

# 华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资 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 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
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 .....	14
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 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>55</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	55
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	56
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 .....	58
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	63
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 .....	63
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 .....	63
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 .....	63

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 .....	63
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
7.12 投资组合报告附注 .....	64
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
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 .....	66
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>66</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
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 .....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
10.4 基金投资策略的改变 .....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
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 .....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
10.8 其他重大事件 .....	70
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>72</b>
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 .....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>73</b>
12.1 备查文件目录 .....	73
12.2 存放地点 .....	73
12.3 查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华宝中证医疗 ETF
场内简称	医疗 ETF
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	6,072,820,474.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 6 月 17 日

### 2.2 基金产品说明

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	<p>本基金主要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。</p> <p>1、组合复制策略 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。</p> <p>2、替代性策略 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。</p> <p>3、债券投资策略 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>4、资产支持证券投资策略 本基金将通过对宏观经济、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同，控制信用风险和流动性风险的前提下，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>5、股指期货、权证等金融衍生工具投资策略 在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，降低跟踪误差，以更好地</p>

	<p>实现本基金的投资目标。</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。</p> <p>本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
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。

### 2.3 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
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	上海证券报
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

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

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-2021年6月30日)
本期已实现收益	170,020,663.30
本期利润	638,482,370.59
加权平均基金份额本期利润	0.2176
本期加权平均净值利润率	22.82%
本期基金份额净值增长率	19.54%
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	2,060,372,581.52
期末可供分配基金份额利润	0.3393
期末基金资产净值	5,703,344,716.13
期末基金份额净值	0.9392
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	181.76%

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、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。

3、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）。

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

##### 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	4.59%	1.73%	4.18%	1.77%	0.41%	-0.04%
过去三个月	23.81%	1.74%	23.22%	1.77%	0.59%	-0.03%
过去六个月	19.54%	2.14%	18.74%	2.17%	0.80%	-0.03%

过去一年	39.33%	1.99%	34.85%	2.03%	4.48%	-0.04%
过去三年	-%	-%	-%	-%	-%	-%
自基金合同生效起至今	181.76%	1.79%	160.30%	1.84%	21.46%	-0.05%

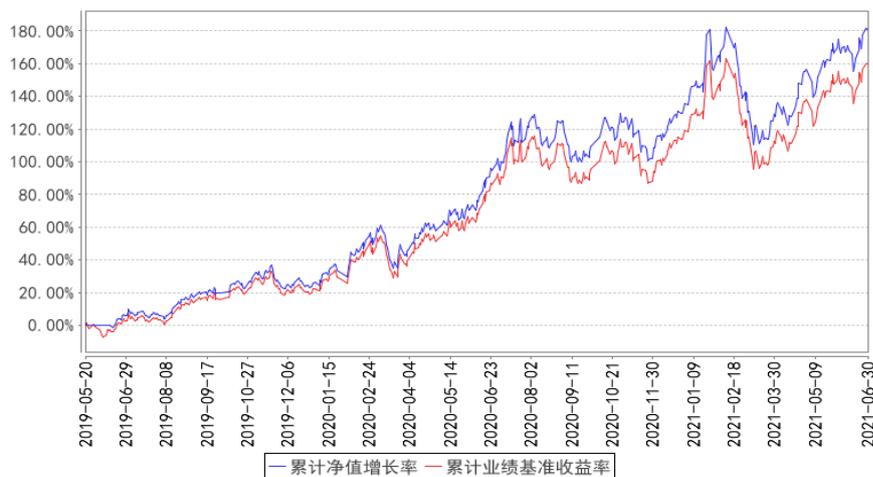
注：1、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

2、本基金业绩比较基准为：中证医疗指数收益率。

3、本基金成立于 2019 年 5 月 20 日。

### 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ETF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：1、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 6 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 2019 年 11 月 20 日，本基金已达到基金合同规定的资产配置比例。

## § 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 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

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	2019 年 5 月 20 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

				<p>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。</p>	
张放	本基金的基金经理助理，华宝 MSCI ESG 指数、华宝中证智能制造主题 ETF、华	2019 年 10 月 14 日	-	9 年	<p>硕士。曾在海通期货股份有限公司、长江证券股份有限公司从事分析研究工作。2014 年加入华宝基金管理有限公司，担任投资经理、基金经理助理等职务。2019 年 9 月至 2021 年 3 月任华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF) 基金经理助理。2019 年 10 月至 2020 年 11 月任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2019 年 12 月起任华宝中证消费龙头指数证券</p>

	宝大数据 ETF 基金经理				投资基金（LOF）基金经理助理。2020 年 6 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、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助理。2021 年 1 月起任华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 1 月起任华宝中证智能制造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 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）基金经理。2021 年 5 月起任华宝中证大数据产业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。

#### 4.2 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、《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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。本报告期中，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%。在本报告期中，中证医疗指数累计上涨了 18.74%。

本报告期本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，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

本报告期基金份额净值增长率为 19.54%，业绩比较基准收益率为 18.74%。

## 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其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（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）

### 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

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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	77,282,640.57	20,209,713.05
结算备付金		26,267,585.14	2,914,949.87
存出保证金		2,811,735.80	1,144,954.42
交易性金融资产	6.4.7.2	5,614,895,988.65	1,268,487,827.65
其中: 股票投资		5,614,895,988.65	1,268,487,827.65
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		21,165,957.62	901,710.66
应收利息	6.4.7.5	282,191.96	85,134.20
应收股利		158,361.25	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,742,864,460.99	1,293,744,289.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		15,726,861.12	696,142.90
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,290,847.78	564,385.93
应付托管费		458,169.53	112,877.19
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,284,197.48	3,914,791.10
应交税费		18,184.10	5,279.91
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	14,741,484.85	6,307,671.81
负债合计		39,519,744.86	11,601,148.84
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,024,273,496.32	543,940,158.00
未分配利润	6.4.7.10	3,679,071,219.81	738,202,983.01
所有者权益合计		5,703,344,716.13	1,282,143,141.01
负债和所有者权益总计		5,742,864,460.99	1,293,744,289.85

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9392 元，基金份额总额 6,072,820,474.00 份。

## 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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		657,174,357.00	374,075,663.10
1. 利息收入		1,983,880.18	157,604.57
其中：存款利息收入	6.4.7.11	158,134.31	82,773.77
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		1,825,745.87	74,830.80
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		174,364,780.97	173,907,975.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	156,941,047.12	171,165,242.69
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	17,423,733.85	2,742,732.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	468,461,707.29	188,804,503.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	12,363,988.56	11,205,579.85
减：二、费用		18,691,986.41	8,728,319.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,833,067.60	1,963,847.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,366,613.53	392,769.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	9,958,910.91	6,154,936.57

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		6,572.52	269.34
7. 其他费用	6.4.7.20	526,821.85	216,496.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		638,482,370.59	365,347,343.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		638,482,370.59	365,347,343.48

### 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

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1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）	543,940,158.00	738,202,983.01	1,282,143,141.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	638,482,370.59	638,482,370.59
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）	1,480,333,338.32	2,302,385,866.21	3,782,719,204.53
其中：1. 基金申购款	3,708,880,321.68	3,407,285,468.40	7,116,165,790.08
2. 基金赎回款	-2,228,546,983.36	-1,104,899,602.19	-3,333,446,585.55
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	2,024,273,496.32	3,679,071,219.81	5,703,344,716.13

项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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）	307,940,158.00	79,600,745.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	365,347,343.48	365,347,343.48
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）	315,000,000.00	191,819,778.17	506,819,778.17
其中：1. 基金申购款	1,764,500,000.00	1,026,704,309.14	2,791,204,309.14
2. 基金赎回款	-1,449,500,000.00	-834,884,530.97	-2,284,384,530.97
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）	622,940,158.00	636,767,866.87	1,259,708,024.87

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：

黄小慧

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（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]2018号文《关于准予华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人华宝基金管理有限公司于2019年4

月 22 日至 2019 年 5 月 13 日止期间向社会公开募集，募集期结束经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具德师报（验）字（19）第 00029 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2019 年 5 月 20 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 249,438,000.00 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 2,158.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 249,440,158.00 元，折合 249,440,158.00 份基金份额。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。

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：中证医疗指数收益率。

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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）和在财务报表附注所列示依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》、

其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 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

无

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

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

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

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

##### (2) 增值税

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

利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。

### （3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

### （4）企业所得税

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

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

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

### （5）个人所得税

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

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

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

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

#### 6.4.7 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	77,282,640.57
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	77,282,640.57	

##### 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	5,030,099,556.52	5,614,895,988.65	584,796,432.13
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		5,030,099,556.52	5,614,895,988.65	584,796,432.13

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

#### 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	7,206.32
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	11,820.40
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	261,900.04
其他	1,265.20
合计	282,191.96

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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	6,284,197.48
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,284,197.48

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	104,138.35
应付指数使用费	282,147.01
应退替代款	14,248,298.34
可退替代款	106,901.15
合计	14,741,484.85

#### 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 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	543,940,158.00	543,940,158.00
本期申购	5,761,000,000.00	2,213,000,005.68
本期赎回（以“-”号填列）	-1,728,000,000.00	-732,666,667.36
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	1,495,880,316.00	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	6,072,820,474.00	2,024,273,496.32

注：本基金管理人于 2021 年 2 月 24 日对 2021 年 2 月 23 日登记在册的基金份额按 1:3 的拆分比例进行拆分，即每 1 份基金份额拆成 3 份，增加基金份额持有人持有的基金份额数，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于份额拆分日进行变更登记。

#### 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
上年度末	469,699,899.53	268,503,083.48	738,202,983.01
本期利润	170,020,663.30	468,461,707.29	638,482,370.59
本期基金份额交易产生的变动数	1,420,652,018.69	881,733,847.52	2,302,385,866.21
其中：基金申购款	2,119,664,705.98	1,287,620,762.42	3,407,285,468.40
基金赎回款	-699,012,687.29	-405,886,914.90	-1,104,899,602.19

本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,060,372,581.52	1,618,698,638.29	3,679,071,219.81

#### 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6月30日	
活期存款利息收入		79,911.95
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		68,678.76
其他		9,543.60
合计		158,134.31

#### 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1月1日至2021年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		107,722,882.02
股票投资收益——赎回差价收入		49,218,165.10
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		156,941,047.12

##### 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1月1日至2021年6月30日	
卖出股票成交总额		2,391,401,020.25
减：卖出股票成本总额		2,283,678,138.23
买卖股票差价收入		107,722,882.02

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
赎回基金份额对价总额		1,837,566,269.55

减：现金支付赎回款总额	1,301,584,861.55
减：赎回股票成本总额	486,763,242.90
赎回差价收入	49,218,165.10

#### 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 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。

##### 6.4.7.13.3 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

##### 6.4.7.14.2 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 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6月30日
股票投资产生的股利收益	17,423,733.85
其中：证券出借权益补偿收入	646,059.93
基金投资产生的股利收益	-

合计	17,423,733.85
----	---------------

## 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6月30日
1. 交易性金融资产	468,461,707.29
股票投资	468,461,707.29
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	468,461,707.29

## 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6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	12,363,988.56
合计	12,363,988.56

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

## 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6月30日
交易所市场交易费用	9,958,910.91
银行间市场交易费用	-
合计	9,958,910.91

## 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6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

银行费用	12,699.48
指数使用费	409,984.02
合计	526,821.85

#### 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

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
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、基金销售机构
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6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华宝证券	155,947.65	0.00	-	-

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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6月30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	142.11	0.00	142.11	0.00
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30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 (%)
-	-	-	-	-

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6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,833,067.60	1,963,847.63
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计

提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,366,613.53	392,769.47

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华宝证券	34,471,591.00	46,053.73	3,043,203.00	135.17
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

-	-	-	-
---	---	---	---

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

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:张)	出借期限 (单位:天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华宝证券	2021010600007545	迈克生物	2021年1月6日	350,056.00	7,600	28	3.10	844.02	-	-
华宝证券	2021010600007547	凯利泰	2021年1月6日	274,908.00	18,600	28	3.10	662.83	-	-
华宝证券	2021010600007549	欧普康视	2021年1月6日	563,840.00	6,400	28	3.10	1,359.48	-	-
华宝证券	2021010600007551	健帆生物	2021年1月6日	1,740,028.00	23,600	28	3.10	4,195.40	-	-
华宝证券	2021010700013092	凯利泰	2021年1月7日	145,908.00	10,800	14	3.20	181.57	-	-
华宝证券	2021010700013094	康龙化成	2021年1月7日	1,228,822.00	9,800	14	3.20	1,529.20	-	-
华宝证券	2021010700013096	迪安诊断	2021年1月7日	351,840.00	9,600	14	3.20	437.85	-	-
华宝证	2021010700013098	迈克生	2021年1月7日	210,220.00	4,600	14	3.20	261.61	-	-

券		物	日							
华宝 证券	2021010700013100	卫 宁 健 康	2021 年 1 月 7 日	331,136.00	20,800	14	3.20	412.08	-	-
华宝 证券	2021010700013102	乐 普 医 疗	2021 年 1 月 7 日	324,398.00	12,200	14	3.20	403.70	-	-
华宝 证券	2021011400009515	泰 格 医 药	2021 年 1 月 14 日	807,000.00	5,000	28	3.10	2,432.21	-	-
华宝 证券	2021011400009519	万 孚 生 物	2021 年 1 月 14 日	310,488.00	3,400	28	3.10	935.78	-	-
华宝 证券	2021011400009531	乐 普 医 疗	2021 年 1 月 14 日	361,216.00	12,800	28	3.10	1,088.66	-	-
华宝 证券	2021011400009535	健 帆 生 物	2021 年 1 月 14 日	105,686.00	1,400	28	3.10	318.53	-	-
华宝 证券	2021012100013289	迈 克 生 物	2021 年 1 月 21 日	236,440.00	4,600	14	3.20	294.24	-	-
华宝 证券	2021012100013291	迪 安 诊 断	2021 年 1 月 21 日	422,016.00	9,600	14	3.20	525.18	-	-
华宝 证券	2021012100013293	凯 利 泰	2021 年 1 月 21 日	145,152.00	10,800	14	3.20	180.63	-	-

华宝 证券	2021012100013295	卫 宁 健 康	2021 年 1 月 21 日	301,808.00	20,800	14	3.20	375.58	-	-
华宝 证券	2021012100013297	康 龙 化 成	2021 年 1 月 21 日	1,414,238.00	9,800	14	3.20	1,759.94	-	-
华宝 证券	2021012100013299	乐 普 医 疗	2021 年 1 月 21 日	348,554.00	12,200	14	3.20	433.76	-	-
华宝 证券	2021020300006236	凯 利 泰	2021 年 2 月 3 日	187,860.00	18,600	28	3.10	452.95	-	-
华宝 证券	2021020300006238	迈 克 生 物	2021 年 2 月 3 日	323,000.00	7,600	28	3.10	778.79	-	-
华宝 证券	2021020300006240	欧 普 康 视	2021 年 2 月 3 日	720,448.00	6,400	28	3.10	1,737.08	-	-
华宝 证券	2021020300006242	健 帆 生 物	2021 年 2 月 3 日	1,874,312.00	23,600	28	3.10	4,519.17	-	-
华宝 证券	2021020400013387	迪 安 诊 断	2021 年 2 月 4 日	384,096.00	9,600	14	3.20	477.99	-	-
华宝 证券	2021020400013389	康 龙 化 成	2021 年 2 月 4 日	1,474,900.00	9,800	14	3.20	1,835.43	-	-
华宝 证券	2021020400013391	卫 宁 健 康	2021 年 2 月 4 日	337,584.00	20,800	14	3.20	420.10	-	-
华 宝	2021020400013393	乐	2021	361,730.00	12,200	14	3.20	450.15	-	-

宝 证 券		普 医 疗	年 2 月 4 日								
华 宝 证 券	2021020400013395	凯 利 泰	2021 年 2 月 4 日	106,920.00	10,800	14	3.20	133.06		-	-
华 宝 证 券	2021020400013397	迈 克 生 物	2021 年 2 月 4 日	189,704.00	4,600	14	3.20	236.08		-	-
华 宝 证 券	2021021800040584	卫 宁 健 康	2021 年 2 月 18 日	372,320.00	20,800	14	3.20	463.33		-	-
华 宝 证 券	2021021800040586	乐 普 医 疗	2021 年 2 月 18 日	396,866.00	12,200	14	3.20	493.88		-	-
华 宝 证 券	2021021800040588	凯 利 泰	2021 年 2 月 18 日	118,368.00	10,800	14	3.20	147.30		-	-
华 宝 证 券	2021021800040590	康 龙 化 成	2021 年 2 月 18 日	1,415,512.00	9,800	14	3.20	1,761.53		-	-
华 宝 证 券	2021021800040592	迪 安 诊 断	2021 年 2 月 18 日	360,672.00	9,600	14	3.20	448.84		-	-
华 宝 证 券	2021021800040594	迈 克 生 物	2021 年 2 月 18 日	197,754.00	4,600	14	3.20	246.09		-	-
华 宝 证 券	2021021800040728	泰 格 医	2021 年 2 月	896,750.00	5,000	28	3.10	2,162.16		-	-

券		药	18 日								
华宝 证券	2021021800040732	万孚 生物	2021 年2 月 18 日	278,800.00	3,400	28	3.10	672.22		-	-
华宝 证券	2021021800040734	乐普 医疗	2021 年2 月 18 日	416,384.00	12,800	28	3.10	1,003.95		-	-
华宝 证券	2021021800040738	健帆 生物	2021 年2 月 18 日	125,636.00	1,400	28	3.10	302.92		-	-
华宝 证券	2021030300003784	欧普 康视	2021 年3 月3 日	589,632.00	6,400	28	3.10	1,421.67		-	-
华宝 证券	2021030300003786	凯利 泰	2021 年3 月3 日	201,438.00	18,600	28	3.10	485.69		-	-
华宝 证券	2021030300004120	健帆 生物	2021 年3 月3 日	1,891,776.00	23,600	28	3.10	4,561.28		-	-
华宝 证券	2021030300004122	迈克 生物	2021 年3 月3 日	311,600.00	7,600	28	3.10	751.30		-	-
华宝 证券	2021030400000236	欧普 康视	2021 年3 月4 日	2,301,316.00	26,800	28	3.10	5,548.73		-	-
华宝 证券	2021030400037175	凯利 泰	2021 年3 月4 日	113,184.00	10,800	14	3.20	140.85		-	-
华宝 证	2021030400037177	乐普 医	2021 年3 月4	380,274.00	12,200	14	3.20	473.23		-	-

券		疗	日							
华宝 证券	2021030400037179	迈 克 生 物	2021 年 3 月 4 日	183,264.00	4,600	14	3.20	228.06	-	-
华宝 证券	2021030400037181	卫 宁 健 康	2021 年 3 月 4 日	381,264.00	20,800	14	3.20	474.46	-	-
华宝 证券	2021030400037183	迪 安 诊 断	2021 年 3 月 4 日	316,032.00	9,600	14	3.20	393.28	-	-
华宝 证券	2021030400037185	康 龙 化 成	2021 年 3 月 4 日	1,166,298.00	9,800	14	3.20	1,451.39	-	-
华宝 证券	2021031800033688	泰 格 医 药	2021 年 3 月 18 日	667,650.00	5,000	28	3.10	1,609.78	-	-
华宝 证券	2021031800033696	卫 宁 健 康	2021 年 3 月 18 日	325,520.00	20,800	14	3.20	405.09	-	-
华宝 证券	2021031800035272	康 龙 化 成	2021 年 3 月 18 日	1,203,440.00	9,800	14	3.20	1,497.61	-	-
华宝 证券	2021031800035276	乐 普 医 疗	2021 年 3 月 18 日	374,912.00	12,800	28	3.10	903.95	-	-
华宝 证券	2021031800035282	凯 利 泰	2021 年 3 月 18 日	107,892.00	10,800	14	3.20	134.27	-	-
华宝	2021031800035288	乐 普	2021 年 3	357,338.00	12,200	14	3.20	444.69	-	-

证券		医疗	月 18 日								
华宝 证券	2021031800035290	迈 克 生 物	2021 年 3 月 18 日	170,200.00	4,600	14	3.20	211.80		-	-
华宝 证券	2021031800035292	迪 安 诊 断	2021 年 3 月 18 日	303,744.00	9,600	14	3.20	377.99		-	-
华宝 证券	2021031800035298	万 孚 生 物	2021 年 3 月 18 日	263,500.00	3,400	28	3.10	635.33		-	-
华宝 证券	2021031800035302	健 帆 生 物	2021 年 3 月 18 日	100,884.00	1,400	28	3.10	243.24		-	-
华宝 证券	2021040100030973	凯 利 泰	2021 年 4 月 1 日	108,000.00	10,800	14	3.20	134.40		-	-
华宝 证券	2021040100030975	乐 普 医 疗	2021 年 4 月 1 日	358,192.00	12,200	14	3.20	445.75		-	-
华宝 证券	2021040100030979	迪 安 诊 断	2021 年 4 月 1 日	336,000.00	9,600	14	3.20	418.13		-	-
华宝 证券	2021040100030981	迈 克 生 物	2021 年 4 月 1 日	190,808.00	4,600	14	3.20	237.45		-	-
华宝 证券	2021040100030985	卫 宁 健 康	2021 年 4 月 1 日	349,024.00	20,800	14	3.20	434.34		-	-
华	2021040100030987	康	2021	1,460,494.00	9,800	14	3.20	1,817.50		-	-

宝 证 券		龙 化 成	年 4 月 1 日								
华 宝 证 券	2021040100031015	欧 普 康 视	2021 年 4 月 1 日	2,537,156.00	26,800	28	3.10	6,117.37		-	-
华 宝 证 券	2021041500030676	万 孚 生 物	2021 年 4 月 15 日	293,726.00	3,400	28	3.10	708.21		-	-
华 宝 证 券	2021041500030678	泰 格 医 药	2021 年 4 月 15 日	686,500.00	5,000	28	3.10	1,655.23		-	-
华 宝 证 券	2021041500030682	健 帆 生 物	2021 年 4 月 15 日	123,732.00	1,400	28	3.10	298.33		-	-
华 宝 证 券	2021041500030686	乐 普 医 疗	2021 年 4 月 15 日	355,968.00	12,800	28	3.10	858.28		-	-
华 宝 证 券	2021041500030688	康 龙 化 成	2021 年 4 月 15 日	1,446,676.00	9,800	14	3.20	1,800.31		-	-
华 宝 证 券	2021041500030824	乐 普 医 疗	2021 年 4 月 15 日	339,282.00	12,200	14	3.20	422.22		-	-
华 宝 证 券	2021041500030834	卫 宁 健 康	2021 年 4 月 15 日	358,592.00	20,800	14	3.20	446.25		-	-
华 宝	2021041500030836	迈 克	2021 年 4	193,660.00	4,600	14	3.20	241.00		-	-

证券		生物	月 15 日								
华宝 证券	2021041500030840	迪 安 诊 断	2021 年 4 月 15 日	336,000.00	9,600	14	3.20	418.13		-	-
华宝 证券	2021042900024173	欧 普 康 视	2021 年 4 月 29 日	3,078,516.00	26,800	28	3.10	7,422.64		-	-
华宝 证券	2021051300026190	健 帆 生 物	2021 年 5 月 13 日	138,278.00	1,400	28	3.10	333.40		-	-
华宝 证券	2021051300026192	乐 普 医 疗	2021 年 5 月 13 日	389,504.00	12,800	28	3.10	939.14		-	-
华宝 证券	2021051300026196	泰 格 医 药	2021 年 5 月 13 日	780,300.00	5,000	28	3.10	1,881.39		-	-
华宝 证券	2021051300026198	万 孚 生 物	2021 年 5 月 13 日	318,070.00	3,400	28	3.10	766.90		-	-
华宝 证券	2021052700019629	欧 普 康 视	2021 年 5 月 27 日	1,893,920.00	19,000	28	3.10	4,566.45		-	-
华宝 证券	2021062400008833	欧 普 康 视	2021 年 6 月 24 日	1,948,070.00	19,000	28	3.10	1,006.50	1,967,450.00	1,006.50	
华	2021063000000377	康	2021	1,996,308.00	9,200	14	3.20		-1,996,308.00		-

宝 证 券		龙 化 成	年 6 月 30 日							
华 宝 证 券	2021063000000379	创 业 慧 康	2021 年 6 月 30 日	484,432.00	54,800	14	3.20	-	484,432.00	-
华 宝 证 券	2021063000000381	乐 普 医 疗	2021 年 6 月 30 日	1,162,744.00	36,200	14	3.20	-	1,162,744.00	-
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日										
关 联 方 名 称	合 约 编 号	证 券 名 称	成 交 时 间	交 易 金 额	交 易 数 量 ( 单 位 : 张)	出 借 期 限 ( 单 位 : 天)	费 率	利 息 收 入	期 末 证 券 出 借 业 务 余 额	期 末 应 收 利 息 余 额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
中国银行股份有限公司—华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,361,221,800.00	55.35	0.00	0.00

##### 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6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	77,282,640.57	79,911.95	21,145,000.90	42,876.61

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
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	-
300933	中辰 股份	2021年 1月15 日	2021 年7月 22日	新股锁 定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易 购	2021年 1月20 日	2021 年7月 27日	新股锁 定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极 光	2021年 1月27 日	2021 年8月 3日	新股锁 定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞 生物	2021年 2月2 日	2021 年8月 9日	新股锁 定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖 智控	2021年 2月3 日	2021 年8月 10日	新股锁 定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡 龙	2021年 2月3 日	2021 年8月 10日	新股锁 定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中 生态	2021年 2月18 日	2021 年8月 25日	新股锁 定	13	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固 特	2021年 2月24 日	2021 年9月 3日	新股锁 定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
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	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工 修复	2021年 3月18 日	2021 年9月	新股锁 定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

		日	29日							
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	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.4	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
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	2021年	2021	新股锁	8.42	13.6	593	4,993.06	8,064.80	-

	科技	4月15日	年10月26日	定							
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	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39		-
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		-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00		-
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		-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12		-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43		-

		日	月 3 日							
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新股锁定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁定	14.2	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-

301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688070	纵横股份	2021年2月2日	2021年8月10日	新股锁定	23.16	34.47	2,407	55,746.12	82,969.29	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688533	上声电子	2021年4月9日	2021年10月19日	新股锁定	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688607	康众医疗	2021年1月25日	2021年8月2日	新股锁定	23.21	44.5	1,890	43,866.90	84,105.00	-
688626	翔宇医疗	2021年3月23日	2021年10月8日	新股锁定	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	-
688677	海泰新光	2021年2月18日	2021年8月26日	新股锁定	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-
688687	凯因	2021年	2021	新股锁	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92	-

	科技	1月29日	年8月9日	定						
--	----	-------	-------	---	--	--	--	--	--	--

注：1、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、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，锁定期为自发行人股票上市之日起6个月。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000516	国际医学	2021年7月1日-2021年7月14日	18.81	568,500	10,693,485.00
2	002030	达安基因	2021年7月1日-2021年7月22日	21.24	936,500	19,891,260.00
3	002044	美年健康	2021年7月1日-2021年7月22日	9.11	2,308,800	21,033,168.00
4	002223	鱼跃医疗	2021年7月1日-2021年7月14日	38.13	344,300	13,128,159.00
5	002382	蓝帆医	2021年7月1日-2021	20.85	249,100	5,193,735

		疗	年 7 月 16 日			. 00
6	300003	乐普医疗	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 21 日	32. 12	177, 600	5, 704, 512 . 00
7	300015	爱尔眼科	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 28 日	70. 98	1, 253, 934	89, 004, 23 5. 32
8	300244	迪安诊断	2021 年 7 月 5 日	38. 30	38, 000	1, 455, 400 . 00
9	300253	卫宁健康	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 9 日	16. 27	206, 100	3, 353, 247 . 00
10	300326	凯利泰	2021 年 7 月 2 日-2021 年 7 月 9 日	13. 59	603, 200	8, 197, 488 . 00
11	300347	泰格医药	2021 年 7 月 7 日	193. 30	8, 000	1, 546, 400 . 00
12	300451	创业慧康	2021 年 7 月 8 日-2021 年 7 月 14 日	8. 84	562, 530	4, 972, 765 . 20
13	300463	迈克生物	2021 年 7 月 2 日-2021 年 7 月 8 日	42. 09	100, 200	4, 217, 418 . 00
14	300482	万孚生物	2021 年 7 月 7 日-2021 年 7 月 12 日	64. 69	95, 000	6, 145, 550 . 00
15	300529	健帆生物	2021 年 7 月 8 日-2021 年 7 月 14 日	86. 36	15, 400	1, 329, 944 . 00
16	300595	欧普康视	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 22 日	103. 55	70, 200	7, 269, 210 . 00
17	300676	华大基因	2021 年 7 月 6 日-2021 年 7 月 14 日	118. 60	105, 500	12, 512, 30 0. 00
18	300677	英科医疗	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 21 日	124. 80	197, 800	24, 685, 44 0. 00
19	300759	康龙化成	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 14 日	216. 99	27, 900	6, 054, 021 . 00
20	300760	迈瑞医疗	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 28 日	480. 05	33, 000	15, 841, 65 0. 00
21	300896	爱美客	2021 年 7 月 6 日-2021 年 7 月 12 日	788. 88	15, 100	11, 912, 08 8. 00
22	600529	山东药玻	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 23 日	33. 95	328, 400	11, 149, 18 0. 00
23	600763	通策医疗	2021 年 7 月 5 日-2021 年 7 月 7 日	411. 00	30, 000	12, 330, 00 0. 00
24	603127	昭衍新药	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 14 日	183. 75	58, 800	10, 804, 50 0. 00
25	603259	药明康德	2021 年 7 月 12 日-2021 年 7 月 13 日	156. 59	20, 000	3, 131, 800 . 00
26	603658	安图生物	2021 年 7 月 1 日	75. 77	5, 400	409, 158. 0 0
27	688016	心脉医	2021 年 7 月 7 日-2021	454. 61	30, 000	13, 638, 30

		疗	年 7 月 9 日			0.00
28	688029	南微医学	2021 年 7 月 2 日-2021 年 7 月 9 日	311.69	30,000	9,350,700.00
29	688139	海尔生物	2021 年 7 月 9 日-2021 年 7 月 16 日	105.10	115,000	12,086,500.00
30	688202	美迪西	2021 年 7 月 2 日-2021 年 7 月 9 日	519.90	30,000	15,597,000.00
31	688298	东方生物	2021 年 7 月 8 日-2021 年 7 月 9 日	217.60	20,000	4,352,000.00
32	688363	华熙生物	2021 年 7 月 12 日-2021 年 7 月 22 日	277.86	41,000	11,392,260.00
33	688366	昊海生科	2021 年 7 月 2 日-2021 年 7 月 9 日	209.30	30,000	6,279,000.00
34	688389	普门科技	2021 年 7 月 7 日-2021 年 7 月 9 日	30.66	159,000	4,874,940.00
35	688399	硕世生物	2021 年 7 月 6 日-2021 年 7 月 9 日	168.60	31,000	5,226,600.00
合计	-	-	-	-	8,845,264	394,763,413.52

#### 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 基金，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。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经营管理及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、各项业务全面实施和监督反馈；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，将风险控制可在承受的范围之内。

#### 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。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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(上年度末:同)。

#### 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于本报告期末，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》（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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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该比例限制）。

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；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	77,282,640.57	-	-	-	77,282,640.57
结算备付金	26,267,585.14	-	-	-	26,267,585.14
存出保证金	2,811,735.80	-	-	-	2,811,735.80
交易性金融资产	-	-	-	5,614,895,988.65	5,614,895,988.65
应收利息	-	-	-	282,191.96	282,191.96
应收股利	-	-	-	158,361.25	158,361.25
应收证券清算款	-	-	-	21,165,957.62	21,165,957.62
资产总计	106,361,961.51	-	-	5,636,502,499.48	5,742,864,460.99
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,290,847.78	2,290,847.78
应付托管费	-	-	-	458,169.53	458,169.53
应付证券清算款	-	-	-	15,726,861.12	15,726,861.12
应付交易费用	-	-	-	6,284,197.48	6,284,197.48
应交税费	-	-	-	18,184.10	18,184.10
其他负债	-	-	-	14,741,484.85	14,741,484.85
负债总计	-	-	-	39,519,744.86	39,519,744.86
利率敏感度缺口	106,361,961.51	-	-	5,596,982,754.62	5,703,344,716.13
上年度末 2020年12月31日					
资产					
银行存款	20,209,713.05	-	-	-	20,209,713.05

结算备付金	2,914,949.87	-	-	-	2,914,949.87
存出保证金	1,144,954.42	-	-	-	1,144,954.42
交易性金融资产	-	-	-	-1,268,487,827.65	1,268,487,827.65
应收利息	-	-	-	85,134.20	85,134.20
应收证券清算款	-	-	-	901,710.66	901,710.66
资产总计	24,269,617.34	-	-	-1,269,474,672.51	1,293,744,289.85
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	564,385.93	564,385.93
应付托管费	-	-	-	112,877.19	112,877.19
应付证券清算款	-	-	-	696,142.90	696,142.90
应付交易费用	-	-	-	3,914,791.10	3,914,791.10
应交税费	-	-	-	5,279.91	5,279.91
其他负债	-	-	-	6,307,671.81	6,307,671.81
负债总计	-	-	-	11,601,148.84	11,601,148.84
利率敏感度缺口	24,269,617.34	-	-	-1,257,873,523.67	1,282,143,141.01

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（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 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交易的股票，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以复制、跟踪中证医疗指数的方法为原则，根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股、备选成份股等进行替代，以期在规定的风险承

受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

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。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量于国内依法发行上市的非成份股、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。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		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,614,895,988.65	98.45	1,268,487,827.65	98.93
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	5,614,895,988.65	98.45	1,268,487,827.65	98.93

#### 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)	上年度末 (2020年12月31日)	
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	279,956,478.60	62,894,198.35

	2. 业绩比较基准下 降 5%	279,956,478.60	-62,894,198.35
--	--------------------	----------------	----------------

#### 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) 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银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证券清算款、应收利息以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### (b) 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人民币 5,612,837,538.57 元，第二层次的余额为人民币 2,058,450.08 元，无划分为第三层次的余额（于上年度末，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人民币 1,262,053,201.00 元，第二层次的余额为人民币 6,434,626.65 元，无划分为第三层次的余额）。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关证券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

##### (2) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

##### (3) 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 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	5,614,895,988.65	97.77
	其中：股票	5,614,895,988.65	97.77
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	103,550,225.71	1.80
8	其他各项资产	24,418,246.63	0.43
9	合计	5,742,864,460.99	100.00

注：1. 此处股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值，两者在金额上不相等。

2. 参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 394,763,413.52 元，占基金资产净值的比例为 6.92%。

## 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	2,643,957,594.70	46.36
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	155,953,660.26	2.73
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	1,105,467,941.50	19.38
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	1,707,235,072.49	29.93
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,612,614,268.95	98.41

### 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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,010,859.31	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	95,577.58	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	46,251.64	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00
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	44,438.33	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	2,281,530.00	0.04

### 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	300015	爱尔眼科	8,237,713	584,712,868.74	10.25
2	603259	药明康德	3,679,940	576,241,804.60	10.10
3	300760	迈瑞医疗	1,111,199	533,431,079.95	9.35
4	300347	泰格医药	1,594,864	308,287,211.20	5.41
5	600763	通策医疗	686,524	282,161,364.00	4.95
6	300759	康龙化成	1,100,519	238,801,617.81	4.19
7	300595	欧普康视	2,139,025	221,496,038.75	3.88
8	300896	爱美客	262,854	207,360,263.52	3.64
9	603882	金域医学	1,157,560	184,943,361.20	3.24
10	300003	乐普医疗	5,269,556	169,258,138.72	2.97
11	300529	健帆生物	1,677,213	144,844,114.68	2.54
12	000516	国际医学	6,651,200	125,109,072.00	2.19
13	300253	卫宁健康	7,127,474	115,964,001.98	2.03
14	300677	英科医疗	901,100	112,457,280.00	1.97
15	002223	鱼跃医疗	2,927,304	111,618,101.52	1.96
16	002044	美年健康	11,432,995	104,154,584.45	1.83
17	300676	华大基因	870,403	103,229,795.80	1.81
18	002030	达安基因	4,099,018	87,063,142.32	1.53
19	603127	昭衍新药	471,537	86,644,923.75	1.52
20	688363	华熙生物	308,046	85,593,661.56	1.50
21	603392	万泰生物	285,620	74,026,991.60	1.30
22	300482	万孚生物	1,112,461	71,965,102.09	1.26
23	300244	迪安诊断	1,813,603	69,460,994.90	1.22
24	688202	美迪西	132,631	68,954,856.90	1.21
25	300463	迈克生物	1,623,377	68,327,937.93	1.20
26	600529	山东药玻	1,991,465	67,610,236.75	1.19
27	300685	艾德生物	649,208	67,569,568.64	1.18
28	688016	心脉医疗	123,181	55,999,314.41	0.98
29	603658	安图生物	737,481	55,878,935.37	0.98
30	002382	蓝帆医疗	2,629,904	54,833,498.40	0.96
31	688139	海尔生物	512,607	53,874,995.70	0.94
32	688029	南微医学	171,145	53,344,185.05	0.94

33	300143	盈康生命	1,879,100	48,405,616.00	0.85
34	300298	三诺生物	1,419,544	44,460,118.08	0.78
35	300326	凯利泰	3,019,217	41,031,159.03	0.72
36	300451	创业慧康	4,523,717	39,989,658.28	0.70
37	688366	昊海生科	176,870	37,018,891.00	0.65
38	688298	东方生物	154,023	33,515,404.80	0.59
39	000710	贝瑞基因	883,416	26,537,816.64	0.47
40	688399	硕世生物	150,481	25,371,096.60	0.44
41	300406	九强生物	1,230,599	24,279,718.27	0.43
42	300633	开立医疗	676,450	21,362,291.00	0.37
43	688389	普门科技	692,451	21,230,547.66	0.37
44	603301	振德医疗	471,027	20,687,505.84	0.36
45	300832	新产业	320,160	19,721,856.00	0.35
46	300206	理邦仪器	1,215,000	19,318,500.00	0.34
47	300869	康泰医学	189,000	13,384,980.00	0.23
48	002950	奥美医疗	797,840	13,212,230.40	0.23
49	002901	大博医疗	175,754	12,810,709.06	0.22
50	688222	成都先导	171,428	5,057,126.00	0.09

### 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	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.01
2	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
3	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.00
4	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.00
5	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
6	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.00
7	688070	纵横股份	2,407	82,969.29	0.00
8	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
9	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
10	301018	C申菱	7,811	64,753.19	0.00
11	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
12	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
13	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
14	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
15	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
16	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
17	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
18	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
19	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
20	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00

21	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
22	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
23	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
24	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
25	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
26	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
27	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
28	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
29	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
30	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
31	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
32	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
33	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
34	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
35	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
36	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
37	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
38	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
39	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
40	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
41	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
42	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
43	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
44	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
45	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
46	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
47	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
48	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
49	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
50	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
51	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
52	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
53	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
54	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
55	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
56	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
57	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
58	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
59	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
60	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
61	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
62	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
63	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00

64	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
65	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
66	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
67	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
68	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
69	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
70	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
71	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
72	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
73	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
74	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	300760	迈瑞医疗	611,095,277.57	47.66
2	300015	爱尔眼科	523,854,175.12	40.86
3	300347	泰格医药	360,062,537.72	28.08
4	300759	康龙化成	234,034,550.61	18.25
5	300677	英科医疗	208,972,157.22	16.30
6	300003	乐普医疗	202,589,887.03	15.80
7	300595	欧普康视	195,045,315.17	15.21
8	300529	健帆生物	190,302,398.38	14.84
9	300896	爱美客	187,511,384.91	14.62
10	002044	美年健康	181,518,769.24	14.16
11	300676	华大基因	159,881,336.84	12.47
12	300253	卫宁健康	139,709,920.98	10.90
13	000516	国际医学	127,988,822.81	9.98
14	002030	达安基因	115,303,403.86	8.99
15	300482	万孚生物	114,707,408.76	8.95
16	002223	鱼跃医疗	104,906,724.76	8.18
17	300463	迈克生物	93,343,767.81	7.28
18	300244	迪安诊断	84,656,766.54	6.60
19	600763	通策医疗	79,854,009.45	6.23
20	002382	蓝帆医疗	76,097,699.50	5.94
21	688363	华熙生物	70,456,856.88	5.50
22	688202	美迪西	65,693,615.12	5.12
23	300685	艾德生物	61,892,883.53	4.83
24	300298	三诺生物	51,748,663.72	4.04
25	300326	凯利泰	50,884,835.97	3.97
26	603259	药明康德	48,256,678.68	3.76

27	300451	创业慧康	47,936,295.47	3.74
28	300143	盈康生命	46,966,763.71	3.66
29	002901	大博医疗	43,337,027.25	3.38
30	603392	万泰生物	41,525,148.40	3.24
31	300832	新产业	39,061,303.16	3.05
32	300653	正海生物	37,845,507.57	2.95
33	688139	海尔生物	37,493,895.78	2.92
34	002022	科华生物	35,670,978.50	2.78
35	688016	心脉医疗	32,003,730.78	2.50
36	688029	南微医学	31,971,856.60	2.49
37	300406	九强生物	29,960,109.13	2.34
38	000710	贝瑞基因	29,955,702.73	2.34
39	300149	睿智医药	29,191,291.52	2.28
40	688298	东方生物	29,037,000.20	2.26
41	000503	国新健康	28,073,256.80	2.19
42	002950	奥美医疗	26,834,704.91	2.09
43	300639	凯普生物	26,242,177.21	2.05

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	300760	迈瑞医疗	259,211,084.86	20.22
2	300347	泰格医药	194,505,641.52	15.17
3	300015	爱尔眼科	166,076,678.68	12.95
4	603259	药明康德	161,217,392.64	12.57
5	300677	英科医疗	99,737,173.96	7.78
6	300759	康龙化成	85,740,078.11	6.69
7	300003	乐普医疗	85,432,625.59	6.66
8	600763	通策医疗	79,255,412.00	6.18
9	002044	美年健康	78,886,411.21	6.15
10	300676	华大基因	78,548,419.59	6.13
11	300529	健帆生物	75,943,817.70	5.92
12	603392	万泰生物	62,347,563.00	4.86
13	300253	卫宁健康	61,997,639.17	4.84
14	300482	万孚生物	58,291,699.95	4.55
15	002030	达安基因	51,869,983.72	4.05
16	300595	欧普康视	49,796,511.05	3.88
17	002022	科华生物	43,340,104.50	3.38
18	300653	正海生物	42,893,270.52	3.35
19	300463	迈克生物	38,211,857.05	2.98
20	002223	鱼跃医疗	37,728,725.40	2.94

21	300149	睿智医药	37,421,287.31	2.92
22	002901	大博医疗	34,261,518.03	2.67
23	300244	迪安诊断	34,099,973.81	2.66
24	000503	国新健康	33,935,379.13	2.65
25	300639	凯普生物	33,855,040.48	2.64
26	002382	蓝帆医疗	32,286,677.39	2.52

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	5,138,993,656.98
卖出股票收入（成交）总额	2,391,401,020.25

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	2,811,735.80
2	应收证券清算款	21,165,957.62
3	应收股利	158,361.25
4	应收利息	282,191.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,418,246.63

#### 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

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	300015	爱尔眼科	89,004,235.32	1.56	转融通流通受限
2	603259	药明康德	3,131,800.00	0.05	转融通流通受限
3	300760	迈瑞医疗	15,841,650.00	0.28	转融通流通受限
4	300347	泰格医药	1,546,400.00	0.03	转融通流通受限
5	600763	通策医疗	12,330,000.00	0.22	转融通流通受限

6	300759	康龙化成	6,054,021.00	0.11	转融通流通受限
7	300595	欧普康视	7,269,210.00	0.13	转融通流通受限
8	300896	爱美客	11,912,088.00	0.21	转融通流通受限
9	300003	乐普医疗	5,704,512.00	0.10	转融通流通受限

#### 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	688626	翔宇医疗	380,392.32	0.01	新股锁定
2	300957	贝泰妮	214,921.88	0.00	新股锁定
3	688677	海泰新光	182,510.64	0.00	新股锁定
4	688687	凯因科技	149,804.92	0.00	新股锁定
5	300919	中伟股份	99,430.00	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

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 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 (%)
95,605	63,519.90	3,688,577,514.00	60.74	2,384,242,960.00	39.26

### 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	中融国际信托有限公司—中融一日进斗金53号集合资金信托计划	37,167,000.00	0.61

2	李树平	21,213,200.00	0.35
3	泰康资产丰选 FOF4 号股票型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	20,918,300.00	0.34
4	赵翊茗	18,820,700.00	0.31
5	光大证券资管—光大银行—光证资管阳光红精选集合资产管理计划	17,000,000.00	0.28
6	尹毅	17,000,000.00	0.28
7	何绍成	15,183,000.00	0.25
8	刘芳	12,849,600.00	0.21
9	正大置地有限公司	12,595,200.00	0.21
10	平安银行股份有限公司—兴业养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)	11,960,400.00	0.20
11	中国银行股份有限公司—华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,361,221,800.00	55.35

### 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	0.00	0.0000

### 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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2019 年 5 月 20 日) 基金份额总额	249,440,158.00
本报告期期初基金份额总额	543,940,158.00
本报告期基金总申购份额	5,761,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,728,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额 (份额)	1,495,880,316.00

减少以“-”填列)	
本报告期末基金份额总额	6,072,820,474.00

## § 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

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

### 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：2019 年 11 月 20 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，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	
国联证券	3	1,134,026,677.04	15.08%	1,033,438.98	15.04%	-
招商证券	1	1,046,180,441.29	13.91%	953,385.51	13.88%	-
兴业证券	2	1,005,376,513.27	13.37%	916,915.10	13.34%	-
东方财富	2	949,668,154.44	12.63%	865,614.07	12.60%	-
浙商证券	2	506,320,279.90	6.73%	467,630.67	6.81%	-
天风证券	4	501,422,833.99	6.67%	456,946.23	6.65%	-
光大证券	2	415,259,046.07	5.52%	378,426.38	5.51%	-
中银国际	2	342,846,129.47	4.56%	312,435.72	4.55%	-
国泰君安	1	325,235,224.60	4.32%	302,890.39	4.41%	-
东方证券	1	264,704,457.61	3.52%	241,226.36	3.51%	-
华创证券	2	202,957,317.98	2.70%	184,955.06	2.69%	-
财通证券	2	185,110,485.30	2.46%	169,818.68	2.47%	-
方正证券	1	149,250,486.62	1.98%	136,011.16	1.98%	-
宏信证券	2	129,311,611.20	1.72%	117,884.56	1.72%	-
海通证券	2	116,240,145.18	1.55%	108,073.51	1.57%	-
开源证券	2	95,664,317.37	1.27%	87,563.90	1.27%	-
中金公司	2	66,601,693.12	0.89%	60,694.44	0.88%	-
广发证券	2	49,901,163.65	0.66%	45,475.11	0.66%	-
国元证券	2	18,647,374.60	0.25%	16,993.57	0.25%	-
长江证券	1	5,619,524.16	0.07%	5,233.39	0.08%	-
国信证券	1	3,919,252.02	0.05%	3,650.02	0.05%	-
中泰证券	1	2,762,219.12	0.04%	2,572.48	0.04%	-
中信建投	1	1,814,235.43	0.02%	1,689.58	0.02%	-
申万宏源	3	1,210,313.08	0.02%	1,127.25	0.02%	-
国海证券	2	206,185.15	0.00%	187.89	0.00%	-
华宝证券	1	155,947.65	0.00%	142.11	0.00%	-

华金证券	1	52,062.00	0.00%	48.47	0.00%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：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、本报告期新增券商交易单元如下：

光大证券、财通证券、开源证券、民生证券、东方财富、信达证券

## 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
国联证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

东方财富	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2021-1-22
2	关于华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分及相关业务安排的公告	基金管理人网站, 上海证券报	2021-2-8
3	关于华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分及相关业务安排的第一次提示性公告	基金管理人网站, 上海证券报	2021-2-18
4	关于华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分及相关业务安排的第二次提示性公告	基金管理人网站, 上海证券报	2021-2-23
5	关于华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果及恢复交易和申购、赎回的公告	基金管理人网站, 上海证券报	2021-2-25
6	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增第一创业为一级交易商的公告	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	2021-3-16
7	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站	2021-3-31
8	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2021-3-31
9	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)	基金管理人网站	2021-3-31
10	华宝中证医疗交易型开放式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	2021-3-31
11	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	2021-3-31
12	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增安信证券为一级交易商的公告	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	2021-4-13
13	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2021-4-22
14	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增湘财证券为一级交易商的公告	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	2021-4-28
15	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增华鑫证券	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券	2021-6-1

	为一级交易商的公告	时报, 中国证券报	
16	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要	基金管理人网站	2021-6-5
17	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)	基金管理人网站	2021-6-5

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
中国银行股份有限公司—华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20210514~20210630	0.00	6,647,821,800.00	3,286,600,000.00	3,361,221,800.00	55.35
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下, 如该投资者集中赎回, 可能会增加基金的流动性风险。此外, 由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产, 可能对持有资产的价格形成冲击, 增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产, 加强防范流动性风险、市场风险, 保护持有人利益。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

## § 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基金合同；  
华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；  
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