汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）2020年第2季度报告

2020年6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7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07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2020年04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富中证互联网医疗指数(LOF)
基金主代码	501007
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月22日
报告期末基金份额总额	71,749,644.69份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪中证互联网医疗主题指数，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。本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	中证互联网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	汇添富中证互联网医疗指数A	汇添富中证互联网医疗指数C
下属分级基金的场内简称	互联医疗	互联医C
下属分级基金的交易代码	501007	501008
报告期末下属分级基金的份额总额	49,363,186.99份	22,386,457.70份

注：汇添富中证互联网医疗指数（LOF）A的扩位证券简称为互联网医疗LOF；汇添富中证互联网医疗指数（LOF）C的扩位证券简称为互联网医疗LOFC。

§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4月1日-2020年6月30日）	
	汇添富中证互联网医疗指数A	汇添富中证互联网医疗指数C
1.本期已实现收益	2,932,789.55	1,334,601.12
2.本期利润	11,963,158.72	5,841,669.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.2059	0.2036
4.期末基金资产净值	62,739,710.43	28,187,260.44
5.期末基金份额净值	1.2710	1.2591

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

汇添富中证互联网医疗指数A

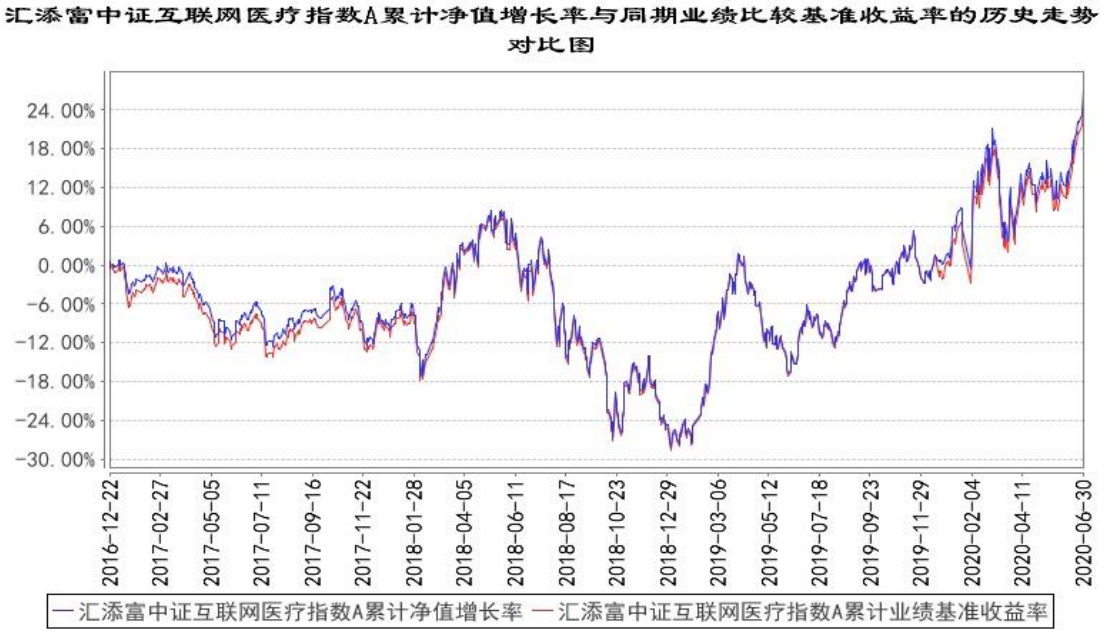
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	20.20%	1.45%	20.17%	1.46%	0.03%	-0.01%
过去六个月	25.92%	1.93%	25.86%	1.95%	0.06%	-0.02%
过去一年	40.09%	1.55%	38.57%	1.57%	1.52%	-0.02%
过去三年	35.82%	1.60%	36.77%	1.60%	-0.95%	0.00%

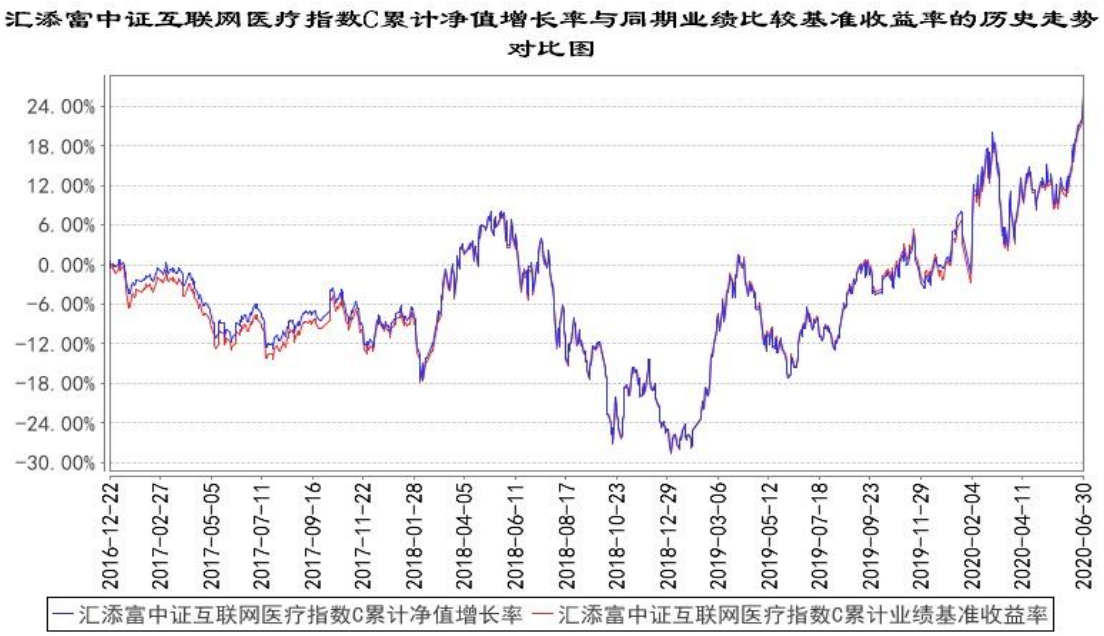
自基金合同生效起至今	27.10%	1.50%	25.39%	1.51%	1.71%	-0.01%

汇添富中证互联网医疗指数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	20.09%	1.45%	20.17%	1.46%	-0.08%	-0.01%
过去六个月	25.65%	1.93%	25.86%	1.95%	-0.21%	-0.02%
过去一年	39.51%	1.55%	38.57%	1.57%	0.94%	-0.02%
过去三年	34.81%	1.59%	36.77%	1.60%	-1.96%	-0.01%
自基金合同生效起至今	25.91%	1.50%	25.39%	1.51%	0.52%	-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





注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016 年 12 月 22 日）起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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 12 月 22 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、本报告期未发生本基金的基金经理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遵规守信情况的说明

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26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

2020年2季度全球股市企稳反弹，海外流动性风险缓解，国内市场也普遍上涨。A股市场，休闲服务、电子、医药生物、食品饮料、传媒行业涨幅居前五，仅采掘、纺织服装、建筑装饰三个行业下跌。

4月以来国内生产活动逐步恢复，社会消费品零售同比恢复较快，尤其是食品项等主要消费板块在4月出现明显的报复性消费的迹象。5月后，以汽车消费为代表的可选消费复苏加快但分化加剧，主要消费回归正常。6月因天气及疫情反复的原因社会开工强度有所放缓，发电集团日均耗煤量显示经济改善但仍有波折。货币政策在二季度偏稳健，边际并未有更大宽松，财政政策接力，社融整体向好。

以美国为代表的海外国家启动大放水，向市场注入巨大的流动性。在海外疫情并未出现明显抑制的态势的背景下重启经济显示出海外经济也承担了巨大的压力，疫情反复也将对经济复苏形

成扰动。海外5月份经济数据明显改善，但力度远小于中国。

互联网医疗主题是计算机行业和医疗行业的交叉发展和医药商业新模式的探索。互联网医疗指数在二季度上涨21.29%。

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。股票投资仓位报告期内基本保持在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 类基金份额净值为 1.2710 元，本报告期基金份额净值增长率为20.20%；截至本报告期末本基金C类基金份额净值为1.2591元，本报告期基金份额净值增长率为20.09%；同期业绩比较基准收益率为20.17%。

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	86,157,999.52	92.98
	其中：股票	86,157,999.52	92.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	200,060.00	0.22
	其中：债券	200,060.00	0.22
	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	4,757,130.57	5.13
8	其他资产	1,544,537.97	1.67
9	合计	92,659,728.06	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	17,127,609.91	18.84
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	22,061,726.44	24.26
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	27,371,638.80	30.10
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	5,191,803.00	5.71
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	14,278,795.44	15.70
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	86,031,573.59	94.62

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	71,369.53	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	55,056.40	0.06
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	-	-

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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	126,425.93	0.14

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投资股票。

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	300253	卫宁健康	239,286	5,489,220.84	6.04
2	300676	华大基因	33,300	5,191,803.00	5.71
3	603883	老百姓	50,008	5,002,800.32	5.50
4	002044	美年健康	346,112	4,987,473.92	5.49
5	300347	泰格医药	48,704	4,961,963.52	5.46
6	603939	益丰药房	53,550	4,873,050.00	5.36
7	300451	创业慧康	257,050	4,752,854.50	5.23
8	002223	鱼跃医疗	126,400	4,600,960.00	5.06
9	002727	一心堂	121,700	4,516,287.00	4.97
10	002777	久远银海	148,106	4,503,903.46	4.95

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	002989	中天精装	980	55,056.40	0.06
2	300837	浙矿股份	737	33,187.11	0.04
3	300833	浩洋股份	406	26,430.60	0.03
4	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	200,060.00	0.22
	其中：政策性金融债	200,060.00	0.22
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	200,060.00	0.22

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	018013	国开2004	2,000	200,060.00	0.22

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债券。

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

注：本基金本报告期末无股指期货持仓。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末无国债期货持仓。

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	68,514.33
2	应收证券清算款	394,576.11
3	应收股利	-
4	应收利息	1,765.34
5	应收申购款	1,079,682.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,544,537.97

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证互联网医疗指数A	汇添富中证互联网医疗指数C
报告期期初基金份额总额	63,865,501.34	34,729,518.74
报告期期间基金总申购份额	16,037,910.14	19,522,229.85
减:报告期期间基金总赎回份额	30,540,224.49	31,865,290.89
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	49,363,186.99	22,386,457.70

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

单位：份

项目	汇添富中证互联网医疗指数A	汇添富中证互联网医疗指数C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,900.09	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,900.09	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	20.26	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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

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	10,000,900.09	13.94	10,000,900.09	13.94	3年

基金管理人高级管理人员	100.00	0.00	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	21,012.89	0.03	-	-	-
合计	10,022,012.98	13.97	10,000,900.09	13.94	-

§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互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)募集的文件；

2、《汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)基金合同》；

3、《汇添富中证互联网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互联网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7月21日