

华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资
基金联接基金(原华宝中证医疗指数证券
投资基金)
2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2021 年 07 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 05 月 13 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	华宝医疗 ETF 联接
场内简称	医疗基金
基金主代码	162412
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 5 月 13 日
报告期末基金份额总额	2,174,418,937.91 份
投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金可以通过申购赎回代理券商以成份股实物形式申购及赎回目标 ETF 基金份额，也可以通过券商在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额。
业绩比较基准	中证医疗指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型基金，本基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金

	与货币市场基金。本基金主要通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	医疗基金	华宝医疗 ETF 联接 C
下属分级基金的场内简称	医疗基金	-
下属分级基金的交易代码	162412	012323
报告期末下属分级基金的份额总额	2,141,260,044.49 份	33,158,893.42 份

2.1.1 目标基金基本情况（转型后）

基金名称	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512170
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 20 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 6 月 17 日
基金管理人名称	华宝基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明（转型后）

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。
业绩比较基准	中证医疗指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪中证医疗指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	华宝中证医疗指数
场内简称	医疗基金
基金主代码	162412

基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 1 日
报告期末基金份额总额	2,150,026,841.98 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构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地调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对股票投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与标的指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中证医疗指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 5 月 13 日-2021 年 6 月 30 日）	
	华宝医疗 ETF 联接 A	华宝医疗 ETF 联接 C
1. 本期已实现收益	482,577,834.37	164,479.57
2. 本期利润	325,364,349.88	3,166,065.71
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1486	0.1457
4. 期末基金资产净值	3,296,066,829.58	51,034,243.24
5. 期末基金份额净值	1.5393	1.5391

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、自 2021 年 5 月 13 日起，增设华宝医疗 ETF 联接 C，C 类份额的实际起始日为 2021 年 5 月 14 日。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 4 月 1 日-2021 年 5 月 12 日）
1. 本期已实现收益	8,883,734.47
2. 本期利润	242,947,435.26

3. 加权平均基金份额本期利润	0.1436
4. 期末基金资产净值	2,993,231,236.02
5. 期末基金份额净值	1.3922

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

华宝医疗 ETF 联接 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	10.57%	1.50%	10.82%	1.56%	-0.25%	-0.06%

华宝医疗 ETF 联接 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	10.55%	1.50%	10.82%	1.56%	-0.27%	-0.06%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：基金转型日 2021 年 5 月 13 日

3.2.2 自基金转型以来基金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

华宝医疗ETF联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效于 2021 年 5 月 13 日，截至报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

3.2 基金净值表现（转型前）

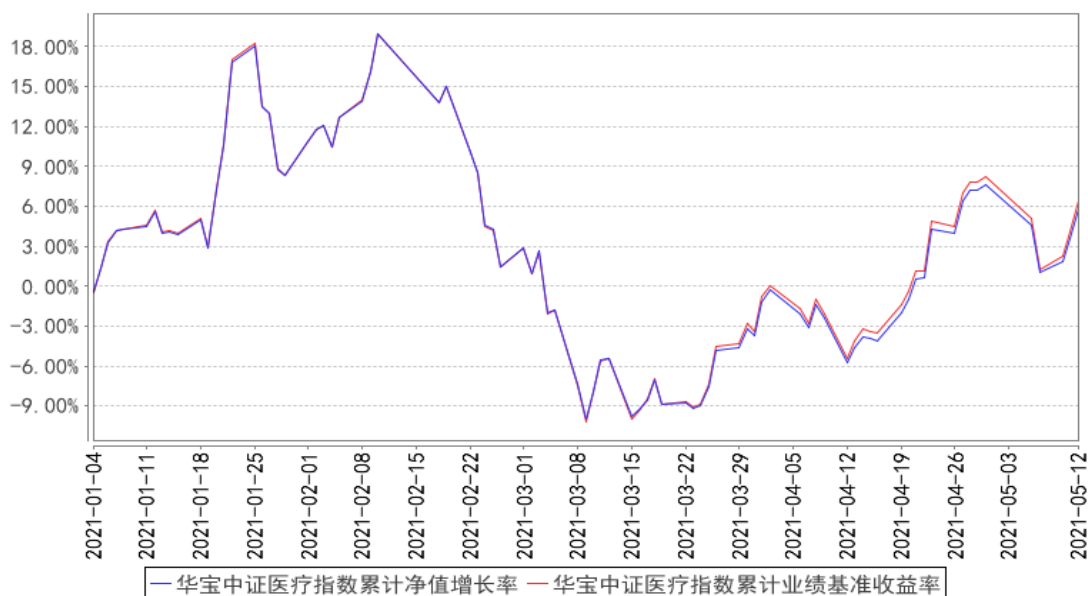
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-11.05%	2.22%	-10.59%	2.26%	-0.46%	-0.04%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同	5.82%	2.20%	6.38%	2.24%	-0.56%	-0.04%

生效起至今					
-------	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华宝中证医疗指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：注：本基金转型日期为 2021 年 1 月 1 日，截止至本报告期末，本基金转型未满一年。

3.3 其他指标

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡洁	本基金基金经理、指数研发投资部总经理	2021 年 5 月 13 日	-	14 年	硕士。2006 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，现任指数研发投资部总经理。2012 年 10 月至 2019 年 1 月任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2012 年 10 月至 2018 年 11 月任华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2015 年 6 月至 2018 年 8 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。2015 年 5 月至 2021 年 1 月任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理。2021 年 1 月至 2021 年 5 月任华宝中证医疗指数证券投资基金基金经理。2021 年 5 月起

					任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2016 年 8 月起任华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2017 年 1 月起任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2017 年 7 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 11 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019 年 1 月至 2021 年 3 月任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 5 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019 年 7 月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019 年 8 月起任华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2019 年 12 月起任华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2021 年 3 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2021 年 6 月起任华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡洁	本基金基金经理、指数研发投资部总经理	2021 年 1 月 1 日	2021 年 5 月 13 日	14 年	硕士。2006 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发和量化投资部工作，现任指数研发投资部总经理。2012 年 10 月至 2019 年 1 月任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2012 年 10 月至 2018 年 11 月任华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2015 年 6 月至 2018 年 8 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。2015

				<p>年 5 月至 2021 年 1 月任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理。2021 年 1 月至 2021 年 5 月任华宝中证医疗指数证券投资基金基金经理。2021 年 5 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2016 年 8 月起任华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2017 年 1 月起任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2017 年 7 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 11 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019 年 1 月至 2021 年 3 月任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 5 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019 年 7 月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019 年 8 月起任华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2019 年 12 月起任华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2021 年 3 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2021 年 6 月起任华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《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

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝中证医疗指数证券投资基金基金合同》、《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生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%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年二季度，在全球经济复苏继续演绎的背景下，大宗商品价格继续走高并带来主要经济体通胀数据的攀升，国内外权益市场在经济持续复苏与流动性充裕的环境下，继续波动上行。展望 2021 年三季度，全球经济复苏的态势料将延续。国内经济的主要动能可能由外需切换为内需，但消费与投资支撑经济韧性仍在。核心产业的转型升级仍然是国内经济关注的焦点，科技创新和消费升级仍然是未来政策支持的重点。证券市场方面，目前市场整体向好，但波动在增加，结构性行情或将延续。2021 年二季度，电气设备、电子、汽车、化工等行业表现较好，家用电器、农林牧渔、房地产、公用事业等行业表现较弱。本报告期内，以中证 100 指数和沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股指数分别下跌了 0.25% 和上涨了 3.48%；而作为成长股代表的中证 1000 指数和创业板指数分别上涨了 12.56% 和 26.05%。在本报告期内，中证医疗指数累计上涨了 23.22%。

本报告期，本基金由华宝中证医疗指数证券投资基金正式转型成为华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金。我们在操作中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金由华宝中证医疗指数投资基金转型为华宝中证医疗交易型开放式指数证

券投资基金联接基金，2021年1月1日至2021年5月12日，华宝中证医疗指数投资基金净值增长率为5.82%，同期业绩比较基准收益率为6.38%。2021年5月13日至2021年6月30日，华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金A净值增长率为10.57%，同期业绩比较基准收益率为10.82%；华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金C净值增长率为10.55%，同期业绩比较基准收益率为10.82%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告（转型后）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,019,729.24	0.09
	其中：股票	3,019,729.24	0.09
2	基金投资	3,156,859,514.56	92.08
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	235,397,342.57	6.87
8	其他资产	33,217,737.68	0.97
9	合计	3,428,494,324.05	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,843,316.13	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	14,356.93	0.00
F	批发和零售业	6,410.76	0.00
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	122,085.91	0.00
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	22,269.23	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,019,729.24	0.09

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	688063	派能科技	5,499	1,082,203.20	0.03
2	688617	惠泰医疗	1,673	624,430.52	0.02
3	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.01
4	300957	贝泰妮	748	188,466.08	0.01
5	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.00
6	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
7	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.00
8	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
9	688636	智明达	918	74,100.96	0.00
10	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金	指数基金	交易型开放式	华宝基金管理有限公司	3,156,859,514.56	94.32

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

5.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,459,254.80
2	应收证券清算款	19,673,763.33
3	应收股利	-
4	应收利息	33,227.56
5	应收申购款	11,018,740.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	32,751.25
8	其他	-
9	合计	33,217,737.68

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688617	惠泰医疗	624,430.52	0.02	新股锁定
2	688076	诺泰生物	241,973.20	0.01	新股锁定
3	300957	贝泰妮	188,466.08	0.01	新股锁定
4	688323	瑞华泰	102,806.14	0.00	新股锁定
5	300919	中伟股份	99,430.00	0.00	新股锁定
6	688682	霍莱沃	98,242.10	0.00	新股锁定
7	300979	华利集团	80,937.50	0.00	新股锁定
8	688636	智明达	74,100.96	0.00	新股锁定
9	300981	中红医疗	54,324.39	0.00	新股锁定

5.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,755,639,103.93	90.61
	其中：股票	2,755,639,103.93	90.61
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	204,660,301.10	6.73
8	其他资产	80,761,299.81	2.66
9	合计	3,041,060,704.84	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	1,305,857,770.75	43.63
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	100,558,578.24	3.36
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	537,467,808.43	17.96
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	808,441,411.05	27.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

合计	2,752,325,568.47	91.95
----	------------------	-------

5.2.2 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	13,307.01	0.00
B	采矿业	59,572.76	0.00
C	制造业	2,843,132.51	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,687.95	0.00
E	建筑业	9,132.77	0.00
F	批发和零售业	7,773.60	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	9,532.04	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	86,315.81	0.00
J	金融业	54,774.37	0.00
K	房地产业	10,880.32	0.00
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	208,426.32	0.01
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		3,313,535.46	0.11

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	603259	药明康德	2,126,390	325,720,420.20	10.88
2	300760	迈瑞医疗	683,078	307,986,208.64	10.29
3	300015	爱尔眼科	3,354,449	250,677,973.77	8.37
4	300347	泰格医药	1,067,433	167,800,467.60	5.61
5	600763	通策医疗	456,660	153,136,364.40	5.12
6	300003	乐普医疗	3,110,596	94,810,966.08	3.17
7	300529	健帆生物	982,024	93,390,482.40	3.12
8	300595	欧普康视	747,696	91,974,084.96	3.07
9	603882	金城医学	678,904	91,652,040.00	3.06

10	300759	康龙化成	487,800	84,086,964.00	2.81
----	--------	------	---------	---------------	------

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	688063	派能科技	5,499	790,041.33	0.03
2	688617	惠泰医疗	1,673	449,936.62	0.02
3	688660	电气风电	51,238	278,734.72	0.01
4	300912	凯龙高科	5,117	165,586.12	0.01
5	300957	贝泰妮	748	131,184.24	0.00

5.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	511,288.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	88,921.40
5	应收申购款	80,119,617.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	41,472.76
8	其他	-
9	合计	80,761,299.81

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公	占基金资产净	流通受限情况
----	------	------	----------	--------	--------

			允价值（元）	值比例（%）	说明
1	688063	派能科技	790,041.33	0.03	新股锁定
2	688617	惠泰医疗	449,936.62	0.02	新股锁定
3	688660	电气风电	278,734.72	0.01	新股流通受限
4	300912	凯龙高科	165,586.12	0.01	新股锁定
5	300957	贝泰妮	131,184.24	0.00	新股锁定

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	华宝医疗 ETF 联接 A	华宝医疗 ETF 联接 C
基金合同生效日(2021年5月13日)基金份额总额	2,150,026,841.98	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	339,563,518.56	75,598,420.89
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	348,330,316.05	42,439,527.47
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	2,141,260,044.49	33,158,893.42

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,437,651,443.50
报告期期间基金总申购份额	908,841,385.16
减：报告期期间基金总赎回份额	196,465,986.68
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,150,026,841.98

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	华宝医疗 ETF 联接 A	华宝医疗 ETF 联接 C
基金合同生效日(2021年5月13日)管理人持有的本基金份额	88,260.78	-
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-	-

基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	88,260.78	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.00	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	88,260.78
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	88,260.78
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

无

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2021 年 5 月 12 日发布《关于华宝中证医疗指数证券投资基金变更为华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金、增加 C 类份额、降低管理费率 and 托管费率并修订基金合同和托管协议的公告》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同；

华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书；
华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

9.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2021 年 7 月 21 日