汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF） 2019年半年度报告摘要

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:2019年8月29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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2019年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富中证精准医指数（LOF）	
基金主代码	501005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年1月21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	
报告期末基金份额总额	505,030,655.74份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2016年3月21日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证精准医指数A	汇添富中证精准医指数C
下属分级基金的场内简称	精准医疗	精准医C
下属分级基金的交易代码	501005	501006
报告期末下属分级基金的份额总额	395,623,670.36份	109,406,985.38份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪中证精准医疗主题指数，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。在正常市场情况下，日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	中证精准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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半年度报告备置地点	上海市黄城路99号囍目国际大楼20楼 汇添富基金管理股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	汇添富中证精准医指数A	汇添富中证精准医指数C
本期已实现收益	4,853,651.90	1,463,237.05
本期利润	79,038,742.27	18,091,564.84
加权平均基金份额本期利润	0.1862	0.1588
本期基金份额净值增长率	26.59%	26.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.1521	-0.1627
期末基金资产净值	336,467,299.91	91,604,182.56
期末基金份额净值	0.8479	0.8373

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、上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(例如:基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

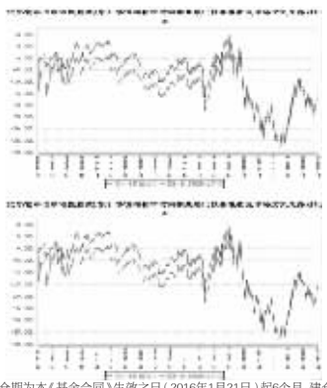
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

汇添富中证精准医指数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
过去一个月	2.84%	1.39%	2.75%	1.41%	0.09%	-0.02%
过去三个月	-5.35%	1.61%	-5.60%	1.62%	0.25%	-0.01%
过去六个月	26.59%	1.82%	27.08%	1.82%	-0.49%	0.00%
过去一年	-13.66%	2.05%	-13.02%	2.07%	-0.64%	-0.02%
过去三年	-16.99%	1.55%	-13.43%	1.56%	-3.56%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	-15.21%	1.49%	-16.89%	1.69%	1.68%	-0.20%
汇添富中证精准医指数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
过去一个月	2.81%	1.39%	2.75%	1.41%	0.06%	-0.02%
过去三个月	-5.41%	1.61%	-5.60%	1.62%	0.19%	-0.01%
过去六个月	26.48%	1.82%	27.08%	1.82%	-0.60%	0.00%
过去一年	-13.92%	2.05%	-13.02%	2.07%	-0.90%	-0.02%
过去三年	-17.88%	1.55%	-13.43%	1.56%	-4.45%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	-16.27%	1.49%	-16.89%	1.69%	0.62%	-0.20%

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



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016年1月21日）起6个月,建仓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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5号文批准,于2005年2月3日正式成立。目前,公司注册资本金为132,724,224元人民币。公司总部设在上海,在北京、上海、广州、成都等地设有分公司,在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全,拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人及QFII基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来,始终将投资业绩放在首位,形成了独树一帜的品牌优势,被誉为"选股专家",并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务,赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2019上半年,汇添富基金新成立13只公开募集证券投资基金,包括5只债券型基金、4只混合型基金、2只基金中基金、2只指数基金联接基金。截至2019年6月30日,公司共管理133只公开募集证券投资基金,形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征,较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	汇添富上证综合指数、汇添富沪深300安中指数基金、汇添富中证互联网医疗指数基金、中证上海国企ETF、汇添富中证500指数（LOF）、汇添富中证精准医指数基金、中证上海国企ETF、汇添富中证主要消费ETF联接基金、汇添富深证300ETF基金的基金经理、2011年9月16日至2013年11月7日任汇添富上证综合指数基金的基金经理、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。	2016年1月21日	-	13	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。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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5次,由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年1季度,A股市场展开春季行情,主要股指上涨均超25%,成交量大幅增加,2月25日两市成交金额突破1万亿元。1月末,大量的上市公司暴露出商誉减值风险和实质性商誉减值。市场对此解读较为正面,认为外延并购增长期间的泡沫将彻底出清,市场出现估值底。春节后市场表现更为强劲。3月中旬开始,市场震荡加大,投资从概念、主题重回基本面。2季度伊始,A股市场行情焦灼,大盘价值股体现出明显的抗跌性,主要消费板块依然领涨,涨幅远超其他行业。5月长假结束后第一天,特朗普突然发布拟提高关税的言论引发市场大跌。6月末G20峰会上中美元首会晤使得中美贸易摩擦取得阶段性缓和,市场风险偏好恢复。

2019年上半年,外部经济环境较为缓和,美联储利率稳定,展望偏鸽派,释放出今年结束缩表的信号。中美贸易谈判几经波折,在6月大阪峰会中美领导人会晤后,贸易摩擦的负面影响才逐渐缓解。国内宏观调控方面,政策仍然重点实施逆周期调节,通过财政减税降费和货币政策保持流动性合理充裕,以对经济形成一定的支撑。两万亿减税力度超市场预期,反映出中央提出推进改革、稳定增长的信心和决定,企业运营成本迎来较大改善,为复苏和长期增长奠定基础。国内经济在上半年表现较为稳健,社融增速、PMI等指标均呈现企稳特征,社零数据在二季度末也呈现企稳回升态势。通胀在二季度走高,主要是因为食品CPI贡献。

资金面方面,货币与信用政策的合理宽松是驱动行情的重要因素,通过陆股通北上的资金持续流入,也逐渐修复2018年悲观预期,修复风险偏好。

精准医疗指数在上半年强于大盘,主要原因是精准医疗是医药创新研发的重要方向,机构资金集中配置,以此规避医改政策的负面影响。

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富中证精准医指数A基金份额净值为0.8479元,本报告期基金份额净值增长率为26.59%;截至本报告期末汇添富中证精准医指数C基金份额净值为0.8373元,本报告期基金份额净值增长率为26.48%;同期业绩比较基准收益率为27.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年下半年,宏观政策预期仍以逆周期调节为主,主要消费维持稳定,可选消费下半年有望阶段性企稳。在"房住不炒"的政策大背景下,固定资产投资回落速度有可能超预期,利率有下行空间,利好股市及产业融资成本。

在地产大繁荣时期,经济金融领域普遍在在依赖土地快速增值的刚兑,隐性推高了利率水平,对产业融资及消费带来较大压力。未来随着房价的止涨甚至回落,以及刚兑的逐步打破,投资者更需要赚取经济增长带来的稳定收益,对于投资标的的把握也要以企业盈利增长为抓手,减少对于估值及弹性的零和博弈。

医药行业一系列政策组合拳增加了行业运行的不确定性,造成市场对于医药上市公司预期的下修,但这些政策的出发点均是基于推动行业高质量、长远发展、实现进一步出清。因此,二级市场的下跌反而是提供了医药行业布局、参与的时机。6月下旬开始,政策对于板块的打压基本出清,医药行业北上资金持续净流入。未来,研发创新（创新药、生物科技）、消费升级（品牌中药、投借、肿瘤药）、制造升级（仿制药龙头集中）是医药行业的大趋势。精准医疗主题集中了肿瘤创新药、细胞治疗、基因诊断、疫苗等新型医疗手段,预期依然是机构资金配置医药行业的主要方向之一。

作为被动投资的指数型基金,汇添富中证精准医疗指数基金将严格遵守基金合同,继续坚持既定的指数化投资策略,积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同,但具有不同特征的,若协会有特定调整估值方法的通知的,例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》,应参照协会通知执行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会,负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金（基金合同）约定:本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式,具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日某一类的基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于其面值。

本基金本报告期未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内,汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）2019年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体:汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	23,858,627.38	22,824,562.99
结算备付金	-	22,942.45
存出保证金	90,533.56	50,885.09
交易性金融资产	403,633,952.42	318,501,631.13
其中:股票投资	403,633,952.42	318,501,631.13
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	2,293,355.92	-
应收利息	4,301.80	4,350.61
应收股利	-	-
应收申购款	298,872.37	979,701.80
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	430,179,643.45	342,384,074.07
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	234,000.00	4,480,715.55
应付赎回款	2,102,209.63	263,167.07
应付管理人报酬	256,152.15	218,827.61
应付托管费	34,153.60	29,177.03
应付销售服务费	29,804.80	22,783.64
应付交易费用	99,438.33	18,353.12
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	352,402.47	397,321.58
负债合计	3,108,160.98	5,430,345.60
所有者权益:		
实收基金	505,030,655.74	504,310,342.46
未分配利润	-77,959,173.27	-167,356,613.99
所有者权益合计	427,071,482.47	336,953,728.47
负债和所有者权益总计	430,179,643.45	342,384,074.07

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额总额505,030,655.74份,其中汇添富中证精准医指数A基金份额总额为395,623,670.36份,基金份额净值0.8479元;汇添富中证精准医指数C基金份额总额为109,406,985.38份,基金份额净值0.8373元。

6.2 利润表

会计主体:汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	99,931,755.52	29,461,301.92
1.利息收入	96,487.50	122,283.88
其中:存款利息收入	96,487.50	122,232.54
债券利息收入	-	51.34
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	8,588,853.53	-8,902,964.07
其中:股票投资收益	6,700,843.52	-11,345,702.97
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	48,666.80
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,888,010.01	2,394,072.10
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	90,813,418.16	38,135,261.36
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	432,996.33	106,720.75
减:二、费用	2,801,448.41	3,963,153.92
1. 管理人报酬	1,581,225.22	2,040,413.97
2. 托管费	210,830.00	272,055.17
3. 销售服务费	177,595.19	163,092.08
4. 交易费用	659,250.73	1,234,509.18
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	0.22
7. 其他费用	172,547.27	243,083.30
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	97,130,307.11	25,508,148.00

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体:汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	504,310,342.46	-167,356,613.99	336,953,728.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	97,130,307.11	97,130,307.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	720,313.28	-7,732,866.39	-7,012,553.11
其中:1.基金申购款	482,686,465.89	-90,934,482.88	391,751,983.01
2.基金赎回款	-481,966,152.61	83,201,616.49	-398,764,536.12
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	505,030,655.74	-77,959,173.27	427,071,482.47

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	552,110,169.58	-24,596,815.26	527,513,354.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,508,148.00	25,508,148.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	-64,579,324.64	-10,369,124.13	-74,948,448.77
其中:1.基金申购款	299,798,528.29	-3,239,861.54	296,558,666.75
2.基金赎回款	-364,377,852.93	-7,129,262.59	-371,507,115.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	487,530,844.94	-9,457,791.39	478,073,053.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1	至6.4财务报表由下列负责人签署:	

张晖 李骁 雷青松

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）（以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可[2015]2740号文《关于准予汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）注册的批复》准予注册,由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司作为发起人向社会公开发行募集。基金合同于2016年1月21日正式生效,首次设立募集规模为1,946,142,280.25份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中证精准医疗主题指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、固定收益资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款等),衍生工具(股指期货、权证、股票期权等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%,其中投资于中证精准医疗主题指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪中证精准医疗主题指数,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。本基金的业绩比较基准为:中证精准医疗主题指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称"企业会计准则"）编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监管管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号（年度报告和半年度报告）》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2019年6月30日的财务状况以及2019年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券（股票）交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳的印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定,凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人,都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金（封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内（含1个月）的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年（含1年）的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（"工商银行"）	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司（"东方证券"）	基金管理人的股东、基金代销机构

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券股份有限公司	433