汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）
2017年第2季度报告

2017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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2017年7月20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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 7 月 18 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 2017 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富中证中药指数（LOF）
交易代码	501011
基金运作方式	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	64,107,471.06 份
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。
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 A	汇添富中证中药指数 C
下属分级基金的场内简称	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	41,005,603.70 份	23,101,867.36 份

§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（ 2017 年 4 月 1 日 － 2017 年 6 月 30 日 ）	
	汇添富中证中药指数 A	汇添富中证中药指数 C
1．本期已实现收益	848,797.29	458,741.51
2．本期利润	765,093.38	340,157.33
3．加权平均基金份额本期利润	0.0165	0.0139
4．期末基金资产净值	44,097,466.59	24,811,202.90
5．期末基金份额净值	1.0754	1.0740

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

汇添富中证中药指数 A

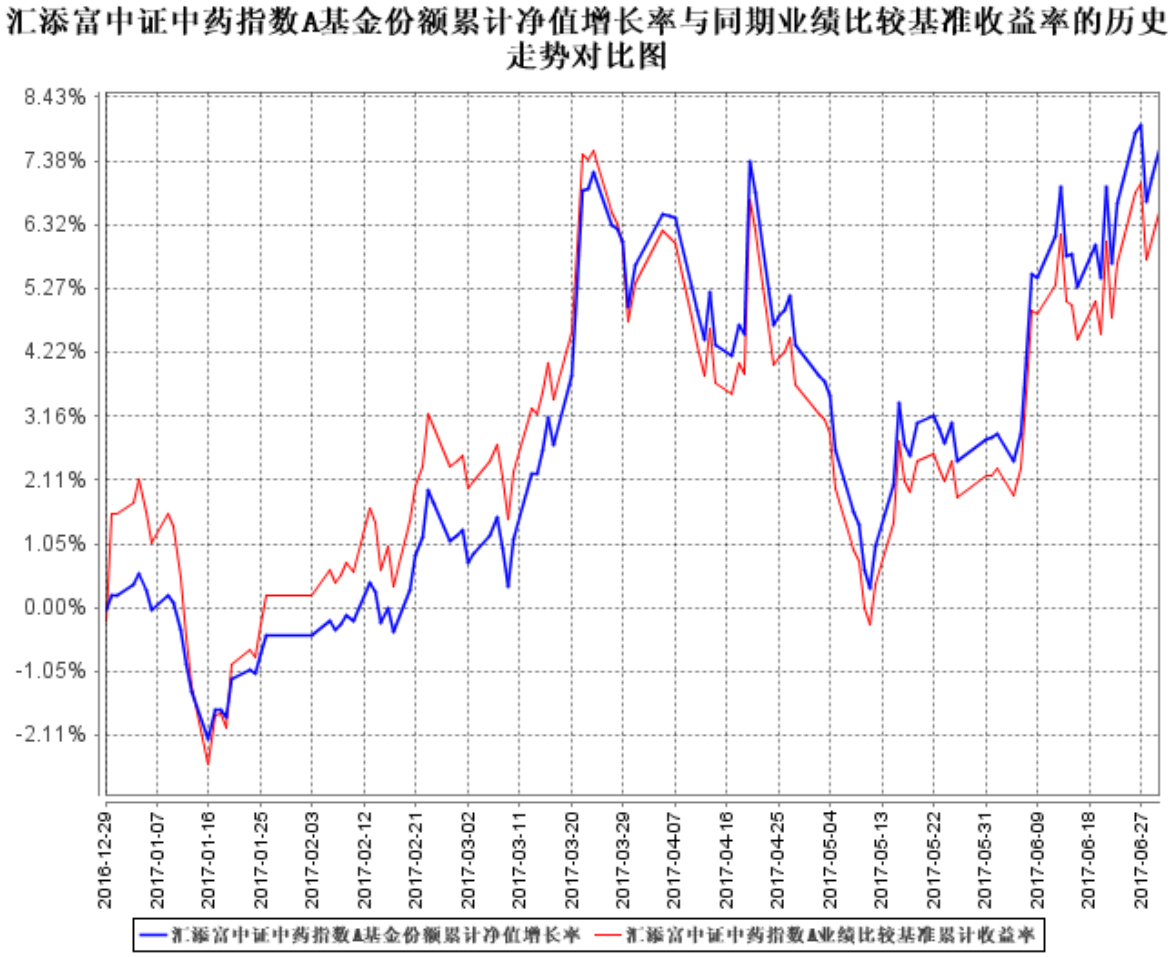
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.78%	0.80%	1.10%	0.80%	0.68%	0.00%

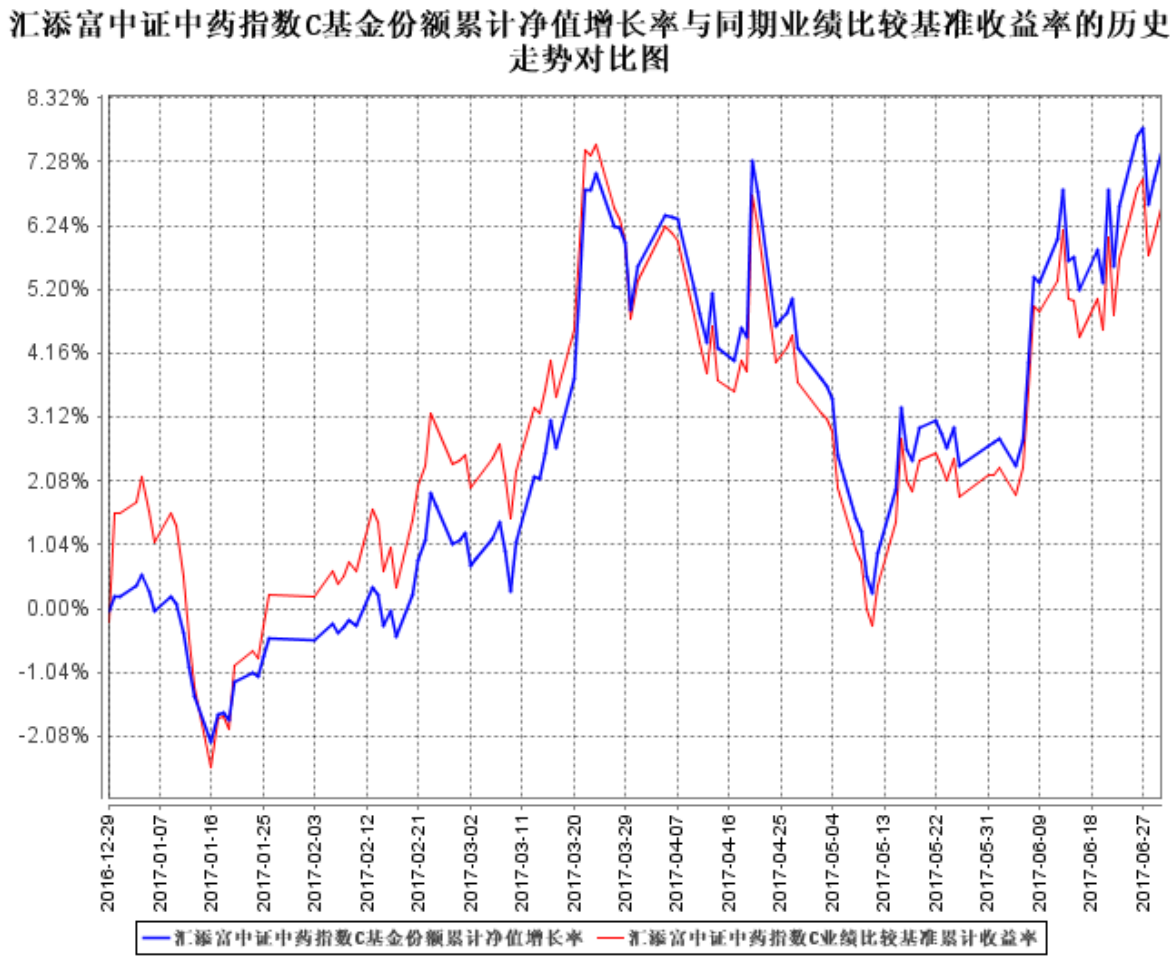
汇添富中证中药指数 C

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	1.73%	0.80%	1.10%	0.80%	0.63%	0.00%

月						

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《基金合同》生效之日为 2016 年 12 月 29 日，截至本报告期末，基金成立未满 1 年；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，截至本报告期末，本基金已完成建仓，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		
过蓓蓓	汇添富中证主要消费 ETF、汇添富中证医药卫生 ETF、汇	2016 年 12 月 29 日	-	6 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

	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、汇添富中证生物科技指数（LOF）基金、汇添富中证中药指数（LOF）基金的基金经理。				富基金管理股份有限公司任基金经理助理，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。

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遵规守信情况的说明

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，基金管理人对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

本报告期内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总成交量 5%的交易次数为 4 次，由于组合投资策略导致，并经过公司内部风控审核。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年二季度沪深 300 指数上涨 6.10%，全球股市表现良好，人民币币值稳中回升。实体经济较为稳健，工业生产恢复，消费增速维持平稳。金融去杠杆是二季度的政策主线，明显超过市场预期，市场流动性压力全面上升，至 6 月央行为预防半年度末资金紧张提供了部分流动性，使得流动性在紧平衡背景下出现边际宽松。龙头股在二季度前两个月依然一支独秀，市场仍在寻求流动性紧张下的确定性增长。进入 6 月份，中小板股票出现了 5%以上的反弹，部分中小盘成长股显示出投资价值。预计三季度会有上市公司二季度、半年度业绩报告披露，市场投资重点会继续在低估值、业绩确定性较高的个股和行业上，对于业绩不达预期的股票会有明显的负超额收益。

二季度，中药板块经历大幅回调和恢复性上涨，龙头中药明显强于中药板块表现。三季度是业绩披露关键期，中药消费品、中药商业、中药龙头均有良好的业绩预期。中药行业受益于估值偏低、产品持续提价、中药消费品打开新的成长空间，以及大型国有中药企业混合所有制改革，2017 年是中药行业很好的投资年。

报告期内，本基金完成建仓期阶段。建仓期结束后，本基金股票投资仓位基本保持在 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

报告期内中证中药基准上涨 1.10%，本基金在报告期内累计收益率为 1.78%，收益率超越业绩比较基准 0.68%。收益率的差异因素主要来源于投资运作、日常申购赎回等因素。本基金日均跟踪误差为 0.0253%，这一跟踪误差水平远低于合同约定上限，在报告期达到了投资目标。

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	65,109,930.83	93.46
	其中：股票	65,109,930.83	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	4,095,969.02	5.88
8	其他资产	459,458.66	0.66
9	合计	69,665,358.51	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	64,034,303.75	92.93
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	1,075,627.08	1.56
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	65,109,930.83	94.49

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	000538	云南白药	70,680	6,633,318.00	9.63
2	600518	康美药业	291,400	6,335,036.00	9.19
3	000423	东阿阿胶	85,851	6,171,828.39	8.96
4	600535	天士力	106,297	4,415,577.38	6.41
5	000623	吉林敖东	152,530	3,491,411.70	5.07
6	600085	同仁堂	90,000	3,146,400.00	4.57
7	600436	片仔癀	49,511	3,022,151.44	4.39
8	600332	白云山	92,143	2,675,832.72	3.88
9	000999	华润三九	64,200	2,038,350.00	2.96
10	600252	中恒集团	455,500	1,840,220.00	2.67

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。

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：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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	60,159.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	895.13
5	应收申购款	398,404.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	459,458.66

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

注：本基金本报告期末前十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	汇添富中证中药指数 A	汇添富中证中药指数 C
报告期期初基金份额总额	48,793,709.53	27,288,889.09
报告期期间基金总申购份额	12,343,195.67	18,024,772.09
减:报告期期间基金总赎回份额	20,131,301.50	22,211,793.82
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	41,005,603.70	23,101,867.36

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

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,004,050.40
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	10,004,050.40
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	15.61

注：本基金于 2016 年 12 月 29 日成立。本公司于 2016 年 12 月 15 日使用固有资金 10,001,000.00 元认购本基金份额 10004050.40 份，认购费用 1,000.00 元。符合招募说明书规定的认购费率。

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	10,004,050.40	15.61	10,004,050.40	15.61	3 年
基金管理人高级管理人员	4,880.49	0.00	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	104,477.52	0.16	-	-	-
合计	10,113,408.31	15.78	10,004,050.40	15.61	-

§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中药指数型发起式证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金托管协议》；

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中药指数型发起式证券投资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。

10.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 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

2017 年 7 月 20 日