

汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金 （LOF）2022 年第 2 季度报告

2022 年 06 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 07 月 21 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年7月19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2022年04月01日起至2022年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富中证中药指数（LOF）
基金主代码	501011
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29日
报告期末基金份额总额(份)	1,767,293,852.66
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪中证中药指数，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

	投资组合管理进行适当变通和调整，从而使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	中证中药指数收益率*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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证中药指数（LOF）A	汇添富中证中药指数（LOF）C
下属分级基金场内简称	中药基金	中药C
下属分级基金的交易代码	501011	501012
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	1,097,672,934.98	669,620,917.68

注：A类份额扩位证券简称：中药基金LOF；C类份额扩位证券简称：中药基金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(2022年04月01日 - 2022年06月30日)	
	汇添富中证中药指数（LOF）A	汇添富中证中药指数（LOF）C
1. 本期已实现收益	-51,151,169.78	-32,453,989.33
2. 本期利润	-122,631,621.71	-89,925,908.91
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0965	-0.1110

4. 期末基金资产净值	1,315,692,876.35	789,224,602.85
5. 期末基金份额净值	1.1986	1.1786

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

汇添富中证中药指数（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	-5.68%	1.83%	-6.60%	1.84%	0.92%	-0.01%
过去六个月	-9.09%	2.07%	-10.05%	2.10%	0.96%	-0.03%
过去一年	2.01%	1.80%	-1.69%	1.83%	3.70%	-0.03%
过去三年	48.16%	1.49%	32.26%	1.52%	15.90%	-0.03%
过去五年	11.46%	1.44%	-4.93%	1.46%	16.39%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	19.86%	1.39%	1.26%	1.41%	18.60%	-0.02%
汇添富中证中药指数（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	-5.78%	1.83%	-6.60%	1.84%	0.82%	-0.01%
过去六	-9.27%	2.07%	-10.05%	2.10%	0.78%	-0.03%

个月						
过去一年	1.60%	1.80%	-1.69%	1.83%	3.29%	-0.03%
过去三年	46.45%	1.49%	32.26%	1.52%	14.19%	-0.03%
过去五年	9.74%	1.44%	-4.93%	1.46%	14.67%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	17.86%	1.39%	1.26%	1.41%	16.60%	-0.02%

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

汇添富中证中药指数（LOF）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



汇添富中证中药指数（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29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		
过蓓蓓	本基金的基金经理, 指数与量化投资部总监助理	2016年12月29日		11	国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：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

				<p>有限公司，现任指数与量化投资部总监助理。</p> <p>2015年8月3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。2015年8月3日至今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。2015年8月3日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年8月3日至今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。</p> <p>2015年8月3日至今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。2015年8月18日至今任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。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生物科技主题指数型发起式证券投</p>
--	--	--	--	---

				<p>资基金（LOF）的基金经理。</p> <p>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理。2019年4月15日至2022年6月13日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</p>
--	--	--	--	--

					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。2022年2月28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 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，本基金管理人管理的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 11 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、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

2022 年二季度市场大幅波动。4 月份，上证指数下跌 6.31%，高成长主题例如新能源、芯片等回撤超过 10%。4 月末到二季度末，市场又重新进入反弹。市场大幅波动主要是由于内外部因素的共同影响。内部因素来自于国内疫情发生，长三角区域受影响尤为严重，长三角重点产业如集成电路、汽车、生物医药都受到疫情的影响无法满产开工，影响了产业链供需节奏。4 月下旬开始，复工复产逐步推进，产业链开工逐步恢复，市场悲观情绪好转。加之 6 月初公布的汽车销售数据超出市场预期，进一步激发了投资者的信心，高成长板块的反弹带动市场整体反弹。外部因素主要来自于海外高通胀环境下利率水平的抬升，压制成长板块的估值，同时带来汇率的波动。

政策端以稳增长为主基调，保持流动性相对宽松的环境以及利率水平的稳定偏降，但实体经济融资需求仍然偏弱。因此，高景气、高成长的板块在经济低速增长期显得更为可贵，这也带来了高成长板块在二季度后两个月的大幅反弹。

医药在反弹的第一阶段弱于大盘反弹幅度，但中药反弹力度稍强于医药整体。中医药顶层政策出台后，二季度多以可执行的细则出台，中药注册审批全流程改革从申报端、审评端、支付端、质控端制定了标准规范和管理方案，中药成为医药子板块中政策明显较为友好的板

块。

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，以实现对业绩比较基准的跟踪。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证中药指数（LOF）A 类份额净值增长率为-5.68%，同期业绩比较基准收益率为-6.60%。本报告期汇添富中证中药指数（LOF）C 类份额净值增长率为-5.78%，同期业绩比较基准收益率为-6.60%。

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	1,994,610,195.19	93.46
	其中：股票	1,994,610,195.19	93.46
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	116,364,690.13	5.45
8	其他资产	23,199,492.90	1.09
9	合计	2,134,174,378.22	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 148,535,304.00 元，占期末基金资产净值比例 7.06%。

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	1,965,620,330.97	93.38
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	27,355,020.00	1.30
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	1,992,975,350.97	94.68

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	811,547.24	0.04
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	21,401.16	0.00
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	411,092.42	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	332,571.54	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	41,997.72	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,634,844.22	0.08

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 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

5.3.1 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	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产
----	------	-----	-------	---------	-------

		称			净值比例 (%)
1	600436	片仔癀	593,188	211,607,955.24	10.05
2	000538	云南白药	3,131,242	189,095,704.38	8.98
3	600085	同仁堂	2,988,517	158,032,778.96	7.51
4	600332	白云山	3,063,593	96,778,902.87	4.60
5	002603	以岭药业	3,640,560	88,465,608.00	4.20
6	000999	华润三九	1,720,800	77,436,000.00	3.68
7	600771	广誉远	2,144,206	75,368,840.90	3.58
8	000423	东阿阿胶	1,995,277	73,725,485.15	3.50
9	300026	红日药业	7,855,500	60,487,350.00	2.87
10	000623	吉林敖东	4,055,000	59,851,800.00	2.84

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	688302	海创药业	13,082	501,694.70	0.02
2	688279	峰昭科技	5,505	370,706.70	0.02
3	688046	药康生	12,070	316,716.80	0.02

		物			
4	688163	赛伦生 物	3,607	84,980.92	0.00
5	301200	大族数 控	857	44,495.44	0.00

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

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、银保监会及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

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	943,743.84
2	应收证券清算款	1,516,653.41
3	应收股利	69,264.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,616,530.13
6	其他应收款	53,301.52
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,199,492.90

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

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	002603	以岭药业	13,678,470.00	0.65	转融通出借流通受限
2	600771	广誉远	11,096,855.00	0.53	转融通出借流通受限
3	300026	红日药业	9,353,190.00	0.44	转融通出借流通受限
4	600085	同仁堂	8,201,688.00	0.39	转融通出

					借流通受限
5	000999	华润三九	5,184,000.00	0.25	转融通出借流通受限
6	000623	吉林敖东	4,067,856.00	0.19	转融通出借流通受限
7	000423	东阿阿胶	2,324,155.00	0.11	转融通出借流通受限

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	688302	海创药业	501,694.70	0.02	新股流通受限
2	688279	峰昭科技	370,706.70	0.02	新股流通受限
3	688046	药康生物	316,716.80	0.02	新股流通受限
4	688163	赛伦生物	84,980.92	0.00	新股流通受限
5	301200	大族数控	44,495.44	0.00	新股流通受限

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证中药指数（LOF）A	汇添富中证中药指数（LOF）C
本报告期初基金份额总额	1,198,407,125.21	711,922,852.20
本报告期基金总申购份额	672,788,819.55	1,073,930,707.14
减：本报告期基金总赎回份额	773,523,009.78	1,116,232,641.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,097,672,934.98	669,620,917.68

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

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。

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

注：本基金成立后有 10,004,050.40 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2016 年 12 月 29 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，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者超过 20%的情况

注：无

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中药指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；

- 3、《汇添富中证中药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中药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

2022 年 07 月 21 日