

博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券  
投资基金（QDII）  
2023 年中期报告  
2023 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

## § 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。本中期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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 .....	5
2.5 信息披露方式 .....	5
2.6 其他相关资料 .....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
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 .....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
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 .....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	11
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 .....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	33
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	34
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	34
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	44
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	46
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	46
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 .....	47

7.11 投资组合报告附注 .....	47
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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的情况.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金简称	博时恒生医疗保健(QDII-ETF)
场内简称	恒生医疗 ETF
基金主代码	513060
交易代码	513060
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 18 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	20,227,893,320.00 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	2021 年 3 月 29 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>1、组合复制策略，本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。2、债券和货币市场工具投资策略；3、金融衍生品投资策略；4、融资及转融通证券出借；5、资产支持证券的投资策略；6、非成份股的股票投资策略；7、存托凭证投资策略。</p> <p>未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明更新中公告。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即恒生医疗保健指数收益率（经汇率调整后）。
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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪恒生医疗保健指数，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。此外，本基金可投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。

### 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		博时基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	秦一楠
	联系电话	0755-83169999	010-66060069
	电子邮箱	service@bosera.com	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	95105568	95599
传真	0755-83195140	010-68121816
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	江向阳	谷澍

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Bank of New York Mellon
	中文	-	纽约梅隆银行
注册地址		-	-
办公地址		-	-
邮政编码		-	-

注：本基金未聘请境外投资顾问。

## 2.5 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	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.6 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（2023年1月1日至2023年6月30日）
本期已实现收益	75,520,594.97
本期利润	-1,789,647,240.17
加权平均基金份额本期利润	-0.1219
本期加权平均净值利润率	-21.83%
本期基金份额净值增长率	-19.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023年6月30日）

期末可供分配利润	-10,416,470,610.35
期末可供分配基金份额利润	-0.5150
期末基金资产净值	9,811,422,709.65
期末基金份额净值	0.4850
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	-51.50%

注：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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

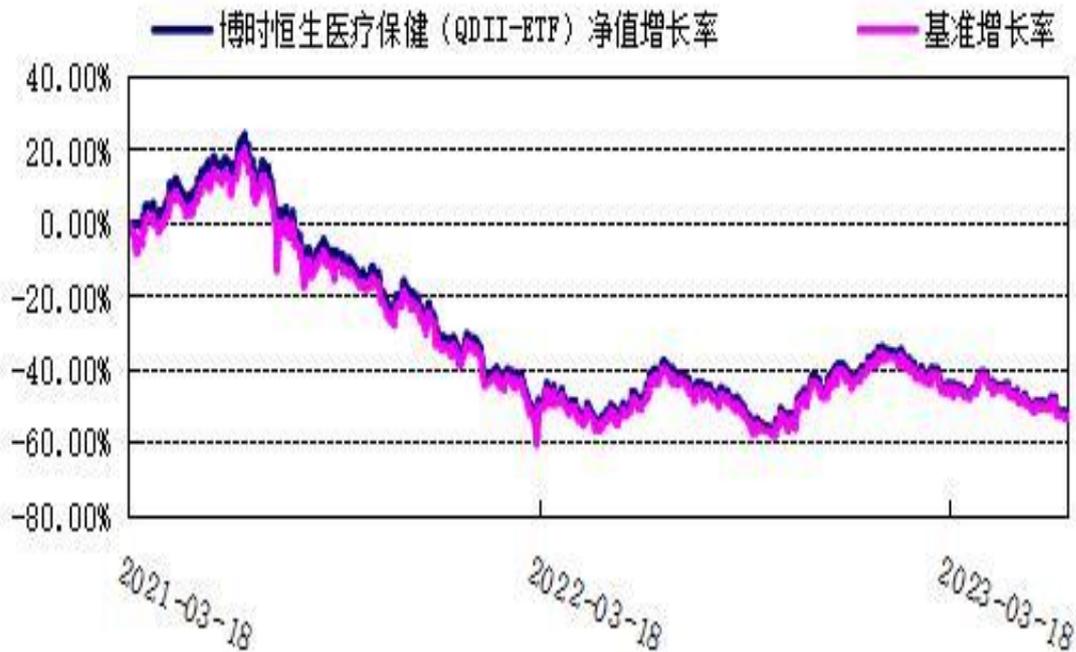
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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	-2.36%	1.67%	-2.71%	1.69%	0.35%	-0.02%
过去三个月	-9.78%	1.72%	-10.07%	1.73%	0.29%	-0.01%
过去六个月	-19.76%	1.84%	-19.29%	1.85%	-0.47%	-0.01%
过去一年	-17.46%	2.25%	-16.40%	2.27%	-1.06%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-51.50%	2.54%	-52.52%	2.57%	1.02%	-0.03%

### 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



## § 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

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2023 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 14767 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5220 亿元人民币，累计分红逾 1851 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
万	指数	2021-03-18	-	16.3	万琮女士，硕士。2004 年起先后在中企动力科技股份有

琼	与量化投资部投资总监助理/基金经理				<p>限公司、华夏基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017 年 9 月 29 日-2019 年 9 月 5 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 30 日-2022 年 5 月 27 日)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 1 月 19 日-2023 年 3 月 8 日)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 20 日-2023 年 3 月 8 日)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 3 日-2023 年 3 月 8 日)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 日-2023 年 3 月 8 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监助理兼博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 10 月 8 日一至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日一至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 8 月 1 日一至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2019 年 12 月 30 日一至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 3 月 18 日一至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 5 月 11 日一至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 5 月 17 日一至今)、博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 6 月 8 日一至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021 年 12 月 21 日一至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021 年 12 月 28 日一至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2022 年 1 月 10 日一至今)、博时中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 3 月 3 日一至今)、博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)(2022 年 7 月 26 日一至今)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2023 年 4 月 19 日一至今)的基金经理。</p>
王萌	基金经理	2023-03-06	-	6.9	<p>王萌先生，博士。2016 年毕业后加入博时基金管理有限公司。现任基金经理助理。</p>

助理				
----	--	--	--	--

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

## 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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易共 89 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 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

2023 年上半年，美国通胀持续下行，经济指标改善，在龙头科技公司的带领下美股大幅反弹。从经济基本面上来看，一季度 GDP 环比折合年率 2.0%，超出市场预期。一季度的银行风波对信贷投放造成负面影响，对经济形成冲击，同时也使得美联储转宽预期。2 月，3 月美联储分别加息 25bps。二季度 GDP 环比折合年率初值 2.4%，优于预期，其中消费与固定资产投资为主要拉动。5 月美联储加息 25bps，6 月暂停加息。从最新的经济数据来看，通胀和经济数据均有所好转，美国经济实现软着陆的概率有所提升。6 月 CPI 和核心 CPI 均低于市场预期。从货币政策上来看，美联储 7 月如期加息 25bps 至 5.25%-5.50% 区间。从市场情绪上来看，7 月会议的加息已经被市场充分计入，美股与主要资产对会议的反应也较为平淡。海外市场在上半年表现出色，日经指数创 1991 年以来的新高，纳斯达克和标普 500 指数也有不错表现。

国内经济仍在修复，但供给回升快于需求，需求驱动不足。在国内经济复苏放缓的背景下 A 股市场整体处于低位盘整状态。小盘和价值风格表现强劲，国证 2000 指数、中证 1000 指数以及红利指数在上半年

均录得正收益。相比较而言，大盘成长风格持续走弱。板块之间的结构分化加剧，受估值驱动因素影响的“中特估”相关板块走势强劲。得益于人工智能科技的突破进展以及相关应用场景的落地，科技板块表现亮眼，受到市场关注。消费和新能源板块持续走弱。根据中信一级行业指数显示，2023 年上半年涨幅靠前的行业是通信、传媒、计算机、家电和机械等，涨幅靠后的行业有消费者服务、房地产、农林牧渔、建材和基础化工等。受人民币贬值以及国内经济增速不及预期的影响，港股市场在年初冲高后回落，恒生指数在上半年录得负收益。电讯和能源板块涨幅领先，医疗保健、地产建筑和必须性消费板块跌幅较大。本基金为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，取得标的指数所代表的市场平均回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 0.4850 元，份额累计净值为 0.4850 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-19.76%，同期业绩基准增长率为-19.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，美国经济仍具有较强韧性。经济方面，就业岗位增幅强劲，失业率保持在较低的水平，实际薪资增速回升，对居民消费能力起到强劲支撑作用。通货膨胀率依然值得关注，由于去年高基数效应，6 月美国的 CPI 可能会是第三季度的一个阶段性低点。货币政策方面，目前已经接近加息周期尾声，9 月加息概率下降但还需继续观察核心通胀情况，年内降息概率不大。流动性方面，美联储借款逐步到期、继续缩表，以及新发国债都会使得金融流动性重新收缩。下半年盈利韧性交易可能仍是主逻辑，而软着陆的前景将缓解分子端的压力，对美股偏利好。

国内方面，受疫情政策放开影响，消费环境发生了改变，接触性消费快速增长，叠加政策推动，消费潜力进一步释放。在稳经济、促恢复、扩内需等政策支撑下，市场预期好转，内需稳定恢复，加之降息等政策出台，支撑信贷规模扩张。随着宏观稳经济政策协同发力，整体经济继续稳步恢复，有效需求不足的问题有望得到缓解，经济内生修复动能有望加强，恢复和扩大需求是未来经济持续回升向好的关键所在。港股方面，随着美国等主要经济体进入加息尾声，全球流动性的边际向好对港股估值起到支撑作用。受益于一系列内地经济政策出台，港股基本面有望持续改善。AH 股溢价指数当前处于过去 10 年的较高位置，意味着两地上市的股票 H 股价格显著低于 A 股。港股通资金占用比例显著增大，香港市场已成为内地资金的重要资产配置市场。截止 2023 年 6 月 30 日，恒生指数的市盈率(TTM)为 8.99，处在 2003 年以来的 10% 分位。综合考虑，在长期维度港股具有较强的配置价值。

在投资策略上，本基金作为一只被动策略的指数基金，会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪标的指数。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—博时基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为，博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人认为，博时基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

# § 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：博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	247,249,753.95	205,058,205.43
结算备付金		67,419,907.52	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	9,704,016,887.65	6,927,277,866.91
其中：股票投资		9,704,016,887.65	6,927,277,866.91
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-

其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		-	159,720,680.40
应收股利		27,680,771.79	161,678.79
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	75,616.24	-
资产总计		10,046,442,937.15	7,292,218,431.53
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		228,816,043.95	331,561,238.19
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,868,379.21	3,132,232.89
应付托管费		1,160,513.79	939,669.85
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	1,175,290.55	5,200,810.52
负债合计		235,020,227.50	340,833,951.45
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.3.8	20,227,893,320.00	11,500,393,320.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	-10,416,470,610.35	-4,549,008,839.92
净资产合计		9,811,422,709.65	6,951,384,480.08
<b>负债和净资产总计</b>		<b>10,046,442,937.15</b>	<b>7,292,218,431.53</b>

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.4850 元，基金份额总额 20,227,893,320.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2023年1月1日至2023 年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30 日
<b>一、营业总收入</b>		-1,762,490,070.69	374,205,981.22
1. 利息收入		772,974.90	803,086.83
其中：存款利息收入	6.4.3.10	772,974.90	803,086.83
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）		77,360,501.87	9,349,858.34
其中：股票投资收益	6.4.3.11	26,541,418.40	-17,172,943.15
基金投资收益	6.4.3.12	-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	50,819,083.47	26,522,801.49
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-1,865,167,835.14	348,341,197.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-10,762,604.19	-1,976,989.67
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	35,306,891.87	17,688,828.39
<b>减：二、营业总支出</b>		27,157,169.48	7,513,036.58
1. 管理人报酬		20,330,864.07	5,588,369.28
2. 托管费		6,099,259.20	1,676,510.85
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.3.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.3.20	727,046.21	248,156.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,789,647,240.17	366,692,944.64
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,789,647,240.17	366,692,944.64

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,789,647,240.17	366,692,944.64

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	11,500,393,320.00	-	-4,549,008,839.92	6,951,384,480.08
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	11,500,393,320.00	-	-4,549,008,839.92	6,951,384,480.08
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填 列）	8,727,500,000.00	-	-5,867,461,770.43	2,860,038,229.57
（一）、综合收益总 额	-	-	-1,789,647,240.17	-1,789,647,240.17
（二）、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）	8,727,500,000.00	-	-4,077,814,530.26	4,649,685,469.74
其中：1. 基金申购款	10,790,000,000.00	-	-4,865,397,758.45	5,924,602,241.55
2. 基金赎回款	-2,062,500,000.00	-	787,583,228.19	-1,274,916,771.81
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 （基金净值）	20,227,893,320.00	-	-10,416,470,610.35	9,811,422,709.65
项目	上年度可比期间			

	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,257,893,320.00	-	-389,880,189.24	868,013,130.76
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,257,893,320.00	-	-389,880,189.24	868,013,130.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8,977,500,000.00	-	-3,831,202,080.33	5,146,297,919.67
（一）、综合收益总额	-	-	366,692,944.64	366,692,944.64
（二）、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）	8,977,500,000.00	-	-4,197,895,024.97	4,779,604,975.03
其中：1. 基金申购款	9,810,000,000.00	-	-4,599,989,241.41	5,210,010,758.59
2. 基金赎回款	-832,500,000.00	-	402,094,216.44	-430,405,783.56
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	10,235,393,320.00	-	-4,221,082,269.57	6,014,311,050.43

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：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：徐卫，会计机构负责人：佘方方

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

#### 6.4.2 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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) 对基金从境内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。

目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的境内企业债券利息收入，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。对基金从境内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。对基金持有的境内上市公司限售股，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。

目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算

有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利,由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出境内股票按 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。

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	247,249,753.95
等于: 本金	247,239,601.20
加: 应计利息	10,152.75
减: 坏账准备	-
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
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	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
合计	247,249,753.95

注:于 2023 年 06 月 30 日,银行存款中包含的外币余额为:港币 111,304,121.83(折合人民币 102,620,174.24)

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2023年6月30日

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		10,822,860,519.19	-	9,704,016,887.65	-1,118,843,631.54
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		10,822,860,519.19	-	9,704,016,887.65	-1,118,843,631.54

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

##### 6.4.3.4 买入返售金融资产

###### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

###### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

##### 6.4.3.5 其他权益工具投资

###### 6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

###### 6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

##### 6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	-
应付交易费用	1,030,961.73
其中：交易所市场	1,030,961.73
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	144,328.82
合计	1,175,290.55

#### 6.4.3.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,500,393,320.00	11,500,393,320.00
本期申购	10,790,000,000.00	10,790,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,062,500,000.00	-2,062,500,000.00
本期末	20,227,893,320.00	20,227,893,320.00

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

#### 6.4.3.9 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	126,605,583.37	-4,675,614,423.29	-4,549,008,839.92
本期利润	75,520,594.97	-1,865,167,835.14	-1,789,647,240.17
本期基金份额交易产生的变动数	191,321,999.65	-4,269,136,529.91	-4,077,814,530.26
其中：基金申购款	227,577,410.71	-5,092,975,169.16	-4,865,397,758.45
基金赎回款	-36,255,411.06	823,838,639.25	787,583,228.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	393,448,177.99	-10,809,918,788.34	-10,416,470,610.35

#### 6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	285,192.00
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	487,318.68

其他	464.22
合计	772,974.90

#### 6.4.3.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	1,776,649,310.24
减：卖出股票成本总额	1,735,528,743.55
减：交易费用	14,579,148.29
买卖股票差价收入	26,541,418.40

#### 6.4.3.12 基金投资收益

无发生额。

#### 6.4.3.13 债券投资收益

无发生额。

#### 6.4.3.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.3.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

##### 6.4.3.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

#### 6.4.3.15 衍生工具收益

##### 6.4.3.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

##### 6.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

#### 6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	50,819,083.47
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	50,819,083.47

#### 6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日

1. 交易性金融资产	-1,865,167,835.14
——股票投资	-1,865,167,835.14
——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	-1,865,167,835.14

#### 6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	35,306,891.87
合计	35,306,891.87

#### 6.4.3.19 信用减值损失

无发生额。

#### 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
IOPV 计算与发布费	9,916.99
银行汇划费用	336,568.07
中登结算服务费	74,383.76
其他费用	206,998.44
合计	727,046.21

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

#### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 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。

##### 6.4.5.2 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
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人
纽约梅隆银行（“纽约梅隆”）	境外资产托管人
博时恒生医疗保健 ETF 发起式联接基金（QDII）（“恒生医疗保健 ETF 发起式联接基金”）	基金管理人管理的其他基金
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司	基金管理人的子公司

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。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.6.2 关联方报酬

###### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	20,330,864.07	5,588,369.28
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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 × 0.50% / 当年天数。

**6.4.6.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,099,259.20	1,676,510.85

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

**6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.6.4 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**
**6.4.6.4.1 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**

无。

**6.4.6.4.2 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**

无。

**6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况**
**6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**6.4.6.5.2 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 2023年6月30日		上年度末 2022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
招商证券	10,498,151.00	0.05%	3,243,813.00	0.03%
中国农业银行股份有限公司—博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	2,265,623,500.00	11.20%	1,057,309,100.00	9.19%

注：1. 除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

**6.4.6.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
中国农业银行	52,503,566.04	285,192.00	216,754,082.19	277,338.39
纽约梅隆银行	194,746,187.91	-	4,892,568.95	-

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

#### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

##### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪恒生医疗保健指数，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。此外，本基金可投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去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同类风险损失的频度。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特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，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。

#### 6.4.9.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内交易所进行的交易主要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，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在场外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。

##### 6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.9.3 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，由于组合资产流动性差，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。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用组合证券形式，流动性风险相对较低。

#### 6.4.9.3.1 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。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，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%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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。

#### 6.4.9.4 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。

##### 6.4.9.4.1 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。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	52,503,566.04	-	-	194,746,187.91	247,249,753.95
结算备付金	67,419,907.52	-	-	-	67,419,907.52
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	9,704,016,887.65	9,704,016,887.65
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	27,680,771.79	27,680,771.79
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
<b>资产总计</b>	<b>119,923,473.56</b>	-	-	<b>9,926,519,463.59</b>	<b>10,046,442,937.15</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	228,816,043.95	228,816,043.95
应付管理人报酬	-	-	-	3,868,379.21	3,868,379.21
应付托管费	-	-	-	1,160,513.79	1,160,513.79
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,175,290.55	1,175,290.55
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>235,020,227.50</b>	<b>235,020,227.50</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>119,923,473.56</b>	-	-	<b>9,691,499,236.09</b>	<b>9,811,422,709.65</b>

上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	202,622,365.71	-	-	2,435,839.72	205,058,205.43
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	6,927,277,866.91	6,927,277,866.91
应收证券清算款	-	-	-	159,720,680.40	159,720,680.40
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	161,678.79	161,678.79
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>202,622,365.71</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>7,089,596,065.82</b>	<b>7,292,218,431.53</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	331,561,238.19	331,561,238.19
应付管理人报酬	-	-	-	3,132,232.89	3,132,232.89
应付托管费	-	-	-	939,669.85	939,669.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,200,810.52	5,200,810.52
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>340,833,951.45</b>	<b>340,833,951.45</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>202,622,365.71</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>6,748,762,114.37</b>	<b>6,951,384,480.08</b>

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。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（不包括可转债和可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期：同）。

#### 6.4.9.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

##### 6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计

以外币计价的资产			
银行存款	-	102,620,174.24	102,620,174.24
结算备付金	-	-	-
存出保证金	-	-	-
交易性金融资产	-	9,704,016,887.65	9,704,016,887.65
应收股利	-	12,794,376.87	12,794,376.87
应收证券清算款	-	-	-
应收申购款	-	-	-
应收利息	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产合计	-	9,819,431,438.76	9,819,431,438.76
以外币计价的负债			
应付赎回款	-	-	-
应付证券清算款	-	190,798,564.21	190,798,564.21
应付利息	-	-	-
其他负债	-	-	-
负债合计	-	190,798,564.21	190,798,564.21
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	9,628,632,874.55	9,628,632,874.55
项目	上年度末 2022年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
银行存款	-	645,862.21	645,862.21
结算备付金	-	-	-
存出保证金	-	-	-
交易性金融资产	-	6,927,277,866.91	6,927,277,866.91
应收股利	-	21,915.49	21,915.49
应收证券清算款	-	159,720,680.40	159,720,680.40
应收申购款	-	-	-
应收利息	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产合计	-	7,087,666,325.01	7,087,666,325.01

以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	7,087,666,325.01	7,087,666,325.01

#### 6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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：人民币万元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	所有外币均相对人民币升值 5%	增加约 48,143	增加约 35,438
	所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 48,143	减少约 35,438

#### 6.4.9.4.3 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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	9,704,016,887.65	98.91	6,927,277,866.91	99.65
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	9,704,016,887.65	98.91	6,927,277,866.91	99.65

##### 6.4.9.4.3.2 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
----	----------------------

分析	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：人民币万元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 47,080	增加约 35,761
	业绩比较基准下降 5%	减少约 47,080	减少约 35,761

注：无。

#### 6.4.10 公允价值

##### 6.4.10.1 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。

##### 6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	9,704,016,887.65
第二层次	-
第三层次	-
合计	9,704,016,887.65

###### 6.4.10.2.2 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证券，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证券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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

### 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	9,704,016,887.65	96.59
	其中：普通股	9,704,016,887.65	96.59
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	314,669,661.47	3.13

8	其他各项资产	27,756,388.03	0.28
9	合计	10,046,442,937.15	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	5,355,876,420.74	54.59
中国大陆	4,348,140,466.91	44.32
合计	9,704,016,887.65	98.91

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	22,095,241.48	0.23
日常消费品	1,059,977,510.02	10.80
医疗保健	8,621,944,136.15	87.88
合计	9,704,016,887.65	98.91

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	中国香港证券交易所	中国香港	17,884,000.00	619,150,321.52	6.31
1	药明生物	药明生物	02269 HS	深港通	中国大陆	9,045,000.00	313,141,056.71	3.19
2	BEIGENE LTD	BEIGENE LTD	6160 HK	中国香港证券交易所	中国香港	5,848,300.00	579,102,479.09	5.90
2	百济神州	百济神州	06160 HS	深港通	中国大陆	2,098,800.00	207,824,544.42	2.12
3	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	中国香港证券交易所	中国香港	56,786,000.00	356,541,338.27	3.63
3	石药集团	石药集团	01093	深港通	中国大	51,724,000.00	324,758,640.87	3.31

			HS		陆			
4	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6618 HK	中国香港证券交易所	中国香港	7,070,500.00	322,357,606.73	3.29
4	京东健康	京东健康	06618 HS	深港通	中国大陆	6,423,150.00	292,843,683.14	2.98
5	INNOVENT BIOLOGICS INC	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	中国香港证券交易所	中国香港	8,330,000.00	227,330,764.64	2.32
5	信达生物	信达生物	01801 HS	深港通	中国大陆	7,484,000.00	204,242,910.27	2.08
6	SINO BIOPHARMACEUTICAL	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	中国香港证券交易所	中国香港	71,564,000.00	224,993,766.62	2.29
6	中国生物制药	中国生物制药	01177 HS	深港通	中国大陆	65,261,000.00	205,177,438.42	2.09
7	国药控股	国药控股	01099 HS	深港通	中国大陆	8,318,800.00	187,909,296.99	1.92
7	SINOPHARM GROUP CO-H	SINOPHARM GROUP CO-H	1099 HK	中国香港证券交易所	中国香港	7,949,600.00	179,569,619.10	1.83
8	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	中国香港证券交易所	中国香港	32,940,000.00	143,042,799.85	1.46
8	阿里健康	阿里健康	00241 HS	深港通	中国大陆	32,634,000.00	141,713,986.96	1.44
9	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1066 HK	中国香港证券交易所	中国香港	15,770,000.00	148,885,755.90	1.52
9	威高股份	威高股份	01066 HS	深港通	中国大陆	14,386,400.00	135,823,084.26	1.38
10	GENSCRIPT BIOTECH CORP	GENSCRIPT BIOTECH CORP	1548 HK	中国香港证券交易所	中国香港	9,118,000.00	147,956,400.06	1.51
10	金斯瑞生物科技	金斯瑞生物科技	01548 HS	深港通	中国大陆	7,560,000.00	122,674,970.88	1.25
11	WUXI APPTec CO LTD-H	WUXI APPTec CO LTD-H	2359 HK	中国香港证券交易所	中国香港	2,205,840.00	127,108,772.70	1.30
11	药明康德	药明康德	02359 HS	深港通	中国大陆	2,185,600.00	125,942,468.00	1.28
12	AKESO INC	AKESO INC	9926 HK	中国香港证券交易所	中国香港	3,376,000.00	110,030,568.37	1.12

12	康方生物	康方生物	09926 HS	深港通	中国大陆	3,252,000.00	105,989,161.24	1.08
13	康哲药业	康哲药业	00867 HS	深港通	中国大陆	8,356,000.00	98,303,867.87	1.00
13	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	867 HK	中国香港证券交易所	中国香港	7,995,000.00	94,056,896.08	0.96
14	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	6078 HK	中国香港证券交易所	中国香港	2,493,600.00	97,479,691.51	0.99
14	海吉亚医疗	海吉亚医疗	06078 HS	深港通	中国大陆	2,100,400.00	82,108,735.98	0.84
15	翰森制药	翰森制药	03692 HS	深港通	中国大陆	7,346,000.00	85,338,100.01	0.87
15	HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	3692 HK	中国香港证券交易所	中国香港	7,014,000.00	81,481,273.27	0.83
16	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	中国香港证券交易所	中国香港	6,471,600.00	84,488,270.47	0.86
16	微创医疗	微创医疗	00853 HS	深港通	中国大陆	5,726,000.00	74,754,285.92	0.76
17	三生制药	三生制药	01530 HS	深港通	中国大陆	10,733,500.00	77,882,089.24	0.79
17	3SBIO INC	3SBIO INC	1530 HK	中国香港证券交易所	中国香港	9,965,000.00	72,305,866.61	0.74
18	中国中药	中国中药	00570 HS	深港通	中国大陆	22,684,000.00	76,336,809.27	0.78
18	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	570 HK	中国香港证券交易所	中国香港	20,054,000.00	67,486,262.26	0.69
19	华润医药	华润医药	03320 HS	深港通	中国大陆	11,684,000.00	73,467,865.66	0.75
19	CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	3320 HK	中国香港证券交易所	中国香港	11,167,500.00	70,220,163.45	0.72
20	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1833 HK	中国香港证券交易所	中国香港	4,022,600.00	70,243,852.81	0.72
20	平安好医生	平安好医生	01833 HS	深港通	中国大陆	3,437,900.00	60,033,645.30	0.61
21	上海医药	上海医药	02607 HS	深港通	中国大陆	4,734,600.00	67,748,005.00	0.69

21	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2607 HK	中国香港证券交易所	中国香港	4,179,900.00	59,810,730.82	0.61
22	先健科技	先健科技	01302 HS	深港通	中国大陆	24,394,000.00	60,050,382.92	0.61
22	LIFETECH SCIENTIFIC CORP	LIFETECH SCIENTIFIC CORP	1302 HK	中国香港证券交易所	中国香港	23,322,000.00	57,411,454.89	0.59
23	复星医药	复星医药	02196 HS	深港通	中国大陆	3,079,500.00	59,340,061.87	0.60
23	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	2196 HK	中国香港证券交易所	中国香港	2,943,000.00	56,709,791.23	0.58
24	和黄医药	和黄医药	00013 HS	深港通	中国大陆	3,483,000.00	59,215,566.91	0.60
24	HUTCHMED CHINA LTD	HUTCHMED CHINA LTD	13 HK	中国香港证券交易所	中国香港	3,332,000.00	56,648,368.92	0.58
25	NEW HORIZON HEALTH LTD	NEW HORIZON HEALTH LTD	6606 HK	中国香港证券交易所	中国香港	2,179,500.00	54,958,605.46	0.56
25	诺辉健康	诺辉健康	06606 HS	深港通	中国大陆	1,981,000.00	49,953,199.09	0.51
26	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	1951 HK	中国香港证券交易所	中国香港	13,762,000.00	52,529,515.47	0.54
26	锦欣生殖	锦欣生殖	01951 HS	深港通	中国大陆	12,627,500.00	48,199,132.14	0.49
27	LUYE PHARMA GROUP LTD	LUYE PHARMA GROUP LTD	2186 HK	中国香港证券交易所	中国香港	17,612,000.00	53,747,487.93	0.55
27	绿叶制药	绿叶制药	02186 HS	深港通	中国大陆	14,314,000.00	43,682,803.89	0.45
28	SHANGHAI MICROPORT MEDBOT GR	SHANGHAI MICROPORT MEDBOT GR	2252 HK	中国香港证券交易所	中国香港	3,025,500.00	67,783,646.91	0.69
28	微创机器人—B	微创机器人—B	02252 HS	深港通	中国大陆	1,014,000.00	22,717,771.60	0.23
29	诺诚健华	诺诚健华	09969 HS	深港通	中国大陆	7,007,000.00	45,609,815.85	0.46
29	INNOCARE PHARMA LTD	INNOCARE PHARMA LTD	9969 HK	中国香港证券交易所	中国香港	6,630,000.00	43,155,855.44	0.44
30	固生堂	固生堂	02273 HS	深港通	中国大	971,000.00	44,493,556.23	0.45

			HS		陆			
30	GUSHENGTANG HOLDINGS LTD	GUSHENGTANG HOLDINGS LTD	2273 HK	中国香港证券交易所	中国香港	926,600.00	42,459,041.40	0.43
31	康诺亚-B	康诺亚-B	02162 HS	深港通	中国大陆	1,218,500.00	45,948,394.57	0.47
31	KEYMED BIOSCIENCES INC	KEYMED BIOSCIENCES INC	2162 HK	中国香港证券交易所	中国香港	986,000.00	37,181,056.25	0.38
32	SIMCERE PHARMACEUTICAL GROUP	SIMCERE PHARMACEUTICAL GROUP	2096 HK	中国香港证券交易所	中国香港	6,437,000.00	46,053,933.62	0.47
32	先声药业	先声药业	02096 HS	深港通	中国大陆	4,852,000.00	34,713,948.41	0.35
33	远大医药	远大医药	00512 HS	深港通	中国大陆	9,900,000.00	40,344,000.84	0.41
33	GRAND PHARMACEUTICAL GROUP L	GRAND PHARMACEUTICAL GROUP L	512 HK	中国香港证券交易所	中国香港	9,466,500.00	38,577,422.62	0.39
34	石四药集团	石四药集团	02005 HS	深港通	中国大陆	8,318,000.00	38,345,148.20	0.39
34	SSY GROUP LTD	SSY GROUP LTD	2005 HK	中国香港证券交易所	中国香港	7,900,000.00	36,418,210.00	0.37
35	联邦制药	联邦制药	03933 HS	深港通	中国大陆	6,162,000.00	37,155,314.57	0.38
35	THE UNITED LABORATORIES INTE	THE UNITED LABORATORIES INTE	3933 HK	中国香港证券交易所	中国香港	5,954,000.00	35,901,126.74	0.37
36	REMEGEN CO LTD-H	REMEGEN CO LTD-H	9995 HK	中国香港证券交易所	中国香港	1,217,000.00	38,430,200.86	0.39
36	荣昌生物	荣昌生物	09995 HS	深港通	中国大陆	737,000.00	23,272,849.66	0.24
37	泰格医药	泰格医药	03347 HS	深港通	中国大陆	763,200.00	31,418,201.82	0.32
37	HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	3347 HK	中国香港证券交易所	中国香港	729,500.00	30,030,893.91	0.31
38	ZAI LAB LTD	ZAI LAB LTD	9688 HK	中国香港证券交易所	中国香港	1,834,100.00	35,511,073.88	0.36
38	再鼎医药	再鼎医药	09688 HS	深港通	中国大陆	1,133,300.00	21,942,478.61	0.22

39	华润医疗	华润医疗	01515 HS	深港通	中国大 陆	5,287,000.00	29,295,794.64	0.30
39	CHINA RESOURCES MEDICAL HOLD	CHINA RESOURCES MEDICAL HOLD	1515 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	4,932,000.00	27,328,704.21	0.28
40	ASCENTAGE PHARMA GROUP INTER	ASCENTAGE PHARMA GROUP INTER	6855 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	1,472,900.00	28,653,469.62	0.29
40	亚盛医药-B	亚盛医药-B	06855 HS	深港通	中国大 陆	1,143,900.00	22,253,176.65	0.23
41	EVEREST MEDICINES LTD	EVEREST MEDICINES LTD	1952 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	1,273,000.00	27,933,596.85	0.28
41	云顶新耀-B	云顶新耀-B	01952 HS	深港通	中国大 陆	1,003,000.00	22,008,953.37	0.22
42	康龙化成	康龙化成	03759 HS	深港通	中国大 陆	1,275,300.00	28,454,386.47	0.29
42	PHARMARON BEIJING CO LTD-H	PHARMARON BEIJING CO LTD-H	3759 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	918,450.00	20,492,379.25	0.21
43	丽珠医药	丽珠医药	01513 HS	深港通	中国大 陆	956,500.00	23,766,500.80	0.24
43	LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-H	LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-H	1513 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	921,700.00	22,901,812.63	0.23
44	圣诺医药-B	圣诺医药-B	02257 HS	深港通	中国大 陆	483,000.00	24,648,259.42	0.25
44	SIRNAOMICS LTD	SIRNAOMICS LTD	2257 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	375,900.00	19,182,775.81	0.20
45	YIDU TECH INC	YIDU TECH INC	2158 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	4,123,100.00	21,858,140.49	0.22
45	医渡科技	医渡科技	02158 HS	深港通	中国大 陆	3,939,100.00	20,882,685.65	0.21
46	爱康医疗	爱康医疗	01789 HS	深港通	中国大 陆	3,454,000.00	21,654,728.66	0.22
46	AK MEDICAL HOLDINGS LTD	AK MEDICAL HOLDINGS LTD	1789 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	3,310,000.00	20,751,925.84	0.21
47	ALPHAMAB ONCOLOGY	ALPHAMAB ONCOLOGY	9966 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	3,317,000.00	22,875,393.30	0.23
47	康宁杰瑞制药-B	康宁杰瑞制药-B	09966	深港通	中国大	2,531,000.00	17,454,814.72	0.18

			HS		陆			
48	CARSGEN THERAPEUTICS HOLDING	CARSGEN THERAPEUTICS HOLDING	2171 HK	中国香港证券交易所	中国香港	2,489,000.00	22,236,691.65	0.23
48	科济药业-B	科济药业-B	02171 HS	深港通	中国大陆	2,025,000.00	18,091,322.06	0.18
49	同仁堂国药	同仁堂国药	03613 HS	深港通	中国大陆	1,555,000.00	20,558,955.43	0.21
49	BEIJING TONG REN TANG CHINES	BEIJING TONG REN TANG CHINES	3613 HK	中国香港证券交易所	中国香港	1,490,000.00	19,699,577.87	0.20
50	SCICLONE PHARMACEUTICALS HOL	SCICLONE PHARMACEUTICALS HOL	6600 HK	中国香港证券交易所	中国香港	2,366,000.00	22,992,005.33	0.23
50	赛生药业	赛生药业	06600 HS	深港通	中国大陆	1,748,000.00	16,986,485.76	0.17
51	LEPU BIOPHARMA CO LTD-H	LEPU BIOPHARMA CO LTD-H	2157 HK	中国香港证券交易所	中国香港	7,176,000.00	36,124,061.50	0.37
51	乐普生物-B	乐普生物-B	02157 HS	深港通	中国大陆	608,000.00	3,060,678.57	0.03
52	PEIJIA MEDICAL LTD	PEIJIA MEDICAL LTD	9996 HK	中国香港证券交易所	中国香港	3,347,000.00	19,008,941.09	0.19
52	沛嘉医疗-B	沛嘉医疗-B	09996 HS	深港通	中国大陆	3,225,000.00	18,316,054.68	0.19
53	四环医药	四环医药	00460 HS	深港通	中国大陆	26,025,000.00	18,715,733.01	0.19
53	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	460 HK	中国香港证券交易所	中国香港	24,874,000.00	17,887,997.81	0.18
54	时代天使	时代天使	06699 HS	深港通	中国大陆	278,600.00	18,763,888.03	0.19
54	ANGELALIGN TECHNOLOGY INC	ANGELALIGN TECHNOLOGY INC	6699 HK	中国香港证券交易所	中国香港	233,600.00	15,733,109.27	0.16
55	CSTONE PHARMACEUTICALS	CSTONE PHARMACEUTICALS	2616 HK	中国香港证券交易所	中国香港	7,856,000.00	18,035,256.45	0.18
55	基石药业-B	基石药业-B	02616 HS	深港通	中国大陆	6,932,000.00	15,914,001.75	0.16
56	康基医疗	康基医疗	09997 HS	深港通	中国大陆	2,702,000.00	20,701,788.57	0.21
56	KANGJI MEDICAL	KANGJI MEDICAL	9997	中国香	中国香	1,723,500.00	13,204,860.32	0.13

	HOLDINGS LTD	HOLDINGS LTD	HK	港证券 交易所	港			
57	君实生物	君实生物	01877 HS	深港通	中国大 陆	959,400.00	20,167,685.55	0.21
57	SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-H	SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-H	1877 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	635,800.00	13,365,243.36	0.14
58	CLOUDR GROUP LTD	CLOUDR GROUP LTD	9955 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	4,147,800.00	29,790,429.54	0.30
58	智云健康	智云健康	09955 HS	深港通	中国大 陆	478,500.00	3,436,694.28	0.04
59	瑞尔集团	瑞尔集团	06639 HS	深港通	中国大 陆	2,142,500.00	14,834,819.55	0.15
59	ARRAIL GROUP LTD	ARRAIL GROUP LTD	6639 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	2,087,500.00	14,453,995.71	0.15
60	加科思-B	加科思-B	01167 HS	深港通	中国大 陆	2,730,600.00	14,803,244.50	0.15
60	JACOBIO PHARMACEUTICALS GROU	JACOBIO PHARMACEUTICALS GROU	1167 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	2,560,500.00	13,881,091.17	0.14
61	VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	2500 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	2,448,500.00	13,883,428.38	0.14
61	启明医疗-B	启明医疗-B	02500 HS	深港通	中国大 陆	2,364,500.00	13,407,133.52	0.14
62	MICROPORT NEUROTECH LTD	MICROPORT NEUROTECH LTD	2172 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	1,847,000.00	23,670,269.13	0.24
62	微创脑科学	微创脑科学	02172 HS	深港通	中国大 陆	272,000.00	3,485,821.98	0.04
63	CANSINO BIOLOGICS INC-H	CANSINO BIOLOGICS INC-H	6185 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	572,400.00	13,800,436.35	0.14
63	康希诺生物	康希诺生物	06185 HS	深港通	中国大 陆	553,600.00	13,347,172.55	0.14
64	希玛眼科	希玛眼科	03309 HS	深港通	中国大 陆	3,886,000.00	13,543,037.98	0.14
64	C-MER EYE CARE HOLDINGS LTD	C-MER EYE CARE HOLDINGS LTD	3309 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	3,790,000.00	13,208,469.88	0.13
65	OCUMENSION THERAPEUTICS	OCUMENSION THERAPEUTICS	1477 HK	中国香 港证券	中国香 港	2,423,500.00	17,026,269.20	0.17

				交易所				
65	欧康维视生物-B	欧康维视生物-B	01477 HS	深港通	中国大 陆	1,334,500.00	9,375,513.20	0.10
66	心通医疗-B	心通医疗-B	02160 HS	深港通	中国大 陆	8,440,000.00	13,773,274.82	0.14
66	MICROPORT CARDIOFLOW MEDTECH	MICROPORT CARDIOFLOW MEDTECH	2160 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	7,633,000.00	12,456,327.81	0.13
67	长江生命科技	长江生命科技	00775 HS	深港通	中国大 陆	17,888,000.00	12,534,207.46	0.13
67	CK LIFE SCIENCES INTL HLDGS	CK LIFE SCIENCES INTL HLDGS	775 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	17,066,000.00	11,958,228.12	0.12
68	腾盛博药-B	腾盛博药-B	02137 HS	深港通	中国大 陆	4,446,000.00	12,871,246.47	0.13
68	BRII BIOSCIENCES LTD	BRII BIOSCIENCES LTD	2137 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	3,490,000.00	10,103,610.03	0.10
69	医思健康	医思健康	02138 HS	深港通	中国大 陆	2,920,000.00	11,226,397.27	0.11
69	EC HEALTHCARE	EC HEALTHCARE	2138 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	2,827,000.00	10,868,844.21	0.11
70	方达控股	方达控股	01521 HS	深港通	中国大 陆	5,824,000.00	10,739,223.04	0.11
70	FRONTAGE HOLDINGS CORP	FRONTAGE HOLDINGS CORP	1521 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	5,394,000.00	9,946,320.24	0.10
71	VIVA BIOTECH HOLDINGS	VIVA BIOTECH HOLDINGS	1873 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	7,970,500.00	11,022,962.39	0.11
71	维亚生物	维亚生物	01873 HS	深港通	中国大 陆	6,108,500.00	8,447,872.25	0.09
72	DINGDANG HEALTH TECHNOLOGY G	DINGDANG HEALTH TECHNOLOGY G	9886 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	5,909,000.00	15,308,823.29	0.16
72	叮当健康	叮当健康	09886 HS	深港通	中国大 陆	595,000.00	1,541,504.46	0.02
73	医脉通	医脉通	02192 HS	深港通	中国大 陆	1,308,500.00	8,432,811.70	0.09
73	MEDLIVE TECHNOLOGY CO LTD	MEDLIVE TECHNOLOGY CO LTD	2192 HK	中国香 港证券 交易所	中国香 港	1,301,000.00	8,384,476.90	0.09
74	雍禾医疗	雍禾医疗	02279	深港通	中国大	1,079,000.00	7,660,086.43	0.08

			HS		陆			
74	YONGHE MEDICAL GROUP CO LT-H	YONGHE MEDICAL GROUP CO LT-H	2279 HK	中国香港证券交易所	中国香港	838,500.00	5,952,717.77	0.06
75	KINTOR PHARMACEUTICAL LTD	KINTOR PHARMACEUTICAL LTD	9939 HK	中国香港证券交易所	中国香港	2,062,000.00	6,825,030.71	0.07
75	开拓药业-B	开拓药业-B	09939 HS	深港通	中国大陆	1,737,000.00	5,749,310.54	0.06
76	GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	2367 HK	中国香港证券交易所	中国香港	261,400.00	8,386,993.91	0.09
76	巨子生物	巨子生物	02367 HS	深港通	中国大陆	100,400.00	3,221,324.36	0.03
77	三叶草生物-B	三叶草生物-B	02197 HS	深港通	中国大陆	5,157,000.00	4,992,383.40	0.05
77	CLOVER BIOPHARMACEUTICALS LT	CLOVER BIOPHARMACEUTICALS LT	2197 HK	中国香港证券交易所	中国香港	4,253,500.00	4,117,724.03	0.04
78	3D MEDICINES INC	3D MEDICINES INC	1244 HK	中国香港证券交易所	中国香港	67,000.00	5,973,416.22	0.06
78	3D MEDICINES	3D MEDICINES	01244 HS	深港通	中国大陆	26,000.00	2,318,042.12	0.02
79	AIM VACCINE CO LTD	AIM VACCINE CO LTD	6660 HK	中国香港证券交易所	中国香港	129,200.00	5,342,523.75	0.05
79	艾美疫苗	艾美疫苗	06660 HS	深港通	中国大陆	49,800.00	2,059,269.99	0.02
80	LEPU SCIENTECH MEDICAL TEC-H	LEPU SCIENTECH MEDICAL TEC-H	2291 HK	中国香港证券交易所	中国香港	166,000.00	4,117,009.49	0.04
80	心泰医疗	心泰医疗	02291 HS	深港通	中国大陆	44,000.00	1,091,255.53	0.01
81	GAUSH MEDITECH LTD	GAUSH MEDITECH LTD	2407 HK	中国香港证券交易所	中国香港	79,000.00	3,492,506.34	0.04
81	高视医疗	高视医疗	02407 HS	深港通	中国大陆	28,600.00	1,264,375.71	0.01
82	ORBUSNEICH MEDICAL GROUP HOL	ORBUSNEICH MEDICAL GROUP HOL	6929 HK	中国香港证券交易所	中国香港	289,500.00	2,322,144.93	0.02
82	业聚医疗	业聚医疗	06929 HS	深港通	中国大陆	112,000.00	898,377.31	0.01

83	SIPAI HEALTH TECHNOLOGY CO L	SIPAI HEALTH TECHNOLOGY CO L	314 HK	中国香港证券交易所	中国香港	121,400.00	843,939.92	0.01
83	思派健康	思派健康	00314 HS	深港通	中国大陆	63,200.00	439,349.29	0.00
84	JENSCARE SCIENTIFIC CO LTD-H	JENSCARE SCIENTIFIC CO LTD-H	9877 HK	中国香港证券交易所	中国香港	22,800.00	666,370.26	0.01
84	健世科技-B	健世科技-B	09877 HS	深港通	中国大陆	9,000.00	263,040.89	0.00
85	SHANDONG BOAN BIOTECH-H	SHANDONG BOAN BIOTECH-H	6955 HK	中国香港证券交易所	中国香港	43,600.00	655,232.75	0.01
85	博安生物	博安生物	06955 HS	深港通	中国大陆	18,000.00	270,508.93	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	BEIGENE LTD	6160 HK	871,586,774.03	12.54
1	百济神州	06160 HS	169,286,784.19	2.44
2	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	615,785,001.29	8.86
2	药明生物	02269 HS	2,723,951.16	0.04
3	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	375,205,237.46	5.40
4	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6618 HK	361,478,060.88	5.20
5	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	261,963,945.96	3.77
6	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	248,849,515.87	3.58
7	SINOPHARM GROUP CO-H	1099 HK	171,037,894.47	2.46
8	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1066 HK	164,782,132.33	2.37
9	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	161,546,386.54	2.32
10	WUXI APPTEC CO LTD-H	2359 HK	150,768,405.37	2.17
11	GENSCRIPT BIOTECH CORP	1548 HK	143,073,396.09	2.06
12	AKESO INC	9926 HK	119,692,105.19	1.72
12	康方生物	09926 HS	427,638.54	0.01

13	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	6078 HK	118,484,767.01	1.70
14	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	100,043,151.74	1.44
14	微创医疗	00853 HS	1,315,080.56	0.02
15	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	867 HK	91,820,439.85	1.32
16	SHANGHAI MICROPORT MEDBOT GR	2252 HK	72,808,092.74	1.05
16	微创机器人—B	02252 HS	18,955,799.97	0.27
17	HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	3692 HK	89,284,189.48	1.28
18	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	570 HK	76,806,104.35	1.10
19	ZAI LAB LTD	9688 HK	75,288,684.12	1.08
20	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1833 HK	74,912,829.60	1.08

注：注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	再鼎医药	09688 HS	138,653,431.81	1.99
1	ZAI LAB LTD	9688 HK	33,061,845.66	0.48
2	BEIGENE LTD	6160 HK	157,134,629.44	2.26
2	百济神州	06160 HS	14,458,680.06	0.21
3	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6618 HK	68,595,138.28	0.99
3	京东健康	06618 HS	61,058,481.01	0.88
4	药明生物	02269 HS	103,862,555.22	1.49
4	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	15,173,838.57	0.22
5	石药集团	01093 HS	66,703,053.05	0.96
5	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	45,393,361.65	0.65
6	信达生物	01801 HS	45,305,803.63	0.65
6	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	32,326,594.82	0.47
7	中国生物制药	01177 HS	44,125,824.45	0.63
7	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	31,352,538.13	0.45
8	阿里健康	00241 HS	31,529,602.71	0.45
8	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	19,621,569.54	0.28
9	金斯瑞生物科技	01548 HS	30,613,980.51	0.44
9	GENSCRIPT BIOTECH CORP	1548 HK	17,311,737.65	0.25
10	威高股份	01066 HS	27,037,532.01	0.39
10	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1066 HK	20,479,952.88	0.29

11	国药控股	01099 HS	22,001,232.02	0.32
11	SINOPHARM GROUP CO-H	1099 HK	20,997,495.93	0.30
12	药明康德	02359 HS	28,899,596.69	0.42
12	WUXI APPTec CO LTD-H	2359 HK	13,777,480.75	0.20
13	翰森制药	03692 HS	16,242,918.16	0.23
13	HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	3692 HK	11,107,835.21	0.16
14	海吉亚医疗	06078 HS	17,163,772.15	0.25
14	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	6078 HK	9,137,279.45	0.13
15	康哲药业	00867 HS	15,017,389.72	0.22
15	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	867 HK	11,026,057.14	0.16
16	康方生物	09926 HS	19,876,461.41	0.29
16	AKESO INC	9926 HK	4,418,634.79	0.06
17	微创医疗	00853 HS	19,107,123.70	0.27
17	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	3,126,851.39	0.04
18	和黄医药	00013 HS	13,575,894.91	0.20
18	HUTCHMED CHINA LTD	13 HK	8,113,034.13	0.12
19	三生制药	01530 HS	11,881,023.29	0.17
19	3SBIO INC	1530 HK	9,077,758.02	0.13
20	中国中药	00570 HS	11,576,730.25	0.17
20	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	570 HK	9,280,738.91	0.13

注：注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	6,377,435,599.43
卖出收入（成交）总额	1,776,649,310.24

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 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

本基金本报告期末未持有基金。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 7.11.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 7.11.3 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	应收清算款	-
3	应收股利	27,680,771.79
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	27,756,388.03

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.11.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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

份额单位：份

持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	博时恒生医疗保健交易型开

(户)						放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
116,474	173,668.74	6,620,660,882.00	32.73%	11,341,608,938.00	56.07%	2,265,623,500.00	11.20%

## 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
0	中国农业银行股份有限公司—博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	2,265,623,500.00	11.20%
1	中国人寿保险股份有限公司	999,449,300.00	4.94%
2	天安人寿保险股份有限公司—传统产品	515,707,200.00	2.55%
3	天安人寿保险股份有限公司—分红产品	334,126,300.00	1.65%
4	陕西省国际信托股份有限公司—陕国投·聚财2号证券投资集合资金信托计划	246,889,600.00	1.22%
5	华润深国投信托有限公司—景林稳健	233,093,500.00	1.15%
6	陕西省国际信托股份有限公司—陕国投·聚财3号证券投资集合资金信托计划	200,024,800.00	0.99%
7	王艳君	199,500,000.00	0.99%
8	中国银河证券股份有限公司	185,000,000.00	0.91%
9	华泰证券股份有限公司	176,020,909.00	0.87%
10	BARCLAYS BANK PLC	133,062,104.00	0.66%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，由于系统字数限制可能有持有人名称显示不全的情况，持有人为场内持有人。

## 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	27,900.00	0.00%

## 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的情况

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 3 月 18 日）基金份额总额	307,893,320.00
本报告期期初基金份额总额	11,500,393,320.00
本报告期基金总申购份额	10,790,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,062,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	20,227,893,320.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

### 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

基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

基金管理人于 2023 年 5 月 27 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起，聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

## 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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.6.2 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

### 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	
中信里昂证券	-	6,552,950,904.82	80.36%	1,965,885.66	62.35%	-
华泰证券	1	1,288,701,761.54	15.80%	1,030,961.73	32.70%	-
高盛	-	312,432,242.93	3.83%	156,216.31	4.95%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议

### 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		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
中信里昂	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增开源证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-16
2	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
3	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华福证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-30
4	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
5	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)暂停申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-25
6	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增德邦证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-22
7	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)2023 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22
8	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增国金证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-14
9	关于博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)新增长江证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-14
10	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)暂停申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-06
11	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)2022 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-30
12	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增	上海证券报、基金管理人	2023-03-15

	中国中金财富证券有限公司为申购、赎回代办券商的公告	网站、证监会基金电子披露网站	
13	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
14	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
15	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增中国国际金融股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-08
16	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2022 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-20
17	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2023 年境外主要市场节假日暂停申购、赎回等交易类业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-11
18	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230104	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

## § 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

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）设立的文件
- 2、《博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》
- 3、《博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》

- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）在指定报刊上各项公告的原稿

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日