

### 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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	医药ETF	指数型	交易型开放式(ETF)	汇添富基金管理股份有限公司	116,051,429.00	91.02

**5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

注：本基金本报告期末未持有股指期货投资。

**5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

**5.12 投资组合报告附注****5.12.1 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。

**5.12.2 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。

**5.12.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	83,628.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,393.71
5	应收申购款	459,352.21
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	544,374.86

#### 5.12.4 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的处于转股期的可转换债券。

#### 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	添富中证医药ETF联接A	添富中证医药ETF联接C
报告期期初基金份额总额	107,954,673.88	101,284,788.77
报告期期间基金总申购份额	8,817,955.37	13,954,075.95
减:报告期期间基金总赎回份额	64,339,531.15	48,965,850.05
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	52,433,098.10	66,273,014.67

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 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 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。

### § 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医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文

件；

- 2、《汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 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医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金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20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](http://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1月21日