中欧医疗健康混合型证券投资基金

2020年年度报告

2020年12月31日

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2021年03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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年3月30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。

本报告期自2020年01月01日起至2020年12月31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 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 11
§4 管理人报告 12
4.1 基金管理人及基金经理情况 12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.9 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 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16
§6 审计报告 16
6.1 审计报告基本信息 16
6.2 审计报告的基本内容 16
§7 年度财务报表 18
7.1 资产负债表 18
7.2 利润表 20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 22
7.4 报表附注 24
§8 投资组合报告 58
8.1 期末基金资产组合情况 58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 58
8.3 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 59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 67
8.6 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 67
8.7 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 67
8.8 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 67
8.9 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 68
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 68

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 68
8.12 投资组合报告附注 68
§9 基金份额持有人信息 69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 70
9.3 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 70
§10 开放式基金份额变动 71
§11 重大事件揭示 71
11.1 基金份额持有人大会决议 71
11.2 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 71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 71
11.4 基金投资策略的改变 71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 72
11.8 其他重大事件 75
§12 影响投资者决策的其他重要信息 77
12.1 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 77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 77
§13 备查文件目录 77
13.1 备查文件目录 77
13.2 存放地点 78
13.3 查阅方式 78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧医疗健康混合型证券投资基金	
基金简称	中欧医疗健康混合	
基金主代码	003095	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2016年09月29日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
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	6,775,967,459.30份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧医疗健康混合A	中欧医疗健康混合C
下属分级基金的交易代码	003095	003096
报告期末下属分级基金的份额总额	2,962,113,231.70份	3,813,854,227.60份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于医疗健康相关行业股票，在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。
业绩比较基准	65%×中证医药卫生指数收益率+35%×中证综合债券指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。

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		中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	010-66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-33830351	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		窦玉明	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2020年		2019年		2018年	
	中欧医疗健康混合A	中欧医疗健康混合C	中欧医疗健康混合A	中欧医疗健康混合C	中欧医疗健康混合A	中欧医疗健康混合C
本期已实现收益	870,627,301.24	1,173,805,650.95	114,831,827.10	66,556,816.21	13,317,974.10	-22,539,259.93
本期利润	3,494,071,824.22	4,755,631,910.06	568,752,004.13	281,568,782.21	-76,424,680.89	-120,282,861.21
加权平均基金份额本期利润	1.6406	1.5729	0.6578	0.4264	-0.0908	-0.4424
本期加权平均净值利润率	59.25%	56.69%	46.08%	28.79%	-6.98%	-35.56%
本期基金份额净值增长率	98.85%	97.23%	75.23%	75.58%	-16.01%	-15.77%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末		2019年末		2018年末	
期末可供分配利润	1,467,167,970.51	1,810,156,353.55	121,695,261.41	183,743,832.35	-47,353,474.61	-33,333,472.84
期末可供分配基金份额利润	0.4953	0.4746	0.1040	0.1056	-0.0513	-0.0523
期末基金资产净值	10,207,678,711.37	13,035,182,825.71	2,028,414,402.14	3,016,142,593.52	913,593,332.94	629,464,126.88
期末基金份额净值	3.446	3.418	1.733	1.733	0.989	0.987
3.1.3 累计期末指标	2020年末		2019年末		2018年末	
基金份额累计净值增长	262.87%	259.96%	82.49%	82.51%	4.14%	3.94%

率						

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、上述基金业绩指标不包括基金份额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

中欧医疗健康混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	18.34%	1.72%	4.48%	0.96%	13.86%	0.76%
过去六个月	18.62%	1.94%	6.34%	1.19%	12.28%	0.75%
过去一年	98.85%	1.92%	33.14%	1.13%	65.71%	0.79%
过去三年	192.63%	1.90%	37.54%	1.06%	155.09%	0.84%
自基金合同生效起至今	262.87%	1.68%	47.56%	0.92%	215.31%	0.76%

注：本基金业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧医疗健康混合C

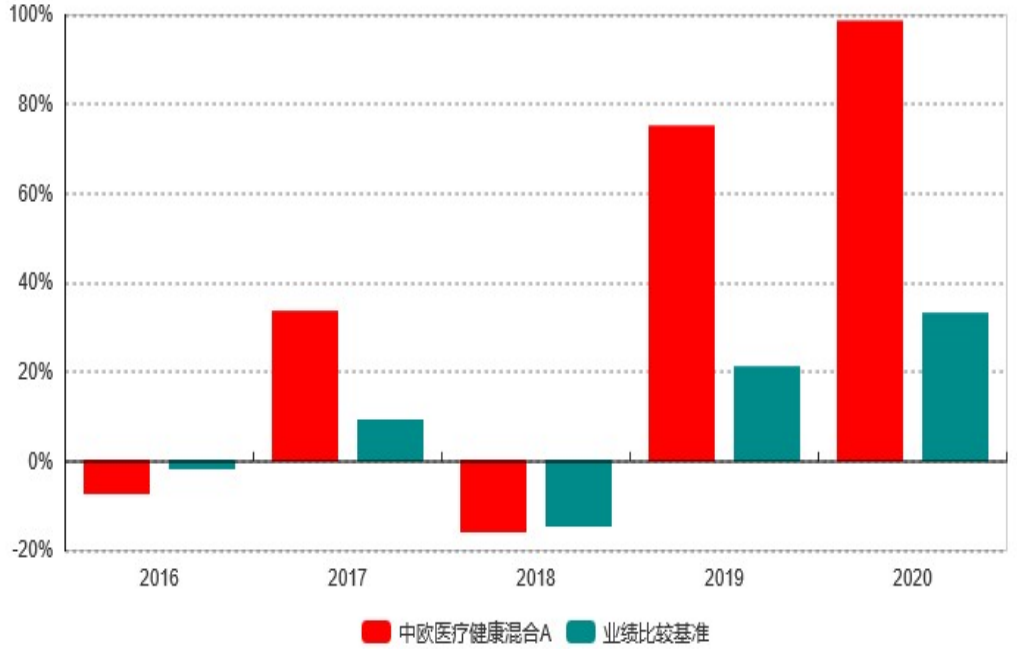
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	18.15%	1.72%	4.48%	0.96%	13.67%	0.76%
过去六个月	18.15%	1.94%	6.34%	1.19%	11.81%	0.75%
过去一年	97.23%	1.92%	33.14%	1.13%	64.09%	0.79%

过去三年	191.70%	1.90%	37.54%	1.06%	154.16%	0.84%
自基金合同生效起至今	259.96%	1.67%	47.56%	0.92%	212.40%	0.75%

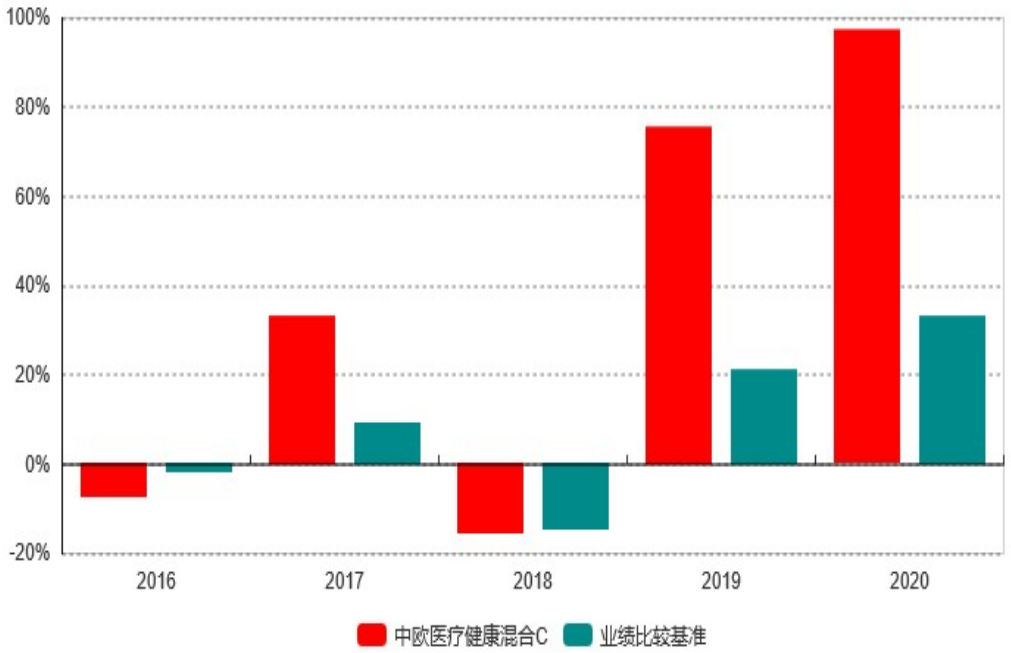
注：本基金业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2016 年 9 月 29 日，2016 年度数据为 2016 年 9 月 29 日至 2016 年 12 月 31 日数据



注：本基金合同生效日为 2016 年 9 月 29 日，2016 年度数据为 2016 年 9 月 29 日至 2016 年 12 月 31 日数据

3.3 过去三年基金的利润分配情况

中欧医疗健康混合A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018年	0.750	60,261,013.10	18,867,198.23	79,128,211.33	-
合计	0.750	60,261,013.10	18,867,198.23	79,128,211.33	-

中欧医疗健康混合C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018年	0.750	16,126,263.56	6,044,542.34	22,170,805.90	-
合计	0.750	16,126,263.56	6,044,542.34	22,170,805.90	-

§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

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份有限公司、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司以及自然人股东，注册资本为2.20亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。截至2020年12月31日，本基金管理人共管理88只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
葛兰	基金经理	2016-09-29	-	9	历任国金证券研究所研究员（2011.02-2012.09），民生加银基金管理有限公司研究员（2012.09-2014.09）。2014/10/08加入中欧基金管理有限公司,历任研究员。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。
2、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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《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，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，为基金份额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，无违法违规、未履行基金合同承诺或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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，本基金管理人制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖公司旗下各类资产组合及投资顾问业务涉及的投资组合；涵盖了股票、债券等各类投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动的各个环节，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。具体控制措施包括：在研究分析环节，基金经理共享研究报告，投研体系职权划分明确且互不干预，各基金持仓及交易信息进行有效隔离；在投资决策环节，基金经理公平对待管理的所有组合，尽可能同时同价下达投资指令；在交易执行环节，本基金管理人以系统控制和人工控制相结合的方式，严控反向交易和同向交易；在事后监控环节，本基金管理人设置日常异常交易分析机制，发现异常问题对基金经理进行提示，留存解释说明，并定期编制公平交易分析报告，逐级审核签署备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照相关法规及制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

对于同向交易，本基金管理人采集连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）不同投资组合的同向交易计算交易价差，并结合同向交易占优比、溢价率等进行综合分析，来判断是否可能存在组合之间利益输送。

综合而言，本报告期内，公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.3 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%的交易共有2次，为量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，公司内部风控已对该交易进行事后审核。

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

我们总体维持了高仓位的运作，在长期看好的创新药产业链、医疗服务、高质量仿制药的龙头企业等方向进行了着重的布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金A类份额净值增长率为98.85%，同期业绩比较基准收益率为33.14%；基金C类份额净值增长率为97.23%，同期业绩比较基准收益率为33.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从未来的配置方向来看，创新药产业链仍旧是我们长期最为看好的方向，从国家层面政策的顶层设计到国内企业近年来的创新积累，都使得国内的创新产药产业链长期维持在高景气度的状态。此外，随着国内居民消费能力的提升以及知识结构、认知水平的提升，产品以及服务的渗透率以居民的支付能力都在持续的提升中，相关行业的龙头企业也有着长期的增长空间。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020年，在公司业务全面发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持人利益的原则，不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

（一）落实法律法规，培养合规文化

2020年，监管机构相继颁布了一系列法律法规，公司在收到相关法规后第一时间内通过电子邮件向相关部门和员工传达了有关内容。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读；同时，公司致力于积极推动公司合规文化建设，通过法规培训、风险案例研讨、员工合规测试等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

（二）完善制度体系，提高运作效率

2020年，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善，在兼顾合规、风险管理和效率的前提下，对一系列规章制度进行了补充和修订，以使得各项业务运作更为规范、顺畅和高效：公司全年共制订或修订制度流程22项，内容涵盖投资研究、合规管理、产品运作、基金销售及宣传推介、信息技术、反洗钱等各项内容。

（三）加强内部审计，强化风险管理

2020年，公司按照年初制定的监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，全年除有序完成监管要求的法定审计工作及常规定期审计工作外，针对易发生风险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现和纠正。通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以XBRL形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§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，本基金托管人在对中欧医疗健康混合型证券投资基金的托管过程中，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，中欧医疗健康混合型证券投资基金的管理人--中欧基金管理有限公司在中欧医疗健康混合型证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在

各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中欧医疗健康混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧医疗健康混合型证券投资基金2020年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第21695号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中欧医疗健康混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了中欧医疗健康混合型证券投资基金(以下简称"中欧医疗健康混合基金")的财务报表，包括2020年12月31日的资产负债表，2020年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了中欧医疗健康混合基金2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报

	表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中欧医疗健康混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	中欧医疗健康混合基金的基金管理人中欧基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中欧医疗健康混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中欧医疗健康混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督中欧医疗健康混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （一） 识别和评估由于舞弊或错误导致

	的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中欧医疗健康混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中欧医疗健康混合基金不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰、潘晓怡
会计师事务所的地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2021-03-30

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中欧医疗健康混合型证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	2,211,770,730.93	489,924,713.30
结算备付金		26,484,175.88	17,955,540.19
存出保证金		4,548,372.86	860,972.01
交易性金融资产	7.4.7.2	21,388,029,774.55	4,723,163,989.59
其中：股票投资		21,342,165,584.15	4,720,844,551.79
基金投资		-	-
债券投资		45,864,190.40	2,319,437.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,071,718.21	150,154.37
应收股利		-	-
应收申购款		230,940,195.83	61,016,635.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		23,862,844,968.26	5,293,072,005.27
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		357,180,401.11	201,475,789.03
应付赎回款		211,484,216.38	33,787,896.82
应付管理人报酬		26,716,024.92	6,136,142.09
应付托管费		4,452,670.84	1,022,690.34
应付销售服务费		8,219,741.00	1,920,933.74
应付交易费用	7.4.7.7	11,390,228.78	3,911,885.86
应交税费		100.04	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	540,048.11	259,671.73
负债合计		619,983,431.18	248,515,009.61
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	6,775,967,459.30	2,910,750,446.09
未分配利润	7.4.7.10	16,466,894,077.78	2,133,806,549.57
所有者权益合计		23,242,861,537.08	5,044,556,995.66
负债和所有者权益总计		23,862,844,968.26	5,293,072,005.27

注：报告截止日2020年12月31日，基金份额总额6,775,967,459.30份。其中A类基金份额净值3.446元，基金份额总额2,962,113,231.70份；C类基金份额净值3.418元，基金份额总额3,813,854,227.60份。

7.2 利润表

会计主体：中欧医疗健康混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2020年01月01日 至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
一、收入		8,622,311,690.85	907,548,944.16
1.利息收入		5,416,373.70	1,801,591.47

其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,180,114.23	1,462,011.67
债券利息收入		1,082,752.24	27,247.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		153,507.23	312,332.29
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,150,324,911.84	207,244,316.42
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,109,253,116.65	201,267,160.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	6,050,430.84	-0.28
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	35,021,364.35	5,977,156.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	6,205,270,782.09	668,932,143.03
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	261,299,623.22	29,570,893.24
减：二、费用		372,607,956.57	57,228,157.82
1．管理人报酬		211,023,503.99	32,776,813.44
2．托管费		35,170,584.06	5,462,802.28
3．销售服务费		66,080,716.48	7,690,674.18
4．交易费用	7.4.7.18	60,038,873.88	11,057,922.25
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6．税金及附加		27.98	-
7．其他费用	7.4.7.19	294,250.18	239,945.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,249,703,734.28	850,320,786.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,249,703,734.28	850,320,786.34

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧医疗健康混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,910,750,446.09	2,133,806,549.57	5,044,556,995.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,249,703,734.28	8,249,703,734.28
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,865,217,013.21	6,083,383,793.93	9,948,600,807.14
其中：1.基金申购款	22,026,141,244.51	37,856,699,641.51	59,882,840,886.02
2.基金赎回款	-18,160,924,231.30	-31,773,315,847.58	-49,934,240,078.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少	-	-	-

以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	6,775,967,459.30	16,466,894,077.78	23,242,861,537.08
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,561,501,052.77	-18,443,592.95	1,543,057,459.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	850,320,786.34	850,320,786.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,349,249,393.32	1,301,929,356.18	2,651,178,749.50
其中：1.基金申购款	5,623,283,662.14	3,205,861,657.71	8,829,145,319.85
2.基金赎回款	-4,274,034,268.82	-1,903,932,301.53	-6,177,966,570.35
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,910,750,446.09	2,133,806,549.57	5,044,556,995.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

刘建平	杨毅	王音然
————————	————————	————————
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧医疗健康混合型证券投资基金(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[2016]1031号文《关于准予中欧医疗健康混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧医疗健康混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。经向中国证监会备案，《中欧医疗健康混合型证券投资基金基金合同》于2016年9月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为209,326,535.44份基金份额，其中认购资金利息折合163,277.51基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中欧医疗健康混合型证券投资基金基金合同》和《中欧医疗健康混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，各类别基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2021年3月30日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧医疗健康混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020年度财务报表符合 企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1）金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和

报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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。

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	2,211,770,730.93	489,924,713.30
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	2,211,770,730.93	489,924,713.30

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		14,602,082,445.75	21,342,165,584.15	6,740,083,138.40
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	45,882,042.25	45,864,190.40	-17,851.85
	银行间市场	-	-	-

	合计	45,882,042.25	45,864,190.40	-17,851.85
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		14,647,964,488.00	21,388,029,774.55	6,740,065,286.55
项目		上年度末2019年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,186,048,470.95	4,720,844,551.79	534,796,080.84
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	2,321,014.18	2,319,437.80	-1,576.38
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,321,014.18	2,319,437.80	-1,576.38
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,188,369,485.13	4,723,163,989.59	534,794,504.46

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2020年12月31日	2019年12月31日
应收活期存款利息	158,308.12	100,831.16
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	13,109.69	8,888.00
应收债券利息	898,048.92	40,009.07
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	2,251.48	426.14
合计	1,071,718.21	150,154.37

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	11,390,228.78	3,911,885.86
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	11,390,228.78	3,911,885.86

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	389,012.16	36,342.26
应付证券出借违约金	-	-

预提费用-审计费	150,000.00	100,000.00
应付转出费	755.76	784.79
应付转出补差费	280.19	2,544.68
预提费用-信息披露费	-	120,000.00
合计	540,048.11	259,671.73

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (中欧医疗健康混合A)	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,170,216,056.70	1,170,216,056.70
本期申购	7,549,214,043.58	7,549,214,043.58
本期赎回（以“-”号填列）	-5,757,316,868.58	-5,757,316,868.58
本期末	2,962,113,231.70	2,962,113,231.70

金额单位：人民币元

项目 (中欧医疗健康混合C)	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,740,534,389.39	1,740,534,389.39
本期申购	14,476,927,200.93	14,476,927,200.93
本期赎回（以“-”号填列）	-12,403,607,362.72	-12,403,607,362.72
本期末	3,813,854,227.60	3,813,854,227.60

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 中欧医疗健康混合A

单位：人民币元

项目 (中欧医疗健康混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	121,695,261.41	736,503,084.03	858,198,345.44
本期利润	870,627,301.24	2,623,444,522.98	3,494,071,824.22

本期基金份额交易产生的变动数	474,845,407.86	2,418,449,902.15	2,893,295,310.01
其中：基金申购款	2,224,194,881.73	10,792,042,855.51	13,016,237,737.24
基金赎回款	-1,749,349,473.87	-8,373,592,953.36	-10,122,942,427.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,467,167,970.51	5,778,397,509.16	7,245,565,479.67

7.4.7.10.2 中欧医疗健康混合C

单位：人民币元

项目 (中欧医疗健康混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	183,743,832.35	1,091,864,371.78	1,275,608,204.13
本期利润	1,173,805,650.95	3,581,826,259.11	4,755,631,910.06
本期基金份额交易产生的变动数	452,606,870.25	2,737,481,613.67	3,190,088,483.92
其中：基金申购款	4,124,202,239.65	20,716,259,664.62	24,840,461,904.27
基金赎回款	-3,671,595,369.40	-17,978,778,050.95	-21,650,373,420.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,810,156,353.55	7,411,172,244.56	9,221,328,598.11

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
活期存款利息收入	3,834,476.93	1,372,459.32
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	306,553.48	81,253.45

其他	39,083.82	8,298.90
合计	4,180,114.23	1,462,011.67

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	16,965,147,753.04	2,741,723,314.17
减：卖出股票成本总额	14,855,894,636.39	2,540,456,153.48
买卖股票差价收入	2,109,253,116.65	201,267,160.69

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	6,050,430.84	-0.28
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	6,050,430.84	-0.28

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
卖出债券（、债转	172,649,156.32	4,075.61

股及债券到期兑付）成交总额		
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	162,042,213.37	4,037.52
减：应收利息总额	4,556,512.11	38.37
买卖债券差价收入	6,050,430.84	-0.28

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	35,021,364.35	5,977,156.01
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	35,021,364.35	5,977,156.01

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	6,205,270,782.09	668,932,143.03
——股票投资	6,205,287,057.56	668,933,719.41
——债券投资	-16,275.47	-1,576.38
——资产支持证券投资	-	-

——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	6,205,270,782.09	668,932,143.03

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
基金赎回费收入	259,643,448.13	29,266,756.02
转换费收入	1,656,175.09	304,137.22
合计	261,299,623.22	29,570,893.24

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	60,038,873.88	11,057,922.25
银行间市场交易费用	-	-
合计	60,038,873.88	11,057,922.25

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年

	12月31日	12月31日
审计费用	150,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	6,250.18	1,945.67
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	294,250.18	239,945.67

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于2021年01月14日宣告收益分配基准日为2021年01月11日的分红，向截至2021年01月18日止在本基金A类份额注册登记人中欧基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每10份基金份额派发红利0.3561元；向截至2021年01月18日止在本基金C类份额注册登记人中欧基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每10份基金份额派发红利0.3531元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（"中欧基金"）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司(“国都证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
万盛基业投资有限责任公司(“万盛基业”)	基金管理人的股东
北京百骏投资有限公司(“北京百骏”)	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.p.a (“意大利意联银行”)	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)（"上海睦亿合伙"）	基金管理人的股东
自然人股东	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司("中欧盛世资	基金管理人的全资子公司

管″）	
上海中欧财富基金销售有限公司(″中欧财富″)	基金管理人的控股子公司
中欧基金国际有限公司（“中欧国际”）	基金管理人的全资子公司

注：1、中欧基金管理有限公司旗下子公司中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司，自2020年4月24日起，将公司名称变更为″上海中欧财富基金销售有限公司″。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31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
国都证券	1,077,206,156.30	2.56%	358,615,207.34	4.42%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总

		量的比例		额的比例
国都证券	1,005,090.97	2.57%	436,986.85	3.84%
关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31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
国都证券	333,978.98	4.42%	98,411.56	2.52%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	211,023,503.99	32,776,813.44
其中：支付销售机构的客户维护费	86,984,511.58	12,838,338.16

注：支付基金管理人 中欧基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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×1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	35,170,584.06	5,462,802.28

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%　/　当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧医疗健康混合A	中欧医疗健康混合C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	1,056,972.27	1,056,972.27
国都证券	0.00	5,106.59	5,106.59
中欧基金	0.00	719,380.20	719,380.20
合计	0.00	1,781,459.06	1,781,459.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧医疗健康混合A	中欧医疗健康混合C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	261,821.93	261,821.93
国都证券	0.00	1,622.47	1,622.47
中欧基金	0.00	497,649.57	497,649.57
合计	0.00	761,093.97	761,093.97

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.80%，销售服务费按前一日C类基金份额的资产净值0.80%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×0.80%÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日资产净值
基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一

次性划付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧医疗健康混合A

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年12月31日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	5,114,226.14	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	5,114,226.14	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.17%	0.00%

中欧医疗健康混合C

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年12月31日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：　1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.10.5.2 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

中欧医疗健康混合A

关联方名称	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019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
自然人股东	1,350,014.17	0.05%	1,253,007.06	0.11%

中欧医疗健康混合C

关联方名称	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019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
自然人股	4,690.95	0.00%	274.54	0.00%

东				

注：

1、截止本年度末，本基金除管理人之外的其他关联方持有本基金C类份额的比例为0.0001%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。

2、截止上年度末，本基金除管理人之外的其他关联方持有本基金C类份额的比例为0.000016%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。

2、本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.10.6 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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	2,211,770,730.93	3,834,476.93	489,924,713.30	1,372,459.32

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况--按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内不存在利润分配情况。资产负债表日之后，年度报告批准报出日之前的利润分配参见资产负债表日后事项(附注：7.4.8.2)

7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300347	泰格医药	2020-07-01	2021-01-04	大宗交易流通受限	93.11	161.61	850,000	79,143,500.00	137,368,500.00	-
603229	奥翔药业	2020-12-28	2021-06-21	非公开发行限售	27.62	33.47	905,141	24,999,994.42	30,295,069.27	-
300888	稳健医疗	2020-09-09	2021-03-17	新股流通受限	74.30	156.39	10,265	762,689.50	1,605,343.35	-
688256	寒武纪	2020-07-10	2021-01-20	新股流通受限	64.39	143.54	8,962	577,063.18	1,286,405.48	-
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	新股流通受限	25.70	88.29	12,114	311,329.80	1,069,545.06	-
688050	爱博医疗	2020-07-22	2021-01-29	新股流通受限	33.55	168.63	3,520	118,096.00	593,577.60	-
688586	江航装备	2020-07-24	2021-02-01	新股流通受限	10.27	30.20	16,436	168,797.72	496,367.20	-
688777	中控技术	2020-11-13	2021-05-24	新股流通受限	35.73	77.12	5,794	207,019.62	446,833.28	-
688313	仕佳光子	2020-08-04	2021-02-18	新股流通受限	10.82	22.92	7,151	77,373.82	163,900.92	-
6885	航亚	2020	2021	新股	8.17	25.5	5,991	48,9	152,	-

10	科技	-12-07	-06-16	流通受限		3		46.47	950.23	
300901	中胤时尚	2020-10-19	2021-04-29	新股流通受限	8.96	15.00	9,611	86,114.56	144,165.00	-
688569	铁科轨道	2020-08-21	2021-03-01	新股流通受限	22.46	20.10	6,841	153,648.86	137,504.10	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-01-07	新股未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688557	兰剑智能	2020-11-25	2021-06-02	新股流通受限	27.70	32.75	1,812	50,192.40	59,343.00	-
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	新股流通受限	138.02	126.67	381	52,585.62	48,261.27	-
300861	美畅股份	2020-08-06	2021-02-24	新股流通受限	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
688679	通源环境	2020-12-16	2021-06-25	新股流通受限	12.05	13.49	3,139	37,824.95	42,345.11	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	新股流通受限	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-25	新股流通受限	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
3009	广联	2020	2021	新股	17.8	33.1	879	15,7	29,1	-

00	航空	-10-19	-04-29	流通受限	7	6		07.73	47.64	
300877	金春股份	2020-08-17	2021-03-03	新股流通受限	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300894	火星人	2020-12-24	2021-06-30	新股流通受限	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300910	瑞丰新材	2020-11-20	2021-05-27	新股流通受限	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300873	海晨股份	2020-08-14	2021-03-02	新股流通受限	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300878	维康药业	2020-08-17	2021-03-03	新股流通受限	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	新股流通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300908	仲景食品	2020-11-13	2021-05-24	新股流通受限	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300884	狄耐克	2020-11-05	2021-05-12	新股流通受限	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300898	熊猫乳品	2020-10-09	2021-04-16	新股流通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
3008	品渥	2020	2021	新股	26.6	60.0	272	7,25	16,3	-

92	食品	-09-11	-03-30	流通受限	6	1		1.52	22.72	
300909	汇创达	2020-11-11	2021-05-18	新股流通受限	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	新股流通受限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	新股流通受限	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020-09-10	2021-03-18	新股流通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300902	国安达	2020-10-22	2021-04-29	新股流通受限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300925	法本信息	2020-12-21	2021-06-30	新股流通受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	新股流通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	新股流通受限	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	新股流通受限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300882	万胜智能	2020-08-27	2021-03-10	新股流通受限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
3009	亿田	2020	2021	新股	24.3	33.0	309	7,52	10,2	-

11	智能	-11-24	-06-03	流通受限	5	6		4.15	15.54	
300918	南山智尚	2020-12-15	2021-06-22	新股流通受限	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	新股流通受限	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300922	天秦装备	2020-12-18	2021-06-25	新股流通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	新股流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注

123090	三诺转债	2020-12-21	2021-01-12	新债未上市	100.00	100.00	50,760	5,076,000.00	5,076,000.00	-

注：

1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

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

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市

后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。 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。本基金主要投资于医疗健康相关行业股票，在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。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、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。 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。

7.4.13.2 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。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。 针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。 针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金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%。除附注7.4.12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，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。 于2020年12月31日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注7.4.12披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,211,770,730.93	-	-	-	2,211,770,730.93
结算备付金	26,484,175.88	-	-	-	26,484,175.88
存出保证金	4,548,372.86	-	-	-	4,548,372.86
交易性金融资产	40,786,920.90	-	5,077,269.50	21,342,165,584.15	21,388,029,774.55
应收利息	-	-	-	1,071,718.21	1,071,718.21
应收申购款	-	-	-	230,940,195.83	230,940,195.83

资产总计	2,283,590,200.57	-	5,077,269.50	21,574,177,498.19	23,862,844,968.26
负债					
应付证券清算款	-	-	-	357,180,401.11	357,180,401.11
应付赎回款	-	-	-	211,484,216.38	211,484,216.38
应付管理人报酬	-	-	-	26,716,024.92	26,716,024.92
应付托管费	-	-	-	4,452,670.84	4,452,670.84
应付销售服务费	-	-	-	8,219,741.00	8,219,741.00
应付交易费用	-	-	-	11,390,228.78	11,390,228.78
应交税费	-	-	-	100.04	100.04
其他负债	-	-	-	540,048.11	540,048.11
负债总计	-	-	-	619,983,431.18	619,983,431.18
利率敏感度缺口	2,283,590,200.57	-	5,077,269.50	20,954,194,067.01	23,242,861,537.08
上年度末2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	489,924,713.30	-	-	-	489,924,713.30
结算备付金	17,955,540.19	-	-	-	17,955,540.19
存出保证金	860,972.01	-	-	-	860,972.01
交易性金融资产	2,319,437.80	-	-	4,720,844,551.79	4,723,163,989.59
应收利息	-	-	-	150,154.37	150,154.37
应收申购款	-	-	-	61,016,635.81	61,016,635.81

资产总计	511,060,663.30	-	-	4,782,011,341.97	5,293,072,005.27
负债					
应付证券清算款	-	-	-	201,475,789.03	201,475,789.03
应付赎回款	-	-	-	33,787,896.82	33,787,896.82
应付管理人报酬	-	-	-	6,136,142.09	6,136,142.09
应付托管费	-	-	-	1,022,690.34	1,022,690.34
应付销售服务费	-	-	-	1,920,933.74	1,920,933.74
应付交易费用	-	-	-	3,911,885.86	3,911,885.86
其他负债	-	-	-	259,671.73	259,671.73
负债总计	-	-	-	248,515,009.61	248,515,009.61
利率敏感度缺口	511,060,663.30	-	-	4,533,496,332.36	5,044,556,995.66

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2020年12月31日本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为0.20%(2019年12月31日:0.05%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。 本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019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	21,342,165,584.15	91.82	4,720,844,551.79	93.58
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	21,342,165,584.15	91.82	4,720,844,551.79	93.58

7.4.13.4.3.2 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日

	1.业绩比较基准上升5%	1,819,161,337.65	420,229,021.88
	2.业绩比较基准下降5%	-1,819,161,337.65	-420,229,021.88

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为21,167,516,907.40元，属于第二层次的余额为220,512,867.15元，第三层次的余额为0.00元(2019年12月31日：属于第一层次的余额为人民币4,715,197,652.61元，属于第二层次的余额为人民币7,966,336.98元，属于第三层次的余额为0.00元)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	21,342,165,584.15	89.44
	其中：股票	21,342,165,584.15	89.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,864,190.40	0.19
	其中：债券	45,864,190.40	0.19
	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	2,238,254,906.81	9.38
8	其他各项资产	236,560,286.90	0.99
9	合计	23,862,844,968.26	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	12,916,015,821.66	55.57
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	314,318,979.85	1.35

G	交通运输、仓储和邮政业	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,810,911.03	0.01
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	3,143,624,354.31	13.53
N	水利、环境和公共设施管理业	42,345.11	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,966,284,912.04	21.37
R	文化、体育和娱乐业	48,261.27	0.00
S	综合	-	-
	合计	21,342,165,584.15	91.82

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300015	爱尔眼科	28,485,977	2,133,314,817.53	9.18
2	603259	药明康德	13,834,726	1,863,814,286.72	8.02
3	300347	泰格医药	9,821,351	1,587,228,535.11	6.83
4	002821	凯莱英	5,125,166	1,533,142,157.24	6.60
5	600276	恒瑞医药	13,369,791	1,490,196,904.86	6.41
6	000661	长春高新	3,091,681	1,387,886,517.71	5.97

7	300677	英科医疗	7,733,751	1,300,430,230.65	5.59
8	300760	迈瑞医疗	3,001,611	1,278,686,286.00	5.50
9	600763	通策医疗	4,501,083	1,244,639,471.16	5.35
10	300122	智飞生物	7,744,808	1,145,534,551.28	4.93
11	300759	康龙化成	7,464,447	898,719,418.80	3.87
12	300357	我武生物	10,575,118	811,111,550.60	3.49
13	300595	欧普康视	9,270,409	759,431,905.28	3.27
14	600521	华海药业	20,371,867	688,772,823.27	2.96
15	300630	普利制药	12,288,482	514,764,510.98	2.21
16	603456	九洲药业	12,737,370	455,997,846.00	1.96
17	603520	司太立	6,445,384	424,299,628.72	1.83
18	300601	康泰生物	1,987,828	346,875,986.00	1.49
19	603939	益丰药房	3,473,458	313,271,177.02	1.35
20	300363	博腾股份	5,893,670	215,236,828.40	0.93
21	603127	昭衍新药	1,999,980	206,217,937.80	0.89
22	300298	三诺生物	5,679,748	203,334,978.40	0.87
23	688179	阿拉丁	2,126,877	169,724,784.60	0.73
24	600529	山东药玻	2,907,431	145,807,664.65	0.63
25	600436	片仔癀	260,306	69,634,458.06	0.30
26	002007	华兰生物	902,802	38,134,356.48	0.16
27	603229	奥翔药业	1,010,335	34,149,377.43	0.15
28	600519	贵州茅台	10,800	21,578,400.00	0.09
29	603658	安图生物	80,000	11,614,400.00	0.05
30	300725	药石科技	82,782	11,423,916.00	0.05
31	603392	万泰生物	18,555	3,739,389.15	0.02
32	603987	康德莱	165,793	2,601,292.17	0.01
33	688029	南微医学	13,462	2,477,142.62	0.01
34	688133	泰坦科技	16,151	2,159,873.23	0.01
35	300482	万孚生物	20,608	1,838,439.68	0.01
36	688202	美迪西	11,252	1,769,151.96	0.01
37	300841	康华生物	3,700	1,732,488.00	0.01

38	300888	稳健医疗	10,265	1,605,343.35	0.01
39	300558	贝达药业	13,500	1,449,495.00	0.01
40	688063	派能科技	5,499	1,422,151.38	0.01
41	688016	心脉医疗	5,611	1,409,483.20	0.01
42	300463	迈克生物	29,250	1,363,050.00	0.01
43	688256	寒武纪	8,962	1,286,405.48	0.01
44	300702	天宇股份	13,679	1,278,986.50	0.01
45	688050	爱博医疗	7,268	1,241,906.64	0.01
46	603882	金域医学	8,602	1,102,088.24	0.00
47	300999	金龙鱼	12,114	1,069,545.06	0.00
48	300149	睿智医药	71,900	1,059,087.00	0.00
49	603883	老百姓	16,417	1,031,480.11	0.00
50	002675	东诚药业	34,493	686,755.63	0.00
51	300832	新产业	4,897	646,697.82	0.00
52	688085	三友医疗	16,119	624,772.44	0.00
53	688366	昊海生科	6,625	597,243.75	0.00
54	688586	江航装备	16,436	496,367.20	0.00
55	688777	中控技术	5,794	446,833.28	0.00
56	300497	富祥药业	30,940	441,513.80	0.00
57	688313	仕佳光子	7,151	163,900.92	0.00
58	688510	航亚科技	5,991	152,950.23	0.00
59	300901	中胤时尚	9,611	144,165.00	0.00
60	688569	铁科轨道	6,841	137,504.10	0.00
61	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
62	688557	兰剑智能	1,812	59,343.00	0.00
63	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
64	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
65	688679	通源环境	3,139	42,345.11	0.00
66	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
67	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
68	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00

69	300142	沃森生物	777	29,961.12	0.00
70	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
71	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
72	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
73	300894	火星人	628	23,217.16	0.00
74	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
75	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
76	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
77	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
78	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
79	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
80	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
81	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
82	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
83	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
84	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
85	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
86	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
87	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
88	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
89	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
90	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
91	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
92	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
93	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
94	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
95	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
96	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
97	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
98	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
99	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00

100	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
101	300009	安科生物	607	8,910.76	0.00
102	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
103	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
104	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
105	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600276	恒瑞医药	1,555,048,895.87	30.83
2	603259	药明康德	1,173,793,946.57	23.27
3	002821	凯莱英	1,159,589,127.09	22.99
4	300015	爱尔眼科	1,140,763,237.02	22.61
5	300760	迈瑞医疗	1,118,673,496.08	22.18
6	300122	智飞生物	1,092,349,314.21	21.65
7	000661	长春高新	978,561,585.09	19.40
8	300677	英科医疗	857,763,821.60	17.00
9	300630	普利制药	822,458,246.18	16.30
10	300142	沃森生物	817,429,278.02	16.20
11	300347	泰格医药	810,792,555.63	16.07
12	600521	华海药业	805,608,307.20	15.97
13	600529	山东药玻	783,821,105.36	15.54
14	600763	通策医疗	693,510,458.10	13.75
15	002007	华兰生物	628,671,763.52	12.46
16	300298	三诺生物	623,647,246.19	12.36
17	300357	我武生物	611,402,065.50	12.12
18	603939	益丰药房	595,622,546.66	11.81
19	300759	康龙化成	577,615,677.68	11.45

20	603456	九洲药业	549,237,029.93	10.89
21	300601	康泰生物	528,399,391.90	10.47
22	300595	欧普康视	522,299,075.62	10.35
23	603520	司太立	493,764,541.41	9.79
24	603987	康德莱	447,778,780.33	8.88
25	300363	博腾股份	359,712,891.72	7.13
26	300463	迈克生物	327,202,386.91	6.49
27	600436	片仔癀	317,026,808.12	6.28
28	688016	心脉医疗	293,990,949.28	5.83
29	688085	三友医疗	280,957,704.41	5.57
30	300702	天宇股份	272,412,445.44	5.40
31	688179	阿拉丁	246,250,049.35	4.88
32	600519	贵州茅台	233,508,894.65	4.63
33	300841	康华生物	219,885,215.00	4.36
34	603229	奥翔药业	219,808,089.26	4.36
35	603127	昭衍新药	213,139,147.86	4.23
36	603658	安图生物	209,006,627.26	4.14
37	300725	药石科技	207,875,934.33	4.12
38	300482	万孚生物	197,668,898.99	3.92
39	603882	金域医学	192,094,879.75	3.81
40	000858	五 粮 液	151,908,594.39	3.01
41	000710	贝瑞基因	151,299,227.12	3.00
42	688366	昊海生科	146,137,304.30	2.90
43	603392	万泰生物	129,140,300.29	2.56
44	688185	康希诺	120,021,616.61	2.38
45	688050	爱博医疗	118,201,293.22	2.34
46	300453	三鑫医疗	113,867,443.20	2.26
47	600211	西藏药业	105,841,126.78	2.10

注：买入金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。

8.4.2 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	600529	山东药玻	781,187,112.56	15.49
2	600276	恒瑞医药	771,195,606.47	15.29
3	300677	英科医疗	769,567,643.33	15.26
4	002007	华兰生物	729,450,981.50	14.46
5	300142	沃森生物	692,994,627.84	13.74
6	300630	普利制药	613,258,333.77	12.16
7	300015	爱尔眼科	588,052,117.85	11.66
8	002821	凯莱英	529,297,643.72	10.49
9	000661	长春高新	509,367,657.60	10.10
10	603987	康德莱	469,772,406.52	9.31
11	300760	迈瑞医疗	451,357,293.69	8.95
12	603939	益丰药房	435,718,176.26	8.64
13	300601	康泰生物	419,317,998.88	8.31
14	603520	司太立	405,802,417.37	8.04
15	600521	华海药业	405,496,855.38	8.04
16	300463	迈克生物	388,824,281.60	7.71
17	300357	我武生物	368,639,602.19	7.31
18	300298	三诺生物	353,577,130.16	7.01
19	300595	欧普康视	348,715,169.85	6.91
20	600763	通策医疗	340,230,718.62	6.74
21	300347	泰格医药	328,228,831.37	6.51
22	300122	智飞生物	288,456,483.32	5.72
23	603259	药明康德	277,197,599.07	5.49
24	688085	三友医疗	272,856,951.55	5.41
25	600436	片仔癀	269,040,202.47	5.33
26	300702	天宇股份	266,686,368.65	5.29
27	300725	药石科技	246,378,266.66	4.88
28	603229	奥翔药业	245,221,816.92	4.86

29	688016	心脉医疗	245,015,701.36	4.86
30	600519	贵州茅台	237,917,864.80	4.72
31	603882	金域医学	223,382,430.65	4.43
32	300759	康龙化成	220,960,614.62	4.38
33	603456	九洲药业	199,898,121.39	3.96
34	300363	博腾股份	195,084,881.10	3.87
35	300482	万孚生物	193,597,343.32	3.84
36	603658	安图生物	191,683,514.18	3.80
37	300841	康华生物	188,699,319.79	3.74
38	000858	五 粮 液	162,719,495.50	3.23
39	603127	昭衍新药	152,163,956.17	3.02
40	000710	贝瑞基因	142,834,784.61	2.83
41	688366	昊海生科	131,774,487.43	2.61
42	600211	西藏药业	127,864,845.32	2.53
43	300453	三鑫医疗	122,291,421.01	2.42
44	603392	万泰生物	122,273,619.16	2.42
45	688185	康希诺	107,620,380.65	2.13

注：卖出金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。

8.4.3 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	25,271,928,611.19
卖出股票收入（成交）总额	16,965,147,753.04

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	40,786,920.90	0.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	5,077,269.50	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,864,190.40	0.20

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019627	20国债01	407,910	40,786,920.90	0.18
2	123090	三诺转债	50,760	5,076,000.00	0.02
3	110076	华海转债	10	1,269.50	0.00

8.7 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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,548,372.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,071,718.21
5	应收申购款	230,940,195.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	236,560,286.90

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300347	泰格医药	137,368,500.00	0.59	大宗交易流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧医疗健康混合A	1,097,486	2,699.00	111,341,021.94	3.76%	2,850,772,209.76	96.24%
中欧医疗健康混合C	2,085,889	1,828.41	4,383,007.17	0.11%	3,809,471,220.43	99.89%
合计	3,183,37	2,128.55	115,724,029.11	1.71%	6,660,243,430.19	98.29%

	5					

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧医疗健康混合A	2,574,457.34	0.09%
	中欧医疗健康混合C	36,800.23	0.00%
	合计	2,611,257.57	0.04%

注：截至本报告期末，管理人的从业人员持有本基金C份额占总份额实际比例为0.0010%，上表持有份额比例为四舍五入结果。

9.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧医疗健康混合A	>100
	中欧医疗健康混合C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧医疗健康混合A	10~50
	中欧医疗健康混合C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧医疗健康混合A	中欧医疗健康混合C
基金合同生效日(2016年09月29日)基金份额总额	163,142,177.19	46,184,358.25
本报告期期初基金份额总额	1,170,216,056.70	1,740,534,389.39

本报告期基金总申购份额	7,549,214,043.58	14,476,927,200.93
减：本报告期基金总赎回份额	5,757,316,868.58	12,403,607,362.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,962,113,231.70	3,813,854,227.60

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

11.2 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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为150,000.00元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备

名称	易单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	注
安信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	10,045,699.05	0.02%	9,355.89	0.02%	-
东北证券	1	138,451,551.42	0.33%	128,940.17	0.33%	-
东方证券	1	1,939,801,963.93	4.61%	1,806,538.50	4.61%	-
东吴证券	1	5,521,467,328.16	13.13%	5,142,150.61	13.13%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	2,619,443,148.53	6.23%	2,439,490.85	6.23%	-
广发证券	1	3,261,342,855.56	7.76%	3,037,281.20	7.76%	-
国金证券	1	1,721,421,933.84	4.09%	1,603,164.92	4.09%	-
国泰君安	1	2,252,347,457.77	5.36%	2,097,615.63	5.36%	-
国信证券	1	1,696,266,263.07	4.03%	1,579,736.17	4.03%	-
海通证券	1	2,089,099,138.68	4.97%	1,945,583.91	4.97%	-

华泰证券	1	3,070,356,973.07	7.30%	2,859,422.88	7.30%	-
平安证券	1	370,194,362.64	0.88%	344,762.98	0.88%	-
申万宏源	1	2,936,969,989.00	6.99%	2,738,597.36	6.99%	-
天风证券	1	2,015,631,646.06	4.79%	1,877,148.84	4.79%	-
西部证券	1	1,904,838,770.66	4.53%	1,773,974.78	4.53%	-
西南证券	1	145,975,306.80	0.35%	135,946.94	0.35%	-
兴业证券	1	2,363,786,156.93	5.62%	2,201,382.35	5.62%	-
浙商证券	1	2,294,874,726.68	5.46%	2,137,201.54	5.46%	-
中信建投	1	1,096,238,194.71	2.61%	1,020,928.14	2.61%	-
中信证券	1	1,736,926,469.56	4.13%	1,617,597.44	4.13%	-
中信证券(华南)	1	-	-	-	-	-
国都证券	2	1,077,206,156.30	2.56%	1,005,090.97	2.57%	-
中泰证券	2	1,781,040,499.59	4.24%	1,658,682.13	4.24%	-

注：1.根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

2.本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

3.广州证券于2020年4月更名为中信证券（华南）。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	265,322.96	0.12%	-	-	-	-	-	-
东方证券	14,799,580.43	6.67%	-	-	-	-	-	-
东吴证券	1,120,435.32	0.51%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	499,146.15	0.23%	-	-	-	-	-	-
广发证券	19,297,885.80	8.70%	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	22,937,968.50	10.35%	-	-	-	-	-	-
国信证券	1,927,086.04	0.87%	-	-	-	-	-	-
海通证券	1,949,523.30	0.88%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	41,755,558.06	18.83%	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	399,078.98	0.18%	-	-	-	-	-	-
天风证券	882,893.00	0.40%	2,594,400,000.00	100.00%	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1,048,335.94	0.47%	-	-	-	-	-	-
浙商证券	69,083,926.19	31.16%	-	-	-	-	-	-
中信建	-	-	-	-	-	-	-	-

投								
中信证券	1,018,577.87	0.46%	-	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	44,743,329.19	20.18%	-	-	-	-	-	-

注：1.根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

2.本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

3.广州证券于2020年4月更名为中信证券（华南）。

11.8 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	中欧医疗健康混合型证券投资基金2019年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2020-01-18
2	中欧基金管理有限公司关于中欧医疗健康混合型证券投资基金调整代销渠道大额申购交易限额的公告	中国证监会指定媒介	2020-01-20
3	中欧基金管理有限公司关于延长2020年春节假期对旗下基金业务影响的提示性公告	中国证监会指定媒介	2020-01-30
4	中欧基金管理有限公司关于使用固有资金投资旗下基金的公告	中国证监会指定媒介	2020-02-13
5	中欧基金管理有限公司关于调整旗下基金在部分销售机构定投业务起点金额的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-25
6	中欧基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-25
7	中欧医疗健康混合型证券投资基金2019年年度报告	中国证监会指定媒介	2020-04-01
8	中欧医疗健康混合型证券投	中国证监会指定媒介	2020-04-22

	资基金2020年第一季度报告		
9	中欧基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-25
10	中欧基金管理有限公司关于调整部分基金在招商银行定投业务起点金额的公告	中国证监会指定媒介	2020-05-13
11	中欧基金管理有限公司关于中欧医疗健康混合型证券投资基金调整代销渠道大额申购等交易限额的公告	中国证监会指定媒介	2020-05-21
12	中欧医疗健康混合型证券投资基金2020年第二季度报告	中国证监会指定媒介	2020-07-21
13	中欧医疗健康混合型证券投资基金2020年中期报告	中国证监会指定媒介	2020-08-31
14	中欧医疗健康混合型证券投资基金2020年资料概要更新	中国证监会指定媒介	2020-08-31
15	中欧医疗健康混合型证券投资基金2020年第三季度报告	中国证监会指定媒介	2020-10-28
16	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会指定媒介	2020-10-31
17	中欧医疗健康混合型证券投资基金托管协议（修订）	中国证监会指定媒介	2020-10-31
18	中欧医疗健康混合型证券投资基金基金合同（修订）	中国证监会指定媒介	2020-10-31
19	中欧医疗健康混合型证券投资基金更新招募说明书（2020年11月）	中国证监会指定媒介	2020-11-04
20	中欧医疗健康混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2020-11-04
21	中欧基金管理有限公司关于	中国证监会指定媒介	2020-11-17

	调整旗下部分基金在中欧钱滚滚电子交易平台最低交易限额的公告		
22	中欧医疗健康混合型证券投资基金更新招募说明书（2020年12月）	中国证监会指定媒介	2020-12-24
23	中欧基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定媒介	2020-12-29

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中欧医疗健康混合型证券投资基金相关批准文件

2、《中欧医疗健康混合型证券投资基金基金合同》

3、《中欧医疗健康混合型证券投资基金托管协议》

4、《中欧医疗健康混合型证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人的住所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

二〇二一年三月三十一日