南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录 1
1.1 重要提示 1
1.2 目录 2
§2 基金简介 4
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 信息披露方式 5
2.5 其他相关资料 5
§3 主要财务指标和基金净值表现 5
3.1 主要会计数据和财务指标 5
3.2 基金净值表现 6
§4 管理人报告 7
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遵规守信情况的说明 8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 8
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 10
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
§5 托管人报告 11
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 11
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 11
§6 中期财务会计报告（未经审计） 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 14
6.4 报表附注 16
§7 投资组合报告 36
7.1 期末基金资产组合情况 36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 42

7.10 本基金投资股指期货的投资政策 43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 43
7.12 投资组合报告附注 43
§8 基金份额持有人信息 44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 44
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 44
§9 开放式基金份额变动 45
§10 重大事件揭示 45
10.1 基金份额持有人大会决议 45
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 45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 45
10.4 基金投资策略的改变 45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 45
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 46
10.8 其他重大事件 47
§11 影响投资者决策的其他重要信息 48
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 48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 48
§12 备查文件目录 48
12.1 备查文件目录 48
12.2 存放地点 48
12.3 查阅方式 49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证全指医疗保健设备与服务 ETF
场内简称	医疗 ETF 南方
基金主代码	159877
交易代码	159877
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 10 月 22 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	211,792,292.00 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	2021 年 11 月 3 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最小化。
投资策略	本基金主要采用复制策略、替代策略及其他适当的策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。主要投资策略包括：复制策略、替代策略、金融衍生品投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略等以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为中证全指医疗保健设备与服务指数，及其未来可能发生的变更。
风险收益特征	本基金属股票型基金，一般而言，其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 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		南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	郭明
	联系电话	0755-82763888	（010）66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	（010）66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518017	100140
法定代表人	周易	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,980,033.61
本期利润	-19,436,193.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0973
本期加权平均净值利润率	-17.16%
本期基金份额净值增长率	-15.04%
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	-109,587,162.25
期末可供分配基金份额利润	-0.5174
期末基金资产净值	102,205,129.75
期末基金份额净值	0.4826
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	-51.74%

注：基金业绩指标不包括持有人认（申）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；

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；

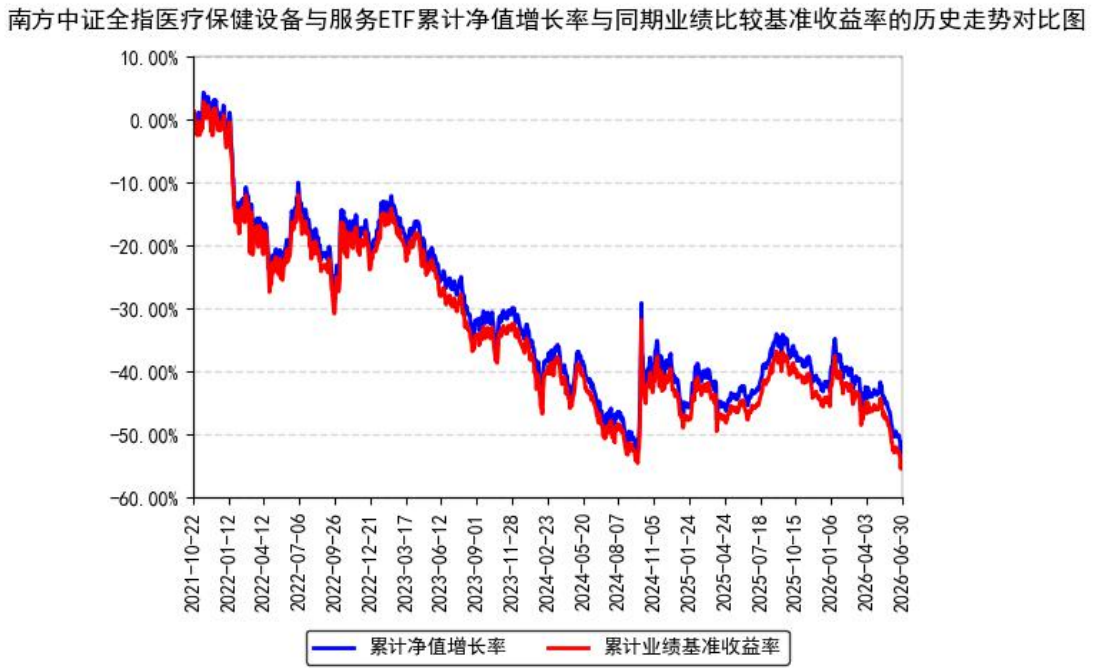
对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	-13.73%	1.28%	-14.65%	1.29%	0.92%	-0.01%
过去六个月	-15.04%	1.48%	-15.87%	1.48%	0.83%	0.00%
过去一年	-14.52%	1.25%	-15.34%	1.26%	0.82%	-0.01%
过去三年	-34.97%	1.63%	-35.99%	1.63%	1.02%	0.00%
自基金合同生效起至今	-51.74%	1.60%	-54.23%	1.61%	2.49%	-0.01%

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

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

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		
朱恒红	本基金基金经理	2021 年 11 月 2 日	-	9 年	中国国籍，北京大学经济学硕士，具有基金从业资格。2016 年 7 月加入南方基金，历任数量化投资部助理研究员、指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2020 年 12 月 25 日，任投资经理；2023 年 4 月 13 日至 2024 年 5 月 17 日，任南方沪深 300ESG 基准 ETF 基金经理；2021 年 7 月 16 日至 2025 年 6 月 6 日，任南方中证香港科技 ETF（QDII）基金经理；2020 年 12 月 25 日至今，任南方策略优化混合基金经理；2021 年 4 月 23 日至今，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 11 月 2 日至今，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2022 年 6 月 17 日至今，任南方恒生生物科技 ETF（QDII）（原：南方恒生香港上市生物科技 ETF（QDII））基金经理；2022 年 7 月 11 日至今，任南方中证上海环交所碳中和 ETF 基金经理；2022 年 12 月 1 日至今，任南方上证科创板 50 成份增强策略 ETF 基金经理；2023 年 5 月 30 日至

					今，任南方恒生生物科技 ETF 发起联接（QDII）（原：南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接（QDII））基金经理；2023 年 6 月 1 日至今，任南方中证上海环交所碳中和 ETF 联接基金经理；2023 年 10 月 24 日至今，任南方中证全指医疗保健设备与服务 ETF 发起联接基金经理；2023 年 12 月 8 日至今，任南方上证科创板 100ETF 基金经理；2024 年 4 月 16 日至今，任南方中证创新药产业 ETF 发起联接基金经理；2024 年 5 月 30 日至今，任南方深证主板 50ETF 基金经理；2024 年 6 月 24 日至今，任南方上证科创板 100ETF 联接基金经理；2024 年 9 月 25 日至今，任南方中证 A500ETF 基金经理；2024 年 10 月 18 日至今，任南方深证主板 50ETF 联接基金经理；2024 年 11 月 12 日至今，任南方中证 A500ETF 联接基金经理；2025 年 1 月 14 日至今，任南方中证港股通汽车产业主题 ETF 发起联接（原：南方中证港股通汽车产业主题指数发起）基金经理；2026 年 3 月 18 日至今，任南方中证港股通汽车产业主题 ETF 基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限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》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。 公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占优比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易次数为 24 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

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，A 股市场整体呈现成交天量、板块极致分化的格局，其中医疗保健指数下跌 15.87%。年初市场主要受盈利修复预期驱动，中小盘风格表现突出；进入 3 月后，中东地缘冲突持续升级，美伊局势反复扰动全球市场，霍尔木兹海峡潜在的能源供应风险推升油价，风险偏好受到压制。5 月市场一度冲高，但中旬起美联储释放偏"鹰"基调，全球流动性预期收紧，资金避险情绪显著升温，市场转入宽幅震荡。上半年最鲜明的特征是资金对科技赛道的极致追捧，在 AI 算力建设加速与光通信需求爆发的驱动下，电子、通信行业涨幅领跑全市场。科技股持续吸金，成交额占比创出历史新高。与此同时，"十五五"规划细则逐步落地，为科技成长提供了中长期的产业与政策双击。与传统科技独舞形成鲜明对比的是，大消费赛道整体疲软，医药生物持续处于调整通道。在科技股对资金的"虹吸效应"下，传统行业经营困难与转型摩擦被充分定价，估值持续压缩 。与此同时，海外滞胀压力、美联储政策不确定性与地缘冲突反复，始终是压制风险偏好的外部闸门。下半年市场预计将在高位震荡中等待盈利验证，随着中报陆续披露，核心矛盾将进一步锚定企业盈利改善的成色。AI 算力、先进制造等新质生产力方向仍是中长期主线，但科技板块内部可能呈现"缩圈分化"态势；而景气边际修复的消费与出海链、以及跌至历史估值低位的传统板块，有望接力演绎结构性的"复苏"行情。

期间我们通过自建的指数化交易系统、日内择时交易模型、跟踪误差归因分析系统、ETF 现金流精算系统等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

（1）报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内；

（2）大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

（3）报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

（4）新股上市初期涨幅较大的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.4826 元，报告期内，份额净值增长率为-15.04%，同期业绩基准增长率为-15.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年中国经济预计呈"前高中低后扬"的浅 V 走势，实际 GDP 增速有望实现全年 4.7%左右的目标。核心特征是"量升价稳"——生产强于需求、上游强于下游的 K 型分化仍存，但伴随扩内需与"反内卷"政策发力，名义 GDP 增长将温和改善。出口在 AI 算力、半导体、光模块等产业链带动下保持韧性，消费维持"服务强、商品弱"，地产拖累逐步收敛。政策面"财政+货币"维持双宽松基调不变。

A 股下半年向好趋势有望延续，但波动料将显著增大。市场上涨动力从估值扩张切换至盈利驱动，预计全年 A 股非金融盈利增速达 10%—15%，企业盈利成为核心变量。美联储政策路径重估、科技板块交易拥挤度处于历史高位、中报业绩验证窗口，都将加剧阶段性震荡。市场风格从单一科技主线向"科技+周期+红利"多主线并行均衡，指数大概率温和上行，全面普涨难现，结构分化仍是主线。美联储推迟宽松导致美债收益率与美元阶段性上行、地缘冲突推升油价、科技板块估值消化压力，是下半年三大主要扰动源。

总体而言，下半年是中国资产从"速度型增长"向"高质量发展"切换的关键期，新质生产力崛起与制度型开放深化，为权益资产价值重估提供基本面支撑。耐心与定力是穿越震荡的核心品质。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括财务负责人、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总

经理、指数投资部总经理、指数研究部总经理、现金及债券指数投资部总经理、国际投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金

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	161,485.65	165,425.81
结算备付金		45,031.55	29,237.08
存出保证金		9,862.72	7,887.21
交易性金融资产	6.4.7.2	102,181,303.16	95,835,144.96
其中：股票投资		102,181,303.16	95,835,144.96
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		17,136.13	40,374.20
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		102,414,819.21	96,078,069.26
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		6,031.05	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		43,018.83	41,725.75
应付托管费		8,603.78	8,345.15
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	6.4.7.6	152,035.80	157,048.43
负债合计		209,689.46	207,119.33
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	211,792,292.00	168,792,292.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-109,587,162.25	-72,921,342.07
净资产合计		102,205,129.75	95,870,949.93
负债和净资产总计		102,414,819.21	96,078,069.26

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.4826 元，基金份额总额 211,792,292.00 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金

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		-19,042,485.11	-713,893.10
1.利息收入		431.97	417.22
其中：存款利息收入	6.4.7.9	431.93	417.22
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		0.04	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”		-1,604,230.45	-3,448,451.55

填列）			
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,532,747.75	-4,258,945.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	928,517.30	810,493.60
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）	6.4.7.15	-17,456,159.56	2,700,757.63
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	17,472.93	33,383.60
减：二、营业总支出		393,708.06	335,630.23
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	280,428.66	211,371.15
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	56,085.73	42,274.22
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	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.18	57,193.67	81,984.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,436,193.17	-1,049,523.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,436,193.17	-1,049,523.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-19,436,193.17	-1,049,523.33

6.3 净资产变动表

会计主体：南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金

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	168,792,292.00	-	-72,921,342.07	95,870,949.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	168,792,292.00	-	-72,921,342.07	95,870,949.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	43,000,000.00	-	-36,665,820.18	6,334,179.82
（一）、综合收益总额	-	-	-19,436,193.17	-19,436,193.17
（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）	43,000,000.00	-	-17,229,627.01	25,770,372.99
其中：1.基金申购款	67,000,000.00	-	-27,428,761.37	39,571,238.63
2.基金赎回款	-24,000,000.00	-	10,199,134.36	-13,800,865.64
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	211,792,292.00	-	-109,587,162.25	102,205,129.75
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	144,792,292.00	-	-62,259,851.61	82,532,440.39
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	144,792,292.00	-	-62,259,851.61	82,532,440.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,000,000.00	-	-1,212,637.43	-212,637.43
(一)、综合收益总额	-	-	-1,049,523.33	-1,049,523.33
(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)	1,000,000.00	-	-163,114.10	836,885.90
其中：1.基金申购款	39,000,000.00	-	-16,722,772.40	22,277,227.60
2.基金赎回款	-38,000,000.00	-	16,559,658.30	-21,440,341.70
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	145,792,292.00	-	-63,472,489.04	82,319,802.96

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：

____杨小松___ ____蔡忠评_____ ____徐超____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]403 号《关于准予南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由南方

基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 451,776,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 1024 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 10 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 451,792,292.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 16,292.00 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2021]1052 号核准，本基金 451,792,292.00 份基金份额于 2021 年 11 月 3 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金可少量投资于非成份股(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产、货币市场工具以及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)。本基金可投资存托凭证。本基金投资于标的指数成份股、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%。每个交易日日终，在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金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。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为：中证全指医疗保健设备与服务指数收益率。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“南方中证全指医疗保健设备与服务 ETF 发起联接”)。南方中证全指医疗保健设备与服务 ETF 发起联接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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在

具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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

本财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，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 日的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，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。对证券投资基金(封闭式证券投

资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(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；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、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，继续免征增值税直至债券到期。

(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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	161,485.65
等于：本金	161,473.36
加：应计利息	12.29
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	161,485.65

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		128,999,325.40	-	102,181,303.16	-26,818,022.24
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		128,999,325.40	-	102,181,303.16	-26,818,022.24

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。

6.4.7.4 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。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 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	2,382.05
其中：交易所市场	2,382.05
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	92,626.08
预提费用	57,027.67
应付指数使用费	-
可退替代款	-
合计	152,035.80

6.4.7.7 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	168,792,292.00	168,792,292.00
本期申购	67,000,000.00	67,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-24,000,000.00	-24,000,000.00
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	211,792,292.00	211,792,292.00

注：本基金申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）；赎回含转出份额（如有）。

6.4.7.8 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	-49,067,710.13	-23,853,631.94	-72,921,342.07
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-49,067,710.13	-23,853,631.94	-72,921,342.07
本期利润	-1,980,033.61	-17,456,159.56	-19,436,193.17
本期基金份额交易产生的变动数	-12,539,594.62	-4,690,032.39	-17,229,627.01
其中：基金申购款	-19,562,297.67	-7,866,463.70	-27,428,761.37
基金赎回款	7,022,703.05	3,176,431.31	10,199,134.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-63,587,338.36	-45,999,823.89	-109,587,162.25

6.4.7.9 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	348.07
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	65.62
其他	18.24
合计	431.93

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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	-1,586,179.44
股票投资收益——赎回差价收入	-946,568.31
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	-2,532,747.75

6.4.7.10.2 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	17,399,661.57
减：卖出股票成本总额	18,969,705.67
减：交易费用	16,135.34
买卖股票差价收入	-1,586,179.44

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	13,800,865.64
减：现金支付赎回款总额	5,235,352.64
减：赎回股票成本总额	9,512,081.31
减：交易费用	-
赎回差价收入	-946,568.31

6.4.7.10.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 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	928,517.30
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	928,517.30

6.4.7.15 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	-17,456,159.56
——股票投资	-17,456,159.56
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
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	-17,456,159.56

6.4.7.16 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	17,472.93
合计	17,472.93

注：替代损益收入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。

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 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	17,356.09
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	166.00
合计	57,193.67

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

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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

无。

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
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(“南方中证全指医疗保健设备与服务 ETF 发起联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	8,341,929.50	18.50%	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	828.21	18.40%	799.82	33.58%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	-	-	-	-

注：1.上述佣金费率参考市场价格确定。

2.该类佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告〔2024〕3 号）相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

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	280,428.66	211,371.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,542.66	4,101.50
应支付基金管理人的净管理费	275,886.00	207,269.65

注：支付基金管理人南方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。

6.4.10.2.2 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	56,085.73	42,274.22

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%÷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
华泰证券股份有限公司	924,833.00	0.44%	1,190,529.00	0.71%
中国工商银行股份有限公司－南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	107,539,300.00	50.78%	77,152,500.00	45.71%

注：本基金其他关联方投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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
中国工商银行	161,485.65	348.07	127,653.44	337.15

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，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

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：本期无。本基金报告期后分红情况（如有）详见本报告“资产负债表日后事项”部分内容。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定期	46.08	463.33	174	8,017.92	80,619.42	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期	10.12	27.73	558	5,646.96	15,473.34	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期	7.82	20.74	492	3,847.44	10,204.08	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期	13.30	51.56	134	1,782.20	6,909.04	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定期	7.08	28.40	227	1,607.16	6,446.80	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	24.68	86.80	71	1,752.28	6,162.80	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁定期	13.91	32.47	140	1,947.40	4,545.80	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期	78.38	121.77	27	2,116.26	3,287.79	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定期	30.38	38.99	83	2,521.54	3,236.17	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期	53.26	58.74	49	2,609.74	2,878.26	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定期	18.38	16.78	42	771.96	704.76	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

本基金为被动式指数基金，紧密跟踪中证全指医疗保健设备与服务指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证全指医疗保健设备与服务指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。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，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，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净资产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。

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。本基金为履行与金融负债有关的义务而调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，可能产生基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行期货投资，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合约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一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

同时，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逆回购交易的流

动性风险和交易对手风险。此外，基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。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。

6.4.13.4.1.1 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	161,485.65	-	-	-	161,485.65
结算备付金	45,031.55	-	-	-	45,031.55
存出保证金	9,862.72	-	-	-	9,862.72
交易性金融资产	-	-	-	102,181,303.16	102,181,303.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	17,136.13	17,136.13
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税	-	-	-	-	-

资产					
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	216,379.92	-	-	102,198,439.29	102,414,819.21
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	6,031.05	6,031.05
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	43,018.83	43,018.83
应付托管费	-	-	-	8,603.78	8,603.78
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	-	-	-	152,035.80	152,035.80
负债总计	-	-	-	209,689.46	209,689.46
利率敏感度缺口	216,379.92	-	-	101,988,749.83	102,205,129.75
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	165,425.81	-	-	-	165,425.81
结算备付金	29,237.08	-	-	-	29,237.08
存出保证金	7,887.21	-	-	-	7,887.21
交易性金融资产	-	-	-	95,835,144.96	95,835,144.96
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-

其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	40,374.20	40,374.20
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	202,550.10	-	-	95,875,519.16	96,078,069.26
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	41,725.75	41,725.75
应付托管费	-	-	-	8,345.15	8,345.15
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	-	-	-	157,048.43	157,048.43
负债总计	-	-	-	207,119.33	207,119.33
利率敏感度缺口	202,550.10	-	-	95,668,399.83	95,870,949.93

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

假设	除市场利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：人民币元）	
		本期末（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	0.00	0.00
	2.市场利率平行下降 25 个基点	0.00	0.00

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。本基金本期末的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于股票，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，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。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，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

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	102,181,303.16	99.98	95,835,144.96	99.96
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	102,181,303.16	99.98	95,835,144.96	99.96

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 ）
	1.组合自身基准上升 5%	5,075,955.89	4,774,701.69
	2.组合自身基准下降 5%	-5,075,955.89	-4,774,701.69

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
第一层次	102,040,834.90
第二层次	-
第三层次	140,468.26
合计	102,181,303.16

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股票和债券，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股票和债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，确定相关金融工具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

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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。

6.4.15 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	102,181,303.16	99.77
	其中：股票	102,181,303.16	99.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	206,517.20	0.20
8	其他各项资产	26,998.85	0.03
9	合计	102,414,819.21	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而行业分类的合计项中不含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	83,935,869.57	82.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	238,564.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	307,050.00	0.30
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	2,325,766.43	2.28
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,233,584.90	14.90
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	102,040,834.90	99.84

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	10,204.08	0.01
C	制造业	130,264.18	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	140,468.26	0.14

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值

					比例（%）
1	300760	迈瑞医疗	74,042	10,057,124.86	9.84
2	688271	联影医疗	72,012	7,289,774.76	7.13
3	300015	爱尔眼科	679,126	5,609,580.76	5.49
4	688301	奕瑞科技	30,224	3,747,776.00	3.67
5	002432	九安医疗	47,500	3,357,300.00	3.28
6	300677	英科医疗	66,770	2,615,380.90	2.56
7	300832	新产业	57,260	2,404,920.00	2.35
8	002044	美年健康	456,000	2,293,680.00	2.24
9	688617	惠泰医疗	12,427	2,256,246.12	2.21
10	002223	鱼跃医疗	87,600	2,247,816.00	2.20
11	300003	乐普医疗	187,875	2,226,318.75	2.18
12	301093	华兰股份	14,330	1,943,577.90	1.90
13	300896	爱美客	22,026	1,920,667.20	1.88
14	600529	山东药玻	96,700	1,784,115.00	1.75
15	603301	振德医疗	19,200	1,673,472.00	1.64
16	600763	通策医疗	45,554	1,543,369.52	1.51
17	300049	福瑞医科	38,500	1,496,880.00	1.46
18	300676	华大基因	42,658	1,495,589.48	1.46
19	300244	迪安诊断	72,788	1,364,047.12	1.33
20	688677	海泰新光	12,283	1,242,179.79	1.22
21	688029	南微医学	16,429	1,179,602.20	1.15
22	688108	赛诺医疗	60,782	1,126,290.46	1.10
23	300529	健帆生物	69,800	1,074,920.00	1.05
24	301293	三博脑科	21,030	1,013,225.40	0.99
25	301580	爱迪特	15,216	978,845.28	0.96
26	688016	心脉医疗	10,849	961,655.36	0.94
27	300888	稳健医疗	33,900	948,861.00	0.93
28	600645	中源协和	54,500	932,495.00	0.91
29	603882	金域医学	40,500	910,440.00	0.89
30	688277	天智航	53,127	908,471.70	0.89
31	920982	锦波生物	6,701	844,258.99	0.83
32	600587	新华医疗	70,650	839,322.00	0.82
33	688068	热景生物	9,549	826,943.40	0.81
34	300595	欧普康视	78,195	823,393.35	0.81
35	300685	艾德生物	45,480	765,883.20	0.75
36	688139	海尔生物	27,719	732,335.98	0.72
37	688289	圣湘生物	50,656	729,446.40	0.71
38	603658	安图生物	25,000	725,500.00	0.71
39	688253	英诺特	12,035	725,469.80	0.71
40	301087	可孚医疗	15,200	724,280.00	0.71
41	002030	达安基因	142,920	720,316.80	0.70
42	688050	爱博医疗	19,623	715,258.35	0.70

43	002219	新里程	401,800	695,114.00	0.68
44	300482	万孚生物	40,913	679,564.93	0.66
45	300298	三诺生物	48,600	677,970.00	0.66
46	301363	美好医疗	34,756	637,077.48	0.62
47	600055	万东医疗	61,400	627,508.00	0.61
48	002382	蓝帆医疗	117,300	595,884.00	0.58
49	300463	迈克生物	70,400	581,504.00	0.57
50	300633	开立医疗	30,981	569,740.59	0.56
51	301267	华厦眼科	36,750	536,182.50	0.52
52	688198	佰仁医疗	5,950	530,978.00	0.52
53	688105	诺唯赞	30,177	523,570.95	0.51
54	300206	理邦仪器	42,200	516,106.00	0.50
55	002901	大博医疗	12,100	505,538.00	0.49
56	300143	盈康生命	70,690	476,450.60	0.47
57	688351	微电生理	20,660	468,155.60	0.46
58	300406	九强生物	42,700	466,711.00	0.46
59	688212	澳华内镜	15,784	464,049.60	0.45
60	688607	康众医疗	8,883	453,033.00	0.44
61	688575	亚辉龙	49,965	437,693.40	0.43
62	300453	三鑫医疗	45,550	411,772.00	0.40
63	688626	翔宇医疗	9,215	407,855.90	0.40
64	688410	山外山	28,012	402,252.32	0.39
65	603222	济民健康	45,760	386,672.00	0.38
66	688085	三友医疗	32,090	384,117.30	0.38
67	688389	普门科技	37,419	366,332.01	0.36
68	300869	康泰医学	35,100	362,934.00	0.36
69	300238	冠昊生物	30,900	358,440.00	0.35
70	688656	浩欧博	3,656	353,791.12	0.35
71	301367	瑞迈特	9,124	352,733.84	0.35
72	688767	博拓生物	10,751	349,515.01	0.34
73	002022	科华生物	74,900	343,042.00	0.34
74	603387	基蛋生物	44,320	335,059.20	0.33
75	301239	普瑞眼科	10,900	331,905.00	0.32
76	688399	硕世生物	7,246	328,895.94	0.32
77	002950	奥美医疗	36,900	328,041.00	0.32
78	300639	凯普生物	65,925	327,647.25	0.32
79	688298	东方生物	17,672	315,621.92	0.31
80	300501	海顺新材	24,244	307,898.80	0.30
81	300288	朗玛信息	34,500	307,050.00	0.30
82	000710	贝瑞基因	41,100	306,606.00	0.30
83	300562	乐心医疗	22,300	301,273.00	0.29
84	301033	迈普医学	5,800	300,382.00	0.29
85	688317	之江生物	19,501	296,415.20	0.29

86	688580	伟思医疗	5,516	293,837.32	0.29
87	300439	美康生物	33,600	269,808.00	0.26
88	300289	利德曼	47,500	263,625.00	0.26
89	603987	康德莱	38,200	263,580.00	0.26
90	688581	安杰思	4,796	248,001.16	0.24
91	688161	威高骨科	11,519	241,668.62	0.24
92	600327	大东方	77,300	239,630.00	0.23
93	301060	兰卫医学	29,200	238,564.00	0.23
94	603309	维力医疗	21,200	237,864.00	0.23
95	002551	尚荣医疗	86,100	229,887.00	0.22
96	688613	奥精医疗	16,052	226,493.72	0.22
97	300653	正海生物	15,750	226,170.00	0.22
98	300642	透景生命	18,980	223,964.00	0.22
99	688151	华强科技	14,977	222,707.99	0.22
100	688273	麦澜德	5,748	222,677.52	0.22
101	002172	澳洋健康	78,000	219,960.00	0.22
102	301122	采纳股份	7,100	208,811.00	0.20
103	603014	威高血净	6,100	199,653.00	0.20
104	688236	春立医疗	12,540	181,328.40	0.18
105	300981	中红医疗	18,711	179,064.27	0.18
106	301602	超研股份	12,500	171,750.00	0.17
107	688314	康拓医疗	4,679	158,524.52	0.16
108	300314	戴维医疗	16,800	156,408.00	0.15
109	688358	祥生医疗	4,844	148,081.08	0.14
110	688013	天臣医疗	5,843	144,146.81	0.14
111	603205	健尔康	6,770	138,514.20	0.14

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301666	大普微	174	80,619.42	0.08
2	001399	惠科股份	558	15,473.34	0.02
3	001257	盛龙股份	492	10,204.08	0.01
4	301531	春光集团	134	6,909.04	0.01
5	301669	高特电子	227	6,446.80	0.01
6	301696	三瑞智能	71	6,162.80	0.01
7	301599	理奇智能	140	4,545.80	0.00
8	301683	慧谷新材	27	3,287.79	0.00
9	001393	维通利	83	3,236.17	0.00
10	001237	惠康科技	49	2,878.26	0.00
11	001312	福恩股份	42	704.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688271	联影医疗	3,629,414.21	3.79
2	688301	奕瑞科技	2,368,734.29	2.47
3	300760	迈瑞医疗	1,935,490.00	2.02
4	688029	南微医学	1,172,754.24	1.22
5	688617	惠泰医疗	956,278.53	1.00
6	688050	爱博医疗	841,507.64	0.88
7	600529	山东药玻	689,851.91	0.72
8	600763	通策医疗	626,204.00	0.65
9	688108	赛诺医疗	622,322.71	0.65
10	603301	振德医疗	549,015.00	0.57
11	600645	中源协和	542,622.00	0.57
12	688198	佰仁医疗	521,486.95	0.54
13	688607	康众医疗	496,992.59	0.52
14	688139	海尔生物	489,796.43	0.51
15	603882	金域医学	428,058.00	0.45
16	920982	锦波生物	426,169.88	0.44
17	600587	新华医疗	425,653.00	0.44
18	688289	圣湘生物	401,146.59	0.42
19	688277	天智航	399,871.67	0.42
20	688351	微电生理	378,595.80	0.39

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688271	联影医疗	1,923,647.77	2.01
2	688301	奕瑞科技	1,499,607.92	1.56
3	688029	南微医学	930,102.40	0.97
4	688050	爱博医疗	701,517.06	0.73
5	688366	昊海生科	415,638.42	0.43
6	688617	惠泰医疗	389,465.03	0.41
7	002932	*ST 明德	341,077.58	0.36
8	600529	山东药玻	331,286.00	0.35
9	688139	海尔生物	315,707.92	0.33
10	688606	奥泰生物	306,284.53	0.32

11	603301	振德医疗	295,516.00	0.31
12	688298	东方生物	286,701.83	0.30
13	688468	科美诊断	284,734.30	0.30
14	688351	微电生理	281,167.94	0.29
15	600645	中源协和	272,066.00	0.28
16	600763	通策医疗	258,338.00	0.27
17	300015	爱尔眼科	247,321.00	0.26
18	301093	华兰股份	237,157.00	0.25
19	688317	之江生物	235,787.84	0.25
20	600587	新华医疗	220,614.00	0.23

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	27,859,479.74
卖出股票收入（成交）总额	17,399,661.57

注：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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 声明本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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

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。

7.12.2 声明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。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明。

本基金投资的前十名股票（如有）没有超出基金合同约定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,862.72
2	应收清算款	17,136.13
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,998.85

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301666	大普微	80,619.42	0.08	新股锁定期
2	001399	惠科股份	15,473.34	0.02	新股锁定期
3	001257	盛龙股份	10,204.08	0.01	新股锁定期
4	301531	春光集团	6,909.04	0.01	新股锁定期
5	301669	高特电子	6,446.80	0.01	新股锁定期

§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		南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		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
2,406	88,026.72	9,745,280.00	4.60%	94,507,712.00	44.62%	107,539,300.00	50.78%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

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

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021 年 10 月 22 日)基金份额总额	451,792,292.00
本报告期期初基金份额总额	168,792,292.00
本报告期基金总申购份额	67,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	24,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	211,792,292.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

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

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期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，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大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

本报告期内托管人相关从业人员无重大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	
中信建投	2	14,828,358.11	32.88%	1,481.65	32.92%	-
国信证券	2	13,244,686.31	29.37%	1,322.84	29.39%	-
中信证券	1	8,681,174.03	19.25%	867.89	19.28%	-
华泰证券	4	8,341,929.50	18.50%	828.21	18.40%	-
国泰海通	4	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：根据 2024 年 7 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告〔2024〕3 号），基金管理人制定了证券公司交易单元的选择标准和程序：

1、选择标准

基金管理人建立了选择机制，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，并制定了定性与定量相结合的具体标准。

2、选择程序

（1）基金管理人根据上述标准对证券公司进行评估，与符合标准的证券公司签订证券综合研究服务协议后将其入库，并对入库的证券公司开展动态管理，定期检视其是否持续符合选择标准；

（2）基金管理人根据其建立的服务评价及交易量分配机制，定期对证券公司开展评价后，根据评价结果进行交易量的分配。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：新增交易单元：无；减少交易单元：无。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	1,000.00	100.00%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加世纪证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-13
2	南方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
3	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加民生证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
4	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-24
5	南方基金管理股份有限公司成都分公司工商注册信息变更公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-28
6	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加东北证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23

7	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华源证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-30

§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
联接基金	1	20260101-20260630	77,152,500.00	42,573,500.00	12,186,700.00	107,539,300.00	50.78%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

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南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的文件；

2、《南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；

6、《南方中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com