

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）2021年第3季度报告

2021年09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

送出日期：2021年10月27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2021年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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2021年07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

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(份)	52,013,274.06
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。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变

	通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。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%。本基金的投资策略主要包括:资产配置策略;股票投资组合构建;债券投资策略;股指期货、权证等金融衍生工具投资策略;股票期权投资策略;融资及转融通投资策略;存托凭证的投资策略。	
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(LOF)A	汇添富中证互联网医疗指数(LOF)C
下属分级基金场内简称	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(份)	38,270,448.38	13,742,825.68

注:A类份额扩位证券简称:互联网医疗 LOF;C类份额扩位证券简称: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(2021年07月01日-2021年09月30日)	
	汇添富中证互联网医疗指数(LOF)A	汇添富中证互联网医疗指数(LOF)C
1. 本期已实现收益	-760,142.49	-299,377.26
2. 本期利润	-3,772,894.90	-1,206,675.72
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0986	-0.0927

4. 期末基金资产净值	42,742,088.27	15,128,793.59
5. 期末基金份额净值	1.1168	1.1009

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 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(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	-8.25%	1.42%	-7.76%	1.43%	-0.49%	-0.01%
过去六个月	-5.64%	1.22%	-6.11%	1.23%	0.47%	-0.01%
过去一年	-11.01%	1.28%	-12.68%	1.29%	1.67%	-0.01%
过去三年	26.01%	1.57%	19.49%	1.59%	6.52%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	11.68%	1.47%	5.33%	1.48%	6.35%	-0.01%
汇添富中证互联网医疗指数(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	-8.33%	1.42%	-7.76%	1.43%	-0.57%	-0.01%
过去六个月	-5.82%	1.22%	-6.11%	1.23%	0.29%	-0.01%
过去一年	-11.36%	1.28%	-12.68%	1.29%	1.32%	-0.01%
过去三	24.72%	1.57%	19.49%	1.59%	5.23%	-0.02%

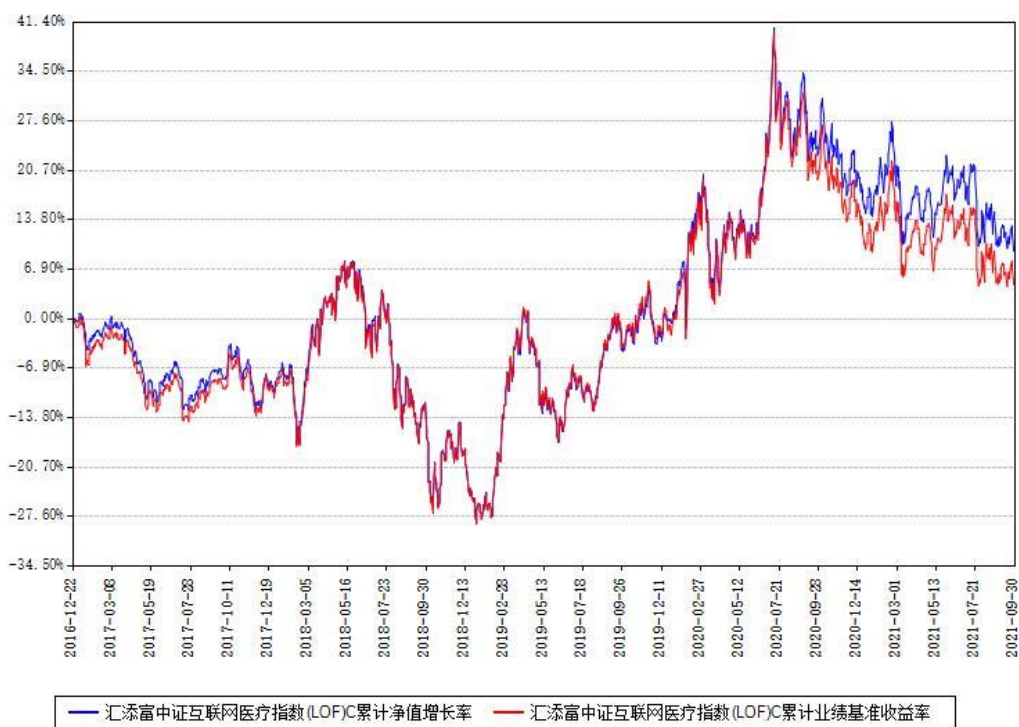
年						
自基金合同生效日起至今	10.09%	1.47%	5.33%	1.48%	4.76%	-0.01%

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

汇添富中证互联网医疗指数(LOF)A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



汇添富中证互联网医疗指数(LOF)C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



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，建仓期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 (年)	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		15	国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。从业资格: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

				<p>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。</p> <p>2010年2月6日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011年9月16日至2013年11月7日任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2013年8月23日至2015年11月2日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2</p>
--	--	--	--	---

				<p>日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年11月6日至今任汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。2015年2月16日至今任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015年3月24日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金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疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2016年7月28日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今</p>
--	--	--	--	--

				<p>任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)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年3月23日至今任汇添富沪深300指数增强型证券投资基金的基金经理。2019年7月26日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年9月24日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年11月6日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年3月5日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的</p>
--	--	--	--	---

					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“离任日期”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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行T检验。对于未通过T检验的交易,再根据同向交易占比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上,本基金管理人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4次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，相关交易事前严格根据公司内部规定进行审批，事后对其交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，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

2021年三季度市场风格再次切换至周期价值板块，上证指数宽幅震荡走平，行业板块分化显著，小盘价值风格在三季度超额收益最高。以煤炭、有色金属、钢铁领衔周期板块涨幅居前，而消费者服务、医药、食品饮料等疫情相关板块继续深度回调。

我国前三季度经济增长低于预期，疫情点状发生是主要影响因素，其次是投资端因为地产政策压制及政府投资冲动减弱而减弱。而消费在6月末也已经重回GDP三驾马车之首，三季度预计仍能保持复苏。全球原材料价格上涨，PPI保持高位，电价有提高的预期，PPI向CPI的传导较慢但依然有可能在四季度引起CPI上行。因此，国内宏观经济面临两大主要矛盾，即成本上升和偿债压力。9月末央行三季度货币政策委员会例会对于经济的定调也是相对更偏谨慎。国内货币政策预计保持合理适度、流动性合理充裕，保持社融规模。美联储退出宽松并非当前国内的主要矛盾，影响也较为有限。但由于融资需求较弱，最终国内或仍将呈现“紧信用紧货币”的实际格局，直至触发稳增长的强动力。

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，是医疗领域一直在推进的工作，尤其是公立医院得以加大发展后，这一块的需求将会增加。

互联网医疗指数在三季度下跌8.19%。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

本基金本报告期A类基金份额净值增长率为-8.25%;C类基金份额净值增长率为-8.33%。同期业绩比较基准收益率为-7.76%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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	54,547,336.06	93.83
	其中：股票	54,547,336.06	93.83
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	3,135,180.83	5.39
8	其他资产	449,907.92	0.77
9	合计	58,132,424.81	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	13,491,982.89	23.31
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	15,676,157.12	27.09
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	15,997,580.81	27.64
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	3,028,296.00	5.23
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	5,940,161.44	10.26
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	54,134,178.26	93.54

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	202,325.92	0.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,236.09	0.04
E	建筑业	8,300.53	0.01
F	批发和零售业	6,954.12	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	32,893.66	0.06
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	106,404.84	0.18
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	10,281.60	0.02
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	24,761.04	0.04
S	综合	-	-
	合计	413,157.80	0.71

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	300015	爱尔眼科	61,326	3,274,808.40	5.66
2	300347	泰格医药	17,404	3,028,296.00	5.23
3	300253	卫宁健康	196,486	2,854,941.58	4.93
4	002223	鱼跃医疗	86,400	2,800,224.00	4.84
5	002727	一心堂	91,400	2,752,968.00	4.76
6	688139	海尔生物	24,151	2,741,138.50	4.74

7	002065	东华软件	358,200	2,725,902.00	4.71
8	300937	药易购	65,300	2,724,316.00	4.71
9	300451	创业慧康	358,335	2,669,595.75	4.61
10	600055	万东医疗	143,172	2,668,726.08	4.61

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	601825	沪农商行	14,596	106,404.84	0.18
2	600955	维远股份	1,525	72,544.25	0.13
3	001213	中铁特货	5,314	32,893.66	0.06
4	605507	国邦医药	1,136	31,603.52	0.05
5	605020	永和股份	850	28,704.50	0.05

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:本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

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中,上海农村商业银行股份有限公司、爱尔眼科医院集团股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	3,823.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	304.43
5	应收申购款	445,780.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	449,907.92
---	----	------------

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不存在流通受限情况。

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不存在流通受限情况。

§ 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 (LOF)A	汇添富中证互联网医疗指数 (LOF)C
本报告期期初基金份额总额	39,201,626.61	13,757,837.61
本报告期基金总申购份额	6,254,478.52	7,082,287.23
减:本报告期基金总赎回份额	7,185,656.75	7,097,299.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	38,270,448.38	13,742,825.68

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

	汇添富中证互联网医疗指数 (LOF)A	汇添富中证互联网医疗 指数(LOF)C
报告期初持有的基金份额	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(%)	26.13	-

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：本基金的基金管理人本报告期末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	19.23	10,000,900.09	19.23	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	2,594.74	0.00	-	-	
合计	10,003,594.83	19.23	10,000,900.09	19.23	

§ 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者超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

		时间区 间					
机构	1	2021 年 7 月 22 日 至 2021 年 7 月 26 日	10,000,900.09	-	-	10,000,900.09	19.23
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、提前终止基金合同的风险 基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金规模低于 2 亿元人民币的，本基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。《基金合同》生效三年后继续存续的，持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p>							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

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）在规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

上海市黄浦区外马路 728 号 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

2021 年 10 月 27 日