

大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券 投资基金（QDII） 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	38
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	38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	50
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	53
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	53

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	53
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	53
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	53
7.11 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.3 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	54
§9 开放式基金份额变动	54
§10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成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	大成恒生医疗保健 ETF（QDII）
场内简称	恒生医疗 ETF 大成
基金主代码	159303
交易代码	159303
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 6 月 18 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	62,991,693.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 6 月 27 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	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，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。但因特殊情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 为有效管理投资组合，在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.35%，年跟踪误差争取不超过 4%。 具体投资策略包括：（一）股票投资策略；（二）金融衍生品投资策略；（三）债券投资策略；（四）资产支持证券投资策略；（五）融资及转融通证券出借投资策略；（六）存托凭证投资策略。
业绩比较基准	恒生医疗保健指数收益率
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。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。 此外，本基金投资境外市场，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投资风险。

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	大成基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段皓静
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95561
传真	0755-83199588	021-62159217
注册地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	福建省福州市台江区江滨中大 道 398 号兴业银行大厦
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	518054	200120
法定代表人	吴庆斌	吕家进

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	-	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		-	NY 10005

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,400,486.39
本期利润	-16,536,286.95
加权平均基金份额本期利润	-0.2980
本期加权平均净值利润率	-18.83%

本期基金份额净值增长率	-17.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	22,188,974.13
期末可供分配基金份额利润	0.3523
期末基金资产净值	85,180,667.13
期末基金份额净值	1.3523
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	35.23%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、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。

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
过去三个月	-15.13%	1.88%	-14.37%	1.94%	-0.76%	-0.06%
过去六个月	-17.30%	2.00%	-13.75%	2.08%	-3.55%	-0.08%
过去一年	-13.33%	1.95%	-8.46%	2.02%	-4.87%	-0.07%
自基金合同生效起至今	35.23%	2.10%	41.85%	2.19%	-6.62%	-0.09%

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

大成恒生医疗保健ETF（QDII）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司。

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。

历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

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		
冉凌浩	本基金基金经理	2024 年 6 月 18 日	—	23 年	英国曼彻斯特大学商学院金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部，任研究员。2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部，任高级研究员。2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理，现任国际业务部基金经理。2011 年 8 月 26 日起任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起任大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）（转型前为大成纳斯达克 100 指数证券投资基金）基金经理。2016 年 12 月 2 日至 2023 年 3 月 14 日任大成恒生综合中小型股指数基金（QDII-LOF）基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2020 年 7 月 7 日任大成海外中国机会混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2017 年 8 月 10 日起任大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金经理。2019 年 3 月 20 日起任大成中华沪深港 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理。2021 年 5 月 18 日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2021 年 9 月 9 日起任大成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基金经理。2023 年 7 月 12 日起任大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2024 年 5 月 29 日起任大成全球美元债债券型证券投资基金（QDII）基金经理。2024 年 6 月 18 日起任大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2025 年 6 月 24 日起担任大成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）基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无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

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，但不存在参与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 5% 的情形。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

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

2026 年上半年，恒生医疗保健指数出现了一定程度的调整。导致其调整的原因有很多，主要有以下几方面：

从全球宏观经济运行格局来看，美国经济保持平稳增长态势，但整体增长力度温和，未出现强劲扩张的表现；中国经济长期向好的基本面没有改变，当前正处于结构转型深化、内需逐步修复的关键窗口，整体增长动能仍在积蓄过程中，消费与投资领域的数据修复斜率相对平缓。

从货币政策来看，凯文·沃什已经正式就任新任美联储主席，虽然他被普遍认为是相对“鹰派”人士，但美联储目前还尚未加息，只是市场上存在一定的加息预期。流动性边际趋紧的外部

环境压制了市场整体风险偏好，也引发了对创新药企业融资端的担忧，导致港股医疗板块进入阶段性调整。

从产业基本面来看，头部药企现金流韧性大幅提升。上一轮宽松周期中，本土创新药企通过授权出海获得了强劲的现金流注入，也拿到了跨国药企的品牌加持。头部药企储备了较充裕的现金流，行业整体抵御流动性收缩的能力显著增强，紧缩环境对研发投入的实际冲击远弱于过往周期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3523 元；本报告期基金份额净值增长率为-17.30%，业绩比较基准收益率为-13.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面，国内经济温和复苏叠加医药政策持续优化，医保谈判规则趋于温和、创新药支付渠道不断拓宽，此前压制板块的政策悲观预期已大幅修复，为行业盈利修复提供了稳定的宏观底色。

指数层面，恒生医疗保健指数经历前期调整后，估值存在一定安全边际。随着港股市场风险偏好回升，资金从高估值赛道向医药板块切换的趋势显现，有望为板块带来持续增量资金。指数底层资产已完成向创新驱动的升级，前十大权重股中创新药企业占比显著提升，成长属性持续强化，盈利弹性逐步提升。

行业走势上，医药产业的创新成长逻辑并未因本轮调整而破坏。此轮回调更多源于宏观流动性收缩带来的估值压缩，而非产业基本面恶化。依托头部企业充裕的现金流安全垫，以及指数创新属性的持续深化，行业内生增长动力依然稳健。下半年随着后续管线临床数据、创新药出海落地等产业催化逐步释放，恒生医疗保健板块仍具备修复空间与中长期配置价值。

本基金的投资目标是要复制基准指数的收益率，因此本基金将坚持被动化的投资理念，持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由公司分管领导、各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

各投研部门、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于

不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管人沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管人的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管人沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、

基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本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、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：大成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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,321,912.92	2,693,801.98
结算备付金		150,068.07	—
存出保证金		13.29	—
交易性金融资产	6.4.7.2	84,167,093.60	82,481,426.26
其中：股票投资		84,167,093.60	82,481,426.26
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	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收清算款		2,461,413.97	—
应收股利		270,113.25	4,281.60
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	60,492.63	—
资产总计		89,431,107.73	85,179,509.84
负 债 和 净 资 产			
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		787.46	36.58
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		35,454.72	38,357.30
应付托管费		7,090.94	7,671.45
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	6.4.7.9	4,207,107.48	124,144.13
负债合计		4,250,440.60	170,209.46
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	62,991,693.00	51,991,693.00
未分配利润	6.4.7.12	22,188,974.13	33,017,607.38
净资产合计		85,180,667.13	85,009,300.38
负债和净资产总计		89,431,107.73	85,179,509.84

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3523 元，基金份额总额 62,991,693.00 份。

6.2 利润表

会计主体：大成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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-16,149,640.37	33,312,619.47
1. 利息收入		16,475.80	27,618.89
其中：存款利息收入	6.4.7.13	16,475.80	27,618.89
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		3,170,617.22	21,346,658.47
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,850,575.76	21,050,242.00
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投 资收益	6.4.7.17	-	-

贵金属投资收益	6. 4. 7. 18	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 19	-110, 636. 20	-
股利收益	6. 4. 7. 20	430, 677. 66	296, 416. 47
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 21	-17, 936, 773. 34	11, 467, 774. 41
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-243. 31	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 22	-1, 399, 716. 74	470, 567. 70
减：二、营业总支出		386, 646. 58	291, 160. 96
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	216, 869. 46	193, 861. 97
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	43, 373. 94	38, 772. 36
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
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. 7. 23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 24	126, 403. 18	58, 526. 63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-16, 536, 286. 95	33, 021, 458. 51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-16, 536, 286. 95	33, 021, 458. 51
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-16, 536, 286. 95	33, 021, 458. 51

6.3 净资产变动表

会计主体：大成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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	51, 991, 693. 00	-	33, 017, 607. 38	85, 009, 300. 38

二、本期期初净资产	51,991,693.00	-	33,017,607.38	85,009,300.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	11,000,000.00	-	-10,828,633.25	171,366.75
（一）、综合收益总额	-	-	-16,536,286.95	-16,536,286.95
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	11,000,000.00	-	5,707,653.70	16,707,653.70
其中：1. 基金申购款	103,000,000.00	-	61,216,720.85	164,216,720.85
2. 基金赎回款	-92,000,000.00	-	-55,509,067.15	-147,509,067.15
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	62,991,693.00	-	22,188,974.13	85,180,667.13
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	29,991,693.00	-	1,961,425.69	31,953,118.69
二、本期期初净资产	29,991,693.00	-	1,961,425.69	31,953,118.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,000,000.00	-	20,443,357.68	30,443,357.68
（一）、综合收益总额	-	-	33,021,458.51	33,021,458.51
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	10,000,000.00	-	-12,578,100.83	-2,578,100.83

地实现投资目标，本基金还可投资于以下金融工具：针对境内市场，本基金的投资范围包括境内具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等）、现金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）。针对境外市场，基金的投资范围包括法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括开放式基金和交易型开放式指数基金（ETF））；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

本基金的投资组合比例为：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%；因法律法规的规定而受限制的情形除外。

本基金的业绩比较基准为：恒生医疗保健指数收益率。

本基金的基金管理人大成基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2025 年 6 月 24 日募集成立了大成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）（以下简称“大成恒生医疗保健 ETF 发起式联接（QDII）”）。大成恒生医疗保健 ETF 发起式联接（QDII）为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2026 年 6 月 30 日的财务

状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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]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[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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关境内外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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的

部分)的利息收入,免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过港股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。基金通过港股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)如基金取得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。

如基金取得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。

(5)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》,自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。基金通过港股通买卖、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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,321,912.92
等于：本金	2,321,691.50
加：应计利息	221.42
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	2,321,912.92

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	98,094,626.63	—	84,167,093.60	-13,927,533.03
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	98,094,626.63	—	84,167,093.60	-13,927,533.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026 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	33,744.99
其中：交易所市场	33,744.99
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	2,758,053.76
预提费用	63,473.08
可退替代款	1,351,835.65
合计	4,207,107.48

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,991,693.00	51,991,693.00
本期申购	103,000,000.00	103,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-92,000,000.00	-92,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	62,991,693.00	62,991,693.00

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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	33,009,484.87	8,122.51	33,017,607.38
本期期初	33,009,484.87	8,122.51	33,017,607.38
本期利润	1,400,486.39	-17,936,773.34	-16,536,286.95
本期基金份额交易产生的变动数	7,758,354.85	-2,050,701.15	5,707,653.70
其中：基金申购款	69,847,760.15	-8,631,039.30	61,216,720.85
基金赎回款	-62,089,405.30	6,580,338.15	-55,509,067.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,168,326.11	-19,979,351.98	22,188,974.13

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,652.81
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	3,802.85
其他	20.14
合计	16,475.80

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,850,575.76
股票投资收益——赎回差价收入	—
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	2,850,575.76

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	96,608,643.02
减：卖出股票成本总额	93,475,519.80
减：交易费用	282,547.46
买卖股票差价收入	2,850,575.76

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-110,636.20

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	430,677.66
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	430,677.66

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-17,936,773.34
股票投资	-17,936,773.34
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	-17,936,773.34

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-1,399,716.74
合计	-1,399,716.74

注：替代损益（如有）是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代成分证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	13,884.51
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
深港通证券组合费	3,338.06
银行划款手续费	84.67
其他	69,424.36
合计	126,403.18

6.4.7.25 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者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
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
布朗兄弟哈里曼银行	境外资产托管人
大成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）（“大成恒生医疗保健 ETF 发起式联接（QDII）”）	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	216,869.46	193,861.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	52,197.95	42,443.46
应支付基金管理人的净管理费	164,671.51	151,418.51

注：本基金管理费年费率为 0.50%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日管理费 = 前一日基金资产净值 × 管理费年费率 / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	43,373.94	38,772.36

注：本基金托管费年费率为 0.10%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 托管费年费率 / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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固有资金投资本基金的情况

无。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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（%）
大成恒生医疗 保健ETF发起 式联接(QDII)	15,070,000.00	23.92	14,400,000.00	27.70

注：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。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
布朗兄弟哈里曼 银行	-	-	-	-
兴业银行	2,321,912.92	12,652.81	3,636,190.27	23,168.86

注：本基金的银行存款由基金托管人和境外资产托管人保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
2627 HK	中慧生物-B	2026 年 4 月 1 日	重大事项停牌	25.47	-	-	1,600	100,256.25	40,745.42	-
2629 HK	MIRXES-B	2026 年 4 月 1 日	重大事项停牌	10.78	-	-	1,700	67,515.63	18,323.80	-

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。此外，本基金投资境外市场，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投资风险。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奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

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。

6.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人兴业银行股份有限公司，因而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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

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

理的价格变现。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“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外(如有)，其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,321,912.92	-	-	-	2,321,912.92
结算备付金	-	-	-	150,068.07	150,068.07
存出保证金	13.29	-	-	-	13.29
交易性金融资产	-	-	-	84,167,093.60	84,167,093.60
应收股利	-	-	-	270,113.25	270,113.25
应收清算款	-	-	-	2,461,413.97	2,461,413.97
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	2,321,926.21	-	-	87,109,181.52	89,431,107.73
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	35,454.72	35,454.72
应付托管费	-	-	-	7,090.94	7,090.94
应付清算款	-	-	-	787.46	787.46
其他负债	-	-	-	4,207,107.48	4,207,107.48
负债总计	-	-	-	4,250,440.60	4,250,440.60
利率敏感度缺口	2,321,926.21	-	-	82,858,740.92	85,180,667.13
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,693,801.98	-	-	-	2,693,801.98
交易性金融资产	-	-	-	82,481,426.26	82,481,426.26
应收股利	-	-	-	4,281.60	4,281.60
资产总计	2,693,801.98	-	-	82,485,707.86	85,179,509.84
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	38,357.30	38,357.30
应付托管费	-	-	-	7,671.45	7,671.45
应付清算款	-	-	-	36.58	36.58
其他负债	-	-	-	124,144.13	124,144.13
负债总计	-	-	-	170,209.46	170,209.46
利率敏感度缺口	2,693,801.98	-	-	82,315,498.40	85,009,300.38

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

于本期末，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（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

金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
结算备付金	-	150,068.07	-	150,068.07
交易性金融资产	-	84,167,093.60	-	84,167,093.60
资产合计	-	84,317,161.67	-	84,317,161.67
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	-	84,317,161.67	-	84,317,161.67
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	82,481,426.26	-	82,481,426.26
资产合计	-	82,481,426.26	-	82,481,426.26
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	-	82,481,426.26	-	82,481,426.26

6.4.13.4.2.2 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	对资产负债表日基金资产净值的	

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	4, 215, 858. 02	4, 124, 071. 33
	所有外币相对人民币贬值 5%	-4, 215, 858. 02	-4, 124, 071. 33

6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法跟踪恒生医疗保健指数，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，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%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	84, 167, 093. 60	98. 81	82, 481, 426. 26	97. 03
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	84,167,093.60	98.81	82,481,426.26	97.03

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		
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：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	4,103,650.31	3,962,160.88
	业绩比较基准下降 5%	-4,103,650.31	-3,962,160.88

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	84,108,024.38	82,481,426.26
第二层次	59,069.22	-
第三层次	-	-
合计	84,167,093.60	82,481,426.26

6.4.14.2.2 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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 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工具(上年度末：同)。

6.4.14.4 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货币资金、应收款项和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 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	84,167,093.60	94.11
	其中：普通股	84,167,093.60	94.11
	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	2,471,980.99	2.76
8	其他各项资产	2,792,033.14	3.12

9	合计	89,431,107.73	100.00
---	----	---------------	--------

注：1. 本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 84,167,093.60 元，占期末基金资产净值的比例为 98.81%。

2. 上述股票投资金额包括可退替代款估值增值（如有）。

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	84,167,093.60	98.81
合计	84,167,093.60	98.81

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资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（%）
通讯	207,509.63	0.24
非必需消费品	-	-
必需消费品	6,595,369.17	7.74
能源	-	-
金融	108,124.05	0.13
房地产	-	-
医疗保健	76,471,345.40	89.78
工业	-	-
材料	-	-
科技	784,745.35	0.92
公用事业	-	-
政府	-	-
合计	84,167,093.60	98.81

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

无。

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

7.4.1 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	BeOne Medicines Ltd	百济神州有限公司	6160 HK	香港联合交易所	中国香港	60,300	8,924,455.48	10.48

2	Innov ent Biolo gics Inc	信达生 物制药	1801 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	129,000	8,918,618.82	10.47
3	Wuxi Biolo gics Cayma n Inc	药明生 物技术 有限公 司	2269 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	289,500	8,700,004.79	10.21
4	WuXi AppTe c Co Ltd	无锡药 明康德 新药开 发股份 有限公 司	2359 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	38,500	5,139,601.20	6.03
5	Akeso Inc	康方生 物科技 (开曼) 有限公 司	9926 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	58,000	4,435,598.00	5.21
6	CSPC Pharm aceut ical Group Ltd	石药集 团有限 公司	1093 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	640,000	3,874,427.84	4.55
7	Sino Bioph armac eutic al Ltd	中国生 物制药 有限公 司	1177 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	818,000	3,133,189.90	3.68
8	Hanso h Pharm aceut ical Group Co Ltd	翰森制 药集团 有限公 司	3692 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	120,000	3,087,174.12	3.62
9	JD Healt h Inter natio nal	京东健 康股份 有限公 司	6618 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	89,100	2,541,415.52	2.98

	Inc							
10	3SBio Inc	三生制药	1530 HK	香港联合交易所	中国香港	161,000	2,361,839.33	2.77
11	Sichuan Kelun-Biotech Biopharmaceutical Co Ltd	四川科伦博泰生物医药股份有限公司	6990 HK	香港联合交易所	中国香港	5,200	1,970,079.85	2.31
12	XtalPi Holdings Ltd	晶泰控股有限公司	2228 HK	香港联合交易所	中国香港	290,000	1,926,878.18	2.26
13	WuXi XDC Cayman Inc	药明合联生物技术有限公司	2268 HK	香港联合交易所	中国香港	30,000	1,486,523.33	1.75
14	Sinopharm Group Co Ltd	国药控股股份有限公司	1099 HK	香港联合交易所	中国香港	106,400	1,470,302.29	1.73
15	Alibaba Health Information Technology Ltd	阿里健康信息技术有限公司	241 HK	香港联合交易所	中国香港	514,000	1,375,018.88	1.61
16	Genscript Biotech Corp	金斯瑞生物科技股份有限公司	1548 HK	香港联合交易所	中国香港	112,000	1,189,705.05	1.40
17	Zai Lab Ltd	再鼎医药有限公司	9688 HK	香港联合交易所	中国香港	89,900	1,129,075.05	1.33

18	Keymed Biosciences Inc	康诺亚生物医药科技有限公司	2162 HK	香港联合交易所	中国香港	18,000	1,106,098.43	1.30
19	InnoCare Pharma Ltd	诺诚健华医药有限公司	9969 HK	香港联合交易所	中国香港	95,000	978,595.29	1.15
20	Giant Biogene Holding Co Ltd	巨子生物控股有限公司	2367 HK	香港联合交易所	中国香港	42,400	975,902.78	1.15
21	Remegen Co Ltd	荣昌生物制药（烟台）股份有限公司	9995 HK	香港联合交易所	中国香港	15,000	967,998.98	1.14
22	China Medical System Holdings Ltd	康哲药业控股有限公司	867 HK	香港联合交易所	中国香港	106,000	946,441.56	1.11
23	Duality Biotherapeutics Inc	映恩生物	9606 HK	香港联合交易所	中国香港	5,700	897,073.18	1.05
24	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd	江苏恒瑞医药股份有限公司	1276 HK	香港联合交易所	中国香港	16,400	824,028.13	0.97
25	Shanghai Micro	上海微创医疗机器人	2252 HK	香港联合交易所	中国香港	36,500	727,245.60	0.85

	Port MedBo t Group Co Ltd	(集团) 股份有 限公司						
26	Unite d Labor atori es Inter natio nal Holdi ngs Ltd/T he	联邦制 药国际 控股有 限公司	3933 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	94,000	688,256.39	0.81
27	Ascen tage Pharm a Group Inter natio nal	亚盛医 药集团	6855 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	23,700	683,409.88	0.80
28	HUTCH MED China Ltd	和黄医 药(中 国)有 限公司	13 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	45,000	655,842.11	0.77
29	Simce re Pharm aceut ical Group Ltd	先声药 业集团 有限公 司	2096 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	72,000	615,975.66	0.72
30	Mao Gepin g Cosme tics Co LTD	毛戈平 化妆品 股份有 限公司	1318 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	13,600	612,466.72	0.72
31	China Resou rces	华润医 药集团 有限公	3320 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	149,500	550,556.47	0.65

	Pharmaceutical Group Ltd	司						
32	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	山东威高集团医用高分子制品有限公司	1066 HK	香港联合交易所	中国香港	195,200	537,444.84	0.63
33	Microport Scientific Corp	微创医疗科学有限公司	853 HK	香港联合交易所	中国香港	98,800	529,464.61	0.62
34	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd	平安健康医疗科技有限公司	1833 HK	香港联合交易所	中国香港	85,700	519,554.45	0.61
35	Grand Pharmaceutical Group Ltd	远大医药集团有限公司	512 HK	香港联合交易所	中国香港	126,500	516,396.40	0.61
36	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	上海复星医药(集团)股份有限公司	2196 HK	香港联合交易所	中国香港	38,500	505,265.93	0.59
37	Shanghai Pharm	上海医药集团股份有	2607 HK	香港联合交易所	中国香港	51,000	504,974.97	0.59

	aceuticals Holding Co Ltd	限公司						
38	Everest Medicines Ltd	云顶新耀有限公司	1952 HK	香港联合交易所	中国香港	22,500	478,788.19	0.56
39	Shanghai Conant Optical Co Ltd	上海康耐特光学科技股份有限公司	2276 HK	香港联合交易所	中国香港	16,100	439,366.44	0.52
40	Consun Pharmaceutical Group Ltd	康臣药业集团有限公司	1681 HK	香港联合交易所	中国香港	40,000	437,054.36	0.51
41	Lifetech Scientific Corp	先健科技公司	1302 HK	香港联合交易所	中国香港	330,000	395,537.67	0.46
42	CARsgen Therapeutics Holdings Ltd	科济药业控股有限公司	2171 HK	香港联合交易所	中国香港	29,500	365,372.93	0.43
43	Luye Pharma Group Ltd	绿叶制药集团有限公司	2186 HK	香港联合交易所	中国香港	221,500	346,290.89	0.41
44	Jinxin Ferti	锦欣生殖医疗集团有	1951 HK	香港联合交易所	中国香港	196,000	335,364.53	0.39

	lity Group Ltd	限公司						
45	Angel align Techn ology Inc	时代天 使科技 有限公 司	6699 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	5,400	310,958.27	0.37
46	Gener tec Unive rsal Medic al Group Co Ltd	通用环 球医疗 集团有 限公司	2666 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	80,000	308,508.96	0.36
47	Micro Port Neuro Scien tific Corp	微创脑 科学有 限公司	2172 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	30,000	291,832.80	0.34
48	Lepu Bioph arma Co Ltd	乐普生 物科技 股份有 限公司	2157 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	86,000	290,564.72	0.34
49	Gushe ngtan g Holdi ngs Ltd	固生堂 控股有 限公司	2273 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	12,800	286,607.60	0.34
50	China Tradi tiona l Chine se Medic ine Holdi ngs Co Ltd	中国中 药控股 有限公 司	570 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	220,000	257,959.35	0.30
51	Livzo n	丽珠医 药集团	1513 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	11,900	246,817.59	0.29

	Pharmaceutical Group Inc	股份有限公司		所				
52	Insilico Medicine Cayman TopCo	英矽智能	3696 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	240,883.66	0.28
53	Genfleet Therapeutics Shanghai Inc	劲方医药科技(上海)股份有限公司	2595 HK	香港联合交易所	中国香港	9,400	240,359.05	0.28
54	Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd	四环医药控股集团有限公司	460 HK	香港联合交易所	中国香港	326,000	235,012.26	0.28
55	Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd	海吉亚医疗控股有限公司	6078 HK	香港联合交易所	中国香港	26,800	213,451.37	0.25
56	AK Medical Holdings Ltd	爱康医疗控股有限公司	1789 HK	香港联合交易所	中国香港	44,000	196,049.11	0.23
57	Yidu Tech Inc	医渡科技有限公司	2158 HK	香港联合交易所	中国香港	48,500	195,458.49	0.23

58	Nanji ng Leads Biola bs Co Ltd	南京维 立志博 生物科技	9887 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	4,300	184,198.61	0.22
59	Healt h & Happi ness H&H Inter natio nal Holdi ngs Ltd	健合 (H&H) 国际控 股有限 公司	1112 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	18,000	159,153.10	0.19
60	Shang hai Chicm ax Cosme tic Co Ltd	上海上 美化妆 品股份 有限公 司	2145 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	6,500	153,898.37	0.18
61	Fujia n Haixi Pharm aceut ical Co Ltd	福建海 西新药 创制股 份有限 公司	2637 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	950	148,522.05	0.17
62	China Shine way Pharm aceut ical Group Ltd	中国神 威药业 集团有 限公司	2877 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	23,000	147,427.68	0.17
63	SSY Group Ltd	石四药 集团有 限公司	2005 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	80,000	147,306.08	0.17
64	Beiji ng Tong	北京同 仁堂国 药有限	3613 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	20,000	112,390.37	0.13

	Ren Tang Chinese Medicine Co Ltd	公司						
65	Bayzed Health Group Inc	佰泽医疗	2609 HK	香港联合交易所	中国香港	31,200	108,124.05	0.13
66	Medlive Technology Co Ltd	医脉通 科技有限公司	2192 HK	香港联合交易所	中国香港	17,500	103,509.45	0.12
67	TYK Medicines Inc	浙江同 源康医药股份有限公司	2410 HK	香港联合交易所	中国香港	19,500	97,047.43	0.11
68	Xunfei Healthcare Technology Co Ltd	讯飞医疗科技股份有限公司	2506 HK	香港联合交易所	中国香港	1,200	89,790.70	0.11
69	Xuanzhu Biopharmaceutical Co Ltd	轩竹生物科技股份有限公司	2575 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	69,466.63	0.08
70	CF PharmTech Inc	长风药业股份有限公司	2652 HK	香港联合交易所	中国香港	3,500	63,838.43	0.07
71	LEPU Scientech Medic	乐普心泰医疗科技 (上海)	2291 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000	62,014.47	0.07

	al Techn ology Shang hai Co Ltd	股份有 限公司						
72	Brain Auror a Medic al Techn ology Ltd	脑动极 光医疗 科技有 限公司	6681 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	43,000	60,129.72	0.07
73	Healt hyWay Inc	健康之 路股份 有限公 司	2587 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	31,000	60,042.86	0.07
74	Shenz hen Edge Medic al Co Ltd	深圳市 精锋医 疗科技 股份有 限公司	2675 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,600	52,835.63	0.06
75	Shand ong BoAn Biote chnol ogy Co Ltd	山东博 安生物 技术股 份有限 公司	6955 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	12,400	50,403.69	0.06
76	160 Healt h Inter natio nal Ltd	健康 160 国 际	2656 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	5,250	43,957.32	0.05
77	Ab&B Bio-T ech Co Ltd	江苏中 慧元通 生物科 技	2627 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,600	40,745.42	0.05
78	Shang hai Bao	上海宝 济药业 股份有	2659 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	2,400	37,521.36	0.04

	Pharmaceuticals Co Ltd	限公司						
79	Mirxess Holding Co Ltd	-	2629 HK	香港联合交易所	中国香港	1,700	18,323.80	0.02
80	Guangzhou Innogen Pharmaceutical Group Co Ltd	广州银诺医药集团股份有限公司	2591 HK	香港联合交易所	中国香港	2,600	16,010.85	0.02
81	TransThera Sciences Nanjing Inc	药捷安康(南京)科技股份有限公司	2617 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500	15,047.63	0.02
82	PegBio Co Ltd	派格生物医药(杭州)股份有限公司	2565 HK	香港联合交易所	中国香港	1,350	6,249.65	0.01

7.4.2 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权益投资明细无。

7.5 报告期内权益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	BeOne Medicines Ltd	6160 HK	10,719,239.93	12.61
2	Innovent Biologics Inc	1801 HK	10,438,740.23	12.28
3	Wuxi Biologics Cayman Inc	2269 HK	9,701,212.84	11.41
4	Akeso Inc	9926 HK	7,021,520.71	8.26
5	CSPC Pharmaceutical	1093 HK	5,331,769.63	6.27

	Group Ltd			
6	WuXi AppTec Co Ltd	2359 HK	4,553,371.80	5.36
7	Sino Biopharmaceutical Ltd	1177 HK	4,427,846.94	5.21
8	Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd	3692 HK	4,238,709.07	4.99
9	JD Health International Inc	6618 HK	4,117,064.76	4.84
10	3SBio Inc	1530 HK	3,275,953.12	3.85
11	XtalPi Holdings Ltd	2228 HK	2,497,760.47	2.94
12	Duality Biotherapeutics Inc	9606 HK	2,283,182.00	2.69
13	Sichuan Kelun-Biotech Biopharmaceutical Co Ltd	6990 HK	2,226,033.40	2.62
14	Alibaba Health Information Technology Ltd	241 HK	2,209,687.80	2.60
15	Remegen Co Ltd	9995 HK	2,156,872.16	2.54
16	Sinopharm Group Co Ltd	1099 HK	2,030,772.19	2.39
17	WuXi XDC Cayman Inc	2268 HK	1,657,303.40	1.95
18	Genscript Biotech Corp	1548 HK	1,379,769.26	1.62
19	China Medical System Holdings Ltd	867 HK	1,359,288.51	1.60
20	Zai Lab Ltd	9688 HK	1,346,613.18	1.58

注：本项中“本期累计买入金额”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	BeOne Medicines Ltd	6160 HK	9,265,559.20	10.90
2	Innovent Biologics Inc	1801 HK	8,977,070.78	10.56
3	Wuxi Biologics Cayman Inc	2269 HK	8,975,436.45	10.56
4	Akeso Inc	9926 HK	6,466,327.83	7.61

5	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	1093 HK	4,851,196.16	5.71
6	Sino Biopharmaceutical Ltd	1177 HK	4,055,430.76	4.77
7	WuXi AppTec Co Ltd	2359 HK	3,883,302.14	4.57
8	Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd	3692 HK	3,802,761.10	4.47
9	JD Health International Inc	6618 HK	3,711,521.36	4.37
10	3SBio Inc	1530 HK	2,981,814.39	3.51
11	XtalPi Holdings Ltd	2228 HK	2,267,369.49	2.67
12	Alibaba Health Information Technology Ltd	241 HK	2,030,518.35	2.39
13	Sichuan Kelun-Biotech Biopharmaceutical Co Ltd	6990 HK	2,030,092.43	2.39
14	Sinopharm Group Co Ltd	1099 HK	1,796,354.49	2.11
15	WuXi XDC Cayman Inc	2268 HK	1,520,058.69	1.79
16	Genscript Biotech Corp	1548 HK	1,251,314.72	1.47
17	Zai Lab Ltd	9688 HK	1,202,556.53	1.41
18	China Medical System Holdings Ltd	867 HK	1,201,815.59	1.41
19	Duality Biotherapeutics Inc	9606 HK	1,122,075.48	1.32
20	InnoCare Pharma Ltd	9969 HK	1,113,404.48	1.31

注：本项中“本期累计卖出金额”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	113,097,960.48
卖出收入（成交）总额	96,608,643.02

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.11 投资组合报告附注**7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本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。

7.11.3 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	13.29
2	应收清算款	2,461,413.97
3	应收股利	270,113.25
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	—
9	合计	2,792,033.14

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		兴业银行股份有限公司 一大成恒生医疗保健交 易型开放式指数证券投 资基金发起式联接基金 (QDII)	
		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 (%)
2,046	30,787.73	12,651,873.00	20.08	35,269,820.00	55.99	15,070,000.00	23.92

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.3 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、基金投资和研究部 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（2024 年 6 月 18 日） 基金份额总额	220,991,693.00
本报告期期初基金份额总额	51,991,693.00
本报告期基金总申购份额	103,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	92,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	62,991,693.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

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

一、基金管理人的重大人事变动

经大成基金管理有限公司 2026 年第一次临时股东会及公司九届四次监事会审议通过，同意选举郭向东先生为公司第九届监事会股东代表监事，监事会主席，任期自 2026 年 4 月 30 日之日起计算，与公司第九届监事会剩余任期一致。自郭向东先生的监事任职生效之日起，陈勇先生将不再担任公司监事、监事会主席职务。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

报告期内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事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

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，自 2024 年 12 月 11 日起，改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
国信证券	1	195,298,365.88	93.13	38,278.38	93.13	—
招商证券	1	14,408,237.62	6.87	2,823.99	6.87	—
CLSA Limited	1	—	—	—	—	—
China International Capital Corporation HK Securities Ltd.	1	—	—	—	—	—
光大证券	1	—	—	—	—	—

注：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准和流程如下：

（一）筛选标准

大成基金管理有限公司（以下简称“公司”）严格按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》要求制定了证券公司筛选标准，建立了证券公司尽职调查、证券公司负面筛查、备选池筛选机制，选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。

（二）筛选流程

1、经公司尽调符合条件的证券公司进入备选池，由股票投委会以公平、公正、公开为原则，结合定性及定量办法科学评估证券公司研究服务能力，形成证券公司白名单，并定期及不定期进行动态调整。

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

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	大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 30 日
2	大成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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 29 日
3	关于大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）新增流动性服务商的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 18 日
4	关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加西部证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 01 日
5	大成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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 05 月 21 日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 调整代理买卖替代证券折算汇率并修订招募说明书的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 05 月 19 日
7	大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 05 月 19 日
8	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 30 日
9	大成基金管理有限公司旗下 212 只公募基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 04 月 22 日
10	大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2026 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 22 日
11	关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加西南证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 20 日
12	关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加粤开证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 20 日

	公告		
13	大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 08 日
14	大成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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 01 日
15	大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 03 月 31 日
16	大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 03 月 31 日
17	关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加德邦证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 03 月 27 日
18	关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加渤海证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 03 月 27 日
19	关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加国联民生证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 03 月 27 日
20	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增华福证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 03 月 10 日
21	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增瑞银证券有限责任公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 03 月 10 日
22	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增浙商证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 03 月 10 日
23	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增万联证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 02 月 26 日
24	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 02 月 14 日
25	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 01 月 30 日
26	大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年第 4 季	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2026 年 01 月 22 日

	度报告	公司网站	
27	大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 01 月 22 日
28	大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 01 月 05 日

§ 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 (%)
目标基金的联接基金	1	20260101-20260407 20260414-20260630	14,400,000.00	1,460,000.00	790,000.00	15,070,000.00	23.92
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

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、中国证监会批准设立大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的文件；
- 2、《大成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、《大成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、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查

阅。

大成基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日