

华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资
基金联接基金(原华宝中证医疗指数证券
投资基金)
2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 5 月 13 日(修订后的基金合同生效日)起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	7
2.2 基金产品说明（转型后）	7
2.2 基金产品说明（转型前）	8
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	9
2.5 其他相关资料(转型后)	9
2.5 其他相关资料(转型前)	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）	9
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)	10
3.2 基金净值表现（转型后）	11
3.2 基金净值表现（转型前）	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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.....	21
§5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	21
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	22
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）	22
6.1 资产负债表	22
6.2 利润表	23
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
6.4 报表附注	25
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）	52

6.1 资产负债表	52
6.2 利润表	53
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	54
6.4 报表附注	55
§7 投资组合报告（转型后）	81
7.1 期末基金资产组合情况	81
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	81
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	82
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	83
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	84
7.6 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	84
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	84
7.8 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	84
7.9 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	84
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	85
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	85
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	85
7.13 投资组合报告附注	85
§7 投资组合报告（转型前）	86
7.1 期末基金资产组合情况	86
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	87
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	89
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	92
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	93
7.6 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	93
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	93
7.8 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	93
7.9 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	93
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	93
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	93
7.12 投资组合报告附注	94
§8 基金份额持有人信息（转型后）	95
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	95
8.2 期末上市基金前十名持有人	95
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	96
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	96
§8 基金份额持有人信息（转型前）	96
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	96
8.2 期末上市基金前十名持有人	97
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	97
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	97
§9 开放式基金份额变动（转型后）	97

§9 开放式基金份额变动（转型前）	98
§10 重大事件揭示	98
10.1 基金份额持有人大会决议	98
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	98
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	98
10.4 基金投资策略的改变	98
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	99
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	99
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后).....	99
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前).....	102
10.8 其他重大事件（转型后）	105
10.8 其他重大事件（转型前）	108
§11 影响投资者决策的其他重要信息	108
11.1 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	108
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	108
§12 备查文件目录	109
12.1 备查文件目录	109
12.2 存放地点	109
12.3 查阅方式	109

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	华宝医疗 ETF 联接	
场内简称	医疗基金	
基金主代码	162412	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 5 月 13 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	2,174,418,937.91 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2021 年 02 月 26 日	
下属分级基金的基 金简称	医疗基金	华宝医疗 ETF 联接 C
下属分级基金的场 内简称	医疗基金	-
下属分级基金的交 易代码	162412	012323
报告期末下属分级 基金的份额总额	2,141,260,044.49 份	33,158,893.42 份

2.1.1 目标基金基本情况（转型后）

基金名称	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512170
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 20 日

基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 6 月 17 日
基金管理人名称	华宝基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	华宝中证医疗指数证券投资基金
基金简称	华宝中证医疗指数
场内简称	医疗基金
基金主代码	162412
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 1 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份 额总额	2,150,026,841.98 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的 证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021 年 2 月 26 日
下属分级基金的基 金简称	-
下属分级基金的交 易代码	-
报告期末下属分级 基金的份额总额	-份

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金可以通过申购赎回代理券商以成份股实物形式申购及赎回目标 ETF 基金份额，也可以通过券商在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额。
业绩比较基准	中证医疗指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型基金，本基金的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。本基金主要通过投资于目标 ETF 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股票市场相似的风险收益特征。
--------	---

2.2.1 目标基金产品说明（转型后）

投资目标	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	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。
业绩比较基准	中证医疗指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪中证医疗指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.2 基金产品说明（转型前）

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。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构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地调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对股票投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与标的指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中证医疗指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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		华宝基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	许俊
	联系电话	021-38505888	010-66594319
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050、 021-38924558	95566
传真		021-38505777	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世	北京市西城区复兴门内大街 1

	纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	XIAOYI HELEN HUANG	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料(转型后)

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人	北京市西城区太平桥大街 17 号、中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

注：华宝医疗 ETF 联接 C 类份额的注册登记机构是基金管理人。

2.5 其他相关资料(转型前)

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 5 月 13 日(修订后的基金合同生效日)-2021 年 6 月 30 日)	
	华宝医疗 ETF 联接 A	华宝医疗 ETF 联接 C
本期已实现收益	482,577,834.37	164,479.57
本期利润	325,364,349.88	3,166,065.71
加权平均基金份额本期利润	0.1486	0.1457

本期加权平均净值利润率	10.16%	9.87%
本期基金份额净值增长率	10.57%	10.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	-1,298,360,833.05	-1,188,802.89
期末可供分配基金份额利润	-0.6064	-0.0359
期末基金资产净值	3,296,066,829.58	51,034,243.24
期末基金份额净值	1.5393	1.5391
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	10.57%	10.55%

注：1、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。

2、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）

3、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。

4、期末可供分配利润采用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。

5、自 2021 年 5 月 13 日起，增设华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金 C 类份额，C 类份额的实际起始日为 2021 年 5 月 14 日。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日(基金合同生效日) - 2021年5月12日)
本期已实现收益	50,111,048.69
本期利润	230,250,762.63
加权平均基金份额本期利润	0.2054
本期加权平均净值利润率	15.42%
本期基金份额净值增长率	5.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年5月12日)
期末可供分配利润	-1,777,432,079.66

期末可供分配基金份额利润	-0.8267
期末基金资产净值	2,993,231,236.02
期末基金份额净值	1.3922
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年5月12日)
基金份额累计净值增长率	5.82%

注：1、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。

2、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）

3、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。

4、期末可供分配利润采用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（转型后）

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

华宝医疗 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
过去一个月	4.25%	1.63%	3.98%	1.68%	0.27%	-0.05%
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	10.57%	1.50%	10.82%	1.56%	-0.25%	-0.06%

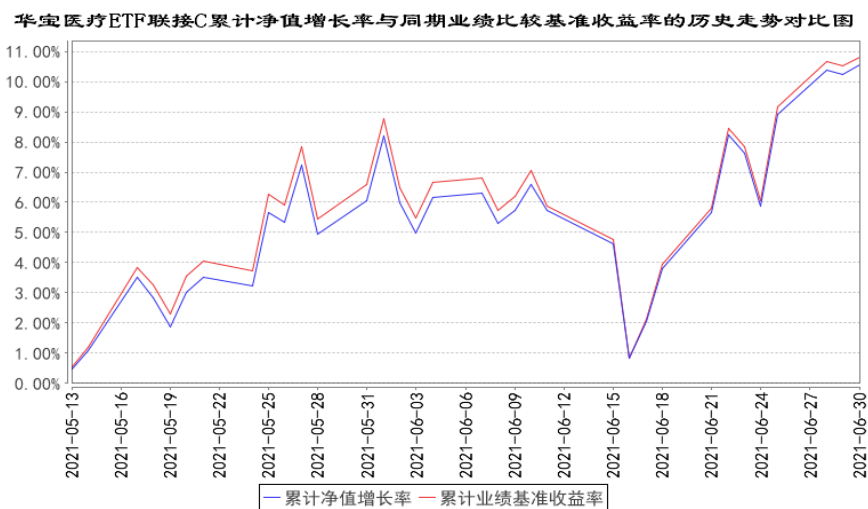
华宝医疗 ETF 联接 C

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	4.24%	1.63%	3.98%	1.68%	0.26%	-0.05%
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	10.55%	1.50%	10.82%	1.56%	-0.27%	-0.06%

注：基金转型日 2021 年 5 月 13 日

3.2.2 自基金转型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率变动的比较



注：1、本基金基金合同生效于 2021 年 5 月 13 日，截至报告日本基金基金合同生效未满一年。
 2、按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

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	12.25%	1.68%	12.51%	1.74%	-0.26%	-0.06%
过去三个月	-11.05%	2.22%	-10.59%	2.26%	-0.46%	-0.04%
过去六个月	-%	-%	-%	-%	-%	-%
过去一年	-%	-%	-%	-%	-%	-%
过去三年	-%	-%	-%	-%	-%	-%
自基金合同生效之日起至今	5.82%	2.20%	6.38%	2.24%	-0.56%	-0.04%

注：本基金转型日期为 2021 年 1 月 1 日，截止至本报告期末，本基金转型未满一年。

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

华宝中证医疗指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金转型日期为 2021 年 1 月 1 日，截止至本报告期末，本基金转型未满一年。

§ 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

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为人民币 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司与美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.），持有股权占比分别为 51%和 49%。公司在北京、深圳等地设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理（香港）有限公司。

截至本报告期末（2021 年 6 月 30 日），本公司正在管理运作的证券投资基金包括：华宝宝康债券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合混合型证券投资基金、华宝先进成长混合型证券投资基金、华宝行业精选混合型证券投资基金、华宝海外中国成长混合型证券投资基金、华宝大盘精选混合型证券投资基金、华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝中证 100 指数证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）、华宝资源优选混合型证券投资基金、华宝现金添益交易型货币市场基金、华宝创新优选混合型证券投资基金、华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝浮动净值型发起式货币市场基金、华宝致远混合型证券投资基金（QDII）、华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）等共 108 只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
胡洁	本基金基金经理、指数研发投资部总经理	2021 年 5 月 13 日	-	14 年	硕士。2006 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发和量化投资部工作，现任指数研发投资部总经理。2012 年 10 月至 2019 年 1 月任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2012 年 10 月至 2018 年 11 月任华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2015 年 6 月至 2018 年 8 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。2015 年 5 月至 2021 年 1 月任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理。2021 年 1 月至 2021 年 5 月任华宝中证医疗指数证券投资基金基金经理。2021 年 5 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2016 年 8 月起任华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2017 年 1 月起任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2017 年 7 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 11 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019 年 1 月至 2021 年 3 月任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 5 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019 年 7 月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019 年 8 月起任华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2019 年 12 月起任华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2021 年 3 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2021 年 6 月起任华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
蒋俊阳	本基金的基金	2021 年 5 月 13 日	-	11 年	硕士。曾先后在上海申银万国证券研究所、光大证券研究所从事资深高级分析师的工

	经理助理，华宝中证电子 50ETF、华宝中证细分食品饮料产业主题 ETF、华宝中证沪港深 500ETF、华宝深证创新 100ETF、华宝食品 ETF 联接、华宝电子 ETF 联接基金经理				作。2018 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，先后在量化投资部、指数研发投资部任基金经理助理。2019 年 1 月至 2021 年 1 月任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理助理。2019 年 1 月至 2020 年 11 月华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2019 年 2 月至 2020 年 11 月任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金(LOF)基金经理助理。2019 年 5 月 1 至 2019 年 10 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2019 年 7 月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2019 年 9 月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理助理。2021 年 1 月起至 2021 年 5 月华宝中证医疗指数证券投资基金基金经理助理。2021 年 5 月至今任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2020 年 7 月起任华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 12 月起任华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 3 月起任华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月起任华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	---	--	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
胡洁	本基金基金经理、指数研发投资部总经理	2021 年 1 月 1 日	2021 年 5 月 13 日	14 年	硕士。2006 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，现任指数研发投资部总经理。2012 年 10 月至 2019 年 1 月任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2012 年 10 月至 2018 年 11 月任华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2015 年 6 月至 2018 年 8 月任华宝中证 1000 指数分级证

					<p>券投资基金基金经理。2015 年 5 月至 2021 年 1 月任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理。2021 年 1 月至 2021 年 5 月任华宝中证医疗指数证券投资基金基金经理。2021 年 5 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2016 年 8 月起任华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2017 年 1 月起任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2017 年 7 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 11 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019 年 1 月至 2021 年 3 月任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 5 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019 年 7 月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019 年 8 月起任华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2019 年 12 月起任华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2021 年 3 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2021 年 6 月起任华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>
蒋俊阳	本基金的基金经理助理，华宝中证电子 50ETF、华宝中证细分食品饮料产业主题 ETF、华	2021 年 1 月 1 日	2021 年 5 月 13 日	11 年	<p>硕士。曾先后在上海申银万国证券研究所、光大证券研究所从事资深高级分析师的工作。2018 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，先后在量化投资部、指数研发投资部任基金经理助理。2019 年 1 月至 2021 年 1 月任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理助理。2019 年 1 月至 2020 年 11 月华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2019 年 2 月至 2020 年 11 月任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理助理。2019 年 5 月 1 日至 2019 年 10 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基</p>

	宝中证沪港深 500ETF、华宝深创 100ETF、华宝食品 ETF 联接、华宝电子 ETF 联接基金经理				金经理助理。2019 年 7 月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2019 年 9 月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理助理。2021 年 1 月起至 2021 年 5 月华宝中证医疗指数证券投资基金基金经理助理。2021 年 5 月至今任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2020 年 7 月起任华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 12 月起任华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 3 月起任华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月起任华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	---	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝中证医疗指数证券投资基金基金合同》、《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生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%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

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

2021 年上半年，全球经济共振复苏是主基调，在疫苗接种加速推进、各国相继推出大规模刺激性财政和货币政策等诸多因素的带动下，上半年全球经济总体恢复势头良好。今年作为“十四五”的开局之年，随着“十四五”规划的正式编制和落地，政策方向逐步明朗，有望注入新的动力。

市场方面，在新能源、新材料等主题板块的带领下，市场环境整体向好。上半年的行情大致可以分为三段，春节前以“茅 20”为代表的白马股表现非常强势，春节后市场出现了短暂而强烈的风格切换，白马股集体出现回调，而以钢铁为代表的周期型价值股则表现强势。二季度，新能源、新材料等概念板块逐渐成为带领市场上涨的主要动力，市场风格再次向成长股切换。本报告期内，作为大盘蓝筹股代表的中证 100 指数和沪深 300 指数分别下跌了 2.85%和上涨了 0.24%；而作为成长股代表的中证 1000 指数和创业板指数分别上涨了 6.58%和 17.22%。在本报告期内，中证医疗指数累计上涨了 18.74%。

本报告期，本基金由华宝中证医疗指数证券投资基金正式转型成为华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金。我们在操作中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金由华宝中证医疗指数投资基金转型为华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金，2021 年 1 月 1 日至 2021 年 5 月 12 日，华宝中证医疗指数投资基金净值增长率为 5.82%，同期业绩比较基准收益率为 6.38%。2021 年 5 月 13 日至 2021 年 6 月 30 日，华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金 A 净值增长率为 10.57%，同期业绩比较基准收益率为 10.82%；华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金 C 净值增长率为 10.55%，同期业绩比较基准收益率为 10.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济与市场方面，展望 2021 年下半年，全球经济复苏的态势或将延续，但与此同时全球范围内的疫情反复仍不容忽视。国内货币政策“稳中趋松”，消费与投资支撑经济的韧性仍在，科技创新和消费升级仍然是国内经济关注的焦点。证券市场方面，目前市场整体稳中向好，但波动在增加，板块之间的分化较为明显，未来结构性行情或将延续。

行业层面，随着人民生活水平不断提高和人口老龄化加速，人民群众健康需求和品质要求持续快速增长。医疗服务领域，从供给侧看，我国医疗卫生服务体系结构性问题依然突出。7月1日，国家发改委、卫健委等四部门联合发布《“十四五”优质高效医疗卫生服务体系建设实施方案》，加快构建强大公共卫生体系，推动优质医疗资源扩容和区域均衡布局，提高全方位全周期健康服务与保障能力。优质民营医疗服务作为公立医疗资源重要补充，有望继续保持快速发展。随着居民支付能力提升和健康意识提升，眼科、口腔、辅助生殖等专科服务持续量价齐升，空间广阔。医药研发外包服务行业，随着全球医药外包率提升以及产业链向中国转移的趋势延续，持续高景气，良好股权融资环境助力国内龙头积极扩张。医疗器械领域，2021年2月，工信部发布《医疗装备产业发展规划（2021-2025年）》（征求意见稿），提出到2025年，关键零部件及材料取得重大突破，高端医疗装备安全可靠，产品性能和质量达到国际水平，助力诊断检验装备、治疗装备、植入介入器械等7大领域医疗器械发展。互联网医疗领域，政府相继发布多项互联网医疗政策文件，行业进入规范发展期，有助于推动我国医疗服务行业创新升级。建议投资者密切关注政策红利下的中证医疗指数带来的中长期投资机会。

作为指数基金的管理人，我们将严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，积极应对成份股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对目标指数的跟踪误差，实现对中证医疗指数的有效跟踪。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

（1）日常估值流程

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

（2）特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导

意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度,对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况,量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法(比如:指数收益法)进行估值,并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见,但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力,参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金(原华宝中证医疗指数证券投资基金)(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	205,356,649.63
结算备付金		30,040,692.94
存出保证金		2,459,254.80
交易性金融资产	6.4.7.2	3,159,879,243.80
其中：股票投资		3,019,729.24
基金投资		3,156,859,514.56
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		19,673,763.33
应收利息	6.4.7.5	33,227.56
应收股利		-
应收申购款		11,018,740.74
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	32,751.25
资产总计		3,428,494,324.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		100.12

应付赎回款		76,646,989.30
应付管理人报酬		84,057.79
应付托管费		16,811.56
应付销售服务费		7,817.47
应付交易费用	6.4.7.7	4,042,945.01
应交税费		209,067.48
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	385,462.50
负债合计		81,393,251.23
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	3,396,563,642.00
未分配利润	6.4.7.10	-49,462,569.18
所有者权益合计		3,347,101,072.82
负债和所有者权益总计		3,428,494,324.05

注：(1)报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,174,418,937.91 份，其中华宝医疗 ETF 联接 A 类基金份额 2,141,260,044.49 份，基金份额净值 1.5393 元；华宝医疗 ETF 联接 C 类基金份额 33,158,893.42 份，基金份额净值 1.5391 元。

(2)本基金修订后的基金合同于 2021 年 5 月 13 日生效。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2021 年 5 月 13 日（修订后的基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 5 月 13 日（修订后 的基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		333,193,508.27
1. 利息收入		141,639.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	141,639.43
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		486,521,240.12
其中：股票投资收益	6.4.7.12	480,544,063.97
基金投资收益	6.4.7.13	6,222,246.18
债券投资收益	6.4.7.14	-

资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	-245,070.03
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-154,211,898.35
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	742,527.07
减：二、费用		4,663,092.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	280,601.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	56,120.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	8,734.65
4. 交易费用	6.4.7.20	4,261,681.05
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		22,400.09
7. 其他费用	6.4.7.21	33,555.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		328,530,415.59
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		328,530,415.59

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2021 年 5 月 13 日（修订后的基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 5 月 13 日（修订后的基金合同生效日）至 2021 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）	3,377,177,621.96	-383,946,385.94	2,993,231,236.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	328,530,415.59	328,530,415.59
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）	19,386,020.04	5,953,401.17	25,339,421.21

其中：1. 基金申购款	608,969,864.58	-6,948,829.78	602,021,034.80
2. 基金赎回款	-589,583,844.54	12,902,230.95	-576,681,613.59
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）	3,396,563,642.00	-49,462,569.18	3,347,101,072.82

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：

黄小意

向辉

张幸骏

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

华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金是由原华宝中证医疗指数证券投资基金转型而来。原华宝中证医疗指数证券投资基金为契约型上市开放式基金，存续期限不定。根据本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2021 年 5 月 12 日发布的《关于华宝中证医疗指数证券投资基金变更为华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金、增加 C 类份额、降低管理费率 and 托管费率并修订基金合同和托管协议的公告》，自 2021 年 5 月 13 日起，原华宝中证医疗指数证券投资基金转型为华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”），《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》自该日起生效，原《华宝中证医疗指数证券投资基金基金合同》自同一日起失效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》，本基金根据销售服务费及申购费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费但收取申购费的基金份额类别，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费但不收取申购费的基金份额类别，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

本基金为华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证医疗指数紧密跟踪的被动指数基金, 本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪, 力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%, 年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定, 本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股, 本基金还可投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板、存托凭证和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货以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相关规定)。本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%, 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, 持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为: 中证医疗指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2021 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间的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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所

得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股

票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管

产品管理人运营资管产品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。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	205,356,649.63
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	205,356,649.63

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	878,892.41	3,019,729.24	2,140,836.83

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	2,895,924,397.42	3,156,859,514.56	260,935,117.14
其他	-	-	-
合计	2,896,803,289.83	3,159,879,243.80	263,075,953.97

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按目标 ETF 于估值日的份额净值确定公允价值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	18,599.44
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	13,518.30
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	3.12
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	1,106.70
合计	33,227.56

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	32,751.25

合计	32,751.25
----	-----------

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,042,945.01
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,042,945.01

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	247,738.08
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	53,421.86
合计	385,462.50

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华宝医疗 ETF 联接 A

项目	本期 2021年5月13日（修订后的基金合同生效日） 至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,150,026,841.98	3,377,177,621.96
2021年5月13日（基金合同生效日）至 2021年6月30日基金份额折算调整	-	-
2021年5月13日（基金合同生效日）至 2021年6月30日未领取红利份额折算 调整	-	-
2021年5月13日（基金合同生效日）至 2021年6月30日集中申购募集资金本 金及利息	-	-
2021年5月13日（基金合同生效日）至	-	-

2021 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购完成后		
本期申购	339,563,518.56	533,371,443.69
本期赎回（以“-”号填列）	-348,330,316.05	-547,144,317.07
本期末	2,141,260,044.49	3,363,404,748.58

华宝医疗 ETF 联接 C

项目	本期 2021 年 5 月 13 日（修订后的基金合同生效日） 至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
2021 年 5 月 13 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2021 年 5 月 13 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日未领取红利份额折算 调整	-	-
2021 年 5 月 13 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日集中申购募集资金本 金及利息	-	-
2021 年 5 月 13 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购 完成后	-	-
本期申购	75,598,420.89	75,598,420.89
本期赎回（以“-”号填列）	-42,439,527.47	-42,439,527.47
本期末	33,158,893.42	33,158,893.42

注：申购含红利再投以及转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华宝医疗 ETF 联接 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效	-1,777,432,079.66	1,393,485,693.72	-383,946,385.94

日			
本期利润	482,577,834.37	-157,213,484.49	325,364,349.88
本期基金份额 交易产生的变 动数	-3,506,587.76	-5,249,295.18	-8,755,882.94
其中：基金申 购款	-220,012,951.07	177,704,726.44	-42,308,224.63
基金赎 回款	216,506,363.31	-182,954,021.62	33,552,341.69
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	-1,298,360,833.05	1,231,022,914.05	-67,337,919.00

华宝医疗ETF联接C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效 日	-	-	-
本期利润	164,479.57	3,001,586.14	3,166,065.71
本期基金份额 交易产生的变 动数	-1,353,282.46	16,062,566.57	14,709,284.11
其中：基金申 购款	-2,991,650.19	38,351,045.04	35,359,394.85
基金赎 回款	1,638,367.73	-22,288,478.47	-20,650,110.74
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	-1,188,802.89	19,064,152.71	17,875,349.82

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年5月13日（修订后的基金合同生效日）至2021年6月 30日
活期存款利息收入	95,555.28
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	42,381.96
其他	3,702.19
合计	141,639.43

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年5月13日（修订后的基金合同生效日）至 2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	340,605,481.02
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	139,938,582.95
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	480,544,063.97

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年5月13日（修订后的基金合同生效日）至 2021年6月30日
卖出股票成交总额	2,118,408,614.86
减：卖出股票成本总额	1,777,803,133.84
买卖股票差价收入	340,605,481.02

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年5月13日（修订后的基金合同生效日）至 2021年6月30日
申购基金份额总额	2,725,216,600.00
减：现金支付申购款总额	2,020,645,488.70
减：申购股票成本总额	564,632,528.35
申购差价收入	139,938,582.95

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年5月13日（修订后的基金合同生效日）至2021年6 月30日
卖出/赎回基金成交总额	105,819,619.11
减：卖出/赎回基金成本总额	99,597,372.93
基金投资收益	6,222,246.18

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年5月13日（修订后的基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	-245,070.03
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	-245,070.03

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 5 月 13 日（修订后的基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-154,211,898.35
股票投资	-415,147,015.49
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	260,935,117.14
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-154,211,898.35

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 5 月 13 日（修订后的基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	742,525.58
基金转换费收入	1.49
合计	742,527.07

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 计入基金资产。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 5 月 13 日（修订后的基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,243,399.16
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	18,281.89
其中：申购费	1,583.66
赎回费	-
交易费	16,698.23
合计	4,261,681.05

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 5 月 13 日（修订后的基金合同生效日） 至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	6,712.51
信息披露费	16,109.73
证券出借违约金	-
银行费用	2,011.69
上市费用	8,721.51
合计	33,555.44

6.4.7.22 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
华宝基金管理有限公司（“华宝基金”）	基金管理人、C 类注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙 (Warburg Pincus Asset Management, L.P.)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司（“宝武财务”）	受宝武集团控制的公司
华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金 （“目标 ETF”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.2 债券交易

无

6.4.10.1.3 债券回购交易

无

6.4.10.1.4 基金交易

无

6.4.10.1.5 权证交易

无

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年5月13日（修订后的基金合同生效日）至2021 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	280,601.21
其中：支付销售机构的客户维护费	843,359.57

注：本基金基金财产中目标 ETF 的部分不收取管理费，在通常情况下，扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应的基金资产净值后剩余部分基金资产的基金管理费按前一日该部分基金资产净值的 0.5% 年费率计提。其计算公式为：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分的基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年5月13日（修订后的基金合同生效日）至2021 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	56,120.24

注：本基金基金财产中目标 ETF 的部分不收取托管费，在通常情况下，扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应的基金资产净值后剩余部分基金资产的基金托管费按前一日该部分基金资产净值的 0.1% 年费率计提。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分的基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年5月13日（修订后的基金合同生效日）至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝医疗 ETF 联接 A	华宝医疗 ETF 联接 C	合计
华宝基金	-	16.02	16.02
合计	-	16.02	16.02

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华宝基金，再由华宝基金计算并支付给各基金销售机构。C类基金份额持有人约定的年基金销售服务费率为0.2%。其计算公式为：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年5月13日（修订后的基金合同生效日）至2021年6月30日	本期 2021年5月13日（修订后的基金合同生效日）至2021年6月30日

	华宝医疗 ETF 联接 A	华宝医疗 ETF 联接 C
基金合同生效日（2021 年 5 月 13 日）持有的基金份额	88,260.78	-
报告期初持有的基金份额	88,260.78	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	88,260.78	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0%	-

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 5 月 13 日（修订后的基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	205,356,649.63	95,555.28

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 3,361,221,800.00 份目标 ETF 基金份额，占其份额的比例为 55.35%。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位）	期末成本总额	期末估值总额	备注

							股)			
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股锁定	24.6	163	610	15,006.00	99,430.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定	10.76	22.2	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.1	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定	12.85	25.8	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	251.96	748	35,402.84	188,466.08	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金	2021年	2021	新股锁	3.4	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-

	辐照	3月29日	2021年10月11日	定						
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.6	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.5	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红	2021年	2021	新股锁	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-

	医疗	4月19日	2021年10月27日	定							
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93		-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	24.9	24.81	295	7,345.50	7,318.95		-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48		-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81		-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54		-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定	12.1	19.29	410	4,961.00	7,908.90		-
688076	诺泰生物	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20		-
688323	瑞华泰	2021年4月21日	2021年10月28日	新股锁定	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14		-
688395	正弦电气	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99		-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年7月7日	新股锁定	74.46	373.24	1,673	124,571.58	624,430.52		-
688636	智明达	2021年3月30日	2021年10月8日	新股锁定	34.5	80.72	918	31,671.00	74,100.96		-

688682	霍莱沃	2021 年 4 月 13 日	2021 年 10 月 20 日	新股锁定	45.72	103.85	946	43,251.12	98,242.10	-
--------	-----	-----------------	------------------	------	-------	--------	-----	-----------	-----------	---

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以达到投资目标，属于较高风险品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，

使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金无债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注 6.4.12 中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上

市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	205,356,649.63	-	-	-	205,356,649.63
结算备付金	30,040,692.94	-	-	-	30,040,692.94
存出保证金	2,459,254.80	-	-	-	2,459,254.80
交易性金融资产	-	-	-	3,159,879,243.80	3,159,879,243.80
应收利息	-	-	-	33,227.56	33,227.56
应收申购款	24,064.72	-	-	10,994,676.02	11,018,740.74
应收证券清算款	-	-	-	19,673,763.33	19,673,763.33

其他资产	-	-	-	32,751.25	32,751.25
资产总计	237,880,662.09	-	-	-3,190,613,661.96	3,428,494,324.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	76,646,989.30	76,646,989.30
应付管理人报酬	-	-	-	84,057.79	84,057.79
应付托管费	-	-	-	16,811.56	16,811.56
应付证券清算款	-	-	-	100.12	100.12
应付销售服务费	-	-	-	7,817.47	7,817.47
应付交易费用	-	-	-	4,042,945.01	4,042,945.01
应交税费	-	-	-	209,067.48	209,067.48
其他负债	-	-	-	385,462.50	385,462.50
负债总计	-	-	-	81,393,251.23	81,393,251.23
利率敏感度缺口	237,880,662.09	-	-	-3,109,220,410.73	3,347,101,072.82

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证医疗指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证医疗指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	3,019,729.24	0.09
交易性金融资产—基金投资	3,156,859,514.56	94.32
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	3,159,879,243.80	94.41

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年6月30日）
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	163,401,810.40
	2. 业绩比较基准下降 5%	-163,401,810.40

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 3,158,000,195.76 元，属于第二层次的余额为 1,879,048.04 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝中证医疗指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 5 月 12 日（基金合同失效日前日）

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 5 月 12 日（基金合 同失效日前日）
资产：		
银行存款	6.4.7.1	201,128,366.28
结算备付金		3,531,934.82
存出保证金		511,288.25
交易性金融资产	6.4.7.2	2,755,639,103.93
其中：股票投资		2,755,639,103.93
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	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	88,921.40
应收股利		-
应收申购款		80,119,617.40
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	41,472.76
资产总计		3,041,060,704.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年5月12日（基金合 同失效日前日）
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		35,618,719.66
应付赎回款		8,810,087.90
应付管理人报酬		835,840.45
应付托管费		183,884.89
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	2,127,848.02
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	253,087.90
负债合计		47,829,468.82
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	3,377,177,621.96
未分配利润	6.4.7.10	-383,946,385.94
所有者权益合计		2,993,231,236.02
负债和所有者权益总计		3,041,060,704.84

注：（1）报告截止日 2021 年 5 月 12 日（基金合同失效日前日），基金份额净值 1.3922 元，基金份额总额 2,150,026,841.98 份。

（2）本基金合同于 2021 年 1 月 1 日生效。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证医疗指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 5 月 12 日（基金合同失效日前日）

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 5 月 12 日（基金合同失效日前日）
一、收入		239,330,904.91
1. 利息收入		154,669.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	154,669.87
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		57,688,196.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	55,484,175.86
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	2,204,021.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	180,139,713.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,348,324.17
减：二、费用		9,080,142.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,453,551.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,199,781.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.20	2,230,282.36
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.21	196,526.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		230,250,762.63
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		230,250,762.63

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证医疗指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 5 月 12 日（基金合同失效日前日）

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 5 月 12 日（基金合同失效日前日）		
	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）	1,128,967,120.98	-183,383,722.23	945,583,398.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	230,250,762.63	230,250,762.63
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）	2,248,210,500.98	-430,813,426.34	1,817,397,074.64
其中：1. 基金申购款	3,168,331,651.71	-543,622,608.57	2,624,709,043.14
2. 基金赎回款	-920,121,150.73	112,809,182.23	-807,311,968.50
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）	3,377,177,621.96	-383,946,385.94	2,993,231,236.02

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：

黄小意

向辉

张幸骏

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

华宝中证医疗指数证券投资基金是由原华宝中证医疗指数分级证券投资基金转型而来。原华宝中证医疗指数分级证券投资基金为契约型开放式基金，根据本基金的基金管理人华宝基金管理

有限公司于 2021 年 1 月 5 日发布的《关于华宝中证医疗指数分级证券投资基金之华宝医疗 A 份额与华宝医疗 B 份额基金份额折算结果的公告》，原华宝中证医疗指数分级证券投资基金以 2020 年 12 月 31 日为基金份额折算基准日进行了基金份额折算。自 2021 年 1 月 1 日起，原华宝中证医疗指数分级证券投资基金转型为华宝中证医疗指数证券投资基金(以下简称“本基金”)，《华宝中证医疗指数证券投资基金基金合同》自该日起生效，原《华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金合同》自同一日起失效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2021]206 号核准，本基金 59,297,851.00 份基金份额于 2021 年 2 月 26 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证医疗指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货以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相关规定)。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证医疗指数成份股及其备选成份股的市值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，应保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中证医疗指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2021 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝中证医疗指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

如财务报表“6.4.8.2 资产负债表日后事项”所述，本基金于 2021 年 5 月 13 日转型为华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金，存续期限不定，因此本基金财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 5 月 12 日(基金合同失效前日)止期间的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 2021 年 5 月 12 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 5 月 12 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 5 月 12 日(基金合同失效前日)。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比

例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2021 年 5 月 12 日 (基金合同失效日前日)
活期存款	201,128,366.28
定期存款	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	201,128,366.28

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末		
	2021 年 5 月 12 日 (基金合同失效日前日)		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,338,351,251.61	2,755,639,103.93	417,287,852.32
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,338,351,251.61	2,755,639,103.93	417,287,852.32

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末
	2021 年 5 月 12 日 (基金合同失效日前日)
应收活期存款利息	77,637.88
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	10,350.56

应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	97.46
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	835.50
合计	88,921.40

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年5月12日（基金合同失效日前日）
其他应收款	-
待摊费用	41,472.76
合计	41,472.76

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年5月12日（基金合同失效日前日）
交易所市场应付交易费用	2,127,848.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,127,848.02

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年5月12日（基金合同失效日前日）
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	30,896.45
应付证券出借违约金	-
预提费用	111,480.32
应付指数使用费	110,711.13
合计	253,087.90

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年5月12日（基金合同失效日前日）	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	718,733,513.88	1,128,967,120.98
本期申购	2,017,068,991.56	3,168,331,651.71
本期赎回（以“-”号填列）	-585,775,663.46	-920,121,150.73
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,150,026,841.98	3,377,177,621.96

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-636,931,194.58	453,547,472.35	-183,383,722.23
本期利润	50,111,048.69	180,139,713.94	230,250,762.63
本期基金份额交易产生的变动数	-1,190,611,933.77	759,798,507.43	-430,813,426.34
其中：基金申购款	-1,685,833,918.69	1,142,211,310.12	-543,622,608.57
基金赎回款	495,221,984.92	-382,412,802.69	112,809,182.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,777,432,079.66	1,393,485,693.72	-383,946,385.94

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年5月12日（基金合同失效日前日）
活期存款利息收入	138,925.11
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	14,084.04
其他	1,660.72
合计	154,669.87

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年5月12日（基金合同失效日前日）
卖出股票成交总额	194,433,967.91
减：卖出股票成本总额	138,949,792.05
买卖股票差价收入	55,484,175.86

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年5月12日（基金合同失效日前日）
股票投资产生的股利收益	2,204,021.07
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,204,021.07

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年5月12日（基金合同失效日前日）
1. 交易性金融资产	180,139,713.94
股票投资	180,139,713.94
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	180,139,713.94

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年5月12日（基金合

	同失效日前日)
基金赎回费收入	1,348,324.17
合计	1,348,324.17

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 计入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 5 月 12 日（基金合同失效日前日）
交易所市场交易费用	2,230,282.36
银行间市场交易费用	-
合计	2,230,282.36

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 5 月 12 日（基金合同失效日前日）
审计费用	18,082.68
信息披露费	43,397.64
证券出借违约金	-
银行费用	10,808.09
指数使用费	110,711.13
上市费用	13,527.24
合计	196,526.78

6.4.7.21 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据华宝基金管理有限公司于 2021 年 5 月 12 日发布的《关于华宝中证医疗指数证券投资基金变更为华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金、增加 C 类份额、降低管理费率 and 托管费率并修订基金合同和托管协议的公告》，自 2021 年 5 月 13 日起，本基金转型为华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金，《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》自该日起生效，《华宝中证医疗指数证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
华宝基金管理有限公司(“华宝基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙 (Warburg Pincus Asset Management, L.P.)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年5月12日(基金合同失效日前日)	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
华宝证券	6,033,954.18	0.30

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年5月12日(基金合同失效日前日)
-------	---------------------------------------

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华宝证券	5,498.77	0.30	5,498.77	0.26

注：(1) 上述佣金按参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

(2) 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 5 月 12 日（基金合同失效日 前日）
当期发生的基金应支付的管理费	5,453,551.75
其中：支付销售机构的客户维护费	2,085,654.41

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 5 月 12 日（基金合同失效日 前日）
当期发生的基金应支付的托管费	1,199,781.39

注：支付基金托管人 中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年5月12日（基金合同 失效日前日）	
	基金合同生效日（2021年1月1日）持有的基金份额	88,260.78
报告期初持有的基金份额	88,260.78	
报告期间申购/买入总份额	-	
报告期间因拆分变动份额	-	
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	
报告期末持有的基金份额	88,260.78	
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.00%	

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年5月12日（基金合同失效 日前日）	
	期末余额	当期利息收入
	中国银行股份有限公司	201,128,366.28

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021年5月12日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001205	盛航股份	2021年4月30日	2021年5月13日	新股流通受限	16.52	16.52	577	9,532.04	9,532.04	-
001206	依依股份	2021年5月10日	2021年5月18日	新股流通受限	44.60	44.60	321	14,316.60	14,316.60	-
300894	火星	2020年12月24日	2021年6月30日	新股锁定	14.07	50.21	628	8,835.96	31,531.88	-
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	新股锁定	39.74	64.79	285	11,325.90	18,465.15	-
300909	汇创达	2020年11月11日	2021年5月18日	新股锁定	29.57	39.60	386	11,414.02	15,285.60	-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	新股锁定	30.26	94.33	474	14,343.24	44,712.42	-
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	新股锁定	24.35	52.91	309	7,524.15	16,349.19	-
300912	凯龙高科	2020年11月26日	2021年6月7日	新股锁定	17.62	32.36	5,117	90,161.54	165,586.12	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	新股锁定	18.78	38.72	281	5,277.18	10,880.32	-
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	新股锁定	4.97	10.42	1,063	5,283.11	11,076.46	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股锁定	24.60	95.94	610	15,006.00	58,523.40	-
300920	润阳科技	2020年12月	2021年6月	新股锁定	26.93	33.80	2,503	67,405.79	84,601.40	-

		17日	25日							
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新股锁定	16.05	33.18	287	4,606.35	9,522.66	-
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	新股锁定	20.08	34.66	353	7,088.24	12,234.98	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定	10.76	25.50	359	3,862.84	9,154.50	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.41	217	2,905.63	6,598.97	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股锁定	13.87	28.52	183	2,538.21	5,219.16	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	13.11	24.83	322	4,221.42	7,995.26	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	4.31	13.98	672	2,896.32	9,394.56	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定	11.72	21.10	340	3,984.80	7,174.00	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股锁定	28.77	47.15	240	6,904.80	11,316.00	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股锁定	16.53	34.44	232	3,834.96	7,990.08	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定	12.85	20.38	371	4,767.35	7,560.98	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	175.38	748	35,402.84	131,184.24	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	22.25	300	2,559.00	6,675.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	21.29	234	2,826.72	4,981.86	-
300961	深水	2021年	2021	新股锁	8.48	19.82	394	3,341.12	7,809.08	-

	海纳	3月23日	2021年9月30日	定						
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.40	17.97	576	1,958.40	10,350.72	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	27.04	283	3,432.79	7,652.32	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	8.24	40.32	286	2,356.64	11,531.52	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	13.83	507	2,301.78	7,011.81	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定	6.87	13.41	1,162	7,982.94	15,582.42	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定	18.24	30.39	245	4,468.80	7,445.55	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股锁定	7.19	14.64	430	3,091.70	6,295.20	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	108.63	360	10,180.80	39,106.80	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	15.80	492	2,696.16	7,773.60	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	15.68	593	4,993.06	9,298.24	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月	新股锁定	33.22	63.17	925	30,728.50	58,432.25	-

		日	月 26 日							
300981	中红 医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁 定	48.59	100.02	601	29,202.59	60,112.02	-
300982	苏文 电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁 定	15.83	28.81	317	5,018.11	9,132.77	-
300985	致远 新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股锁 定	24.90	28.77	295	7,345.50	8,487.15	-
300986	志特 新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股锁 定	14.79	42.30	264	3,904.56	11,167.20	-
300987	川网 传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股锁 定	6.79	48.21	301	2,043.79	14,511.21	-
300991	创益 通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 5 月 20 日	新股流 通受限	13.06	13.06	2,535	33,107.10	33,107.10	-
600032	浙江 新能	2021 年 5 月 12 日	2021 年 5 月 25 日	新股流 通受限	3.51	3.51	3,045	10,687.95	10,687.95	-
605339	南侨 食品	2021 年 5 月 10 日	2021 年 5 月 18 日	新股流 通受限	16.98	16.98	864	14,670.72	14,670.72	-
605488	福莱 新材	2021 年 5 月 6 日	2021 年 5 月 13 日	新股流 通受限	20.43	20.43	416	8,498.88	8,498.88	-
688063	派能 科技	2020 年 12 月 22 日	2021 年 6 月 30 日	新股锁 定	56.00	143.67	5,499	307,944.00	790,041.33	-
688076	诺泰 生物	2021 年 5 月 12 日	2021 年 5 月 20 日	新股流 通受限	15.57	15.57	4,984	77,600.88	77,600.88	-
688217	睿昂 基因	2021 年 5 月 7 日	2021 年 5 月 17 日	新股流 通受限	18.42	18.42	1,040	19,156.80	19,156.80	-
688314	康拓 医疗	2021 年 5 月 11 日	2021 年 5 月	新股流 通受限	17.34	17.34	1,085	18,813.90	18,813.90	-

		日	18 日								
688323	瑞华泰	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 28 日	新股锁定	5.97	25.14	4,513	26,942.61	113,456.82		-
688395	正弦电气	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股锁定	15.95	22.52	1,627	25,950.65	36,640.04		-
688565	力源科技	2021 年 5 月 6 日	2021 年 5 月 13 日	新股流通受限	9.39	9.39	2,464	23,136.96	23,136.96		-
688575	亚辉龙	2021 年 5 月 10 日	2021 年 5 月 17 日	新股流通受限	14.80	14.80	3,435	50,838.00	50,838.00		-
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	74.46	268.94	1,673	124,571.58	449,936.62		-
688636	智明达	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁定	34.50	59.27	918	31,671.00	54,409.86		-
688660	电气风电	2021 年 5 月 11 日	2021 年 5 月 19 日	新股流通受限	5.44	5.44	51,238	278,734.72	278,734.72		-
688678	福立旺	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 23 日	新股锁定	18.05	20.20	4,198	75,773.90	84,799.60		-
688682	霍莱沃	2021 年 4 月 13 日	2021 年 10 月 20 日	新股锁定	45.72	62.97	946	43,251.12	59,569.62		-
688685	迈信林	2021 年 4 月 30 日	2021 年 5 月 13 日	新股流通受限	9.02	9.02	2,612	23,560.24	23,560.24		-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，跟踪中证医疗指数。本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金无债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到

期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持证券均在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持证券均在证券交易所上市，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流

动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年5月12日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	201,128,366.28	-	-	-	201,128,366.28
结算备付金	3,531,934.82	-	-	-	3,531,934.82
存出保证金	511,288.25	-	-	-	511,288.25
交易性金融资产	-	-	-	-2,755,639,103.93	2,755,639,103.93
应收利息	-	-	-	88,921.40	88,921.40
应收申购款	76,601.26	-	-	80,043,016.14	80,119,617.40
资产总计	205,248,190.61	-	-	-2,835,771,041.47	3,041,019,232.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,810,087.90	8,810,087.90
应付管理人报酬	-	-	-	835,840.45	835,840.45
应付托管费	-	-	-	183,884.89	183,884.89
应付证券清算款	-	-	-	35,618,719.66	35,618,719.66
应付交易费用	-	-	-	2,127,848.02	2,127,848.02
负债总计	-	-	-	47,576,380.92	47,576,380.92
利率敏感度缺口	205,248,190.61	-	-	-2,788,194,660.55	2,993,442,851.16

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标，股票资产跟踪的标的指数为中证医疗指数。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证医疗指数成份股及其备选成份股的市值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，应保持不低于本基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对本基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	
	2021 年 5 月 12 日（基金合同失效日前日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	2,755,639,103.93	92.06
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—

其他	-	-
合计	2,755,639,103.93	92.06

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年5月12日（基金合同失效日前日））
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	146,455,591.63
	2. 业绩比较基准下降 5%	-146,455,591.63

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,752,481,881.20 元，属于第二层次的余额为 3,157,222.73 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告（转型后）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,019,729.24	0.09
	其中：股票	3,019,729.24	0.09
2	基金投资	3,156,859,514.56	92.08
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	235,397,342.57	6.87
8	其他各项资产	33,217,737.68	0.97
9	合计	3,428,494,324.05	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,843,316.13	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,356.93	0.00
F	批发和零售业	6,410.76	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	122,085.91	0.00
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	22,269.23	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,019,729.24	0.09

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	688063	派能科技	5,499	1,082,203.20	0.03
2	688617	惠泰医疗	1,673	624,430.52	0.02
3	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.01
4	300957	贝泰妮	748	188,466.08	0.01
5	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.00
6	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
7	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.00
8	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
9	688636	智明达	918	74,100.96	0.00
10	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
11	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
12	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
13	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.00
14	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
15	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
16	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
17	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
18	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
19	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00

20	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
21	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
22	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
23	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
24	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
25	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
26	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
27	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
28	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
29	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
30	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
31	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
32	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
33	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
34	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
35	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
36	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
37	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
38	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
39	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
40	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
41	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	603392	万泰生物	1,893,953.60	0.06
2	603127	昭衍新药	1,277,274.00	0.04
3	600529	山东药玻	1,249,328.00	0.04
4	603301	振德医疗	382,250.00	0.01
5	300993	玉马遮阳	49,573.70	0.00
6	688613	奥精医疗	42,997.31	0.00
7	605296	神农集团	31,909.52	0.00
8	688359	三孚新科	24,409.39	0.00
9	603511	爱慕股份	11,607.47	0.00

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300760	迈瑞医疗	314,729,684.27	9.40

2	300015	爱尔眼科	255,497,096.53	7.63
3	300347	泰格医药	169,157,982.62	5.05
4	300003	乐普医疗	98,556,530.87	2.94
5	300529	健帆生物	97,406,418.02	2.91
6	300595	欧普康视	94,747,981.04	2.83
7	300759	康龙化成	84,316,627.90	2.52
8	002044	美年健康	80,329,554.19	2.40
9	300677	英科医疗	76,081,393.20	2.27
10	300253	卫宁健康	63,551,593.02	1.90
11	300676	华大基因	61,620,784.29	1.84
12	002030	达安基因	53,378,430.06	1.59
13	600763	通策医疗	48,363,954.00	1.44
14	300482	万孚生物	47,327,116.12	1.41
15	002223	鱼跃医疗	45,902,365.22	1.37
16	300463	迈克生物	45,797,894.86	1.37
17	300244	迪安诊断	41,834,502.12	1.25
18	603259	药明康德	35,500,393.10	1.06
19	002382	蓝帆医疗	34,505,045.56	1.03
20	300685	艾德生物	28,202,633.07	0.84

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,963,302.99
卖出股票收入（成交）总额	2,118,408,614.86

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金	指数基金	交易型开放式	华宝基金管理有限公司	3,156,859,514.56	94.32

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.12.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

7.13.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,459,254.80
2	应收证券清算款	19,673,763.33
3	应收股利	-
4	应收利息	33,227.56
5	应收申购款	11,018,740.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	32,751.25
8	其他	-
9	合计	33,217,737.68

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688617	惠泰医疗	624,430.52	0.02	新股锁定
2	688076	诺泰生物	241,973.20	0.01	新股锁定
3	300957	贝泰妮	188,466.08	0.01	新股锁定
4	688323	瑞华泰	102,806.14	0.00	新股锁定
5	300919	中伟股份	99,430.00	0.00	新股锁定
6	688682	霍莱沃	98,242.10	0.00	新股锁定
7	300979	华利集团	80,937.50	0.00	新股锁定
8	688636	智明达	74,100.96	0.00	新股锁定
9	300981	中红医疗	54,324.39	0.00	新股锁定

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 7 投资组合报告（转型前）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,755,639,103.93	90.61

	其中：股票	2,755,639,103.93	90.61
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	204,660,301.10	6.73
8	其他各项资产	80,761,299.81	2.66
9	合计	3,041,060,704.84	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	1,305,857,770.75	43.63
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	-	-
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	100,558,578.24	3.36
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	537,467,808.43	17.96
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	808,441,411.05	27.01

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,752,325,568.47	91.95

7.2.2 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	13,307.01	0.00
B	采矿业	59,572.76	0.00
C	制造业	2,843,132.51	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,687.95	0.00
E	建筑业	9,132.77	0.00
F	批发和零售业	7,773.60	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	9,532.04	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	86,315.81	0.00
J	金融业	54,774.37	0.00
K	房地产业	10,880.32	0.00
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	208,426.32	0.01
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	3,313,535.46	0.11

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	603259	药明康德	2,126,390	325,720,420.20	10.88
2	300760	迈瑞医疗	683,078	307,986,208.64	10.29
3	300015	爱尔眼科	3,354,449	250,677,973.77	8.37
4	300347	泰格医药	1,067,433	167,800,467.60	5.61
5	600763	通策医疗	456,660	153,136,364.40	5.12
6	300003	乐普医疗	3,110,596	94,810,966.08	3.17
7	300529	健帆生物	982,024	93,390,482.40	3.12
8	300595	欧普康视	747,696	91,974,084.96	3.07
9	603882	金城医学	678,904	91,652,040.00	3.06
10	300759	康龙化成	487,800	84,086,964.00	2.81
11	002044	美年健康	6,747,103	80,965,236.00	2.70
12	300677	英科医疗	519,750	75,306,577.50	2.52
13	300253	卫宁健康	4,203,643	62,886,499.28	2.10
14	300676	华大基因	492,584	60,538,573.60	2.02
15	002030	达安基因	1,511,938	52,358,412.94	1.75
16	300482	万孚生物	506,329	46,936,698.30	1.57
17	600529	山东药玻	1,172,041	45,709,599.00	1.53
18	300463	迈克生物	960,317	45,365,375.08	1.52
19	002223	鱼跃医疗	1,481,167	44,627,561.71	1.49
20	603127	昭衍新药	280,017	42,570,984.51	1.42
21	300244	迪安诊断	1,069,456	41,580,449.28	1.39
22	603658	安图生物	333,112	37,468,437.76	1.25
23	603392	万泰生物	117,400	36,158,026.00	1.21
24	002382	蓝帆医疗	1,527,547	34,675,316.90	1.16
25	300685	艾德生物	327,959	27,355,060.19	0.91
26	300298	三诺生物	696,074	24,571,412.20	0.82
27	688016	心脉医疗	70,898	23,190,735.80	0.77
28	688029	南微医学	98,504	23,067,666.72	0.77
29	300143	盈康生命	948,800	22,628,880.00	0.76
30	300451	创业慧康	2,054,412	22,249,281.96	0.74
31	688139	海尔生物	234,234	21,692,410.74	0.72
32	300326	凯利泰	1,780,334	19,637,084.02	0.66
33	002022	科华生物	1,014,061	17,563,536.52	0.59
34	000503	国新健康	1,770,700	15,422,797.00	0.52
35	300406	九强生物	725,200	14,213,920.00	0.47
36	603301	振德医疗	279,700	13,859,135.00	0.46

37	603387	基蛋生物	384,627	12,935,006.01	0.43
38	300639	凯普生物	347,795	12,572,789.25	0.42
39	300206	理邦仪器	716,200	12,461,880.00	0.42
40	300149	睿智医药	861,500	12,405,600.00	0.41
41	002950	奥美医疗	623,800	12,388,668.00	0.41
42	000710	贝瑞基因	436,566	12,145,266.12	0.41
43	300832	新产业	101,500	11,875,500.00	0.40
44	300633	开立医疗	397,733	11,212,093.27	0.37
45	600055	万东医疗	799,077	10,947,354.90	0.37
46	300653	正海生物	147,750	10,194,750.00	0.34
47	002901	大博医疗	109,000	6,953,110.00	0.23
48	603367	辰欣药业	446,501	5,929,533.28	0.20
49	688366	昊海生科	40,719	5,408,297.58	0.18
50	688108	赛诺医疗	121,152	1,060,080.00	0.04

7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	688063	派能科技	5,499	790,041.33	0.03
2	688617	惠泰医疗	1,673	449,936.62	0.02
3	688660	电气风电	51,238	278,734.72	0.01
4	300912	凯龙高科	5,117	165,586.12	0.01
5	300957	贝泰妮	748	131,184.24	0.00
6	688323	瑞华泰	4,513	113,456.82	0.00
7	688678	福立旺	4,198	84,799.60	0.00
8	300920	润阳科技	2,503	84,601.40	0.00
9	688076	诺泰生物	4,984	77,600.88	0.00
10	300981	中红医疗	601	60,112.02	0.00
11	001203	大中矿业	3,809	59,572.76	0.00
12	688682	霍莱沃	946	59,569.62	0.00
13	300919	中伟股份	610	58,523.40	0.00
14	300979	华利集团	925	58,432.25	0.00
15	600906	财达证券	7,597	54,774.37	0.00
16	688636	智明达	918	54,409.86	0.00
17	688575	亚辉龙	3,435	50,838.00	0.00
18	300910	瑞丰新材	474	44,712.42	0.00
19	300973	立高食品	360	39,106.80	0.00
20	688395	正弦电气	1,627	36,640.04	0.00
21	300991	创益通	2,535	33,107.10	0.00
22	605089	味知香	370	32,589.60	0.00
23	300894	火星人	628	31,531.88	0.00
24	688685	迈信林	2,612	23,560.24	0.00

25	688565	力源科技	2,464	23,136.96	0.00
26	688217	睿昂基因	1,040	19,156.80	0.00
27	688314	康拓医疗	1,085	18,813.90	0.00
28	300908	仲景食品	285	18,465.15	0.00
29	300911	亿田智能	309	16,349.19	0.00
30	300968	格林精密	1,162	15,582.42	0.00
31	300909	汇创达	386	15,285.60	0.00
32	605339	南侨食品	864	14,670.72	0.00
33	300987	川网传媒	301	14,511.21	0.00
34	001206	依依股份	321	14,316.60	0.00
35	300925	法本信息	353	12,234.98	0.00
36	300966	共同药业	286	11,531.52	0.00
37	300953	震裕科技	240	11,316.00	0.00
38	300986	志特新材	264	11,167.20	0.00
39	300918	南山智尚	1,063	11,076.46	0.00
40	300917	特发服务	281	10,880.32	0.00
41	600032	浙江新能	3,045	10,687.95	0.00
42	300962	中金辐照	576	10,350.72	0.00
43	001205	盛航股份	577	9,532.04	0.00
44	300922	天秦装备	287	9,522.66	0.00
45	300931	通用电梯	672	9,394.56	0.00
46	605196	华通线缆	1,172	9,376.00	0.00
47	300978	东箭科技	593	9,298.24	0.00
48	300926	博俊科技	359	9,154.50	0.00
49	300982	苏文电能	317	9,132.77	0.00
50	605488	福莱新材	416	8,498.88	0.00
51	300985	致远新能	295	8,487.15	0.00
52	300930	屹通新材	322	7,995.26	0.00
53	300955	嘉亨家化	232	7,990.08	0.00
54	300961	深水海纳	394	7,809.08	0.00
55	300975	商络电子	492	7,773.60	0.00
56	300963	中洲特材	283	7,652.32	0.00
57	300956	英力股份	371	7,560.98	0.00
58	300971	博亚精工	245	7,445.55	0.00
59	300952	恒辉安防	340	7,174.00	0.00
60	300967	晓鸣股份	507	7,011.81	0.00
61	300958	建工修复	300	6,675.00	0.00
62	300927	江天化学	217	6,598.97	0.00
63	300972	万辰生物	430	6,295.20	0.00
64	300929	华骐环保	183	5,219.16	0.00
65	300960	通业科技	234	4,981.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	603259	药明康德	213,820,359.10	7.14
2	300760	迈瑞医疗	198,128,721.98	6.62
3	300015	爱尔眼科	154,929,206.76	5.18
4	300347	泰格医药	109,072,112.56	3.64
5	600763	通策医疗	89,580,082.28	2.99
6	002044	美年健康	65,276,705.56	2.18
7	300677	英科医疗	65,229,708.33	2.18
8	300003	乐普医疗	64,735,804.98	2.16
9	603882	金域医学	64,289,279.16	2.15
10	300529	健帆生物	57,954,909.92	1.94
11	300595	欧普康视	51,944,435.11	1.74
12	300759	康龙化成	48,974,339.50	1.64
13	300253	卫宁健康	48,078,876.67	1.61
14	300676	华大基因	44,052,026.40	1.47
15	002030	达安基因	33,271,296.39	1.11
16	600529	山东药玻	33,203,244.29	1.11
17	300482	万孚生物	30,535,434.97	1.02
18	002223	鱼跃医疗	29,462,868.43	0.98
19	300463	迈克生物	29,381,894.58	0.98
20	603127	昭衍新药	28,148,117.32	0.94

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	603259	药明康德	21,707,660.86	0.73
2	300760	迈瑞医疗	19,657,055.24	0.66
3	300015	爱尔眼科	16,308,064.00	0.54
4	300347	泰格医药	11,576,601.17	0.39
5	600763	通策医疗	9,350,909.00	0.31
6	300677	英科医疗	6,702,909.00	0.22
7	603882	金域医学	6,359,646.00	0.21
8	002044	美年健康	6,055,408.00	0.20
9	300003	乐普医疗	5,900,660.00	0.20
10	300529	健帆生物	5,395,428.30	0.18
11	300595	欧普康视	5,095,401.00	0.17
12	300759	康龙化成	4,542,454.10	0.15

13	300676	华大基因	4,495,284.52	0.15
14	300253	卫宁健康	4,462,267.40	0.15
15	002030	达安基因	3,187,313.38	0.11
16	600529	山东药玻	3,090,919.68	0.10
17	300482	万孚生物	2,925,015.00	0.10
18	603658	安图生物	2,768,964.00	0.09
19	300463	迈克生物	2,720,632.01	0.09
20	002223	鱼跃医疗	2,646,752.00	0.09

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,823,456,312.56
卖出股票收入（成交）总额	194,433,967.91

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	511,288.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	88,921.40
5	应收申购款	80,119,617.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	41,472.76
8	其他	-
9	合计	80,761,299.81

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公 允价值	占基金资产净 值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688063	派能科技	790,041.33	0.03	新股锁定
2	688617	惠泰医疗	449,936.62	0.02	新股锁定
3	688660	电气风电	278,734.72	0.01	新股流通受限
4	300912	凯龙高科	165,586.12	0.01	新股锁定
5	300957	贝泰妮	131,184.24	0.00	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§8 基金份额持有人信息（转型后）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份 额 级 别	持 有 人 户 数 (户)	户 均 持 有 的 基 金 份 额	持 有 人 结 构			
			机 构 投 资 者		个 人 投 资 者	
			持 有 份 额	占 总 份 额 比 例 (%)	持 有 份 额	占 总 份 额 比 例 (%)
华 宝 医 疗 ETF 联 接 A	492,461	4,348.08	32,380,814.40	1.51	2,108,879,230.09	98.49
华 宝 医 疗 ETF 联 接 C	11,782	2,814.37	0.00	0.00	33,158,893.42	100.00
合 计	504,243	4,312.24	32,380,814.40	1.49	2,142,038,123.51	98.51

8.2 期末上市基金前十名持有人

华宝医疗 ETF 联接 A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	吴杰	836,853.00	1.20

2	王嫵	636,669.00	0.92
3	钱中明	569,394.00	0.82
4	叶丙熙	524,052.00	0.75
5	田正政	500,000.00	0.72
6	李建国	496,645.00	0.71
7	李启英	456,986.00	0.66
8	方晨	427,134.00	0.61
9	曹纯燕	384,018.00	0.55
10	洪映藩	375,145.00	0.54

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华宝医疗 ETF 联接 A	112,529.37	0.0053
	华宝医疗 ETF 联接 C	29,487.73	0.0889
	合计	142,017.10	0.0065

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华宝医疗 ETF 联接 A	0~10
	华宝医疗 ETF 联接 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝医疗 ETF 联接 A	0~10
	华宝医疗 ETF 联接 C	0
	合计	0~10

§ 8 基金份额持有人信息（转型前）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
506,351	4,246.12	32,362,982.02	1.51	2,117,663,859.96	98.49

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	张美芳	12,458,575.00	13.38
2	宋伟铭	4,138,449.00	4.44
3	曹纯燕	1,228,800.00	1.32
4	吴杰	836,853.00	0.90
5	胥怀建	742,580.00	0.80
6	王嫵	636,669.00	0.68
7	章美琪	636,472.00	0.68
8	叶丙熙	524,052.00	0.56
9	田正政	500,000.00	0.54
10	李建国	496,645.00	0.53

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	110,440.22	0.0051

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	华宝医疗 ETF 联接 A	华宝医疗 ETF 联接 C
基金合同生效日（2021年5月13日）基金份额总额	2,150,026,841.98	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	339,563,518.56	75,598,420.89
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	348,330,316.05	42,439,527.47
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,141,260,044.49	33,158,893.42

§ 9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

基金合同生效日（2021年1月1日） 基金份额总额	718,733,513.88
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	2,017,068,991.56
减：基金合同生效日起至报告期期末 基金总赎回份额	585,775,663.46
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	2,150,026,841.98

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

报告期内本基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

2021年5月13日本基金变更为华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金，投资策略相应变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	1,113,846,263.63	52.46%	1,015,048.72	52.42%	-
开源证券	2	685,159,690.90	32.27%	624,388.05	32.25%	-
中金公司	2	139,671,694.03	6.58%	127,283.22	6.57%	-
方正证券	1	113,329,575.43	5.34%	103,276.54	5.33%	-
财通证券	2	43,270,811.88	2.04%	40,297.80	2.08%	-
海通证券	2	26,977,151.65	1.27%	25,123.86	1.30%	-
天风证券	3	584,759.68	0.03%	532.85	0.03%	-
兴业证券	2	114,242.25	0.01%	106.39	0.01%	-
华金证券	1	111,827.84	0.01%	104.14	0.01%	-
浙商证券	2	81,578.16	0.00%	74.33	0.00%	-
长江证券	1	33,320.64	0.00%	31.03	0.00%	-
国元证券	2	20,172.37	0.00%	18.39	0.00%	-
宏信证券	2	10,332.00	0.00%	9.42	0.00%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
新时代证 券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元均为新增。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	19,674,648.40	5.30%
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	126,736,218.60	34.15%
财通证券	-	-	-	-	-	-	63,458,928.00	17.10%
海通证券	-	-	-	-	-	-	118,522,951.10	31.94%
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	8,028,627.70	2.16%
华金证券	-	-	-	-	-	-	19,537,615.30	5.26%
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	9,877,579.20	2.66%
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	5,298,000.00	1.43%	
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信金 通	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-	-	-

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单 元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	佣金	占当期佣 金 总量的比	

					例	
海通证券	2	410,061,826.72	20.37%	374,358.63	20.30%	-
中金公司	2	310,443,752.49	15.42%	282,907.00	15.34%	-
宏信证券	2	307,681,832.06	15.29%	280,430.40	15.20%	-
东方财富	2	232,493,839.76	11.55%	216,359.67	11.73%	-
开源证券	2	172,861,453.74	8.59%	160,183.16	8.68%	-
方正证券	1	110,839,063.44	5.51%	101,004.52	5.48%	-
华创证券	2	108,045,168.75	5.37%	98,461.90	5.34%	-
国元证券	2	106,204,845.52	5.28%	96,784.34	5.25%	-
财通证券	2	76,048,507.28	3.78%	70,823.52	3.84%	-
国海证券	2	50,603,759.51	2.51%	46,115.22	2.50%	-
光大证券	2	35,442,022.42	1.76%	32,298.33	1.75%	-
广发证券	2	27,225,058.14	1.35%	24,810.15	1.35%	-
中泰证券	1	17,962,832.34	0.89%	16,728.48	0.91%	-
国信证券	1	12,332,652.37	0.61%	11,485.36	0.62%	-
东方证券	1	11,549,578.10	0.57%	10,525.29	0.57%	-
中信建投	1	6,918,011.21	0.34%	6,442.88	0.35%	-
华宝证券	1	6,033,954.18	0.30%	5,498.77	0.30%	-
申万宏源	3	4,839,451.88	0.24%	4,507.10	0.24%	-
天风证券	3	4,428,038.24	0.22%	4,035.25	0.22%	-
长江证券	1	873,873.95	0.04%	813.84	0.04%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
新时代证	2	-	-	-	-	-

券						
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人 员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元均为新增。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

财通证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

10.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗指数证券投资 基金基金合同	基金管理人网站
2	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗指数证券投资 基金托管协议	基金管理人网站
3	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗指数证券投资 基金招募说明书 (更新)	基金管理人网站
4	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗指数证券	基金管理人网站

		投资基金基金产品资料概要（更新）	
5	医疗 ETF 联接 A	关于华宝中证医疗指数分级证券投资基金之华宝医疗 A 份额与华宝医疗 B 份额基金份额折算结果的公告	基金管理人网站, 证券时报
6	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗指数分级证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站
7	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗指数证券投资基金上市交易公告书	基金管理人网站, 证券时报
8	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗指数证券投资基金上市交易提示性公告	基金管理人网站, 证券时报
9	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗指数分级证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站
10	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗指数证券投资基金基金合同	基金管理人网站
11	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗指数证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站
12	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站
13	医疗 ETF 联接 A	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》修改基金合同部分条款的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报
14	医疗 ETF 联接 A	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增中信证券华南为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报
15	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站
16	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗指数证券投资基金 2021 年第 1	基金管理人网站

		季度报告	
17	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金（A 类份额）基金产品资料概要	基金管理人网站
18	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同	基金管理人网站
19	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议	基金管理人网站
20	医疗 ETF 联接 A	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书	基金管理人网站
21	医疗 ETF 联接 A	关于华宝中证医疗指数证券投资基金变更为华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金、增加 C 类份额、降低管理费率 and 托管费率公告	基金管理人网站, 证券时报
22	医疗 ETF 联接 A	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增华鑫证券为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报
23	医疗 ETF 联接 A	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增平安银行为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报
24	医疗 ETF 联接 C	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金（C 类份额）基金产品资料概要	基金管理人网站
25	医疗 ETF 联接 C	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书	基金管理人网站
26	医疗 ETF 联接 C	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议	基金管理人网站
27	医疗 ETF 联接 C	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同	基金管理人网站
28	医疗 ETF 联接 C	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日

		金增加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	报, 证券时报, 中国证券报
29	医疗 ETF 联接 C	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增华鑫证券为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报
30	医疗 ETF 联接 C	关于华宝中证医疗指数证券投资基金变更为华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金、增加 C 类份额、降低管理费率 and 托管费率公告	基金管理人网站, 证券时报

10.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝中证医疗指数分级证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2021-1-22
2	华宝中证医疗指数分级证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站	2021-3-31
3	关于华宝中证医疗指数分级证券投资基金之华宝医疗 A 份额与华宝医疗 B 份额基金份额折算结果的公告	基金管理人网站, 证券时报	2021-1-5
4	华宝中证医疗指数分级证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站	2021-3-31
5	华宝中证医疗指数分级证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2021-1-22
6	关于华宝中证医疗指数分级证券投资基金之华宝医疗 A 份额与华宝医疗 B 份额基金份额折算结果的公告	基金管理人网站, 证券时报	2021-1-5

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

无

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1. 本基金由华宝中证医疗指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来。

2. 根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》的要求，2021 年 3 月 31 日，基金管理人发布关于修订旗下部分基金基金合同的公告，对基金管理人旗下 34 只指数基金基金合同部分条款进行相应更新，具体内容可详见相关公告，请投资者予以关注。

3、基金管理人于 2021 年 5 月 12 日发布《关于华宝中证医疗指数证券投资基金变更为华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金、增加 C 类份额、降低管理费率 and 托管费率并修订基金合同和托管协议的公告》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同；
华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书；
华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日