# 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 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	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03月26日
报告期末 基金份额 总额(份)	68, 228, 291. 18
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。本基金的投资策略主要包括:资产配置 策略;目标 ETF 的投资策略;成份股、备选成份股投资策略;债券投资策略;可转换债券投资策略;中小企业私募债券投资策略;资产支持证券投资策略;金融衍生工具投资策略;存托凭证的投资策略。

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 的联接基金金债券型基金与货币市场基金,本基金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 (份)	30, 952, 849. 45	37, 275, 441. 73			

# 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08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09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	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其
	权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动
	进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足)导致无法获得足够
	数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的
	实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。在正常市场情况下,
	本基金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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误
	差超过正常范围的,基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步
	扩大。本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上,
	根据审慎原则合理参与存托凭证的投资,以更好地跟踪标的指数,追
	求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

业绩比较基准	中证医药卫生指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,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(2021年07月01日 - 2021年09月30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	404, 166. 28	373, 129. 72			
2. 本期利润	-6, 944, 249. 32	-7, 456, 926. 56			
3. 加权平均基金份 额本期利润	-0. 2433	-0. 2359			
4. 期末基金资产净值	46, 205, 395. 31	55, 091, 550. 11			
5. 期末基金份额净 值	1. 4928	1. 4780			

- 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

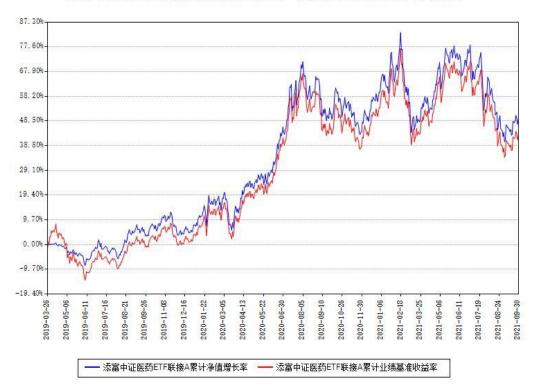
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

	添富中证医药 ETF 联接 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	-14.97%	1.92%	-15.33%	1. 95%	0.36%	-0.03%	
过去六 个月	-3.10%	1.71%	-3.97%	1. 73%	0.87%	-0.02%	
过去一	-1.39%	1.71%	-1.63%	1.73%	0.24%	-0.02%	

年						
自基金 合同生 效日起 至今	49. 28%	1.51%	43.06%	1. 59%	6. 22%	-0. 08%
		添 是	了中证医药 ETF			
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	-15.05%	1.92%	-15.33%	1.95%	0.28%	-0.03%
过去六 个月	-3.30%	1.71%	-3. 97%	1.73%	0.67%	-0.02%
过去一	-1.79%	1.71%	-1.63%	1.73%	-0.16%	-0.02%
自基金 合同生 效日起 至今	47. 80%	1.51%	43. 06%	1. 59%	4.74%	-0. 08%

# 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

### 添富中证医药ETF联接A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



#### 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(2019年03月26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		证券从业年限	说明
江口	4//	任职日期	离任日期	(年)	
过蓓蓓	本基金的基金经理	2019年03月26日		10	国历术博格金业泰公助化理年富有年任要放资的20日融放资理月证放资理月证型券金年籍:大士:从经基司理投助6基限8汇消式基基15至地式基。3能式基。3医开投经8中国金从投资:管融析部。加管司3富交数联经8任交数的15至交数的15至卫式基。3国科融业投格曾理工师基20入理。日中易证接理月中易证基年今易证基年今生指金20日旁放资金,等工资多。任有程、金15汇股20至证型券基。3证型券金8任型券金8任交数的15至岁技程。基从国限部量经、添份55今主开投金、金开投经、中开投经、中易证基、今

任中证主要消抗 数证券金经月。 2015年8月18 口至今任义。 2015年8月18 口至今任义。 2015年8月2日 开放基金金月 18 日至今易避券 投资基金金月 18 日至今易避券金经 理。2016年12 月22日至证此 数之金证数投的 基金经12 月22日至证数投的 基金经12 月22日至证数投的 基金经12 月25日至一中五证数投的 基金经12 中五证数投的 基金经12 中五证数投的 基金经12 中五证数数资基金((LOF)的基金 经2 10年12 中五证指数投资基金((LOF)的 5月23日中证是 5月23日中证规式 5月23日中证规式 5月23日中证规式 5月23日中证规式 5月23日中证规式 5月23日中证规式 5月23日年5日 2019年3月26日 1940日 2018年10 2018年10 2018年10 2018年10 2019年3月26日 2019年3月			
数证券投资基。 的基金经理。 2015 年 8 月 18 日至今任犯证添奶型券 投资基金经理。 1日至今任犯证券 2015 年 8 月 18 日至今任犯证券 2015 年 8 月 18 日至今任则证 300 交易证券 投资基金经理。 2015 年 8 月 18 日至今任刑证 300 交易证券投资基金经理。 2016 年 12 月 22 日至证券 2016 年 12 月 22 日至证券 2016 年 12 月 28 日 22 日至证券 2016 年 12 月 29 日至一年 29 日至一年 29 日至一年 29 日至一年 2018 年 5 月 23 日至一新 3 数量 2019 年 3 日 2018 年 6 日 9 日 9 日 3 日 2018 年 6 日 9 日 9 日 9 日 9 日 9 日 9 日 9 日 9 日 9 日			任中证主要消费
的基金经理。 2015 年 8 月 18 日至今任汉高宫深证 300 交易型开放式指数证基金 2015 年 8 月 18 日至今任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月 18 日至今任汉高宁 21日至今任汇添立题增为投资基金经理。2016 年 12 月 22 日至 证据数型发递起式(LOF)的基金经理。2016 年 12 月 23 日 至 一 任 工 海 工 海 對 對 發 基金 经 2 2 2 1 8 年 5 月 2 3 日 平 证 新 数 数 登 基金(LOF)的基金 经 2 2 2 1 8 年 5 月 2 3 日 平 证 新 数 数 数 型 发 基金 (LOF)的基金 经 2 2 2 1 8 年 5 月 2 3 日 平 证 正 新 数 型 发 基金(LOF)的基金 经 2 2 2 2 1 8 年 5 月 2 3 日 平 证 正 新 数 显 2 2 2 1 8 年 5 月 2 3 日 平 证 正 新 数 显 2 2 2 2 2 2 2 1 8 年 5 月 2 3 日 平 证 正 数 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2			交易型开放式指
2015 年 8 月 18 日至今任江添富 深证 300 爱型 开放式指数证券 投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至今任 深述 300 发型开放资 基金的基金经 理。2016 年 12 月 22 百 至今任 汇添富 中证生物 科技主题排投资 基金 公理。2016 年 12 月 29 日 平 6			数证券投资基金
日至今任汇添富 深证 300 交易型 开放式备证基 金的基金金理。 2015 年 8 月 18 日至今任深证 300 交易亚并投资 基金全理。2016 年 12 月 22 日至今任 汇添富主证证数型 发起式(LOF)的 基金经理。2016 年 12 1 月 29 日至 个任汇海索型投起式(LOF)的基金经理。 2018年 5 月 29 日至 个任汇海索型设置式证券投资基金 经理。2016年 12 月 29 日至 个任汇海索型发起式证产的基金 经理。2018年 5 月 23 日至分任 汇添富产工证券投资基金 经理。2018年 7 月 23 日至分据数据金经理。 2018年 7 10 月 23 日至分据和大指数证基金的基金经理。 2019年 3 月 26 日至今任正医药式基金联基金的基金经理。 2019年 3 月 26 日至少一型开放式 指数证基金经理。			的基金经理。
深证 300 交易型 开放式指数证券 投资基金解接基 金的基金经理。 2015 年 8 月 18 日至今任深证 300 交易型开放 式指数基金经 理。2016 年 12 月 22 日至一次 高主 题相数型 发起式证券投资 基金 (LOF) 的 基金 金 (LOF) 的 基金 金 (LOF) 的 基金 金 (LOF) 的 基金 全 (LOF) 的 基金 全 (LOF) 的 基金 年 正 新能 源汽车 起式证券投资基金 《经理。 2018 年 5 月 23 日平证 种数设发基金(LOF)的基金 经理。 2018 年 10 月 23 日至交易证券投资基金 经理。 2018 年 10 月 23 日至交易证券投票。 2019 年 3 月 26 日至 一个任汇添高 中证医为效基金 经理。 2019 年 3 月 26 日至 一个任汇添高 中证医为效基金 经理。 2019 年 3 月 26			2015年8月18
开放式指数证券 投资基金经理。2015 年8 月18 日至今任深证 300 交易型开放 式指数证券投资 基金的基金经理。2016 年12 月 22 日至今任 汇添富中证金数型 发起式证券投资 基金经理。2016 年12 月 29 日至 今任汇海方型的基金 (LOF)的基金经理。2016年 年12 月 29 日至 今任汇海方型的基金 (LOF)的18 年5 月 23 日至今任 汇添二年产业指数型 发起或证券投资基金 (LOF)的基金 经四。2018年 5 月 23 日至今任 汇添二年产业指数 型发起或证券投资基金 经理。 2018年 10 月 23 日至今任即证 有交验工产数型 数据金经理。 2019年 3 月 26 日至全任汇添完 中证医药,数据金经 接基金经的基金经			日至今任汇添富
开放式指数证券 投资基金经理。2015 年8 月18 日至今任深证 300 交易型开放 式指数证券投资 基金的基金经理。2016 年12 月 22 日至今任 汇添富中证金数型 发起式证券投资 基金经理。2016 年12 月 29 日至 今任汇海方型的基金 (LOF)的基金经理。2016年 年12 月 29 日至 今任汇海方型的基金 (LOF)的18 年5 月 23 日至今任 汇添二年产业指数型 发起或证券投资基金 (LOF)的基金 经四。2018年 5 月 23 日至今任 汇添二年产业指数 型发起或证券投资基金 经理。 2018年 10 月 23 日至今任即证 有交验工产数型 数据金经理。 2019年 3 月 26 日至全任汇添完 中证医药,数据金经 接基金经的基金经			深证 300 交易型
金的基金经理。 2015 年 8 月 18 日至今任深证 300 交易型开放 式指数基金经 理。2016 年 12 月 22 日至今任 汇添宫电证券投资 基金(LOF)的 基金经理。2016 年 12 月 29 日至 今任汇添宫电过券投资 基金(LOF)的 基金经理。2018 年 12 月 29 日至 今任汇添宫中证中药指数型资基金 (LOF)的基金经理。2018 年 12 月 23 日至今任 汇添宫中证者数数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018 年 5 月 23 日至今任 汇添宫中证指数型发起。(LOF)的基金经理。2018 年 10 月 23 日至今任中证成式指数证券投资基金的基金经 2019 年 3 月 26 日至6任汇添宫中证医药卫生活数式指数证券发码理。 2019 年 3 月 26 日至6任汇添宫中证医药工程数证指数证券投资基金联接基金的基金经			
金的基金经理。 2015 年 8 月 18 日至今任深证 300 交易型开放 式指数基金经 理。2016 年 12 月 22 日至今任 汇添宫电证券投资 基金(LOF)的 基金经理。2016 年 12 月 29 日至 今任汇添宫电过券投资 基金(LOF)的 基金经理。2018 年 12 月 29 日至 今任汇添宫中证中药指数型资基金 (LOF)的基金经理。2018 年 12 月 23 日至今任 汇添宫中证者数数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018 年 5 月 23 日至今任 汇添宫中证指数型发起。(LOF)的基金经理。2018 年 10 月 23 日至今任中证成式指数证券投资基金的基金经 2019 年 3 月 26 日至6任汇添宫中证医药卫生活数式指数证券发码理。 2019 年 3 月 26 日至6任汇添宫中证医药工程数证指数证券投资基金联接基金的基金经			投资基金联接基
2015年8月18日至今任深证300交易型开放式指数证券投资基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金经理。2016年12月29日至今任汇添型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年5月23日至今任汇添富中证新数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年10月23日至今任汇添富中证额投发。经理。2018年10月23日至今任中证银行交易型开放式指数证券投经理。2019年3月26日至今任汇证较支经或或者数量数量。2019年3月26日至安日汇证收货类类金的基金经期。2019年3月26日至安日汇汇收入资量,2019年3月26日至安日汇汇收入资量,2019年3月26日至安日汇汇收入资量,2019年3月26日至安日汇汇收入资量,2019年3月26日至安日工厂发表。2019年3月26日至安日工厂发表。2019年3月26日至安日工厂发表。2019年3月26日至安日工厂发表。2019年3月26日至安日工厂发表。2019年3月26日至安日工厂发表。2019年3月26日至安日工厂发表。2019年3月26日至安日工厂发表。2019年3月26日至安日工厂发表。2019年3月26日工厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂厂			
日至今任深证 300 交易型开放 式指数证券投资 基金的基金经 理。2016年12月22日至今任 汇添宫 画指数型 发起式证券投资 基金(LOF)的 基金经理。2016年12月29日至今任汇添富型发起式证券投资基金((LOF)的基金经理。2018年5月23日至今任 汇添富中证 指数型发基金((LOF)的基金经理。2018年10月23日至今任 11年10月23日至今任 11年10月23日至今任 11年10月23日至今任 11年10月23日至今任 11年10月23日至今日中证银行交易型开设基金约理。2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至今日汇汇查,2019年3月26日至4日,2019年3日,2019年			2015年8月18
300 交易型开放 式指数证券投资 基金的基金经 理。2016 年12 月 22 日至今在 汇添靠主题指数型 发起式证券投资 基金公理。2016 年12 月 29 日至 今任汇添富自立证券投资 基金(LOF)的基金全经理。2018 年 5 月 23 日至今任 汇添富中证出指数 型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2018 年 10 月 23 日至今任 汇添富中证业券投资基金(LOF)的基金经理。 2018 年 10 月 23 日至今任工厂额富产任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2019 年 3 月 26 日至今任汇工工生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。			
式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证生物科技主题证券投资基金(LOF)的基金经理。2016年12月29日至今任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年5月23日至今任汇添富中证业指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年10月23日至今任汇流营产量,2018年10月23日至今任汇积资基金约型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年3月26日至今任汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经时,2019年3月26日至今任汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经			
基金的基金经理。2016年12月22日至今任 汇添富申证生物科技主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金全理。2016年12月29日至今任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年5月23日至今任汇添富中业业指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年10月23日至今任中证银行交易型开放式指数证券投理。2019年3月26日至今任汇废药工品。2019年3月26日至今任汇废药工作数证券投理。2019年3月26日至安任工厂发表型开放式指数证券投票。			
理。2016年12月22日至今任 汇添富申证生物 科技主题指数型 发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2016年12月29日至 今任汇添数型发基金 (LOF)的基金 经理。2018年5月23日至今任 汇添富申证指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年5月23日至今任 汇添富申证指数型发起式证券投资基金经理。2018年10月23日至今任中证银行交易型开放式指数延券经经理。2019年3月26日至今任汇版药工生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经			
月 22 日至今任 汇添富中证生物 科技主题指数型 发起式证券投资 基金(LOF)的 基金经理。2016 年 12 月 29 日至 今任汇添富中证 中药指数投资 或(LOF)的基金 (LOF)的基金 经理。2018 年 5 月 23 日至今任 汇添富中证指数 型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2018 年 10 月 23 日至今任甲放式 指数证券投资基。 2019 年 3 月 26 日至今任汇添富 中证医药卫生交 易型开放式指数 证券投资基金联			
汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2016年12月29日至今任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)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型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年10月23日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年3月26日至今任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的基金经			
科技主题指数型 发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2016年12月29日至 今任汇添富中证 中药指数型发起 式证券投资基金 (LOF)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 型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2018年10月23 日至今任中证银 行交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2019年3月26 日至今任汇添富 中证医药卫生交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金的基金经			
发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2016年12月29日至今任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)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型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年10月23日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年3月26日至今任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的基金经			
基金(LOF)的基金经理。2016年12月29日至今任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)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型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年10月23日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年3月26日至今任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的基金经			
基金经理。2016年12月29日至今任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年5月23日至今任汇汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年10月23日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年3月26日至今任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的基金经			
年12月29日至 今任汇添富中证 中药指数型发起 式证券投资基金 (LOF)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 型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2018年10月23日至今任中证银 行交易型开放式 指数证券投资基金的基金经理。 2019年3月26日至今任汇添富 中证医药卫生交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金的基金经			
今任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)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型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年10月23日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年3月26日至今任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的基金经			
中药指数型发起 式证券投资基金 (LOF)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 型发起式证券投 资基金(LOF)的基金经理。 2018年10月23 日至今任中证银 行交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2019年3月26 日至今任汇添富 中证医药卫生交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金的基金经			
式证券投资基金(LOF)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 型发起式证券投 资基金(LOF)的基金经理。 2018 年 10 月 23 日至今任中证银 行交易型开放式 指数证券投资基金的基金经理。 2019 年 3 月 26 日至今任汇添富 中证医药工指数 证券投资基金联 接基金的基金经			
(LOF)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 型发起式证券投 资基金(LOF)的基金经理。 2018年10月23 日至今任中证银 行交易型开放式 指数证券投资基金的基金经理。 2019年3月26 日至今任汇添富 中证医药卫生交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金的基金经			
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型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2018年10月23日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2019年3月26日至今任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的基金经			
月 23 日至今任 汇添富中证新能 源汽车产业指数 型发起式证券投 资基金 (LOF) 的基金经理。 2018 年 10 月 23 日至今任中证银 行交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2019 年 3 月 26 日至今任汇添富 中证医药卫生交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金的基金经			
汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2018年10月23日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2019年3月26日至今任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的基金经			·
源汽车产业指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2018年10月23日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2019年3月26日至今任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的基金经			
型发起式证券投资基金 (LOF)的基金经理。 2018年10月23日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2019年3月26日至今任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的基金经			
资基金(LOF)的基金经理。 2018年10月23日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2019年3月26日至今任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的基金经			
的基金经理。 2018年10月23 日至今任中证银 行交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2019年3月26 日至今任汇添富 中证医药卫生交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金的基金经			
2018年10月23 日至今任中证银 行交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2019年3月26 日至今任汇添富 中证医药卫生交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金的基金经			
日至今任中证银 行交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2019年3月26 日至今任汇添富 中证医药卫生交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金的基金经			
行交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2019年3月26 日至今任汇添富 中证医药卫生交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金的基金经			, , , ,
指数证券投资基金的基金经理。 2019年3月26 日至今任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的基金经			
金的基金经理。 2019年3月26 日至今任汇添富 中证医药卫生交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金的基金经			
2019年3月26 日至今任汇添富 中证医药卫生交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金的基金经			
日至今任汇添富 中证医药卫生交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金的基金经			
中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经			
易型开放式指数 证券投资基金联 接基金的基金经			
证券投资基金联接基金的基金经			
接基金的基金经			
			埋。2019年4

		月 15 日至今任
		中证银行交易型
		开放式指数证券
		投资基金联接基
		金的基金经理。
		2019年10月8
		日至今任中证
		800 交易型开放
		式指数证券投资
		基金的基金经
		理。2021年2
		月1日至今任汇
		添富国证生物医
		药交易型开放式
		指数证券投资基
		金的基金经理。
		2021年6月3
		日至今任汇添富
		中证新能源汽车
		产业交易型开放
		式指数证券投资
		基金的基金经
		理。2021年9
		月 29 日至今任
		汇添富中证 800
		交易型开放式指
		数证券投资基金
		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遵规守信情况说明

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和流程,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 交易系统中的公平交易模块,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,再根据同向交易占优比、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。对CPI影响较大的猪肉价格在三季度末呈现企稳迹象,也接近每一

轮猪周期的价格底部,本轮猪周期养殖户亏损面积之大由生猪供给增加和饲料成本上升两方面造成。同时,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。

医药板块自 2020 年 8 月起一直是宽幅震荡的行情,上下振幅能有 30%~40%。三季度的 跌幅主要发生在 8 月,原因是仿制药利润空间被压制,这种影响在上市公司半年报中有所反映。同时,年内对其他民生相关行业的监管政策也引发了市场对药企大幅压降利润的担忧,资金选择避险,流出医药板块,去追求政策免疫的行业。带量采购及医保谈判的扩大化让资本市场更加强化了对医药行业利润担忧的预期。在当前市场环境下,医药板块在政策层面、资金层面的压力远远大于基本面的压力。中证医药指数动态市盈率 34 倍,回调至近 10 年中位数水平,估值自高位回调了近 50%,但同期指数仅回调 13%,主要是因为利润的增长本身也在消化估值。在当前的估值水平下,医药板块中长期投资价值较为显著,优质创新将会成为下一阶段医药行业政策引导的方向。医药行业是一个民生根本性行业,具有需求刚性,为了保证供应安全,在新药研制等关键领域也有一定的国产化需求。

中证医药指数三季度下跌 16.13%。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

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为-14.97%; C 类基金份额净值增长率为-15.05%。同期业绩比较基准收益率为-15.33%。

### 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	4, 200, 305. 50	4.04
	其中: 股票	4, 200, 305. 50	4.04
2	基金投资	93, 086, 676. 00	89. 55
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	5, 439, 522. 88	5. 23
8	其他资产	1, 222, 766. 23	1.18
9	合计	103, 949, 270. 61	100.00

# 5.2 期末投资目标基金明细

基金名称	基金类型	运作方式管理人		<b>安佐玄</b> 子	刑 运作文式	· 人米刑	公允价值	占基金资产净
至並石柳	至			(元)	值比例 (%)			
中证医药卫			汇添富基金					
生交易型开		交易型开放						
放式指数证	股票型	式	管理股份有	93, 086, 676. 00	91.89			
券投资基金			限公司					

# 5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

# 5.3.1 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	_	_

В	采矿业	_	-
С	制造业	2, 698, 872. 50	2. 66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
Е	建筑业	-	-
F	批发和零售业	261, 854. 00	0. 26
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	-	-
Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	34, 872. 00	0.03
Ј	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	765, 793. 00	0. 76
N	水利、环境和公共设施管理业	_	-
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	438, 914. 00	0.43
R	文化、体育和娱乐业	_	-
S	综合	_	_
	合计	4, 200, 305. 50	4. 15

### 5.3.2 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投资股票。

- 5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
- 5.4.1 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	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产
TT 5		称		公允价值(元)	净值比例

					(%)
1	603259	<b>药明康</b>	4,000	611, 200. 00	0.60
2	600276	恒瑞医	9, 500	477, 185. 00	0. 47
3	300015	爱尔眼科	3,600	192, 240. 00	0. 19
4	300122	智飞生 物	1,200	190, 788. 00	0. 19
5	600436	片仔癀	500	189, 100. 00	0. 19
6	600763	通策医疗	500	151, 010. 00	0.15
7	300142	沃森生 物	2, 100	132, 678. 00	0. 13
8	600196	复星医 药	2, 500	130, 750. 00	0. 13
9	300347	泰格医 药	600	104, 400. 00	0.10
10	002821	凯莱英	200	89, 180. 00	0.09

### 5.5 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。

- 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 注:本基金本报告期末未持有债券。
- 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。

# 5.8 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。

- 5.9 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。
- 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资股指期货。

### 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

### 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中,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. 12. 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。

### 5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7, 962. 95
2	应收证券清算款	279, 414. 71
3	应收股利	-
4	应收利息	552. 14
5	应收申购款	934, 836. 43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1, 222, 766. 23

### 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
本报告期期初基金份	26, 511, 249. 81	29, 889, 914. 00
额总额	20, 011, 210. 01	23, 003, 311. 00
本报告期基金总申购	12, 421, 097. 76	22, 855, 998. 71
份额	12, 421, 031. 10	22, 000, 930. 11
减: 本报告期基金总	7, 979, 498. 12	15, 470, 470. 98
赎回份额	7, 979, 490. 12	13, 470, 470. 30
本报告期基金拆分变		
动份额	_	_
本报告期期末基金份	30, 952, 849. 45	37, 275, 441. 73
额总额	30, 952, 849. 45	31, 213, 441. 13

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:本基金的基金管理人本报告期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者超过 20%的情况注: 无。
- 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

### 9.2 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

### 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 2021年10月27日