

汇添富医药保健混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

资产管理,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,基金管理人对于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未出现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%的情况,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年三季度,受宏观经济乐观预期,周期性板块如有色钢铁涨幅较好,医药生物、传媒等板块表现较差,医药板块中与原料药相关的股票表现较好。第三季度,沪深300指数累计上涨了4.63%,中证医药指数下跌了1.3%,医药板块表现落后于大盘。

三季度继续调整组合结构,提高持股集中度,同时增持了业绩成长确定的个股。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.275元;本报告期基金份额净值增长率为-1.85%,业绩比较基准收益率为-1.30%。

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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,483,247,490.61	94.07
2	债券投资	2,483,247,490.61	94.07
3	固定收益投资	-	-
4	其他资产	-	-
5	其他负债	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	金融衍生品投资	-	-
9	买入返售金融资产	-	-
10	其他金融资产投资	-	-
11	其他	-	-
12	银行存款和结算备付金合计	476,063,528.63	14.09
13	其他资产	4,202,272.03	0.14
14	合计	2,952,513,291.27	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	-	-	-
B 采矿业	29,750.00	0.00	-
C 制造业	3,761,479,388.27	61.96	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,240,120.00	0.18	-
E 建筑业	287,000,712.00	3.45	-
F 批发和零售业	26,365.40	0.00	-
G 交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00	-
H 住宿和餐饮业	-	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	1,449,314,779.01	24.03	-
J 金融业	-	-	-
K 房地产业	-	-	-
L 租赁和商务服务业	28,750.40	0.00	-
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	111,209.00	0.00	-
R 文化、体育和娱乐业	206,311,200.07	3.40	-
S 综合	-	-	-
合计	5,674,413,547.14	92.89	-

5.2.2 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。

5.3 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	002799	亿帆医药	6,464,500	591,136,070.03	9.74
2	002598	汉得信息	16,218,400	300,381,762.00	4.83
3	003046	华信新材	7,875,138	323,486,479.60	5.25
4	300460	舒华股份	4,221,469	215,466,841.40	3.40
5	300503	国脉科技	4,756,064	269,430,000.00	4.23
6	002077	大康医疗	11,240,120	289,469,468.00	4.59
7	002666	奥马电器	14,281,200	285,704,066.40	4.57
8	002102	横店影视	5,462,094	246,812,424.42	4.07
9	002176	东方雨润	21,994,027	236,116,140.00	3.76
10	300268	上海钢联	227,641,000.00	227,641,000.00	3.67

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其他政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换(可交换)债	203,153.00	0.00
8	其他债	-	-
9	合计	203,153.00	0.00

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.10 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.11 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.12 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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.13 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.14 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.15 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.16 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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.17 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.18 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.19 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.20 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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.21 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.22 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.23 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.24 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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.25 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.26 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.27 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.28 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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.29 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.30 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.31 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.32 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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.33 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.34 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.35 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.36 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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.37 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.38 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.39 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.40 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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.41 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.42 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债逆回购	1,000	203,153.00	0.00

5.43 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