

汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富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：2020 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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2020年8月26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2020年01月01日起至6月30日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 | 6 |
| 2.5 信息披露方式 | 6 |
| 2.6 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 11 |
| 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 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 | 14 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表 | 15 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 43 |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 | 43 |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合 | 44 |
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 | 44 |
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 | 58 |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 | 67 |
| 7.7 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 |

| | |
|--|----|
| 7.8 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 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细..... | 67 |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细..... | 67 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 67 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 68 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 68 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 69 |
| 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..... | 70 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 70 |
| § 10 重大事件揭示 | 71 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 71 |
| 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..... | 71 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 71 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 71 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 71 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 71 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 71 |
| 10.8 其他重大事件..... | 75 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 76 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况..... | 76 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 76 |
| § 12 备查文件目录 | 76 |
| 12.1 备查文件目录..... | 76 |
| 12.2 存放地点 | 77 |
| 12.3 查阅方式 | 77 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|--------------------|--------------------|-----------------------|
| 基金名称 | 汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 添富全球医疗混合(QDII) | |
| 基金主代码 | 004877 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017年08月16日 | |
| 基金管理人 | 汇添富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(份) | 244,049,560.56 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 添富全球医疗混合(QDII)人民币 | 添富全球医疗混合(QDII)美元现汇/现钞 |
| 下属分级基金的交易代码 | 004877 | 004878/004879 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 238,141,779.70 | 5,907,780.86 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金采用自下而上的方法，精选全球医疗保健行业相关公司的股票进行投资布局，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出全球医疗保健主题相关公司中商业模式清晰、竞争优势明显、具有长期持续增长模式且估值水平相对合理的上市公司，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。 |
| 业绩比较基准 | 标普全球1200医疗保健指数(S&P Global 1200 Health Care Sector Index)收益率×40%+中证医药卫生指数收益率×40%+一年期人民币定期存款利率(税后)×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为主要投资于全球医疗保健行业相关公司股票的混合型基金，属于证券投资基金中高预期风险高预期收益的品种，其预期风险与预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|---|----------------------|
| 名称 | | 汇添富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 | 李鹏 | 郭明 |
| | 联系电话 | 021-28932888 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | service@99fund.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-888-9918 | 95588 |
| 传真 | | 021-28932998 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区 (东座) 6 楼 H686 室 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 | 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 | | 李文 | 陈四清 |

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外资产托管人 |
|------|----|-------------------------------|
| 名称 | 中文 | 布朗兄弟哈里曼银行 |
| | 英文 | Brown Brothers Harriman & Co. |
| 注册地址 | | 140 Broadway New York |
| 办公地址 | | 140 Broadway New York |
| 邮政编码 | | NY 10005 |

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

| | |
|---------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.99fund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇 添富基金管理股份有限公司 |

2.6 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|---------------|------------------------|
| 注册登记机构 | 汇添富基金管理股份有限公司 | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 |

§ 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(2020年01月01日 - 2020年06月30日) |
|---------------|--------------------------------|

| | 添富全球医疗混合(QDII)人民币 | 添富全球医疗混合(QDII)美元 |
|----------------------|-------------------|------------------|
| 本期已实现收益 | 44,386,471.09 | 8,691,824.89 |
| 本期利润 | 95,851,918.79 | 18,572,116.33 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.5642 | 3.3253 |
| 本期加权平均净值利润率 | 38.85% | 35.03% |
| 本期基金份额净值增长率 | 41.42% | 39.35% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年06月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 123,141,241.96 | 20,386,352.39 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.5171 | 3.4508 |
| 期末基金资产净值 | 422,998,297.55 | 70,053,135.18 |
| 期末基金份额净值 | 1.7762 | 1.6749 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2020年06月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 77.62% | 67.49% |

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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、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

| 添富全球医疗混合(QDII)人民币 | | | | | | |
|-------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
| 过去一个月 | 12.35% | 1.06% | 5.72% | 0.95% | 6.63% | 0.11% |
| 过去三个月 | 35.01% | 1.19% | 17.05% | 0.91% | 17.96% | 0.28% |
| 过去六个月 | 41.42% | 1.40% | 15.56% | 1.27% | 25.86% | 0.13% |
| 过去一年 | 54.67% | 1.09% | 27.10% | 0.95% | 27.57% | 0.14% |
| 自基金合同生效日起至今 | 77.62% | 1.08% | 36.45% | 0.82% | 41.17% | 0.26% |
| 添富全球医疗混合(QDII)美元 | | | | | | |
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
| 过去一个月 | 13.18% | 1.03% | 5.72% | 0.95% | 7.46% | 0.08% |
| 过去三个月 | 35.12% | 1.13% | 17.05% | 0.91% | 18.07% | 0.22% |
| 过去六个月 | 39.35% | 1.36% | 15.56% | 1.27% | 23.79% | 0.09% |

| | | | | | | |
|-------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一年 | 50.17% | 1.07% | 27.10% | 0.95% | 23.07% | 0.12% |
| 自基金合同生效日起至今 | 67.49% | 1.08% | 36.45% | 0.82% | 31.04% | 0.26% |

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

添富全球医疗混合(QDII)人民币累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



添富全球医疗混合(QDII)美元累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年08月16日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5号文批准，于2005年2月3日正式成立。目前，公司注册资本金为132,724,224元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人及QFII基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2020 上半年，汇添富基金新成立 11 只公开募集证券投资基金，包括 4 只债券型基金、5 只混合型基金、1 只基金中基金、1 只指数基金联接基金。截至 2020 年 6 月 30 日，公司共管理 154 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

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（年） | 说明 |
|----|----------|------------------|------|-----------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘江 | 本基金的基金经理 | 2017 年 08 月 16 日 | | 9 | 国籍：中国。学历：清华大学工学硕士，德国亚琛工大工学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司任医药行业分析师，2015 年 6 月 18 日至今任汇添富医疗服务混合基金的基金经理，2017 年 8 月 16 日至今任添富全球医疗混合(QDII)基金的基金经理，2018 年 7 月 5 日至今任添富 3 年封闭配售混合（LOF）基金的基金经理，2018 年 8 月 8 日至 2020 年 5 月 29 日任添富创新医药混合基金的基金经理，2019 年 5 月 6 日至今任汇添富科技创新混合基金的基金经理。 |

注:1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，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最大利益。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、营运、风险管理以及合规稽核等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

对于同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）同买或者同卖同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。根据95%置信区间下平均价差率的T检验显著程度、同向交易占优比等方面进行综合分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。本报告期内，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本公司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%的情况有34次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020年二季度，新冠疫情的发展进入新的阶段，虽然中国迅速控制住疫情，但全球情况不容乐观。尤其是美国仓促复工又加重了感染，巴西、印度等人口巨大的发展中国家感染率不断攀升。疫苗研发进展喜忧参半，但总体判断认为大规模人群推广，仍需较长时日。这些均提示我们要考虑新冠问题的长期性。

疫情对全球经济的冲击较为巨大，为了对冲其影响，各国纷纷开启不同的宽松模式，市场上宽裕的资金使得资本市场的表现独立于实体经济之外。资本市场初步也是以不受疫情冲击影响、或者成长型资产的突出表现为主，但随着成长型资产价格开始出现一定的泡沫，不排除后续市场风格震荡的可能。

中国医药产业，在疫情稳住之后，监管政策逐渐也有露头，但目前尚不构成重大的潜在意外风险。在创新医药和创新器械等各种医药细分领域，不断呈现技术驱动商业的成长特征，使得长期可持续成长的公司。

港股医药随着大量优质新股上市，已经成为中国医药市场的有力补充。其中 biotech、创新器械都有不少可圈可点的公司值得重点投资。

美股医药相对表现逊于美股科技板块，但美股医药中科技属性较强的资产仍然成长动力强劲，存在价值重估的机会。

总体上，无论当下经济活动如何波动，优质医药公司大体上还是能够保持强劲的基本面表现，相信在这种变局巨大的市场里面，仍然能够给投资者创造安心的收益。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期截止6月30日，本基金按人民币计价的净值为1.7762，报告期收益率为41.42%，同期比较基准收益率为15.56%，本基金相对比较基准领先25.86个百分点；按美元计价的净值为1.6749，报告期收益率为39.35%，本基金相对比较基准领先23.79个百分点。两个币种净值的差异，主要来自于人民币兑美元汇率的波动。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新冠疫情本身，对中国医药行业的影响实际上是好坏参半。中国由于执行了严格的隔离政策，导致医院门诊量出现大幅度下降，这使得医疗医药需求被阶段性压制或者推迟。但与此同时，辅助医疗场所开始迎来需求流量的暴增，比如线上问诊、网络售药、连锁药店等。此外，全球各国补充医疗设备、疫情诊治相关耗材的需求则拉动了呼吸机、试剂、PPE（个人防护装备）等业绩销量的暴增，中国制造再次成为焦点。

对于美国医药投资市场，针对新冠病毒的各种疫苗技术路线，包括 mRNA 疫苗、腺病毒疫苗、重组蛋白疫苗、灭活疫苗等，引发了资本的高度关注。各种小分子特效药、中和抗体

也逐渐加速进入临床。与过去数千年来人类遭遇的各种瘟疫不同，这一次我们看到了技术与病毒开始赛跑，并有相当程度的取胜把握，这是生物科技技术进步带来的希望之所在。

由于新冠疫情已经实现了全球的充分扩张分布，无论任何人种，发达国家、发展中国家、北半球国家、南半球国家均深陷疫情泥潭。目前来看，此次新冠疫情大概率会长期与人类共存。疫情的完全结束时间将高度依赖于验证有效、并可大规模注射的疫苗的全面推广。由于新冠病毒极强的传染性和隐蔽性，在疫苗大规模推广之前，新冠病毒只会阶段性收缩，而很难彻底消失。在此之前，经济的暂停与收缩很可能长期持续。所有国家都需要在感染持续与经济重启之间，取得一个均衡值。对资本市场的影响可谓深远。

除去疫情之外，中国医药行业也已经经历了几轮医药政策的洗礼，医保局形成的中国医药购销及定价体系也已经逐渐稳定，行业风气向价值创造、技术创新转移，市场形成了相对较为稳定的预期。这些都有助于优质医药公司迈入新的长期增长轨道。

美国医药市场的主要不确定性因素，在于政治选举周期来临，各种针对高药价、高医疗负担的政治操作会频繁出现。类似于胰岛素降价法案、医保返利取消等政策，阶段性都会冲击美股核心医药公司的估值。但我们现在判断，这些仍不至于构成对美国医药体系的深层次调整。

全球视角来看，因为基因组学、蛋白组学等学科的进步，使得医药产业出现近似“技术爆炸”的投资特征，新技术往商业应用的转换，带来治疗术式、诊疗指南的调整，这些都会打开新医疗器械、创新药品的成长空间。

目前来看，各种技术进步不断出现，产品创新层出不穷，优秀公司此消彼长，成长型投资可能依然是接下来医药投资的主流。

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，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，应参照协会通知执行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部、风险管理及合规稽核人员、基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员

会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别每份基金份额享有同等分配权。

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富全球医疗保健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，汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富全球医疗保健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，汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富全球医疗保健混合

型证券投资基金 2020 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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2020 年 06 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 94,727,211.87 | 43,280,291.51 |
| 结算备付金 | | 4,342,496.92 | 954,759.56 |
| 存出保证金 | | 59,538.44 | 48,704.75 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 417,084,075.70 | 146,821,711.12 |
| 其中：股票投资 | | 416,600,028.50 | 146,234,878.55 |
| 基金投资 | | - | 586,832.57 |
| 债券投资 | | 484,047.20 | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 9,230,041.16 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 6,937.02 | 929.97 |
| 应收股利 | | 220,144.01 | 58,852.18 |
| 应收申购款 | | 10,014,629.27 | 665,606.46 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 526,455,033.23 | 201,060,896.71 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2020 年 06 月 30 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 22,018,618.04 | - |
| 应付赎回款 | | 9,987,436.65 | 2,496,122.75 |
| 应付管理人报酬 | | 661,184.96 | 306,080.65 |
| 应付托管费 | | 128,563.72 | 59,515.69 |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 510,037.13 | 126,499.57 |
| 应交税费 | | 3.03 | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 97,756.97 | 311,299.29 |
| 负债合计 | | 33,403,600.50 | 3,299,517.95 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 277,593,986.61 | 157,460,657.24 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 215,457,446.12 | 40,300,721.52 |
| 所有者权益合计 | | 493,051,432.73 | 197,761,378.76 |
| 负债和所有者权益总计 | | 526,455,033.23 | 201,060,896.71 |

注：报告截止日2020年06月30日，基金份额总额244,049,560.56份。本基金下属添富全球医疗混合(QDII)人民币基金份额净值1.7762元，基金份额总额238,141,779.70份；本基金下属添富全球医疗混合(QDII)美元基金份额净值1.6749元，基金份额总额5,907,780.86份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2020年01月01日 至2020年06月30 日 | 上年度可比期间 2019年01月01日 至2019年06月30 日 |
|-------------------|------------|---------------------------------------|--|
| 一、收入 | | 119,585,533.82 | 50,203,060.94 |
| 1. 利息收入 | | 99,332.79 | 186,327.83 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 99,239.76 | 186,327.83 |
| 债券利息收入 | | 93.03 | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 56,382,864.23 | 16,242,220.50 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 59,208,900.40 | 19,192,988.85 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | -3,452,722.55 | -3,258,853.87 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.14.2 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.16 | - | -366,730.00 |
| 股利收益 | 6.4.7.17 | 626,686.38 | 674,815.52 |

| | | | |
|----------------------------|------------|-----------------------|----------------------|
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 61,345,739.14 | 34,049,447.39 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | 1,020,504.60 | -324,966.48 |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.19 | 737,093.06 | 50,031.70 |
| 减：二、费用 | | 5,161,498.70 | 4,151,201.01 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 2,672,015.29 | 2,111,932.42 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 519,558.57 | 410,653.55 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.20 | 1,861,529.96 | 1,473,817.78 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 0.32 | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.21 | 108,394.56 | 154,797.26 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 114,424,035.12 | 46,051,859.93 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 114,424,035.12 | 46,051,859.93 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020年06月30日 | | |
|--|-------------------------------|----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 157,460,657.24 | 40,300,721.52 | 197,761,378.76 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 114,424,035.12 | 114,424,035.12 |
| 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） | 120,133,329.37 | 60,732,689.48 | 180,866,018.85 |
| 其中：1. 基金申购款 | 257,982,615.11 | 120,891,885.88 | 378,874,500.99 |
| 2. 基金赎回款 | -137,849,285.74 | -60,159,196.40 | -198,008,482.14 |
| 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) | 277,593,986.61 | 215,457,446.12 | 493,051,432.73 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2019年01月01日至2019年06月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 289,739,457.58 | -14,829,595.20 | 274,909,862.38 |
| 二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润) | - | 46,051,859.93 | 46,051,859.93 |
| 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) | -94,103,199.72 | -2,203,490.75 | -96,306,690.47 |
| 其中：1. 基金申购款 | 21,435,407.80 | 1,576,059.84 | 23,011,467.64 |
| 2. 基金赎回款 | -115,538,607.52 | -3,779,550.59 | -119,318,158.11 |
| 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) | 195,636,257.86 | 29,018,773.98 | 224,655,031.84 |

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：

张晖

李骁

雷青松

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

汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2230号文《关于准予汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于2017年8月16日生效,首次设立募集规模为746,998,461.45份人民币基金份额和5,945,011.22份美元基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富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，境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brothers Harriman & Co.）。

针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（以下无特别说明，均包括 exchange traded fund, ETF）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股（包括港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票）、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品、与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具，具体包括：股票（包含中小板、创业板、其他依法上市的股票），衍生工具（股指期货、权证、国债期货、股票期权等），债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等固定收益类资产以及现金；法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金为对冲外币的汇率风险，可以投资于外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易、境内融资交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。本基金采用自下而上的方法，精选全球医疗保健行业相关公司的股票进行投资布局，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。本基金业绩比较基准为：标普全球 1200 医疗保健指数(S&P Global 1200 Health Care Sector Index)收益率×40%+中证医药卫生指数收益率×40%+一年期人民币定期存款利率(税后)×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证

券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2020年06月30日的财务状况以及2020年01月01日至2020年06月30日的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金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。对本基金在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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

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

6.4.6.1 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款 | 94,727,211.87 |
| 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 | 94,727,211.87 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月30日 | | |
|---------------|--------------------|----------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 342,471,575.16 | 416,600,028.50 | 74,128,453.34 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 484,047.20 | 120,047.20 |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 境外OTC市场 | - | - |
| | 合计 | 484,047.20 | 120,047.20 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 342,835,575.16 | 417,084,075.70 | 74,248,500.54 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月30日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息 | 4,885.91 |
| 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 | 1,928.57 |
| 应收债券利息 | 95.74 |
| 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 | 26.80 |
| 合计 | 6,937.02 |

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 510,037.13 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 510,037.13 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 8,249.37 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付审计费 | 29,835.26 |
| 应付信息披露费 | 59,672.34 |
| 应付指数使用费 | - |
| 应付账户维护费 | - |
| 应付汇划费 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 97,756.97 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 添富全球医疗混合(QDII)人民币 | | |
|-------------------|---------------------------|-----------------|
| 项目 | 本期2020年01月01日至2020年06月30日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 120,253,338.35 | 120,253,090.53 |
| 本期申购 | 231,705,948.57 | 231,707,634.00 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -113,817,507.22 | -113,818,304.30 |
| 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 | 238,141,779.70 | 238,142,420.23 |
| 添富全球医疗混合(QDII)美元 | | |

| 项目 | 本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 | |
|----------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额 (份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 5,571,756.41 | 37,207,566.71 |
| 本期申购 | 3,934,610.35 | 26,274,981.11 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -3,598,585.90 | -24,030,981.44 |
| 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 | 5,907,780.86 | 39,451,566.38 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 添富全球医疗混合(QDII)人民币 | | | |
|-------------------|----------------|---------------|----------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 34,355,211.19 | -3,566,317.17 | 30,788,894.02 |
| 本期利润 | 44,386,471.09 | 51,465,447.70 | 95,851,918.79 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 44,399,559.68 | 13,815,504.83 | 58,215,064.51 |
| 其中：基金申购款 | 88,307,457.42 | 21,203,010.38 | 109,510,467.80 |
| 基金赎回款 | -43,907,897.74 | -7,387,505.55 | -51,295,403.29 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 123,141,241.96 | 61,714,635.36 | 184,855,877.32 |
| 添富全球医疗混合(QDII)美元 | | | |
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 10,620,050.50 | -1,108,223.00 | 9,511,827.50 |
| 本期利润 | 8,691,824.89 | 9,880,291.44 | 18,572,116.33 |
| 本期基金份额交易 | 1,074,477.00 | 1,443,147.97 | 2,517,624.97 |

| | | | |
|----------|---------------|---------------|---------------|
| 产生的变动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | 9,727,261.91 | 1,654,156.17 | 11,381,418.08 |
| 基金赎回款 | -8,652,784.91 | -211,008.20 | -8,863,793.11 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 20,386,352.39 | 10,215,216.41 | 30,601,568.80 |

6.4.7.11 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06月30日 |
| 活期存款利息收入 | 87,955.26 |
| 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 | 7,833.79 |
| 其他 | 3,450.71 |
| 合计 | 99,239.76 |

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 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06月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 723,643,283.71 |
| 减：卖出股票成本总额 | 664,434,383.31 |
| 买卖股票差价收入 | 59,208,900.40 |

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|-------------------------|
| | 2020年01月01日至2020年06月30日 |
| 卖出/赎回基金成交总额 | 20,547,480.80 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 24,000,203.35 |
| 基金投资收益 | -3,452,722.55 |

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|-------------------------|
| | 2020年01月01日至2020年06月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 623,729.37 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | 2,957.01 |
| 合计 | 626,686.38 |

6.4.7.18 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06月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 61,345,739.14 |
| ——股票投资 | 60,892,220.52 |
| ——债券投资 | 120,047.20 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | 333,471.42 |
| ——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 | 61,345,739.14 |

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2020年01月01日至2020年06月30日 |
|---------|-------------------------|
| 基金赎回费收入 | 737,093.06 |
| 替代损益 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 737,093.06 |

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|-------------------------|
| | 2020年01月01日至2020年06月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 1,839,639.04 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 交易基金产生的费用 | 21,890.92 |
| 合计 | 1,861,529.96 |

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|-------------------------|
| | 2020年01月01日至2020年06月30日 |
| 审计费用 | 29,835.26 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费 | 18,600.00 |
| 银行费用 | 113.00 |
| 指数使用费 | - |
| 持有人大会-公证费 | - |
| 持有人大会-律师费 | - |
| 开户费 | - |
| 上市费 | - |
| 其他 | 173.96 |
| 合计 | 108,394.56 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金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。

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 |
|--|-------------------------|
| 汇添富基金管理股份有限公司 | 基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构 |
| 中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”) | 基金托管人, 基金代销机构 |
| 布朗兄弟哈里曼银行 (Brown Brothers Harriman & Co.) (“布朗兄弟”) | 基金境外托管人 |
| 东方证券股份有限公司 (“东方证券”) | 基金管理人的股东, 基金代销机构 |

注：以下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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 | | 上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 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 (%) |
| 东方证券 | 776,746,145.60 | 48.62 | 684,035,203.36 | 50.79 |

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 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 (%) |
| 东方证券 | 683,169.37 | 74.51 | 510,037.13 | 100.00 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 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 (%) |
| 东方证券 | 614,875.53 | 79.38 | 192,926.43 | 100.00 |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日 |
|-----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,672,015.29 | 2,111,932.42 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 979,579.49 | 689,869.63 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020 年06月30日 | 上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 519,558.57 | 410,653.55 |

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注:本基金本报告期末不存在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。

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

注:本基金本报告期末不存在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。

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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 | | 上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日 | |
|-------|---------------------------------------|-----------|--|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 工商银行 | 60,479,418.78 | 60,293.97 | 18,596,404.56 | 52,267.07 |
| 布朗兄弟 | 34,247,793.09 | 27,661.29 | 31,929,401.33 | 124,803.15 |

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。此外，基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险

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

本基金所持证券均在证券交易所上市; 因此, 除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外, 本报告期末本基金的其他资产均能及时变现。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求, 并同时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。

本报告期内, 本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金、债券投资、买入返售金融资产及部分应收申购款等。本基金的生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

| | | | | | | | |
|--------|-------|-------|--------|-----|-----|-----|----|
| 本期末 | | | | | | | |
| 2020 年 | 1 个月以 | 1-3 个 | 3 个月-1 | 1-5 | 5 年 | 不计息 | 合计 |
| 06 月 | 内 | 月 | 年 | 年 | 以上 | | |
| 30 日 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|----------|---------------|---|------------|---|---|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 94,727,211.87 | - | - | - | - | - | 94,727,211.87 |
| 结算备付金 | 3,573,343.49 | - | - | - | - | 769,153.43 | 4,342,496.92 |
| 存出保证金 | 59,538.44 | - | - | - | - | - | 59,538.44 |
| 交易性金融资产 | - | - | 484,047.20 | - | - | 416,600,028.50 | 417,084,075.70 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 220,144.01 | 220,144.01 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 6,937.02 | 6,937.02 |
| 应收申购款 | 687,313.57 | - | - | - | - | 9,327,315.7 | 10,014,629.27 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 99,047,407.37 | - | 484,047.20 | - | - | 426,923,578.66 | 526,455,033.23 |
| 负债 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|-----------|-----------|---|----------|---|---|---------------|----------------|
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 9,987,436.65 | 9,987,436.65 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 661,184.96 | 661,184.96 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 128,563.72 | 128,563.72 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 22,018,618.04 | 22,018,618.04 |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 510,037.13 | 510,037.13 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 3.03 | 3.03 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 97,756.97 | 97,756.97 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 33,403,600.50 | 33,403,600.50 |
| 利率敏感 | 99,047.40 | - | 484,047. | - | - | 393,519.97 | 493,051,432.73 |

| | | | | | | | |
|-----------------|---------------|-------|--------|------|------|----------------|----------------|
| 感度缺口 | 7.37 | | 20 | | | 8.16 | |
| 上年度末2019年12月31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 银行存款 | 43,280,291.51 | - | - | - | - | - | 43,280,291.51 |
| 结算备付金 | 185,606.13 | - | - | - | - | 769,153.43 | 954,759.56 |
| 存出保证金 | 48,704.75 | - | - | - | - | - | 48,704.75 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 146,821,711.12 | 146,821,711.12 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 58,852.18 | 58,852.18 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 929.97 | 929.97 |
| 应收申购款 | 37,892.89 | - | - | - | - | 627,713.57 | 665,606.46 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 9,230,041.16 | 9,230,041.16 |
| 买入返 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|-------------------|-------------------|---|---|---|---|--------------------|----------------|
| 售金融 资产 | | | | | | | |
| 其他资 产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总 计 | 43,552,49 5.28 | - | - | - | - | 157,508,40 1.43 | 201,060,896.71 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎 回款 | - | - | - | - | - | 2,496,122. 75 | 2,496,122.75 |
| 应付管 理人报 酬 | - | - | - | - | - | 306,080.65 | 306,080.65 |
| 应付托 管费 | - | - | - | - | - | 59,515.69 | 59,515.69 |
| 应付证 券清算 款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回 购金融 资产款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付销 售服务 费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付交 易费用 | - | - | - | - | - | 126,499.57 | 126,499.57 |
| 应交税 费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利 息 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|---------|-------------------|---|---|---|---|--------------------|----------------|
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 311,299.29 | 311,299.29 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 3,299,517.95 | 3,299,517.95 |
| 利率敏感度缺口 | 43,552.49 5.28 | - | - | - | - | 154,208.88 3.48 | 197,761,378.76 |

注:上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注:本基金本报告期及上年度末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款,且均以活期存款利率或相对固定的利率计息;假定利率变动仅影响其未来收益,而对其本身的公允价值无重大影响,因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下,利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债,因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位:人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 06 月 30 日 | | | |
|----------|----------------------|----------------|-----------|----------------|
| | 美元折合人民币 | 港币折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 银行存款 | 29,714,597.32 | 14,181,135.74 | - | 43,895,733.06 |
| 结算备付金 | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - |
| 交易性金融资 | 140,993,715.80 | 119,633,547.39 | - | 260,627,263.19 |

| | | | | |
|---------------|-----------------------|----------------|-----------|----------------|
| 产 | | | | |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - |
| 应收利息 | 125.87 | - | - | 125.87 |
| 应收股利 | 58,797.30 | 160,741.11 | - | 219,538.41 |
| 应收申购款 | 721,027.89 | - | - | 721,027.89 |
| 其他资产 | - | - | - | - |
| 资产总计 | 171,488,264.18 | 133,975,424.24 | - | 305,463,688.42 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | 3,441,881.01 | 2,780,420.68 | - | 6,222,301.69 |
| 应付赎回款 | 316,482.75 | - | - | 316,482.75 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - |
| 应付托管费 | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - |
| 其他负债 | 339.39 | - | - | 339.39 |
| 负债合计 | 3,758,703.15 | 2,780,420.68 | - | 6,539,123.83 |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 167,729,561.03 | 131,195,003.56 | - | 298,924,564.59 |
| | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 | | | |
| 项目 | 美元折合人民币 | 港币折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 银行存款 | 18,939,976.91 | 18,705,371.49 | - | 37,645,348.40 |

| | | | | |
|-------------------|----------------|---------------|---|----------------|
| 结算备付金 | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | 75,425,251.26 | 43,257,040.64 | - | 118,682,291.90 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | 9,153,751.56 | - | - | 9,153,751.56 |
| 应收利息 | 51.48 | - | - | 51.48 |
| 应收股利 | 54,651.84 | 4,200.34 | - | 58,852.18 |
| 应收申购款 | 137,468.88 | - | - | 137,468.88 |
| 其他资产 | - | - | - | - |
| 资产总计 | 103,711,151.93 | 61,966,612.47 | - | 165,677,764.40 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | 942,542.94 | - | - | 942,542.94 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - |
| 应付托管费 | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - |
| 其他负债 | 264.33 | - | - | 264.33 |
| 负债合计 | 942,807.27 | - | - | 942,807.27 |
| 资产负债表外 汇风险敞口净额 | 102,768,344.66 | 61,966,612.47 | - | 164,734,957.13 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| | | | |
|----|---|-----------------------------|-----------------------|
| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑管理人人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。 | | |
| 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 06 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
| | 港币相对人民币贬值 5% | -6,559,750.18 | -3,098,330.62 |
| | 港币相对人民币升值 5% | 6,559,750.18 | 3,098,330.62 |
| | 美元相对人民币贬值 5% | -8,386,478.05 | -5,138,417.23 |
| | 美元相对人民币升值 5% | 8,386,478.05 | 5,138,417.23 |

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2020 年 06 月 30 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 | 416,600,028.50 | 84.49 | 146,234,878.55 | 73.95 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | 586,832.57 | 0.30 |
| 交易性金融资产—债券投资 | 484,047.20 | 0.10 | - | - |
| 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 | 417,084,075.70 | 84.59 | 146,821,711.12 | 74.24 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--|-----------------------------|-----------------------|
| 假设 | 1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； | | |
| | 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。 | | |
| 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 06 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
| | 标普全球 1200 医疗保健指数（S&P Global 1200 Health Care Sector Index）收益率上涨 5% | 12,346,785.57 | 6,327,836.94 |
| | 标普全球 1200 医疗保健指数（S&P Global 1200 Health Care Sector Index）收益率下跌 5% | -12,346,785.57 | -6,327,836.94 |

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，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 | 416,600,028.50 | 79.13 |
| | 其中：普通股 | 399,616,107.80 | 75.91 |
| | 存托凭证 | 16,983,920.70 | 3.23 |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 484,047.20 | 0.09 |
| | 其中：债券 | 484,047.20 | 0.09 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 99,069,708.79 | 18.82 |
| 8 | 其他各项资产 | 10,301,248.74 | 1.96 |
| 9 | 合计 | 526,455,033.23 | 100.00 |

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 54,803,915.46 元，占期末净值比例为 11.12%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值 | 占基金资产净值比例 |
|--------|------|-----------|
|--------|------|-----------|

| | | (%) |
|------|----------------|-------|
| 中国 | 155,972,765.31 | 31.63 |
| 美国 | 140,993,715.80 | 28.60 |
| 中国香港 | 119,633,547.39 | 24.26 |
| 合计 | 416,600,028.50 | 84.49 |

注：按公允价值占基金资产净值比例从大到小排序；国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；此处股票包括普通股和优先股；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|---------|----------------|------------------|
| 10 能源 | - | - |
| 15 原材料 | - | - |
| 20 工业 | 5,077,330.07 | 1.03 |
| 25 可选消费 | 14,520,672.16 | 2.95 |
| 30 日常消费 | 14,534,266.03 | 2.95 |
| 35 医疗保健 | 357,708,402.59 | 72.55 |
| 40 金融 | - | - |
| 45 信息技术 | 24,503,850.21 | 4.97 |
| 50 电信服务 | 91,088.24 | 0.02 |
| 55 公用事业 | - | - |
| 60 房地产 | 164,419.20 | 0.03 |
| 合计 | 416,600,028.50 | 84.49 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---|---------------------|---------|---------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | Chongqing Zhifei Biological Products Co., Ltd. | 重庆智飞生物制品股份有限公司 | 300122 | 深圳证券交易所 | 中国 | 160,127 | 16,036,719.05 | 3.25 |
| 2 | Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Limited | 山东威高集团医用高分子制品股份有限公司 | 1066 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 800,000 | 12,598,164.48 | 2.56 |
| 3 | Pharmaron Beijing Co., Ltd. | 康龙化成(北京)新药技术股份有限公司 | 300759 | 深圳证券交易所 | 中国 | 60,000 | 5,904,000.00 | 1.20 |
| 3 | Pharmaron Beijing Co., Ltd. | 康龙化成(北京)新药技术股份有限公司 | 3759 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 77,800 | 5,685,250.56 | 1.15 |
| 4 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC / MA | 福泰制药公司 | VRTX US | 纳斯达克交易所 | 美国 | 5,623 | 11,556,668.75 | 2.34 |
| 5 | NOVO NORDISK A S | 诺和诺德公司 | NVO US | 纽约证券交易所 | 美国 | 24,711 | 11,455,171.02 | 2.32 |
| 6 | Shanghai Junshi | 上海君实生物医药科技 | 1877 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 221,200 | 11,284,656.03 | 2.29 |

| | | | | | | | | |
|----|---|----------------|---------|---------|------|---------|---------------|------|
| | Biosciences Co., Ltd. | 股份有限公司 | | | | | | |
| 7 | Yifeng Pharmacy Chain Co., Ltd. | 益丰大药房连锁股份有限公司 | 603939 | 上海证券交易所 | 中国 | 122,220 | 11,122,020.00 | 2.26 |
| 8 | Alibaba Health Information Technology Limited | 阿里健康信息技术有限公司 | 241 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 532,000 | 10,982,471.81 | 2.23 |
| 9 | Bgi Genomics Co., Ltd | 深圳华大基因股份有限公司 | 300676 | 深圳证券交易所 | 中国 | 70,000 | 10,913,700.00 | 2.21 |
| 10 | Shandong Pharmaceutical Glass Co., Ltd | 山东省药用玻璃股份有限公司 | 600529 | 上海证券交易所 | 中国 | 186,257 | 10,802,906.00 | 2.19 |
| 11 | Guangzhou Wondfo Biotech Co., Ltd | 广州万孚生物技术股份有限公司 | 300482 | 深圳证券交易所 | 中国 | 100,300 | 10,431,200.00 | 2.12 |
| 12 | DexCom Inc | 德康医疗公司 | DXCM US | 纳斯达克交易所 | 美国 | 3,617 | 10,380,895.98 | 2.11 |
| 13 | Winning Health Technology Group Co., Ltd. | 卫宁健康科技集团股份有限公司 | 300253 | 深圳证券交易所 | 中国 | 449,930 | 10,321,394.20 | 2.09 |

| | | | | | | | | |
|----|--|------------------------------|------------|-------------|----------|-------------|------------------|------|
| 14 | REGENERON PHARMACEUTIC ALS INC | 再生元制药 股份有限公 司 | REGN US | 纳斯达克 交易所 | 美国 | 2,151 | 9,496,9 45.01 | 1.93 |
| 15 | ILLUMINA INC | | ILMN US | 纳斯达克 交易所 | 美国 | 3,556 | 9,323,4 50.89 | 1.89 |
| 16 | Wuxi Biologics (Cayman) Inc | 药明生物技 术有限公司 | 2269 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 68,500 | 8,872,5 16.75 | 1.80 |
| 17 | Innovent Biologics, Inc. | 信达生物制 药 | 1801 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 167,00 0 | 8,771,3 07.60 | 1.78 |
| 18 | Jiangsu Hengrui Medicine Co.,Ltd. | 江苏恒瑞医 药股份有限 公司 | 600276 | 上海证券 交易所 | 中国 | 84,026 | 7,755,5 99.80 | 1.57 |
| 19 | Hangzhou Tigermed Consulting Co., Ltd. | 杭州泰格医 药科技股份 有限公司 | 300347 | 深圳证券 交易所 | 中国 | 75,054 | 7,646,5 01.52 | 1.55 |
| 20 | UNITEDHEALTH GROUP INC | 联合健康集 团公司 | UNH US | 纽约证券 交易所 | 美国 | 3,596 | 7,508,8 02.30 | 1.52 |
| 21 | Joinn Laboratories (China) Co.,Ltd. | 北京昭衍新 药研究中心 股份有限公 司 | 603127 | 上海证券 交易所 | 中国 | 70,094 | 7,368,9 82.22 | 1.49 |
| 22 | Shenzhen Mindray Bio- Medical Electronics | 深圳迈瑞生 物医疗电子 股份有限公 司 | 300760 | 深圳证券 交易所 | 中国 | 24,000 | 7,336,8 00.00 | 1.49 |

| | | | | | | | | |
|----|---|-------------------------|------------|-------------|----------|-------------|------------------|------|
| | Co., Ltd. | | | | | | | |
| 23 | Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co., Ltd. | 美年大健康 产业控股股 份有限公司 | 002044 | 深圳证券 交易所 | 中国 | 500,00 0 | 7,205,0 00.00 | 1.46 |
| 24 | Tesla, Inc. | 特斯拉 | TSLA US | 纳斯达克 交易所 | 美国 | 882 | 6,742,4 62.14 | 1.37 |
| 25 | Hansoh Pharmaceutic al Group Company Limited | 翰森制药集 团有限公司 | 3692 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 194,00 0 | 6,468,0 68.64 | 1.31 |
| 26 | North China Pharmaceutic al Company.Ltd | 华北制药股 份有限公司 | 600812 | 上海证券 交易所 | 中国 | 500,00 0 | 6,445,0 00.00 | 1.31 |
| 27 | Sinocare Inc. | 三诺生物传 感股份有限 公司 | 300298 | 深圳证券 交易所 | 中国 | 200,00 0 | 6,428,0 00.00 | 1.30 |
| 28 | Edwards Lifesciences Corp | 爱德华兹生 命科学公司 | EW US | 纽约证券 交易所 | 美国 | 12,651 | 6,189,6 81.96 | 1.26 |
| 29 | Jinxin Fertility Group Limited | 锦欣生殖医 疗集团有限 公司 | 1951 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 568,00 0 | 6,091,1 10.22 | 1.24 |
| 30 | Autobio Diagnostics | 郑州安图生 物工程股份 | 603658 | 上海证券 交易所 | 中国 | 35,641 | 5,789,5 24.04 | 1.17 |

| | | | | | | | | |
|----|--|-------------------------------|------------|-------------|----------|-------------|------------------|------|
| | Co., Ltd. | 有限公司 | | | | | | |
| 31 | CSPC Pharmaceutic al Group Limited | 石药集团有 限公司 | 1093 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 432,00 0 | 5,777,0 33.01 | 1.17 |
| 32 | PayPal Holdings, Inc. | | PYPL US | 纳斯达克 交易所 | 美国 | 4,573 | 5,640,6 18.46 | 1.14 |
| 33 | Betta Pharmaceutic als Co.,Ltd | 贝达药业股 份有限公司 | 300558 | 深圳证券 交易所 | 中国 | 39,956 | 5,593,0 40.88 | 1.13 |
| 34 | Beijing Chunlizhengd a Medical Instruments Co., Ltd. | 北京市春立 正达医疗器 械股份有限 公司 | 1858 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 115,50 0 | 5,570,5 22.50 | 1.13 |
| 35 | Viva Biotech Holdings | 维亚生物科 技控股集团 | 1873 HK | | | 700,00 0 | 5,550,0 61.44 | 1.13 |
| 36 | Schrodinger, Inc. | | SDGR US | 纳斯达克 交易所 | 美国 | 8,350 | 5,413,0 52.96 | 1.10 |
| 37 | Adobe Inc | 奥多比公司 | ADBE US | 纳斯达克 交易所 | 美国 | 1,717 | 5,291,4 11.36 | 1.07 |
| 38 | 10x Genomics, Inc. | | TXG US | 纳斯达克 交易所 | 美国 | 8,340 | 5,273,1 33.01 | 1.07 |
| 39 | INTUITIVE SURGICAL INC | 直觉外科手 术公司 | ISRG US | 纳斯达克 交易所 | 美国 | 1,293 | 5,216,1 06.15 | 1.06 |
| 40 | CanSino Biologics | 康希诺生物 股份公司 | 6185 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 26,200 | 5,116,6 88.97 | 1.04 |

| | | | | | | | | |
|----|---|------------------------------|------------|-------------|----------|---------------|------------------|------|
| | Inc. | | | | | | | |
| 41 | DANAHER CORP /DE/ | 丹纳赫公司 | DHR US | 纽约证券 交易所 | 美国 | 3,999 | 5,006,2 20.07 | 1.02 |
| 42 | CStone Pharmaceutic als | 基石药业 | 2616 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 487,00 0 | 4,919,9 88.80 | 1.00 |
| 43 | VEEVA SYSTEMS INC | | VEEV US | 纽约证券 交易所 | 美国 | 2,940 | 4,879,1 54.59 | 0.99 |
| 44 | MicroPort Scientific Corporation | 微创医疗科 学有限公司 | 853 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 170,00 0 | 4,844,8 85.76 | 0.98 |
| 45 | LifeTech Scientific Corporation | 先健科技公 司 | 1302 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 1,900, 000 | 4,234,7 07.84 | 0.86 |
| 46 | Merck & Co., Inc. | 默克集团 | MRK US | 纽约证券 交易所 | 美国 | 7,674 | 4,201,1 90.66 | 0.85 |
| 47 | Exact Sciences Corp | 精密科学公 司 | EXAS US | 纳斯达克 交易所 | 美国 | 6,668 | 4,104,0 98.86 | 0.83 |
| 48 | Teladoc Health, Inc. | | TDOC US | 纽约证券 交易所 | 美国 | 3,009 | 4,065,3 14.81 | 0.82 |
| 49 | Shanghai MicroPort Endovascular MedTech Co., Ltd. | 上海微创心 脉医疗科技 股份有限公 司 | 688016 | 上海证券 交易所 | 中国 | 10,127 | 3,516,7 02.02 | 0.71 |
| 50 | Ak Medical Holdings Limited | 爱康医疗控 股有限公司 | 1789 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 142,00 0 | 3,197,3 14.03 | 0.65 |

| | | | | | | | | |
|----|--|----------------|---------|---------|------|---------|--------------|------|
| 51 | NIO Inc. | 蔚来汽车 | NIO US | 纽约证券交易所 | 美国 | 50,000 | 2,732,687.00 | 0.55 |
| 52 | Staar Surgical Co | | STAA US | 纳斯达克交易所 | 美国 | 6,080 | 2,648,888.37 | 0.54 |
| 53 | Jaftron Biomedical Co., Ltd. | 健帆生物科技集团股份有限公司 | 300529 | 深圳证券交易所 | 中国 | 38,000 | 2,641,000.00 | 0.54 |
| 54 | China Feihe Limited | 中国飞鹤有限公司 | 6186 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 171,000 | 2,424,196.68 | 0.49 |
| 55 | Guardant Health, Inc. | | GH US | 纳斯达克交易所 | 美国 | 4,092 | 2,350,280.44 | 0.48 |
| 56 | Burning Rock Biotech Ltd | 燃石医学 | BNR US | 纳斯达克交易所 | 美国 | 10,000 | 1,912,172.95 | 0.39 |
| 57 | Kangji Medical Holdings Limited | 康基医疗控股有限公司 | 9997 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 60,000 | 1,633,230.72 | 0.33 |
| 58 | Shenzhen Kangtai Biological Products Co., Ltd. | 深圳康泰生物制品股份有限公司 | 300601 | 深圳证券交易所 | 中国 | 10,000 | 1,621,600.00 | 0.33 |
| 59 | VISA INC. | VISA 公司 | V US | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,160 | 1,586,354.54 | 0.32 |
| 60 | AMAZON COM INC | 亚马逊公司 | AMZN US | 纳斯达克交易所 | 美国 | 81 | 1,582,016.36 | 0.32 |
| 61 | Frontage Holdings Corporation | 方达控股公司 | 1521 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 302,000 | 1,324,122.62 | 0.27 |

| | | | | | | | | |
|----|---|------------------|------------|---------|------|--------|--------------|------|
| 62 | Planet Fitness, Inc. | 星球健身公司 | PLNT US | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,897 | 1,242,249.00 | 0.25 |
| 63 | Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co., Ltd. | 广州金域医学检验集团股份有限公司 | 603882 | 上海证券交易所 | 中国 | 12,200 | 1,091,900.00 | 0.22 |
| 64 | Meituan Dianping | 美团点评 | 3690 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 6,800 | 1,067,738.28 | 0.22 |
| 65 | Dashenlin Pharmaceutical Group Co., Ltd. | 大参林医药集团股份有限公司 | 603233 | 上海证券交易所 | 中国 | 10,800 | 877,176.00 | 0.18 |
| 66 | ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICALS LTD | 漳州片仔癀药业股份有限公司 | 600436 | 上海证券交易所 | 中国 | 5,028 | 856,017.00 | 0.17 |
| 67 | China Tourism Group Duty Free Corporation Limited | 中国旅游集团中免股份有限公司 | 601888 | 上海证券交易所 | 中国 | 5,200 | 800,956.00 | 0.16 |
| 68 | TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | TAKE-TWO 互动软件公司 | TTWO US | 纳斯达克交易所 | 美国 | 759 | 749,957.13 | 0.15 |
| 69 | Lepu Medical | 乐普(北京) | 300003 | 深圳证券 | 中国 | 20,000 | 730,400 | 0.15 |

| | | | | | | | | |
|----|---|--------------------------------|------------|-------------|----------|--------|----------------|------|
| | Technology (Beijing) Co., Ltd. | 医疗器械股 份有限公司 | | 交易所 | | | .00 | |
| 70 | RESMED INC | 瑞思迈公司 | RMD US | 纽约证券 交易所 | 美国 | 524 | 712,254 .34 | 0.14 |
| 71 | Changchun High & New Technology Industires Inc. | 长春高新技 术产业(集 团)股份有 限公司 | 000661 | 深圳证券 交易所 | 中国 | 1,600 | 696,480 .00 | 0.14 |
| 72 | Anhui Sunhere Pharmaceutic al Excipients Co., Ltd. | 安徽山河药 用辅料股份 有限公司 | 300452 | 深圳证券 交易所 | 中国 | 26,000 | 682,500 .00 | 0.14 |
| 73 | WuXi Apptec Co., Ltd. | 无锡药明康 德新药开发 股份有限公 司 | 2359 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 7,000 | 643,883 .86 | 0.13 |
| 74 | Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co., Ltd | 江苏鱼跃医 疗设备股份 有限公司 | 002223 | 深圳证券 交易所 | 中国 | 17,200 | 626,080 .00 | 0.13 |
| 75 | BrightGene Bio-Medical Technology | 博瑞生物医 药(苏州)股 份有限公司 | 688166 | 上海证券 交易所 | 中国 | 10,000 | 618,900 .00 | 0.13 |

| | | | | | | | | |
|----|------------------------------------|-------------------|---------|---------|------|--------|------------|------|
| | Co., Ltd. | | | | | | | |
| 76 | Berry Genomics Co., Ltd | 成都市贝瑞和康基因技术股份有限公司 | 000710 | 深圳证券交易所 | 中国 | 10,000 | 597,400.00 | 0.12 |
| 77 | Shanghai Kinetic Medical Co., Ltd. | 上海凯利泰医疗科技股份有限公司 | 300326 | 深圳证券交易所 | 中国 | 20,000 | 582,000.00 | 0.12 |
| 78 | Akeso, Inc. | 康方生物科技(开曼)有限公司 | 9926 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 17,000 | 576,106.61 | 0.12 |
| 79 | BeiGene, Ltd. | 百济神州有限公司 | BGNE US | 纳斯达克交易所 | 美国 | 419 | 558,852.90 | 0.11 |
| 80 | HitGen Inc. | 成都先导药物开发股份有限公司 | 688222 | 上海证券交易所 | 中国 | 10,000 | 542,500.00 | 0.11 |
| 81 | IDEXX LABORATORIES INC /DE | IDEXX 实验室公司 | IDXX US | 纳斯达克交易所 | 美国 | 226 | 528,245.10 | 0.11 |
| 82 | Walvax Biotechnology Co., Ltd. | 云南沃森生物技术股份有限公司 | 300142 | 深圳证券交易所 | 中国 | 10,000 | 523,600.00 | 0.11 |
| 83 | TOPCHOICE MEDICAL CORPORATION | 通策医疗股份有限公司 | 600763 | 上海证券交易所 | 中国 | 3,000 | 500,310.00 | 0.10 |
| 84 | BIOGEN INC. | 生物基因公司 | BIIB US | 纳斯达克交易所 | 美国 | 244 | 462,165.33 | 0.09 |
| 85 | 3SBio Inc. | 三生制药 | 1530 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 50,000 | 448,499 | 0.09 |

| | | | | | | | | |
|----|---|-------------------------------|------------|-------------|----------|--------|----------------|------|
| | | | HK | 交易所 | 港 | | .04 | |
| 86 | Qingdao Haier Biomedical Co., Ltd | 青岛海尔生 物医疗股份 有限公司 | 688139 | 上海证券 交易所 | 中国 | 7,879 | 441,696 .74 | 0.09 |
| 87 | IQVIA Holdings Inc | | IQV US | 纽约证券 交易所 | 美国 | 438 | 439,944 .48 | 0.09 |
| 88 | ADVANCED MICRO DEVICES INC | 美国超威半 导体公司 | AMD US | 纳斯达克 交易所 | 美国 | 1,003 | 373,569 .85 | 0.08 |
| 89 | Shanghai Sanyou Medical Co., Ltd. | 上海三友医 疗器械股份 有限公司 | 688085 | 上海证券 交易所 | 中国 | 4,164 | 330,163 .56 | 0.07 |
| 90 | Yichang Hec Changjiang Pharmaceutic al Co., Ltd. | 宜昌东阳光 长江药业股 份有限公司 | 1558 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 21,200 | 306,740 .46 | 0.06 |
| 91 | BRISTOL MYERS SQUIBB CO | 百时美施贵 宝公司 | BMJ US | 纽约证券 交易所 | 美国 | 735 | 305,961 .83 | 0.06 |
| 92 | Genscript Biotech Corporation | 金斯瑞生物 科技股份有 限公司 | 1548 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 20,000 | 291,204 .67 | 0.06 |
| 93 | Asymchem Laboratories (Tianjin) Co., Ltd. | 凯莱英医药 集团(天津) 股份有限公 司 | 002821 | 深圳证券 交易所 | 中国 | 1,000 | 243,000 .00 | 0.05 |
| 94 | Editas | | EDIT | 纳斯达克 | 美国 | 1,145 | 239,776 | 0.05 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|----------------------|------------|-------------|----------|--------|----------------|------|
| | Medicine, Inc. | | US | 交易所 | | | .29 | |
| 95 | Moderna, Inc. | | MRNA US | 纳斯达克 交易所 | 美国 | 522 | 237,287 .99 | 0.05 |
| 96 | Sea Ltd | | SE US | 纽约证券 交易所 | 美国 | 300 | 227,761 .67 | 0.05 |
| 97 | Xiaomi Corporation | 小米集团 | 1810 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 16,800 | 197,039 .97 | 0.04 |
| 98 | Jiumaojiu Internationa l Holdings Limited | 九毛九国际 控股有限公 司 | 9922 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 16,000 | 195,549 .24 | 0.04 |
| 99 | Country Garden Services Holdings Company Limited | 碧桂园服务 控股有限公 司 | 6098 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 5,000 | 164,419 .20 | 0.03 |
| 100 | Facebook Inc | | FB US | 纳斯达克 交易所 | 美国 | 72 | 115,743 .03 | 0.02 |
| 101 | Ausnutria Dairy Corporation Ltd. | 澳优乳业股 份有限公司 | 1717 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 7,000 | 110,873 .35 | 0.02 |
| 102 | Ping An Healthcare And Technology Company | 平安健康医 疗科技有限 公司 | 1833 HK | 香港联合 交易所 | 中国香 港 | 1,000 | 107,694 .58 | 0.02 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|----------------|---------|---------|------|-------|-----------|------|
| | Limited | | | | | | | |
| 103 | Beijing Wandong Medical Technology Co., Ltd. | 北京万东医疗科技股份有限公司 | 600055 | 上海证券交易所 | 中国 | 6,200 | 99,262.00 | 0.02 |
| 104 | Beijing Tiantan Biological Products Corporation Limited | 北京天坛生物制品股份有限公司 | 600161 | 上海证券交易所 | 中国 | 2,076 | 94,105.08 | 0.02 |
| 105 | Tencent Holdings Ltd | 腾讯控股有限公司 | 700 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 200 | 91,088.24 | 0.02 |
| 106 | GILEAD SCIENCES INC | 吉利德科学公司 | GILD US | 纳斯达克交易所 | 美国 | 143 | 77,891.63 | 0.02 |
| 107 | S.F. Holding Co., Ltd. | 顺丰控股股份有限公司 | 002352 | 深圳证券交易所 | 中国 | 1,300 | 71,110.00 | 0.01 |
| 108 | Align Technology Inc | 艾利科技公司 | ALGN US | 纳斯达克交易所 | 美国 | 35 | 68,001.43 | 0.01 |
| 109 | Haidilao International Holding Ltd. | 海底捞国际控股有限公司 | 6862 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 2,000 | 59,738.98 | 0.01 |
| 110 | Chengdu Kanghong Pharmaceutical Group | 成都康弘药业集团股份有限公司 | 002773 | 深圳证券交易所 | 中国 | 1,000 | 49,600.00 | 0.01 |

| | | | | | | | | |
|------|---|----------------|---------|---------|------|-------|-----------|------|
| | Co., Ltd | | | | | | | |
| 1111 | Alibaba Group Holding Limited | 阿里巴巴集团控股有限公司 | BABA US | 纽约证券交易所 | 美国 | 32 | 48,865.54 | 0.01 |
| 1112 | TAL Education Group | 好未来教育集团 | TAL US | 纽约证券交易所 | 美国 | 100 | 48,409.62 | 0.01 |
| 1113 | Da An Gene Co.,Ltd. of Sun Yat-Sen University | 中山大学达安基因股份有限公司 | 002030 | 深圳证券交易所 | 中国 | 1,390 | 37,919.20 | 0.01 |
| 1114 | Sino Biopharmaceutical Limited | 中国生物制药有限公司 | 1177 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 2,000 | 26,672.45 | 0.01 |

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|---|---------|---------------|----------------|
| 1 | Alibaba Health Information Technology Limited | 241 HK | 29,347,357.39 | 14.84 |
| 2 | CanSino Biologics Inc. | 6185 HK | 24,197,410.10 | 12.24 |
| 3 | Tesla, Inc. | TSLA US | 23,801,427.59 | 12.04 |

| | | | | |
|----|---|---------|---------------|-------|
| 4 | Bgi Genomics Co., Ltd | 300676 | 21,498,719.53 | 10.87 |
| 5 | Ak Medical Holdings Limited | 1789 HK | 21,141,703.08 | 10.69 |
| 6 | Shanghai Junshi Biosciences Co.,Ltd. | 1877 HK | 18,285,089.47 | 9.25 |
| 7 | UNITEDHEALTH GROUP INC | UNH US | 17,490,966.15 | 8.84 |
| 8 | Pharmaron Beijing Co., Ltd. | 3759 HK | 13,138,876.71 | 6.64 |
| 8 | Pharmaron Beijing Co., Ltd. | 300759 | 4,164,142.00 | 2.11 |
| 9 | DexCom Inc | DXCM US | 16,325,249.10 | 8.26 |
| 10 | Chongqing Zhifei Biological Products Co.,Ltd. | 300122 | 15,831,943.48 | 8.01 |
| 11 | Wuxi Biologics (Cayman) Inc | 2269 HK | 15,400,604.15 | 7.79 |
| 12 | Moderna, Inc. | MRNA US | 14,839,835.83 | 7.50 |
| 13 | Blue Sail Medical Co.,Ltd. | 002382 | 14,093,400.64 | 7.13 |
| 14 | MicroPort Scientific Corporation | 853 HK | 14,022,008.71 | 7.09 |
| 15 | Genscript Biotech Corporation | 1548 HK | 13,765,482.35 | 6.96 |
| 16 | Beijing Chunlizhengda Medical Instruments Co., Ltd. | 1858 HK | 13,725,892.56 | 6.94 |
| 17 | HitGen Inc. | 688222 | 13,708,527.08 | 6.93 |
| 18 | Sinocare Inc. | 300298 | 13,696,542.60 | 6.93 |
| 19 | Qingdao Haier Biomedical | 688139 | 13,309,955.32 | 6.73 |

| | | | | |
|----|---|---------|---------------|------|
| | Co., Ltd | | | |
| 20 | Yifan Pharmaceutical Co., Ltd. | 002019 | 12,949,537.54 | 6.55 |
| 21 | China Feihe Limited | 6186 HK | 12,882,336.83 | 6.51 |
| 22 | Guangzhou Wondfo Biotech Co., Ltd | 300482 | 12,801,540.88 | 6.47 |
| 23 | Innovent Biologics, Inc. | 1801 HK | 12,794,628.48 | 6.47 |
| 24 | ADVANCED MICRO DEVICES INC | AMD US | 12,644,534.51 | 6.39 |
| 25 | 10x Genomics, Inc. | TXG US | 11,686,066.15 | 5.91 |
| 26 | NOVO NORDISK A S | NVO US | 11,128,859.13 | 5.63 |
| 27 | Semiconductor Manufacturing International Corporation | 981 HK | 10,876,118.92 | 5.50 |
| 28 | Yichang Hec Changjiang Pharmaceutical Co., Ltd. | 1558 HK | 10,788,521.15 | 5.46 |
| 29 | REGENERON PHARMACEUTICALS INC | REGN US | 10,637,891.32 | 5.38 |
| 30 | Frontage Holdings Corporation | 1521 HK | 10,631,260.94 | 5.38 |
| 31 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC / MA | VRTX US | 10,399,103.52 | 5.26 |
| 32 | Jinxin Fertility Group Limited | 1951 HK | 10,365,123.18 | 5.24 |
| 33 | Shanghai MicroPort Endovascular MedTech Co., Ltd. | 688016 | 10,347,851.20 | 5.23 |
| 34 | Hansoh Pharmaceutical | 3692 HK | 9,806,621.06 | 4.96 |

| | | | | |
|----|---|---------|--------------|------|
| | Group Company Limited | | | |
| 35 | Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Limited | 1066 HK | 9,726,659.71 | 4.92 |
| 36 | Ping An Healthcare And Technology Company Limited | 1833 HK | 9,605,011.06 | 4.86 |
| 37 | CSPC Pharmaceutical Group Limited | 1093 HK | 9,491,207.67 | 4.80 |
| 38 | Akeso, Inc. | 9926 HK | 9,252,536.63 | 4.68 |
| 39 | Winning Health Technology Group Co., Ltd. | 300253 | 8,975,360.88 | 4.54 |
| 40 | Berry Genomics Co., Ltd | 000710 | 8,919,291.96 | 4.51 |
| 41 | Beijing Wandong Medical Technology Co., Ltd. | 600055 | 8,914,897.16 | 4.51 |
| 42 | Shandong Pharmaceutical Glass Co., Ltd | 600529 | 8,822,968.00 | 4.46 |
| 43 | Shenzhen Mindray Bio- Medical Electronics Co., Ltd. | 300760 | 8,783,691.00 | 4.44 |
| 44 | Exact Sciences Corp | EXAS US | 8,512,319.24 | 4.30 |
| 45 | GILEAD SCIENCES INC | GILD US | 8,124,471.07 | 4.11 |
| 46 | Yifeng Pharmacy Chain Co., Ltd. | 603939 | 7,772,801.75 | 3.93 |
| 47 | Schrodinger, Inc. | SDGR US | 7,622,946.55 | 3.85 |
| 48 | Shandong Xinhua Pharmaceutical Company Limited | 000756 | 7,619,348.20 | 3.85 |

| | | | | |
|----|---|---------|--------------|------|
| 49 | Shanghai Sanyou Medical Co., Ltd. | 688085 | 7,284,739.84 | 3.68 |
| 50 | Ausnutria Dairy Corporation Ltd. | 1717 HK | 7,256,941.52 | 3.67 |
| 51 | Joinn Laboratories (China) Co., Ltd. | 603127 | 7,112,210.80 | 3.60 |
| 52 | Teladoc Health, Inc. | TDOC US | 6,770,581.58 | 3.42 |
| 53 | INTUITIVE SURGICAL INC | ISRG US | 6,638,235.48 | 3.36 |
| 54 | North China Pharmaceutical Company. Ltd | 600812 | 6,580,156.00 | 3.33 |
| 55 | ILLUMINA INC | ILMN US | 6,427,070.85 | 3.25 |
| 56 | Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co., Ltd. | 002044 | 6,394,472.00 | 3.23 |
| 57 | Autobio Diagnostics Co., Ltd. | 603658 | 6,319,108.00 | 3.20 |
| 58 | Edwards Lifesciences Corp | EW US | 6,304,759.78 | 3.19 |
| 59 | China Tourism Group Duty Free Corporation Limited | 601888 | 6,170,602.96 | 3.12 |
| 60 | VEEVA SYSTEMS INC | VEEV US | 6,025,580.88 | 3.05 |
| 61 | Hangzhou Tigermed Consulting Co., Ltd. | 300347 | 5,976,733.00 | 3.02 |
| 62 | Merck & Co., Inc. | MRK US | 5,730,218.79 | 2.90 |
| 63 | AMAZON COM INC | AMZN US | 5,575,735.51 | 2.82 |
| 64 | Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co., Ltd. | 603882 | 5,544,784.00 | 2.80 |

| | | | | |
|----|--|---------|--------------|------|
| 65 | Meituan Dianping | 3690 HK | 5,462,645.18 | 2.76 |
| 66 | Ningbo Menovo Pharmaceutical Co., Ltd. | 603538 | 5,333,514.00 | 2.70 |
| 67 | TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | TTWO US | 5,290,757.15 | 2.68 |
| 68 | Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co.,Ltd | 002223 | 5,218,324.00 | 2.64 |
| 69 | Betta Pharmaceuticals Co.,Ltd | 300558 | 5,099,654.40 | 2.58 |
| 70 | Viva Biotech Holdings | 1873 HK | 5,091,499.47 | 2.57 |
| 71 | Anhui Sunhere Pharmaceutical Excipients Co.,Ltd. | 300452 | 4,805,424.00 | 2.43 |
| 72 | Guardant Health, Inc. | GH US | 4,723,203.80 | 2.39 |
| 73 | VISA INC. | V US | 4,685,422.31 | 2.37 |
| 74 | Adobe Inc | ADBE US | 4,655,757.00 | 2.35 |
| 75 | Alibaba Group Holding Limited | BABA US | 4,567,595.41 | 2.31 |
| 76 | RESMED INC | RMD US | 4,547,037.63 | 2.30 |
| 77 | Sino Biopharmaceutical Limited | 1177 HK | 4,296,019.99 | 2.17 |
| 78 | Planet Fitness, Inc. | PLNT US | 4,224,207.81 | 2.14 |
| 79 | Xiaomi Corporation | 1810 HK | 3,958,615.41 | 2.00 |

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金 |
|----|----------|------|----------|-------|
|----|----------|------|----------|-------|

| | | | | 资产净值比例 (%) |
|----|---|---------|---------------|------------|
| 1 | Tesla, Inc. | TSLA US | 25,009,739.43 | 12.65 |
| 2 | CanSino Biologics Inc. | 6185 HK | 24,553,676.60 | 12.42 |
| 3 | Moderna, Inc. | MRNA US | 24,035,025.04 | 12.15 |
| 4 | Ak Medical Holdings Limited | 1789 HK | 23,229,670.31 | 11.75 |
| 5 | Alibaba Health Information Technology Limited | 241 HK | 21,607,259.88 | 10.93 |
| 6 | Pharmaron Beijing Co., Ltd. | 3759 HK | 18,326,486.33 | 9.27 |
| 7 | China Feihe Limited | 6186 HK | 16,220,561.11 | 8.20 |
| 8 | HitGen Inc. | 688222 | 15,202,375.63 | 7.69 |
| 9 | Bgi Genomics Co., Ltd | 300676 | 15,078,222.00 | 7.62 |
| 10 | Yifan Pharmaceutical Co., Ltd. | 002019 | 14,230,317.73 | 7.20 |
| 11 | Frontage Holdings Corporation | 1521 HK | 14,168,162.81 | 7.16 |
| 12 | Wuxi Biologics (Cayman) Inc | 2269 HK | 14,089,505.63 | 7.12 |
| 13 | Blue Sail Medical Co., Ltd. | 002382 | 13,532,150.10 | 6.84 |
| 14 | Beijing Chunlizhengda Medical Instruments Co., Ltd. | 1858 HK | 13,021,002.42 | 6.58 |
| 15 | Qingdao Haier Biomedical Co., Ltd | 688139 | 12,833,825.22 | 6.49 |
| 16 | Chongqing Zhifei Biological Products Co., Ltd. | 300122 | 12,792,327.39 | 6.47 |
| 17 | MicroPort Scientific Corporation | 853 HK | 12,476,609.37 | 6.31 |
| 18 | Shanghai Junshi Biosciences Co., Ltd. | 1877 HK | 12,411,383.52 | 6.28 |
| 19 | Shanghai MicroPort Endovascular MedTech Co., Ltd. | 688016 | 12,263,296.97 | 6.20 |
| 20 | Genscript Biotech Corporation | 1548 HK | 12,247,829.05 | 6.19 |
| 21 | ADVANCED MICRO DEVICES INC | AMD US | 12,162,971.56 | 6.15 |

| | | | | |
|----|---|---------|---------------|------|
| 22 | Sinocare Inc. | 300298 | 12,158,215.08 | 6.15 |
| 23 | DexCom Inc | DXCM US | 12,120,742.53 | 6.13 |
| 24 | Jinxin Fertility Group Limited | 1951 HK | 11,269,422.28 | 5.70 |
| 25 | UNITEDHEALTH GROUP INC | UNH US | 10,820,267.35 | 5.47 |
| 26 | Merck & Co., Inc. | MRK US | 10,226,295.25 | 5.17 |
| 27 | Semiconductor Manufacturing International Corporation | 981 HK | 10,223,790.11 | 5.17 |
| 28 | Yichang Hec Changjiang Pharmaceutical Co., Ltd. | 1558 HK | 10,135,776.97 | 5.13 |
| 29 | Shanghai Sanyou Medical Co., Ltd. | 688085 | 9,476,030.66 | 4.79 |
| 30 | Ping An Healthcare And Technology Company Limited | 1833 HK | 9,400,035.57 | 4.75 |
| 31 | 10x Genomics, Inc. | TXG US | 9,370,609.67 | 4.74 |
| 32 | Berry Genomics Co., Ltd | 000710 | 9,288,780.00 | 4.70 |
| 33 | Shandong Xinhua Pharmaceutical Company Limited | 000756 | 9,190,300.99 | 4.65 |
| 34 | Akeso, Inc. | 9926 HK | 8,831,611.34 | 4.47 |
| 35 | Guardant Health, Inc. | GH US | 8,720,522.23 | 4.41 |
| 36 | CSPC Pharmaceutical Group Limited | 1093 HK | 8,627,094.99 | 4.36 |
| 37 | GILEAD SCIENCES INC | GILD US | 8,407,403.75 | 4.25 |
| 38 | Beijing Wandong Medical Technology Co., Ltd. | 600055 | 8,296,580.00 | 4.20 |
| 39 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC / MA | VRTX US | 7,911,167.62 | 4.00 |
| 40 | Meituan Dianping | 3690 HK | 7,757,368.73 | 3.92 |
| 41 | INTUITIVE SURGICAL INC | ISRG US | 7,626,248.11 | 3.86 |
| 42 | Edwards Lifesciences Corp | EW US | 6,893,780.26 | 3.49 |
| 43 | Ausnutria Dairy Corporation Ltd. | 1717 HK | 6,789,538.03 | 3.43 |

| | | | | |
|----|---|---------|--------------|------|
| 44 | Exact Sciences Corp | EXAS US | 6,784,709.25 | 3.43 |
| 45 | Innovent Biologics, Inc. | 1801 HK | 6,196,886.07 | 3.13 |
| 46 | VEEVA SYSTEMS INC | VEEV US | 6,190,655.76 | 3.13 |
| 47 | China Tourism Group Duty Free Corporation Limited | 601888 | 5,570,425.00 | 2.82 |
| 48 | TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | TTWO US | 5,126,380.29 | 2.59 |
| 49 | BIOGEN INC. | BIIB US | 5,115,385.95 | 2.59 |
| 50 | Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co., Ltd. | 603882 | 4,837,892.36 | 2.45 |
| 51 | Ningbo Menovo Pharmaceutical Co., Ltd. | 603538 | 4,764,225.60 | 2.41 |
| 52 | NOVO NORDISK A S | NVO US | 4,641,090.25 | 2.35 |
| 53 | Schrodinger, Inc. | SDGR US | 4,534,350.36 | 2.29 |
| 54 | Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co., Ltd | 002223 | 4,522,724.00 | 2.29 |
| 55 | Alibaba Group Holding Limited | BABA US | 4,496,817.22 | 2.27 |
| 56 | AMAZON COM INC | AMZN US | 4,471,197.15 | 2.26 |
| 57 | RESMED INC | RMD US | 4,393,219.67 | 2.22 |
| 58 | VISA INC. | V US | 4,269,788.81 | 2.16 |
| 59 | Anhui Sunhere Pharmaceutical Excipients Co., Ltd. | 300452 | 4,233,633.00 | 2.14 |
| 60 | Country Garden Services Holdings Company Limited | 6098 HK | 4,189,103.92 | 2.12 |
| 61 | Hansoh Pharmaceutical Group Company Limited | 3692 HK | 4,177,981.81 | 2.11 |
| 62 | S.F. Holding Co., Ltd. | 002352 | 3,968,307.00 | 2.01 |

注： 本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

| | |
|------------|----------------|
| 买入成本（成交）总额 | 873,907,312.74 |
|------------|----------------|

| | |
|------------|----------------|
| 卖出收入（成交）总额 | 723,643,283.71 |
|------------|----------------|

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 债券信用等级 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|------------|--------------|
| 无评级 | 484,047.20 | 0.10 |

注：本基金债券投资组合主要采用穆迪、标准普尔等国际权威评级机构提供的债券信用评级信息。

7.7 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 | 113583 | 益丰转债 | 3,640 | 484,047.20 | 0.10 |

7.8 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金投资。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 59,538.44 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 220,144.01 |
| 4 | 应收利息 | 6,937.02 |
| 5 | 应收申购款 | 10,014,629.27 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10,301,248.74 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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

| 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(%) |
| | | | | | | |

| | | | | (%) | | |
|-------------------|--------|----------|---------------|-------|----------------|--------|
| 添富全球医疗混合(QDII)人民币 | 26,012 | 9,155.07 | 56,181,516.00 | 23.59 | 181,960,263.70 | 76.41 |
| 添富全球医疗混合(QDII)美元 | 735 | 8,037.80 | 0.00 | 0.00 | 5,907,780.86 | 100.00 |
| 合计 | 26,747 | 9,124.37 | 56,181,516.00 | 23.02 | 187,868,044.56 | 76.98 |

注：表内美元现汇份额以及占比未按汇率进行折算。

8.2 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 | 添富全球医疗混合(QDII)人民币 | 2,747,328.85 | 1.15 |
| | 添富全球医疗混合(QDII)美元 | 4,434.17 | 0.08 |
| | 合计 | 2,751,763.02 | 1.13 |

注：表美元现汇份额为美元份额。如果将美元份额按照2020年6月30日中国人民银行美元兑换人民币汇率中间价折算为人民币份额后进行计算，美元现汇份额的管理人所有从业人员持有本基金为31,391.71份；从业人员持有本基金合计份额为2,778,720.56份，合计份额占比为0.99%。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 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 | 添富全球医疗混合(QDII)人民币 | >100 |
| | 添富全球医疗混合(QDII)美元 | 0 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 添富全球医疗混合(QDII)人民币 | 0 |
| | 添富全球医疗混合(QDII)美元 | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 添富全球医疗混合(QDII)人民币 | 添富全球医疗混合(QDII)美元 |
|--------------------------------|-------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2017年08月16日)基金份额总额 | 746,998,461.45 | 5,945,011.22 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 120,253,338.35 | 5,571,756.41 |
| 本报告期基金总申购份额 | 231,705,948.57 | 3,934,610.35 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 113,817,507.22 | 3,598,585.90 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 238,141,779.70 | 5,907,780.86 |

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|------|------|------|-----------|------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股 | 佣金 | 占当期佣 | |
| | | | | | | |

| | 数量 | | 票成交总 额的比例 (%) | | 金总量的 比例 (%) | |
|---|----|----------------|---------------------|------------|-------------------|--|
| 东方证券 | 2 | 776,746,145.60 | 48.62 | 683,169.37 | 74.51 | |
| JPMorgan Securities | - | 250,533,014.79 | 15.68 | 56,758.95 | 6.19 | |
| Oppenhemier | - | 178,275,816.92 | 11.16 | 63,387.38 | 6.91 | |
| Sanford C. Bernstein | - | 136,916,992.52 | 8.57 | 31,626.34 | 3.45 | |
| CGS-CIMB Securities (Singapore) | - | 92,076,497.40 | 5.76 | 24,181.80 | 2.64 | |
| Credit Suisse | - | 76,983,813.41 | 4.82 | 23,473.24 | 2.56 | |
| Jefferies International | - | 51,814,291.78 | 3.24 | 6,934.65 | 0.76 | |
| China Securities Finance International | - | 34,196,332.80 | 2.14 | 27,357.08 | 2.98 | |
| 北京高华 | 1 | - | - | - | - | |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 申万宏源证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | |

| | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 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(%) |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| JPMorgan Securities | - | - | - | - | - | - | 25,455,329.15 | 58.35 |
| Oppenheimier | - | - | - | - | - | - | 3,370,194.90 | 7.72 |
| Sanford C. Bernstein | - | - | - | - | - | - | 5,276,705.73 | 12.09 |
| CGS-CIMB Securities (Singapore) | - | - | - | - | - | - | 6,620,521.23 | 15.18 |
| Credit Suisse | - | - | - | - | - | - | 2,904,629.14 | 6.66 |
| Jefferies International | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|--|---|---|---|---|---|---|---|---|
| China Securities Finance International | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用, 基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定, 同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 1 个交易单元: 长城证券(上交所单元)。

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 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的费率优惠活动的公告 | 上证报, 公司网站 | 2020 年 01 月 02 日 |
| 2 | 汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年 第 4 季度报告 | 上交所, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2020 年 01 月 21 日 |
| 3 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金暂停申购、赎回 等业务的公告 | 中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报 | 2020 年 01 月 31 日 |
| 4 | 汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年 年度报告 | 中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报 | 2020 年 03 月 30 日 |
| 5 | 汇添富基金管理股份有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告 | 中证报, 上交所, 公司网站, 深交所 | 2020 年 04 月 01 日 |
| 6 | 汇添富基金管理股份有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议并更新招募说明书 | 中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报 | 2020 年 04 月 14 日 |

| | | | |
|----|---|--------------------------------------|------------------|
| 7 | 汇添富基金旗下 145 只基金 2020 年 1 季度报告 | 中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报 | 2020 年 04 月 21 日 |
| 8 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金中基金 (FOF) 资产管理计划通过直销渠道申赎本公司旗下公募基金免除相关费用的公告 | 中证报, 公司网站 | 2020 年 04 月 29 日 |
| 9 | 汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行定投起点的公告 | 上证报, 公司网站 | 2020 年 05 月 16 日 |
| 10 | 汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行定投起点的公告 | 证券时报, 公司网站 | 2020 年 06 月 04 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富全球医疗保健混合型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、报告期内汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼20楼 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2020年08月28日