

嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式 指数证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 08 月 29 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。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 24 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 4 月 24 日（基金合同生效日）起至 2020 年 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 | 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 | 7 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 7 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 16 |
| § 7 投资组合报告 | 37 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 37 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 38 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 39 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 43 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 43 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 44 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 44 |

| | |
|------------------------------------------|-----------|
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 44 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 44 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 44 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 44 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 45 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 | 45 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 45 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 45 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 46 |
| § 10 重大事件揭示 | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 46 |
| 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 | 46 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 46 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 46 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 46 |
| 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 | 47 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 47 |
| 10.8 其他重大事件 | 54 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 55 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 55 |
| § 12 备查文件目录 | 55 |
| 12.1 备查文件目录 | 55 |
| 12.2 存放地点 | 55 |
| 12.3 查阅方式 | 56 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-------------------------------|
| 基金名称 | 嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 嘉实医药健康 100ETF |
| 场内简称 | 医药 100（扩位场内简称：医药健康 ETF） |
| 基金主代码 | 515960 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 4 月 24 日 |
| 基金管理人 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 174,991,927.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2020 年 6 月 10 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成份股时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。 |
| 业绩比较基准 | 中证医药健康 100 策略指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票型证券投资基金，预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------------------------------------|-------------------|
| 名称 | 嘉实基金管理有限公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 胡勇钦 |
| | 联系电话 | (010)65215588 |
| | 电子邮箱 | service@jsfund.cn |
| 客户服务电话 | 400-600-8800 | 95566 |
| 传真 | (010)65215588 | (010)66594942 |
| 注册地址 | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 | 北京西城区复兴门内大街 1 号 |

| | | |
|-------|-------------------------------------------|-----------------|
| | 09-14 单元 | |
| 办公地址 | 北京市朝阳区建国门外大街 21 号 北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层 | 北京西城区复兴门内大街 1 号 |
| 邮政编码 | 100005 | 100818 |
| 法定代表人 | 经雷 | 刘连舸 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券日报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.jsfund.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司 |

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2020 年 01 月 01 日-2020 年 06 月 30 日) |
|---------------|----------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 19,500,567.47 |
| 本期利润 | 46,816,969.02 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1550 |
| 本期加权平均净值利润率 | 15.04% |
| 本期基金份额净值增长率 | 19.16% |
| 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 | 14,697,945.91 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0840 |
| 期末基金资产净值 | 208,512,496.87 |
| 期末基金份额净值 | 1.1916 |
| 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 | 19.16% |

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) 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；(3) 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；(4) 本基金合同生效日为 2020 年 4 月 24 日，本报告期自 2020 年 4 月 24 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

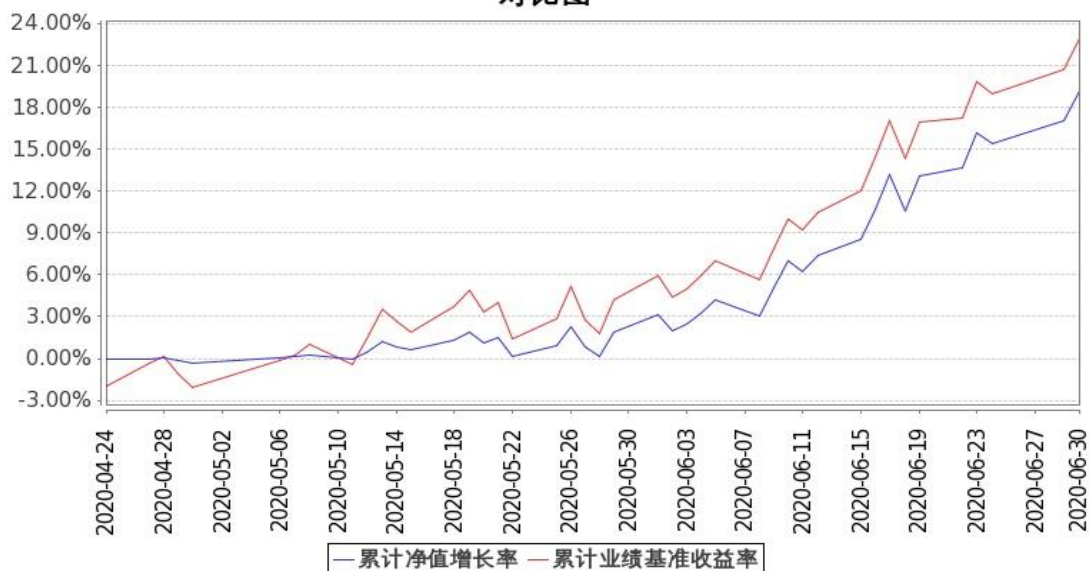
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 16.97% | 1.31% | 17.95% | 1.43% | -0.98% | -0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 19.16% | 1.09% | 22.92% | 1.54% | -3.76% | -0.45% |

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

嘉实医药健康100ETF 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



图：嘉实医药健康 100ETF 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 4 月 24 日至 2020 年 6 月 30 日)

注：本基金基金合同生效日 2020 年 4 月 24 日至报告期末未满 1 年。按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日 6 个月为建仓期，本报告期处于建仓期内。

§ 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

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设

立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2020 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 190 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）混合、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数（QDII）、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉

实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合 (FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合 (FOF)、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合 (FOF)、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合 (FOF)、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开行指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接 A/C、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时,基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

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 | | |
| 李直 | 本基金、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 联 | 2020 年 4 月 24 日 | | 5 年 | 2014 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司,从事指数基金投资研究工作。硕士研究生,具有基金从业资格。 |

| | | | | | |
|----|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 接、嘉实创业板 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实先进制造 100 ETF 基金经理 | | | | |
| 高峰 | 本基金、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实创业板 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实先进制造 100ETF 基金经理 | 2020 年 4 月 24 日 | | 5 年 | 曾任中国工商银行股份有限公司金融市场部外汇及衍生品交易员。2015 年加入嘉实基金管理有限公司任指数投资部指数研究员，现任指数投资部基金经理。北京大学金融学硕士，特许金融分析师 (CFA)，具有基金从业资格。 |
| 金猛 | 本基金、嘉实量化阿尔法混合、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实先进制造 100ETF 基金经理 | 2020 年 4 月 24 日 | | 8 年 | 曾任职于安信基金管理有限责任公司，从事风险控制工作。2014 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于量化投资部。硕士研究生，具有基金从业资格。 |

注：(1) 基金经理的任职日期是指本基金基金合同生效之日；(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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和

公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与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，合计 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

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

本报告期内，本基金仍处于 6 个月建仓期内。作为被动管理的指数基金，本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，继续秉承指数化投资管理策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差，力争投资回报与业绩基准保持一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1916 元；本报告期基金份额净值增长率为 19.16%，业绩比较基准收益率为 22.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于中证医药健康 100 策略指数的被动投资管理产品，将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对指数成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力争进一步降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证医药健康 100 策略指数的投资工具。

4.6 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》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由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目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利

益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同十七（二）“1、在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率。截至收益评价日基金净值增长率减去标的指数增长率的差额超过 1%时，基金管理人可以进行收益分配”。收益评价日，基金净值增长率减去标的指数增长率的差额未超过 1%，因此本基金报告期内未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 |
|----|-----|-----|
|----|-----|-----|

| | | 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------|----------|--------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 3,552,328.59 |
| 结算备付金 | | 3,147,081.08 |
| 存出保证金 | | 97,805.12 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 199,798,156.70 |
| 其中：股票投资 | | 199,798,156.70 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | - |
| 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 | | 3,529,980.49 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 2,509.33 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 210,127,861.31 |
| 负债和所有者权益 | | 本期末 2020 年 6 月 30 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 | | 1,039,284.24 |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 106,513.67 |
| 应付托管费 | | 21,302.73 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 397,409.28 |
| 应交税费 | | - |
| 应付利息 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 50,854.52 |
| 负债合计 | | 1,615,364.44 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 174,991,927.00 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 33,520,569.87 |
| 所有者权益合计 | | 208,512,496.87 |

| | | |
|------------|--|----------------|
| 负债和所有者权益总计 | | 210,127,861.31 |
|------------|--|----------------|

注：本基金合同生效日为 2020 年 4 月 24 日，本报告期自基金合同生效日 2020 年 4 月 24 日起至 2020 年 6 月 30 日止。报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1916 元，基金份额总额 174,991,927.00 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2020 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|------------------------|----------|----------------------------------------------------|
| 一、收入 | | 47,840,564.38 |
| 1. 利息收入 | | 404,243.07 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 185,641.01 |
| 债券利息收入 | | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 218,602.06 |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 19,062,078.67 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 17,989,494.23 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 1,072,584.44 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 27,316,401.55 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 1,057,841.09 |
| 减：二、费用 | | 1,023,595.36 |
| 1. 管理人报酬 | | 281,196.04 |
| 2. 托管费 | | 56,239.21 |
| 3. 销售服务费 | | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 626,876.11 |
| 5. 利息支出 | | - |

| | | |
|---------------------|-------------|------------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 税金及附加 | | - |
| 7. 其他费用 | 6. 4. 7. 19 | 59, 284. 00 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 46, 816, 969. 02 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 46, 816, 969. 02 |

注：本基金合同生效日为 2020 年 4 月 24 日，本期是指 2020 年 4 月 24 日至 2020 年 6 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 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) | 343, 991, 927. 00 | - | 343, 991, 927. 00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 46, 816, 969. 02 | 46, 816, 969. 02 |
| 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） | -169, 000, 000. 00 | -13, 296, 399. 15 | -182, 296, 399. 15 |
| 其中：1. 基金申购款 | 18, 000, 000. 00 | 2, 021, 267. 78 | 20, 021, 267. 78 |
| 2. 基金赎回款 | -187, 000, 000. 00 | -15, 317, 666. 93 | -202, 317, 666. 93 |
| 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) | 174, 991, 927. 00 | 33, 520, 569. 87 | 208, 512, 496. 87 |

注：本基金合同生效日为 2020 年 4 月 24 日，本期是指 2020 年 4 月 24 日至 2020 年 6 月 30 日，无

上年度可比期间数据。

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：

| | | |
|-----------|------------|------------|
| <u>经雷</u> | <u>罗丽丽</u> | <u>罗丽丽</u> |
| 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

嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金（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[2019]1828 号《关于准予嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由嘉实基金管理有限公司于 2020 年 3 月 25 日至 2020 年 4 月 17 日向社会公开募集，基金合同于 2020 年 4 月 24 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集规模为 343,991,927.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2020）验字第 60468756_A03 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）自律监管决定书[2020]148 号文核准，本基金 343,991,927.00 份基金份额于 2020 年 6 月 10 日在上交所挂牌交易。

本基金投资于标的指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为：中证医药健康 100 策略指数收益率。

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（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，在具体会

计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员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〉》及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及参考意见。

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 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2020 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配；

(3) 在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(4) 基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

(5) 本基金收益分配采取现金方式；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规规定及基金合同约定的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会审议。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.6.2 增值税

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，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，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 3,552,328.59 |
| 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个月及以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 3,552,328.59 |

注：定期存款的存款期限指票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 | | |
|---------------|-------------------|----------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 172,481,755.15 | 199,798,156.70 | 27,316,401.55 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 172,481,755.15 | 199,798,156.70 | 27,316,401.55 |

注：股票投资的公允价值和股票投资的估值增值均包含可退替代款的估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,195.15 |
| 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 | 1,274.58 |
| 应收债券利息 | - |
| 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 | 39.60 |
| 合计 | 2,509.33 |

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 397,409.28 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 397,409.28 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 13,491.88 |
| 应付指数使用费 | 37,362.64 |
| 合计 | 50,854.52 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年4月24日（基金合同生效日）至2020年6月30日 | |
|---------------|--------------------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 343,991,927.00 | 343,991,927.00 |
| 本期申购 | 18,000,000.00 | 18,000,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -187,000,000.00 | -187,000,000.00 |
| 本期末 | 174,991,927.00 | 174,991,927.00 |

注：本基金于2020年3月25日至2020年4月17日向社会公开募集，截至2020年4月24日（基金合同生效日）止，本基金募集期间认购资金本金折份额为343,991,927.00份。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 19,500,567.47 | 27,316,401.55 | 46,816,969.02 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,802,621.56 | -8,493,777.59 | -13,296,399.15 |
| 其中：基金申购款 | 1,047,883.01 | 973,384.77 | 2,021,267.78 |
| 基金赎回款 | -5,850,504.57 | -9,467,162.36 | -15,317,666.93 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 14,697,945.91 | 18,822,623.96 | 33,520,569.87 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年4月24日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
|-----------|--------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 133,431.22 |
| 定期存款利息收入 | 46,900.00 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 5,167.53 |
| 其他 | 142.26 |
| 合计 | 185,641.01 |

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年4月24日(基金合同生效日)至2020 年6月30日 |
|------------------|------------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 12,346,312.23 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | 5,643,182.00 |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | 17,989,494.23 |

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年4月24日(基金合同生效日)至2020 年6月30日 |
|------------|------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 175,644,516.22 |
| 减：卖出股票成本总额 | 163,298,203.99 |
| 买卖股票差价收入 | 12,346,312.23 |

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年4月24日(基金合同生效日)至2020 年6月30日 |
|-------------|------------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额 | 202,317,666.93 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 125,228,536.93 |
| 减：赎回股票成本总额 | 71,445,948.00 |
| 赎回差价收入 | 5,643,182.00 |

6.4.7.12.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年4月24日（基金合同生效日）至2020 年6月30日 |
|---------------|------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,072,584.44 |
| 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 | 1,072,584.44 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2020年4月24日（基金合同生效日）至 2020年6月30日 |
|----------------------------|------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 27,316,401.55 |
| 股票投资 | 27,316,401.55 |
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值 税 | - |
| 合计 | 27,316,401.55 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年4月24日（基金合同生效日）至2020 年6月30日 |
|---------|------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | - |
| 其他 | 12.00 |
| 替代损益 | 1,057,829.09 |
| 合计 | 1,057,841.09 |

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2020 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|-------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 626,876.11 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 626,876.11 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------|-------------------------------------------------|
| 审计费用 | 13,491.88 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行划款手续费 | 8,029.48 |
| 指数使用费 | 37,362.64 |
| 其他 | 400.00 |
| 合计 | 59,284.00 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-----------------------------------|--------------|
| 嘉实基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 基金托管人 |
| 中诚信托有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 立信投资有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| DWS Investments Singapore Limited | 基金管理人的股东 |

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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 |
|--------------------|--------------|
| 嘉实基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 基金托管人 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年4月24日（基金合同生效日）至2020 年6月30日 |
|-----------------|------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 281,196.04 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - |

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.5%/当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年4月24日（基金合同生效日）至2020 年6月30日 |
|----------------|------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 56,239.21 |

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%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×0.1%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

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4月24日（基金合同生效日）至2020年6月30日 | |
|---------------|--------------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行股份有限公司_活期 | 3,552,328.59 | 133,431.22 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.11 利润分配情况

本期（2020年4月24日（基金合同生效日）至2020年6月30日），本基金未实施利润分配。

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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|-----------|--------|-------|--------|--------------|----------|----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 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 |
| 300843 | 胜蓝股份 | 2020年6月23日 | 2020年7月2日 | 新发未上市 | 10.01 | 10.01 | 751 | 7,517.51 | 7,517.51 | - |
| 300845 | 捷安高科 | 2020年6月24日 | 2020年7月3日 | 新发未上市 | 17.63 | 17.63 | 470 | 8,286.10 | 8,286.10 | - |
| 300846 | 首都在线 | 2020年6月22日 | 2020年7月1日 | 新发未上市 | 3.37 | 3.37 | 1,131 | 3,811.47 | 3,811.47 | - |
| 300847 | 中船汉光 | 2020年6月29日 | 2020年7月9日 | 新发未上市 | 6.94 | 6.94 | 1,421 | 9,861.74 | 9,861.74 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|--------------------|-------------------|-----------|-------|-------|-------|------------|------------|---|
| 688027 | 国盾量子 | 2020年 6月30 日 | 2020年 7月9 日 | 新发未 上市 | 36.18 | 36.18 | 2,169 | 78,474.42 | 78,474.42 | - |
| 688568 | 中科星图 | 2020年 6月30 日 | 2020年 7月8 日 | 新发未 上市 | 16.21 | 16.21 | 6,956 | 112,756.76 | 112,756.76 | - |

注:1. 以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期,最终日期以上上市公司公告为准。

2. 基金持有的股票在流通受限期内,如获得股票红利、送股、转增股、配股的,则该股票的数量和期末成本总额相应调整,新增股票的可流通日、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

本基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系,本基金管理人董事会对本基金管理人建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任,充分发挥独立董事监督职能,保护投资者利益和本基金管理人合法权益。

为了有效控制本基金管理人运作和基金管理中存在的风险,本基金管理人设立风险控制委员会,由本基金管理人总经理、督察长以及部门总监组成,负责全面评估本基金管理人经营管理过程中的各项风险,并提出防范化解措施。

本基金管理人设立督察长制度,积极对本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金

管理人内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告本基金管理人内部控制执行情况。

监察稽核部具体负责本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金管理人内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。本基金管理人管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。

业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金管理人建立了以董事会为领导的、由总经理、风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2020年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|--------------|------|------|-----------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 3,552,328.59 | - | - | - | 3,552,328.59 |
| 结算备付金 | 3,147,081.08 | - | - | - | 3,147,081.08 |
| 存出保证金 | 97,805.12 | - | - | - | 97,805.12 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -199,798,156.70 | 199,798,156.70 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 3,529,980.49 | 3,529,980.49 |
| 应收利息 | - | - | - | 2,509.33 | 2,509.33 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 6,797,214.79 | - | - | -203,330,646.52 | 210,127,861.31 |
| 负债 | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,039,284.24 | 1,039,284.24 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 106,513.67 | 106,513.67 |
| 应付托管费 | - | - | - | 21,302.73 | 21,302.73 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 397,409.28 | 397,409.28 |
| 应付税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |

| | | | | |
|---------|--------------|---|-----------------|----------------|
| 其他负债 | - | - | 50,854.52 | 50,854.52 |
| 负债总计 | - | - | 1,615,364.44 | 1,615,364.44 |
| 利率敏感度缺口 | 6,797,214.79 | - | -201,715,282.08 | 208,512,496.87 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | |
|---------------|------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 199,798,156.70 | 95.82 |
| 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 | 199,798,156.70 | 95.82 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 199,577,448.70 元，属于第二层次的余额为人民币 220,708.00 元，无属于第三层次的余额。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生转换。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 199,798,156.70 | 95.08 |
| | 其中：股票 | 199,798,156.70 | 95.08 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 6,699,409.67 | 3.19 |
| 8 | 其他各项资产 | 3,630,294.94 | 1.73 |

| | | | |
|---|----|----------------|--------|
| 9 | 合计 | 210,127,861.31 | 100.00 |
|---|----|----------------|--------|

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 167,656,444.34 | 80.41 |
| 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 | 10,281,016.20 | 4.93 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 15,678,024.60 | 7.52 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 5,796,972.00 | 2.78 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 199,412,457.14 | 95.64 |

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 260,845.23 | 0.13 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|------------|------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 124,854.33 | 0.06 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 385,699.56 | 0.18 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 600276 | 恒瑞医药 | 170,720 | 15,757,456.00 | 7.56 |
| 2 | 000661 | 长春高新 | 30,700 | 13,363,710.00 | 6.41 |
| 3 | 300760 | 迈瑞医疗 | 39,571 | 12,096,854.70 | 5.80 |
| 4 | 603259 | 药明康德 | 112,476 | 10,865,181.60 | 5.21 |
| 5 | 300122 | 智飞生物 | 69,447 | 6,955,117.05 | 3.34 |
| 6 | 002007 | 华兰生物 | 118,800 | 5,953,068.00 | 2.86 |
| 7 | 300347 | 泰格医药 | 56,900 | 5,796,972.00 | 2.78 |
| 8 | 600436 | 片仔癀 | 32,700 | 5,567,175.00 | 2.67 |
| 9 | 000538 | 云南白药 | 55,400 | 5,197,074.00 | 2.49 |
| 10 | 300003 | 乐普医疗 | 135,400 | 4,944,808.00 | 2.37 |
| 11 | 600196 | 复星医药 | 131,000 | 4,434,350.00 | 2.13 |
| 12 | 002001 | 新和成 | 140,000 | 4,074,000.00 | 1.95 |
| 13 | 002821 | 凯莱英 | 15,000 | 3,645,000.00 | 1.75 |
| 14 | 600201 | 生物股份 | 122,300 | 3,404,832.00 | 1.63 |
| 15 | 300558 | 贝达药业 | 21,700 | 3,037,566.00 | 1.46 |
| 16 | 300529 | 健帆生物 | 43,220 | 3,003,790.00 | 1.44 |
| 17 | 300676 | 华大基因 | 17,300 | 2,697,243.00 | 1.29 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 18 | 600521 | 华海药业 | 78,910 | 2,677,416.30 | 1.28 |
| 19 | 600867 | 通化东宝 | 153,300 | 2,672,019.00 | 1.28 |
| 20 | 600161 | 天坛生物 | 56,689 | 2,569,712.37 | 1.23 |
| 21 | 300463 | 迈克生物 | 42,300 | 2,463,129.00 | 1.18 |
| 22 | 000963 | 华东医药 | 95,000 | 2,403,500.00 | 1.15 |
| 23 | 002223 | 鱼跃医疗 | 65,300 | 2,376,920.00 | 1.14 |
| 24 | 300482 | 万孚生物 | 22,322 | 2,321,488.00 | 1.11 |
| 25 | 601607 | 上海医药 | 125,300 | 2,303,014.00 | 1.10 |
| 26 | 603658 | 安图生物 | 14,000 | 2,274,160.00 | 1.09 |
| 27 | 300357 | 我武生物 | 34,100 | 2,122,725.00 | 1.02 |
| 28 | 300759 | 康龙化成 | 21,500 | 2,115,600.00 | 1.01 |
| 29 | 002603 | 以岭药业 | 65,300 | 2,036,707.00 | 0.98 |
| 30 | 000513 | 丽珠集团 | 40,200 | 1,930,002.00 | 0.93 |
| 31 | 300009 | 安科生物 | 103,720 | 1,856,588.00 | 0.89 |
| 32 | 002019 | 亿帆医药 | 80,600 | 1,851,382.00 | 0.89 |
| 33 | 300677 | 英科医疗 | 14,300 | 1,827,540.00 | 0.88 |
| 34 | 002030 | 达安基因 | 66,670 | 1,818,757.60 | 0.87 |
| 35 | 603858 | 步长制药 | 61,900 | 1,785,815.00 | 0.86 |
| 36 | 603233 | 大参林 | 21,360 | 1,734,859.20 | 0.83 |
| 37 | 600380 | 健康元 | 105,700 | 1,716,568.00 | 0.82 |
| 38 | 002382 | 蓝帆医疗 | 52,300 | 1,574,753.00 | 0.76 |
| 39 | 603707 | 健友股份 | 23,400 | 1,510,938.00 | 0.72 |
| 40 | 000739 | 普洛药业 | 63,900 | 1,488,231.00 | 0.71 |
| 41 | 002773 | 康弘药业 | 28,200 | 1,398,720.00 | 0.67 |
| 42 | 002294 | 信立泰 | 45,400 | 1,346,564.00 | 0.65 |
| 43 | 002332 | 仙琚制药 | 79,600 | 1,340,464.00 | 0.64 |
| 44 | 603520 | 司太立 | 15,300 | 1,286,118.00 | 0.62 |
| 45 | 002675 | 东诚药业 | 60,900 | 1,275,855.00 | 0.61 |
| 46 | 603883 | 老百姓 | 12,600 | 1,260,504.00 | 0.60 |
| 47 | 000999 | 华润三九 | 42,500 | 1,240,575.00 | 0.59 |
| 48 | 300725 | 药石科技 | 9,400 | 1,167,950.00 | 0.56 |
| 49 | 002727 | 一心堂 | 31,100 | 1,154,121.00 | 0.55 |
| 50 | 300630 | 普利制药 | 15,400 | 1,138,830.00 | 0.55 |
| 51 | 300685 | 艾德生物 | 14,400 | 1,108,224.00 | 0.53 |
| 52 | 000403 | 双林生物 | 14,800 | 1,097,124.00 | 0.53 |
| 53 | 300298 | 三诺生物 | 30,600 | 983,484.00 | 0.47 |
| 54 | 002262 | 恩华药业 | 55,300 | 932,358.00 | 0.45 |
| 55 | 600566 | 济川药业 | 35,400 | 901,284.00 | 0.43 |
| 56 | 600195 | 中牧股份 | 55,200 | 895,896.00 | 0.43 |
| 57 | 002038 | 双鹭药业 | 66,900 | 856,989.00 | 0.41 |
| 58 | 600211 | 西藏药业 | 13,400 | 853,848.00 | 0.41 |
| 59 | 300702 | 天宇股份 | 7,846 | 834,186.72 | 0.40 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 60 | 002099 | 海翔药业 | 105,400 | 833,714.00 | 0.40 |
| 61 | 600993 | 马应龙 | 32,700 | 792,975.00 | 0.38 |
| 62 | 300233 | 金城医药 | 25,600 | 787,200.00 | 0.38 |
| 63 | 600062 | 华润双鹤 | 56,600 | 748,252.00 | 0.36 |
| 64 | 002626 | 金达威 | 26,700 | 693,132.00 | 0.33 |
| 65 | 300497 | 富祥药业 | 34,900 | 682,993.00 | 0.33 |
| 66 | 002020 | 京新药业 | 62,900 | 672,401.00 | 0.32 |
| 67 | 000915 | 山大华特 | 20,300 | 664,825.00 | 0.32 |
| 68 | 603368 | 柳药股份 | 27,540 | 632,043.00 | 0.30 |
| 69 | 600557 | 康缘药业 | 45,000 | 626,400.00 | 0.30 |
| 70 | 300639 | 凯普生物 | 11,500 | 597,195.00 | 0.29 |
| 71 | 002950 | 奥美医疗 | 20,550 | 583,209.00 | 0.28 |
| 72 | 300206 | 理邦仪器 | 31,500 | 574,560.00 | 0.28 |
| 73 | 600055 | 万东医疗 | 35,200 | 563,552.00 | 0.27 |
| 74 | 600329 | 中新药业 | 31,100 | 538,652.00 | 0.26 |
| 75 | 600750 | 江中药业 | 41,040 | 518,745.60 | 0.25 |
| 76 | 002901 | 大博医疗 | 4,300 | 512,947.00 | 0.25 |
| 77 | 300653 | 正海生物 | 6,450 | 498,069.00 | 0.24 |
| 78 | 603987 | 康德莱 | 28,700 | 496,797.00 | 0.24 |
| 79 | 603538 | 美诺华 | 9,700 | 494,506.00 | 0.24 |
| 80 | 300119 | 瑞普生物 | 21,900 | 489,465.00 | 0.23 |
| 81 | 603566 | 普莱柯 | 17,400 | 481,806.00 | 0.23 |
| 82 | 002653 | 海思科 | 17,400 | 463,014.00 | 0.22 |
| 83 | 600285 | 羚锐制药 | 49,300 | 460,955.00 | 0.22 |
| 84 | 300016 | 北陆药业 | 37,500 | 456,000.00 | 0.22 |
| 85 | 300401 | 花园生物 | 31,200 | 447,096.00 | 0.21 |
| 86 | 603301 | 振德医疗 | 8,500 | 438,175.00 | 0.21 |
| 87 | 600299 | 安迪苏 | 32,000 | 391,040.00 | 0.19 |
| 88 | 002755 | 奥赛康 | 20,100 | 379,890.00 | 0.18 |
| 89 | 002737 | 葵花药业 | 25,300 | 370,139.00 | 0.18 |
| 90 | 002432 | 九安医疗 | 32,900 | 366,177.00 | 0.18 |
| 91 | 002107 | 沃华医药 | 31,280 | 347,208.00 | 0.17 |
| 92 | 600479 | 千金药业 | 36,300 | 335,775.00 | 0.16 |
| 93 | 300396 | 迪瑞医疗 | 11,900 | 319,872.00 | 0.15 |
| 94 | 603367 | 辰欣药业 | 19,600 | 316,932.00 | 0.15 |
| 95 | 300255 | 常山药业 | 50,700 | 292,539.00 | 0.14 |
| 96 | 300636 | 同和药业 | 7,000 | 280,210.00 | 0.13 |
| 97 | 002688 | 金河生物 | 41,300 | 280,014.00 | 0.13 |
| 98 | 000756 | 新华制药 | 23,100 | 238,392.00 | 0.11 |
| 99 | 002793 | 罗欣药业 | 17,200 | 227,212.00 | 0.11 |
| 100 | 603079 | 圣达生物 | 7,400 | 219,262.00 | 0.11 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1 | 688568 | 中科星图 | 6,956 | 112,756.76 | 0.05 |
| 2 | 603087 | 甘李药业 | 1,076 | 107,922.80 | 0.05 |
| 3 | 688027 | 国盾量子 | 2,169 | 78,474.42 | 0.04 |
| 4 | 300824 | 北鼎股份 | 1,954 | 26,789.34 | 0.01 |
| 5 | 300842 | 帝科股份 | 455 | 18,527.60 | 0.01 |
| 6 | 300839 | 博汇股份 | 502 | 11,751.82 | 0.01 |
| 7 | 300847 | 中船汉光 | 1,421 | 9,861.74 | 0.00 |
| 8 | 300845 | 捷安高科 | 470 | 8,286.10 | 0.00 |
| 9 | 300843 | 胜蓝股份 | 751 | 7,517.51 | 0.00 |
| 10 | 300846 | 首都在线 | 1,131 | 3,811.47 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2% 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 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 600276 | 恒瑞医药 | 27,925,513.16 | 13.39 |
| 2 | 000661 | 长春高新 | 22,498,564.01 | 10.79 |
| 3 | 603259 | 药明康德 | 18,399,835.20 | 8.82 |
| 4 | 300760 | 迈瑞医疗 | 17,665,143.85 | 8.47 |
| 5 | 300015 | 爱尔眼科 | 12,506,373.06 | 6.00 |
| 6 | 300122 | 智飞生物 | 11,072,449.02 | 5.31 |
| 7 | 000538 | 云南白药 | 10,334,514.04 | 4.96 |
| 8 | 300003 | 乐普医疗 | 10,223,834.04 | 4.90 |
| 9 | 002007 | 华兰生物 | 10,201,305.50 | 4.89 |
| 10 | 600436 | 片仔癀 | 9,851,549.28 | 4.72 |
| 11 | 300347 | 泰格医药 | 9,685,861.18 | 4.65 |
| 12 | 300601 | 康泰生物 | 9,456,941.28 | 4.54 |
| 13 | 600196 | 复星医药 | 8,299,091.64 | 3.98 |
| 14 | 002001 | 新和成 | 8,208,140.69 | 3.94 |
| 15 | 002821 | 凯莱英 | 7,019,537.74 | 3.37 |
| 16 | 002044 | 美年健康 | 6,820,034.44 | 3.27 |
| 17 | 300253 | 卫宁健康 | 6,267,640.71 | 3.01 |
| 18 | 300529 | 健帆生物 | 6,227,451.83 | 2.99 |
| 19 | 600763 | 通策医疗 | 5,352,799.43 | 2.57 |
| 20 | 601607 | 上海医药 | 4,796,345.02 | 2.30 |
| 21 | 603658 | 安图生物 | 4,717,120.00 | 2.26 |
| 22 | 300558 | 贝达药业 | 4,675,734.34 | 2.24 |
| 23 | 000963 | 华东医药 | 4,591,463.92 | 2.20 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 24 | 600079 | 人福医药 | 4,488,643.00 | 2.15 |
| 25 | 600521 | 华海药业 | 4,333,196.29 | 2.08 |
| 26 | 600161 | 天坛生物 | 4,181,621.18 | 2.01 |

7.4.2 累计卖出金额前 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 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 300015 | 爱尔眼科 | 14,092,977.40 | 6.76 |
| 2 | 000661 | 长春高新 | 13,608,520.82 | 6.53 |
| 3 | 300601 | 康泰生物 | 9,608,040.00 | 4.61 |
| 4 | 300760 | 迈瑞医疗 | 6,937,529.66 | 3.33 |
| 5 | 002044 | 美年健康 | 6,603,906.00 | 3.17 |
| 6 | 300253 | 卫宁健康 | 6,278,442.00 | 3.01 |
| 7 | 002007 | 华兰生物 | 5,781,854.78 | 2.77 |
| 8 | 300122 | 智飞生物 | 5,686,998.76 | 2.73 |
| 9 | 000538 | 云南白药 | 5,364,032.59 | 2.57 |
| 10 | 300347 | 泰格医药 | 5,301,621.55 | 2.54 |
| 11 | 300003 | 乐普医疗 | 4,829,208.73 | 2.32 |
| 12 | 002001 | 新和成 | 4,676,389.39 | 2.24 |
| 13 | 002821 | 凯莱英 | 4,274,447.97 | 2.05 |
| 14 | 600763 | 通策医疗 | 3,750,225.48 | 1.80 |
| 15 | 300529 | 健帆生物 | 3,664,720.03 | 1.76 |
| 16 | 300595 | 欧普康视 | 3,032,954.78 | 1.45 |
| 17 | 600079 | 人福医药 | 2,771,955.00 | 1.33 |
| 18 | 300558 | 贝达药业 | 2,696,747.00 | 1.29 |
| 19 | 000963 | 华东医药 | 2,695,544.60 | 1.29 |
| 20 | 300357 | 我武生物 | 2,413,607.00 | 1.16 |

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 392,947,712.14 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 175,644,516.22 |

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 97,805.12 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,529,980.49 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,509.33 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,630,294.94 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 公司名称 | 流通受限部分的公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------------|--------------|----------|
| 1 | 688568 | 中科星图 | 112,756.76 | 0.05 | 新发未上市 |
| 2 | 688027 | 国盾量子 | 78,474.42 | 0.04 | 新发未上市 |

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|-----------|--------------|-----------|----------------|-----------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例（%） | 持有份额 | 占总份额比例（%） |
| 5,133 | 34,091.55 | 6,233,885.00 | 3.56 | 168,758,042.00 | 96.44 |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例（%） |
|----|------------------------|--------------|-------------|
| 1 | 方正证券股份有限公司 | 3,004,502.00 | 1.72 |
| 2 | 赵传旺 | 2,000,000.00 | 1.14 |
| 3 | 慕德俊 | 1,999,000.00 | 1.14 |
| 4 | 邵学军 | 1,770,000.00 | 1.01 |
| 5 | 裴蕾 | 1,700,000.00 | 0.97 |
| 6 | 北京市工业技术开发中心 | 1,700,000.00 | 0.97 |
| 7 | 孙荣秋 | 1,500,000.00 | 0.86 |
| 8 | 李亚成 | 1,500,000.00 | 0.86 |
| 9 | 华泰证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户 | 1,258,300.00 | 0.72 |
| 10 | 邓小燕 | 1,100,000.00 | 0.63 |

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 0 |

| | |
|-----------------|---|
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |
|-----------------|---|

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2020 年 4 月 24 日）基金份额总额 | 343,991,927.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 18,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 187,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 174,991,927.00 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

2020 年 4 月 8 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，宋振茹女士因退休不再担任公司副总经理职务。

2020 年 5 月 6 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司机构首席投资官任职公告》，郭杰先生任公司机构首席投资官。

2020 年 6 月 19 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，郭松先生任公司督察长，王炜女士因工作分工不再担任公司督察长职务。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内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

报告期内本基金聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的审计机构。

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

报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中信建投证券股份有限公司 | 4 | 426,930,289.90 | 75.20% | 298,854.07 | 75.20% | 新增 |
| 中信证券股份有限公司 | 7 | 140,791,539.76 | 24.80% | 98,555.21 | 24.80% | 新增 |
| 安信证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | 新增 |
| 北京高华证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 渤海证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 长城证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | 新增 |
| 长江证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 东北证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 东方证券股份有限公司 | 4 | - | - | - | - | 新增 |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|----|
| 东吴证券股 份有限公司 | 3 | - | - | - | - | 新增 |
| 东兴证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 方正证券股 份有限公司 | 5 | - | - | - | - | 新增 |
| 光大证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 广发证券股 份有限公司 | 4 | - | - | - | - | 新增 |
| 国海证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 国金证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | 3 | - | - | - | - | 新增 |
| 国信证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 国元证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 海通证券股 份有限公司 | 3 | - | - | - | - | 新增 |
| 宏信证券有 限责任公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 华宝证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 华创证券有 限责任公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |

| | | | | | | |
|---------------------|---|---|---|---|---|----|
| 华福证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 华泰证券股 份有限公司 | 5 | - | - | - | - | 新增 |
| 华西证券股 份有限公司 | 3 | - | - | - | - | 新增 |
| 民生证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 平安证券股 份有限公司 | 4 | - | - | - | - | 新增 |
| 瑞银证券有 限责任公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 申万宏源证 券有限公司 | 3 | - | - | - | - | 新增 |
| 天风证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 西部证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 西南证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 湘财证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 新时代证券 股份有限公 司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 信达证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 兴业证券股 份有限公司 | 3 | - | - | - | - | 新增 |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|----|
| 英大证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 招商证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 浙商证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 中国国际金 融股份有限 公司 | 5 | - | - | - | - | 新增 |
| 中国银河证 券股份有限 公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 中国中金财 富证券有限 公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 中航证券有 限公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 中泰证券股 份有限公司 | 5 | - | - | - | - | 新增 |
| 中信证券华 南股份有限 公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |

注:1. 本表“佣金”指本基金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等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范, 在近一年内无重大违规行为;
- (2) 公司财务状况良好;

(3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

(4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 广州证券股份有限公司更名为中信证券华南股份有限公司。

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 | |
|--------------|------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | 408,100,000.00 | 100.00% | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 公司 | | | | | | |
| 东吴证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 有限责任 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 有限责任 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 有限责任 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---------------------|--|--|--|--|--|--|
| 有限责任 公司 | | | | | | |
| 华泰证券 股份有限 公司 | | | | | | |
| 华西证券 股份有限 公司 | | | | | | |
| 民生证券 股份有限 公司 | | | | | | |
| 平安证券 股份有限 公司 | | | | | | |
| 瑞银证券 有限责任 公司 | | | | | | |
| 申万宏源 证券有限 公司 | | | | | | |
| 天风证券 股份有限 公司 | | | | | | |
| 西部证券 股份有限 公司 | | | | | | |
| 西南证券 股份有限 公司 | | | | | | |
| 湘财证券 股份有限 公司 | | | | | | |
| 新时代证 券股份有 限公司 | | | | | | |
| 信达证券 股份有限 公司 | | | | | | |
| 兴业证券 股份有限 公司 | | | | | | |
| 英大证券 有限责任 公司 | | | | | | |

| | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 招商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国中金财富证券有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券华南股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|----------------------------------------------------|----------------------------|------------------|
| 1 | 关于增加中信证券等为嘉实中证医药健康 100 交易型开放式指数证券投资基金网下认购发售代理机构的公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 03 月 25 日 |
| 2 | 关于增加长江证券为嘉实中证医药健康 100 交易型开放式指数证券投资基金网下认购发售代理机构的公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 04 月 14 日 |
| 3 | 嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金上网发售的提示性公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 04 月 15 日 |
| 4 | 嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 04 月 25 日 |
| 5 | 嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 06 月 05 日 |
| 6 | 嘉实中证医药健康 100 策略交易型开 | 证券日报、基金管理人 | 2020 年 06 月 05 日 |

| | | | |
|---|----------------------------------------|----------------------------|------------------|
| | 放式指数证券投资基金上市交易公告书 | 网站及中国证监会基金电子披露网站 | |
| 7 | 嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 06 月 10 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|------|--------------|--------------|------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | - | - | - | - | - | - | - |
| 个人 | 1 | 2020/04/21 至 2020/04/21 | - | 3,364,080.00 | 3,364,080.00 | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> | | | | | | | |

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金基金注册的批复文件；

(2) 《嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

(3) 《嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

(4) 《嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数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) 报告期内嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail: service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2020 年 08 月 29 日