

汇添富创新医药主题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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	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	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
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	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	66
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	66
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	66
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12 投资组合报告附注.....	66
§ 8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
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.....	67
§ 9 开放式基金份额变动	68
§ 10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	68
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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
10.4 基金投资策略的改变.....	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8 其他重大事件.....	74
§ 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	76
12.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富创新医药主题混合型证券投资基金
基金简称	添富创新医药混合
基金主代码	006113
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 08 月 08 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	4,087,919,881.33
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，重点投资于创新医药主题相关的优质上市公司，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金。投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘优质的创新医药主题上市公司。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率*50%+中债综合指数收益率*30%+恒生医疗保健指数收益率(使用估值汇率折算)*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	021-60637111
传真	021-28932998	021-60635778
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼	北京市西城区闹市口大街一 号院一号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	李文	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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

2.5 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)
本期已实现收益	873,319,829.07
本期利润	3,528,762,101.37
加权平均基金份额本期利润	0.9081
本期加权平均净值利润率	47.37%
本期基金份额净值增长率	57.27%
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	1,677,245,276.13
期末可供分配基金份额利润	0.4103
期末基金资产净值	10,267,507,487.46
期末基金份额净值	2.5117
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	151.17%

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

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	17.16%	1.48%	10.94%	0.85%	6.22%	0.63%
过去三个月	40.34%	1.59%	21.00%	1.00%	19.34%	0.59%
过去六个月	57.27%	1.77%	25.21%	1.19%	32.06%	0.58%
过去一年	88.21%	1.47%	37.31%	0.97%	50.90%	0.50%
自基金合同生效日起至今	151.17%	1.33%	28.79%	1.10%	122.38%	0.23%

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

添富创新医药混合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（2018年08月08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		
郑磊	本基金的基金经理	2018年08月08日		10	国籍：中国。 学历：复旦大学社会医学与卫生事业管理硕士。相关业务资格：证券投资基金业务资格。从业经历：曾任国泰君安证券有限公司研究员、

					中海基金管理 有限责任公司 医药行业分析 师、2014 年 12 月 17 日至 2017 年 11 月 8 日任 中海医药混合 的基金经理， 2015 年 6 月 9 日至 2017 年 11 月 8 日任中海 医疗保健主题 股票的基金经 理。2017 年 11 月加入汇添富 基金，2018 年 8 月 8 日至今任 添富创新医药 混合的基金经 理，2019 年 4 月 9 日至今任 汇添富医药保 健混合的基金 经理，2020 年 3 月 13 日至今 任汇添富中盘 积极成长混合 的基金经理。
刘江	本基金的 基金经理	2018 年 08 月 08 日	2020 年 05 月 29 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 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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本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。

4.3.2 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。

4.4 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

报告期内本基金继续坚持了以成长+价值为主导的投资思路，立足企业中长期基本面，选择高质量证券，集中配置了创新药服务、医疗服务、医疗器械、疫苗等较高景气度的子行业。

2020 年上半年，尽管疫情给全球各方面都带来了诸多不确定性，但我们仍然见证了国内经济增长的韧性。与此同时，为了对冲经济向下的风险，各国政府似乎都在尽其所能的释放流动性，国内的优质资产具备了全球的稀缺性。在医药领域，一方面，我们看到了不少细分行业明显受益于短期疫情的扩散，基础防护用品的业绩得到了充分释放；另一方面，我们也看到了医药资产的硬核属性，不少需求的恢复速度也超出了市场的预期。

上半年的医药市场比较活跃，不少投资机会充满了诱惑性，我们希望组合每一次资产的选择都是立足于长期价值的坚持，因此，我们仍然聚焦于对商业模式清晰/竞争优势明确的优质公司的重点配置，放弃追逐了受益于短期疫情爆发的资产，我们希望拓展自己能力圈的同时，有所为而有所不为，力争保持既有投资风格，给投资者带来稳定的回报预期。行业上，

我们主要配置了创新药服务、疫苗、医疗器械、医疗服务等景气度较好的资产。同时，我们仍然坚持组合均衡+子行业分散，尽量控制组合的单一风险来源。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 57.27%。同期业绩比较基准收益率为 25.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们正站在医药黄金时代的黄金起点。政策、资本、人才，构成了行业的天时地利人和。在可见的未来，我们将会看到行业在分层，公司在分层，许多赛道的竞争格局已经形成，行业龙头的竞争优势在逐步增强。与此同时，我们也看到不少新兴产业即将进入爆发期，经过多年技术积累和渠道培育，产业端有了明显的突破，优质供给正在创造需求。这一点，让我们倍感兴奋和期待。

我们认为未来市场的主要矛盾仍然在流动性，对此，我们目前仍然持比较乐观的态度。而在宽松的流动性环境下，医药的优质资产可能将得到持续的估值溢价。我们很明显的感受到，当下市场存在明显的结构性泡沫。我们参与其中的同时，仍需要敬畏市场波动的力量。希望曾经非常痛苦的反思能够对我们未来的组合应对有所帮助。未来如何去应对热门的核心资产可能出现的阶段性均值回归，将成为我们组合的主要任务。

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。

4.7 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：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：汇添富创新医药主题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	1,134,917,411.68	867,613,408.97
结算备付金		16,389,510.19	9,576,741.38
存出保证金		1,425,743.37	827,781.97
交易性金融资产	6.4.7.2	9,255,157,848.78	4,915,454,979.00
其中: 股票投资		9,247,701,660.18	4,915,454,979.00
基金投资		-	-
债券投资		7,456,188.60	-
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		-	18,979,096.32
应收利息	6.4.7.5	216,546.91	202,917.83
应收股利		1,278.18	143.88
应收申购款		103,765,693.72	15,761,402.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,511,874,032.83	5,828,416,472.13
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		23,232,239.54	4,833,667.77
应付赎回款		202,878,106.63	24,951,912.59
应付管理人报酬		11,229,580.48	7,332,239.52
应付托管费		1,871,596.74	1,222,039.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,905,696.81	3,390,067.56
应交税费		48.05	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	249,277.12	292,339.85
负债合计		244,366,545.37	42,022,267.22
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	4,087,919,881.33	3,623,002,349.06

未分配利润	6.4.7.1 0	6,179,587,606.13	2,163,391,855.85
所有者权益合计		10,267,507,487.46	5,786,394,204.91
负债和所有者权益总计		10,511,874,032.83	5,828,416,472.13

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.5117 元，基金份额总额 4,087,919,881.33 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富创新医药主题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		3,609,049,314.55	710,314,642.06
1. 利息收入		3,376,643.67	1,290,970.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,280,322.53	1,290,970.61
债券利息收入		1,431.82	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		94,889.32	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		923,056,625.96	260,105,736.24
其中：股票投资收益	6.4.7.12	901,899,795.49	249,304,470.03
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	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	-	-
股利收益	6.4.7.17	21,156,830.47	10,801,266.21
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,655,442,272.30	446,601,206.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	27,173,772.62	2,316,728.56
减：二、费用		80,287,213.18	28,487,989.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	55,360,531.87	14,248,467.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,226,755.35	2,374,744.45
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	15,564,107.20	11,730,836.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		5.15	-

7. 其他费用	6.4.7.21	135,813.61	133,941.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,528,762,101.37	681,826,652.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,528,762,101.37	681,826,652.32

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富创新医药主题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）	3,623,002,349.06	2,163,391,855.85	5,786,394,204.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,528,762,101.37	3,528,762,101.37
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）	464,917,532.27	487,433,648.91	952,351,181.18
其中：1. 基金申购款	4,514,055,930.89	4,039,336,600.15	8,553,392,531.04
2. 基金赎回款	-4,049,138,398.62	-3,551,902,951.24	-7,601,041,349.86
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）	4,087,919,881.33	6,179,587,606.13	10,267,507,487.46
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）	1,468,616,634.16	-93,060,684.36	1,375,555,949.80
二、本期经营活	-	681,826,652.32	681,826,652.32

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
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）	379,701,938.69	29,579,114.23	409,281,052.92
其中：1. 基金申购款	1,824,661,616.64	266,931,661.61	2,091,593,278.25
2. 基金赎回款	-1,444,959,677.95	-237,352,547.38	-1,682,312,225.33
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）	1,848,318,572.85	618,345,082.19	2,466,663,655.04

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

汇添富创新医药主题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[2018]776号文《关于准予汇添富创新医药主题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2018年8月8日生效。首次设立募集规模为1,435,291,175.00份基金份额。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与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级

债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，重点投资于创新医药主题相关的优质上市公司，谋求基金资产的中长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率×50%+中债综合指数收益率×30%+恒生医疗保健指数收益率（使用估值汇率折算）×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

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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

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，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。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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。

6.4.6.4 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《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。

6.4.6.6 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	1,134,917,411.68
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	1,134,917,411.68

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	5,740,172,194.77	9,247,701,660.18	3,507,529,465.41	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	5,607,000.00	7,456,188.60	1,849,188.60
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	5,607,000.00	7,456,188.60	1,849,188.60
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	5,745,779,194.77	9,255,157,848.78	3,509,378,654.01	

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	211,010.65
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	3,346.00
应收债券利息	1,474.72
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	715.54
合计	216,546.91

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	4,905,696.81
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,905,696.81

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	144,850.98
应付证券出借违约金	-
应付审计费	44,753.80
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		249,277.12

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,623,002,349.06	3,623,002,349.06
本期申购	4,514,055,930.89	4,514,055,930.89
本期赎回（以“-”号填列）	-4,049,138,398.62	-4,049,138,398.62
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	4,087,919,881.33	4,087,919,881.33

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	685,264,867.46	1,478,126,988.39	2,163,391,855.85
本期利润	873,319,829.07	2,655,442,272.30	3,528,762,101.37
本期基金份额交易产生的变动数	118,660,579.60	368,773,069.31	487,433,648.91

其中：基金申购款	1,138,172,345.37	2,901,164,254.78	4,039,336,600.15
基金赎回款	-1,019,511,765.77	-2,532,391,185.47	-3,551,902,951.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,677,245,276.13	4,502,342,330.00	6,179,587,606.13

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	3,171,875.44
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	94,709.07
其他	13,738.02
合计	3,280,322.53

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	4,907,259,942.98
减：卖出股票成本总额	4,005,360,147.49
买卖股票差价收入	901,899,795.49

6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

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	21,156,830.47
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	21,156,830.47

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	2,655,442,272.30
——股票投资	2,653,593,083.70
——债券投资	1,849,188.60
——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	-
——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	2,655,442,272.30

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	27,173,772.62
替代损益	-
其他	-
合计	27,173,772.62

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	15,564,107.20
银行间市场交易费用	-
合计	15,564,107.20

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	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	22,387.47
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	-
合计	135,813.61

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
中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”)	基金托管人, 基金代销机构
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	2,340,291,582.37	22.10	1,499,990,418.96	18.54

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	2,147,810.14	23.00	1,149,641.88	23.43
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	1,373,693.95	19.13	555,836.06	23.93

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	上年度可比期间
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	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	55,360,531.87	14,248,467.25
其中：支付销售机构的客户维护费	12,747,166.99	3,316,175.60

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核

对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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	9,226,755.35	2,374,744.45

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
基金合同生效日 2018 年 08 月 08 日持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	17,817,895.11	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	17,817,895.11	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 (%)	0.44	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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
建设银行	1,134,917,411.68	3,171,875.44	368,559,940.99	1,144,552.34

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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

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

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
300840	酷特智能	2020年06月30日	2020年07月08日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	
300846	首都在线	2020年06月22日	2020年07月01日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	
68856	中	202	202	新	16.2	16.2	11,020	178,634.20	178,634.20	

8	科 星 图	0 年 06 月 30 日	0 年 07 月 08 日	股 流 通 受 限	1	1			
688027	国 盾 量 子	2020 年 06 月 30 日	2020 年 07 月 09 日	新 股 流 通 受 限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40
688528	秦 川 物 联	2020 年 06 月 19 日	2020 年 07 月 01 日	新 股 流 通 受 限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21
300847	中 船 汉 光	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 09 日	新 股 流 通 受 限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74
688377	迪 威	2020	2020	新 股	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48

	尔	年 06 月 29 日	年 07 月 08 日	流 通 受 限						
300759	康 龙 化 成	2020 年 06 月 23 日	2020 年 12 月 23 日	大 宗 流 通 受 限	82.9 4	89.7 2	1,500,0 00	124,410,000 .00	134,580,000 .00	
300845	捷 安 高 科	2020 年 06 月 24 日	2020 年 07 月 03 日	新 股 流 通 受 限	17.6 3	17.6 3	470	8,286.10	8,286.10	
300843	胜 蓝 股 份	2020 年 06 月 23 日	2020 年 07 月 02 日	新 股 流 通 受 限	10.0 1	10.0 1	751	7,517.51	7,517.51	
688277	天 智 航	2020 年	2020 年	新 股 流	12.0 4	12.0 4	8,810	106,072.40	106,072.40	

		06 月 24 日	07 月 07 日	通 受 限						
--	--	--------------------	--------------------	-------------	--	--	--	--	--	--

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。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的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，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；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 202 0年 06 月 30 日	1 - 3 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	1,134,917,411.68	-	-	-	-	-	1,134,917,411.68
结 算 备 付 金	16,389,510.19	-	-	-	-	-	16,389,510.19
存 出	1,425,743.37	-	-	-	-	-	1,425,743.37

保 证 金							
交 易 性 金 融 资 产	-	-	7,456,188. 60	-	-	9,247,701,660. 18	9,255,157,848. 78
应 收 股 利	-	-	-	-	-	1,278.18	1,278.18
应 收 利 息	-	-	-	-	-	216,546.91	216,546.91
应 收 申 购 款	-	-	-	-	-	103,765,693.72	103,765,693.72
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	1,152,732,665. 24	-	7,456,188. 60	-	-	9,351,685,178. 99	10,511,874,032 .83
负 债							
应 付 赎 回	-	-	-	-	-	202,878,106.63	202,878,106.63

款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,229,580.48	11,229,580.48
应付托管费	-	-	-	-	-	1,871,596.74	1,871,596.74
应付证券清算款	-	-	-	-	-	23,232,239.54	23,232,239.54
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-

应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,905,696.81	4,905,696.81
应交税费	-	-	-	-	-	48.05	48.05
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	249,277.12	249,277.12

负 债 总 计	-	-	-	-	-	244,366,545.37	244,366,545.37
利 率 敏 感 度 缺 口	1,152,732,665. 24	-	7,456,188. 60	-	-	9,107,318,633. 62	10,267,507,487 .46
上 年 度 末 201 9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	867,613,408.97	-	-	-	-	-	867,613,408.97
结 算	9,576,741.38	-	-	-	-	-	9,576,741.38

备付金							
存出保证金	827,781.97	-	-	-	-	-	827,781.97
交易性金融资产	-	-	-	-	-	4,915,454,979.00	4,915,454,979.00
应收股利	-	-	-	-	-	143.88	143.88
应收利息	-	-	-	-	-	202,917.83	202,917.83
应收申购款	-	-	-	-	-	15,761,402.78	15,761,402.78
衍	-	-	-	-	-	-	-

生 金 融 资 产								
应 收 证 券 清 算 款		-	-	-	-	-	18,979,096.32	18,979,096.32
买 入 返 售 金 融 资 产		-	-	-	-	-	-	-
其 他 资 产		-	-	-	-	-	-	-
资 产 总 计	878,017,932.32	-	-	-	-	-	4,950,398,539.81	5,828,416,472.13
负								

债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	24,951,912.59	24,951,912.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,332,239.52	7,332,239.52
应付托管费	-	-	-	-	-	1,222,039.93	1,222,039.93
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,833,667.77	4,833,667.77
卖出回购	-	-	-	-	-	-	-

金融 资产 款							
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	3,390,067.56	3,390,067.56
应交 税费	-	-	-	-	-	-	-
应付 利息	-	-	-	-	-	-	-
应付 利	-	-	-	-	-	-	-

润							
其他 负 债	-	-	-	-	-	292,339.85	292,339.85
负 债 总 计	-	-	-	-	-	42,022,267.22	42,022,267.22
利 率 敏 感 度 缺 口	878,017,932.32	-	-	-	-	4,908,376,272. 59	5,786,394,204. 91

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：本基金持有的可转换债券的市场风险在附注 6.4.13.4.3.1 中进行披露；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	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	227,704,798.61	-	227,704,798.61
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	-	-	-	-
应收股利	-	1,278.18	-	1,278.18
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	-	227,706,076.79	-	227,706,076.79
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	-	-	-	-
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	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇率风险敞口净额	-	227,706,076.79	-	227,706,076.79
	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	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	111,682,876.41	-	111,682,876.41
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	-	-	-	-
应收股利	-	143.88	-	143.88
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	-	111,683,020.29	-	111,683,020.29
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	-	-	-	-
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	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	111,683,020.29	-	111,683,020.29

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
分析	相关风险变量的变动	人民币元	
		本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	11,385,254.56	5,584,151.01

	港币相对人民币贬值 5%	-11,385,254.56	-5,584,151.01
--	--------------	----------------	---------------

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	9,247,701.6 60.18	90.07	4,915,454.9 79.00	84.95
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	7,456,188.6 0	0.07	—	—
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	9,255,157.8 48.78	90.14	4,915,454.9 79.00	84.95

注：本基金投资股票资产占基金资产比例为 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别，法律法规另有规定

的从其规定。本基金投资于创新医药主题上市公司股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。上表列示于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险。

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
	中证医药卫生指数上涨 5%	497,022,675.11	229,718,799.74
	中证医药卫生指数下跌 5%	-497,022,675.11	-229,718,799.74

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（元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	-------	--------------

1	权益投资	9,247,701,660.18	87.97
	其中：股票	9,247,701,660.18	87.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,456,188.60	0.07
	其中：债券	7,456,188.60	0.07
	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	1,151,306,921.87	10.95
8	其他资产	105,409,262.18	1.00
9	合计	10,511,874,032.83	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 227,704,798.61 元，占期末净值比例为 2.22%。

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	211,278.91	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,510,838,943.46	63.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	111,481.14	0.00
E	建筑业	75,030.70	0.00
F	批发和零售业	184,712,235.11	1.80
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	5,669,990.94	0.06

J	金融业	957,096.26	0.01
K	房地产业	119,718.00	0.00
L	租赁和商务服务业	49,401.82	0.00
M	科学研究和技术服务业	808,430,581.95	7.87
N	水利、环境和公共设施管理业	63,801.27	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	1,508,757,302.01	14.69
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,019,996,861.57	87.85

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	537,650.78	0.01
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	226,408,800.81	2.21
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 电信服务	728,705.89	0.01
55 公用事业	-	-
60 房地产	29,641.13	0.00

合计	227,704,798.61	2.22
----	----------------	------

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

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	603259	药明康德	6,970,086	673,310,307.60	6.56
2	300015	爱尔眼科	14,580,380	633,517,511.00	6.17
3	300760	迈瑞医疗	2,024,365	618,848,380.50	6.03
4	603658	安图生物	3,376,751	548,519,432.44	5.34
5	600276	恒瑞医药	5,872,314	542,014,582.20	5.28
6	600521	华海药业	15,645,299	530,844,995.07	5.17
7	600529	山东药玻	8,809,744	510,965,152.00	4.98
8	000661	长春高新	1,030,352	448,512,225.60	4.37
9	002821	凯莱英	1,839,485	446,994,855.00	4.35
10	300601	康泰生物	2,657,335	430,913,443.60	4.20

11	600763	通策医疗	2,566,081	427,945,328.37	4.17
12	300122	智飞生物	4,097,130	410,327,569.50	4.00
13	688016	心脉医疗	754,302	261,938,912.52	2.55
14	603520	司太立	2,837,538	238,523,444.28	2.32
15	300347	泰格医药	2,300,703	234,395,621.64	2.28
16	01066	威高股份	14,340,000	225,822,098.30	2.20
17	603882	金域医学	2,378,758	212,898,841.00	2.07
18	300357	我武生物	3,282,323	204,324,606.75	1.99
19	600436	片仔癀	1,149,705	195,737,276.25	1.91
20	300463	迈克生物	3,345,906	194,832,106.38	1.90
21	300595	欧普康视	2,767,638	191,908,018.92	1.87
22	603939	益丰药房	2,029,449	184,679,859.00	1.80
23	300725	药石科技	1,453,346	180,578,240.50	1.76
24	600079	人福医药	6,029,172	164,114,061.84	1.60
25	300452	山河药辅	5,411,154	142,042,792.50	1.38
26	300759	康龙化	1,500,100	134,589,840.00	1.31

		成			
27	603707	健友股 份	1,560,334	100,750,766.38	0.98
28	002901	大博医 疗	722,215	86,153,027.35	0.84
29	300702	天宇股 份	464,321	49,366,608.72	0.48
30	688085	三友医 疗	32,135	2,547,984.15	0.02
31	688029	南微医 学	9,534	2,312,376.36	0.02
32	688111	金山办 公	4,137	1,413,116.46	0.01
33	688106	金宏气 体	26,075	1,355,378.50	0.01
34	688520	神州细 胞	12,351	932,747.52	0.01
35	688099	晶晨股 份	15,597	870,156.63	0.01
36	688023	安恒信 息	2,728	839,951.20	0.01
37	00700	腾讯控 股	1,600	728,705.89	0.01
38	601077	渝农商 行	147,911	698,139.92	0.01
39	06862	海底捞	18,000	537,650.78	0.01
40	688051	佳华科 技	4,053	514,690.47	0.01
41	688222	成都先	9,201	499,154.25	0.00

		导			
42	688166	博瑞医药	8,041	497,657.49	0.00
43	688365	光云科技	8,249	481,246.66	0.00
44	02269	药明生物	3,500	453,340.27	0.00
45	688566	吉贝尔	9,882	449,631.00	0.00
46	688198	佰仁医疗	3,213	423,248.49	0.00
47	688518	联赢激光	14,111	389,886.93	0.00
48	002157	正邦科技	21,900	382,812.00	0.00
49	688558	国盛智科	8,488	376,018.40	0.00
50	688138	清溢光电	10,066	278,425.56	0.00
51	688030	山石网科	5,043	238,130.46	0.00
52	688555	泽达易盛	3,004	234,312.00	0.00
53	600966	博汇纸业	22,100	224,315.00	0.00
54	688228	开普云	2,718	212,330.16	0.00
55	688058	宝兰德	1,450	205,871.00	0.00
56	688188	柏楚电子	1,246	203,222.60	0.00
57	688516	奥特维	3,440	187,996.00	0.00

58	600918	中泰证 券	14,487	186,013.08	0.00
59	688399	硕世生 物	653	181,534.00	0.00
60	688568	中科星 图	11,020	178,634.20	0.00
61	300832	新产业	882	151,871.58	0.00
62	002714	牧原股 份	1,846	151,372.00	0.00
63	01177	中国生 物制药	10,000	133,362.24	0.00
64	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
65	603392	万泰生 物	785	129,525.00	0.00
66	688310	迈得医 疗	3,276	123,144.84	0.00
67	600048	保利地 产	8,100	119,718.00	0.00
68	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
69	688027	国盾量 子	2,830	102,389.40	0.00
70	603489	八方股 份	701	98,833.99	0.00
71	002985	北摩高 科	782	97,335.54	0.00
72	601778	晶科科 技	12,349	97,063.14	0.00
73	688528	秦川物 联	8,337	94,458.21	0.00

74	300803	指南针	1,393	78,606.99	0.00
75	601827	三峰环境	6,723	63,801.27	0.00
76	603786	科博达	816	61,485.60	0.00
77	002982	湘佳股份	581	59,906.91	0.00
78	300821	东岳硅胶	5,703	59,083.08	0.00
79	002989	中天精装	980	55,056.40	0.00
80	002990	盛视科技	612	53,807.04	0.00
81	603927	中科软	884	53,428.96	0.00
82	000538	云南白药	511	47,936.91	0.00
83	601609	金田铜业	4,477	46,829.42	0.00
84	002962	五方光电	1,916	46,807.88	0.00
85	002987	京北方	770	45,853.50	0.00
86	002980	华盛昌	700	44,492.00	0.00
87	300829	金丹科技	574	42,872.06	0.00
88	300822	贝仕达克	933	41,901.03	0.00
89	300831	派瑞股份	1,716	41,372.76	0.00
90	603093	南华期货	1,769	38,104.26	0.00

91	002961	瑞达期货	1,260	34,839.00	0.00
92	603610	麒盛科技	1,037	33,266.96	0.00
93	300837	浙矿股份	737	33,187.11	0.00
94	603353	和顺石油	689	32,376.11	0.00
95	300806	斯迪克	666	31,868.10	0.00
96	002986	宇新股份	630	31,783.50	0.00
97	002983	芯瑞达	660	31,554.60	0.00
98	300825	阿尔特	1,642	31,280.10	0.00
99	01918	融创中国	1,000	29,641.13	0.00
100	002959	小熊电器	226	27,798.00	0.00
101	603390	通达电气	2,119	27,716.52	0.00
102	605001	威奥股份	1,353	27,709.44	0.00
103	002979	雷赛智能	1,005	27,104.85	0.00
104	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
105	300833	浩洋股份	406	26,430.60	0.00
106	300805	电声股份	1,142	26,174.64	0.00

107	300830	金现代	1,671	26,134.44	0.00
108	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
109	603950	长源东 谷	1,081	25,716.99	0.00
110	002981	朝阳科 技	490	24,348.10	0.00
111	603682	锦和商 业	2,018	23,227.18	0.00
112	300838	浙江力 诺	909	22,243.23	0.00
113	300809	华辰装 备	1,107	21,918.60	0.00
114	603221	爱丽家 居	1,442	21,442.54	0.00
115	002988	豪美新 材	1,097	20,491.96	0.00
116	603815	交建股 份	958	19,974.30	0.00
117	603095	越剑智 能	630	19,000.80	0.00
118	603212	赛伍技 术	715	18,954.65	0.00
119	300842	帝科股 份	455	18,527.60	0.00
120	603992	松霖科 技	1,135	18,114.60	0.00
121	300823	建科机 械	453	13,096.23	0.00
122	600956	新天绿	2,533	12,766.32	0.00

		能			
123	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
124	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
125	600570	恒生电子	78	8,400.60	0.00
126	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
127	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
128	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
129	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
130	603115	海星股份	199	3,757.12	0.00
131	603755	日辰股份	37	3,269.32	0.00
132	002960	青鸟消防	100	2,332.00	0.00
133	300787	海能实业	48	1,800.00	0.00
134	003816	中国广核	558	1,651.68	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600521	华海药业	382,213,953.94	6.61
2	300122	智飞生物	366,168,991.20	6.33
3	300760	迈瑞医疗	292,530,387.55	5.06
4	002007	华兰生物	263,083,216.77	4.55
5	603259	药明康德	225,362,799.40	3.89
6	600079	人福医药	216,345,641.74	3.74
7	300326	凯利泰	201,625,696.42	3.48
8	01066	威高股份	196,417,278.53	3.39
9	300015	爱尔眼科	191,973,710.23	3.32
10	300463	迈克生物	188,647,642.12	3.26
11	300357	我武生物	169,212,633.62	2.92
12	300725	药石科技	167,588,646.88	2.90
13	600436	片仔癀	164,370,548.35	2.84
14	300595	欧普康视	157,249,564.14	2.72
15	000739	普洛药业	154,917,745.05	2.68
16	600276	恒瑞医药	141,651,353.42	2.45
17	603658	安图生物	134,520,641.21	2.32
18	603520	司太立	126,191,944.40	2.18
19	300759	康龙化成	124,419,172.00	2.15
20	002821	凯莱英	117,052,085.29	2.02

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002007	华兰生物	288,254,403.83	4.98
2	603882	金域医学	263,968,646.75	4.56
3	000739	普洛药业	262,969,407.32	4.54
4	300326	凯利泰	244,599,445.67	4.23
5	600529	山东药玻	239,108,646.40	4.13
6	600276	恒瑞医药	199,108,504.59	3.44
7	603259	药明康德	185,044,747.35	3.20
8	300601	康泰生物	169,341,015.08	2.93
9	02269	药明生物	157,263,723.85	2.72
10	300347	泰格医药	137,355,564.30	2.37
11	300685	艾德生物	133,429,730.62	2.31
12	300122	智飞生物	132,885,423.39	2.30
13	688085	三友医疗	124,727,055.84	2.16
14	000661	长春高新	122,472,525.37	2.12
15	000538	云南白药	120,124,096.67	2.08
16	688029	南微医学	109,247,544.56	1.89
17	300760	迈瑞医疗	101,244,719.03	1.75
18	603520	司太立	96,102,687.00	1.66
19	002821	凯莱英	94,922,305.56	1.64
20	002475	立讯精密	85,059,799.70	1.47

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。

7.4.3 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	5,684,013,744.97
卖出股票收入（成交）总额	4,907,259,942.98

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	7,456,188.60	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,456,188.60	0.07

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

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	56,070	7,456,188.60	0.07

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	1,425,743.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,278.18
4	应收利息	216,546.91
5	应收申购款	103,765,693.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	105,409,262.18
---	----	----------------

7.12.4 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。

7.12.5 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

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（%）
316,895	12,899.92	1,422,479,987.78	34.80	2,665,439,893.55	65.20

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	8,533,586.86	0.21

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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研部	>100

门负责人持有本开放式基金	
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（2018 年 08 月 08 日）基金份额总额	1,435,291,175.00
本报告期期初基金份额总额	3,623,002,349.06
本报告期基金总申购份额	4,514,055,930.89
减：本报告期基金总赎回份额	4,049,138,398.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,087,919,881.33

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 (%)	
东方证券	2	2,340,291,582.37	22.10	2,147,810.14	23.00	
西部证券	2	1,974,975,815.95	18.65	1,435,207.35	15.37	
申万宏源证券	2	1,412,564,594.41	13.34	1,275,394.29	13.66	
东吴证券	2	1,218,736,549.16	11.51	1,122,702.94	12.02	
中信证券	3	634,861,406.73	6.00	584,891.98	6.26	

川财 证券	2	619,845,154.64	5.85	569,142.30	6.10	
国金 证券	2	548,956,127.41	5.18	505,731.99	5.42	
中泰 证券	2	465,662,145.03	4.40	430,388.88	4.61	
华菁 证券	2	376,387,770.81	3.55	350,527.36	3.75	
方正 证券	2	285,327,383.04	2.69	259,410.57	2.78	
野村 东方 国际	2	228,778,987.14	2.16	208,487.04	2.23	
华泰 证券	2	190,509,113.41	1.80	177,420.31	1.90	
海通 证券	2	153,586,912.75	1.45	141,899.02	1.52	
太平 洋证 券	2	137,432,790.84	1.30	127,836.09	1.37	
联讯 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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
---	------	--------	------	------

商 名 称	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	-	-	-	-	-	-	-	-
西 部 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申 万 宏 源 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东 吴 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中 信 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
川	-	-	-	-	-	-	-	-

财 证 券									
国 金 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中 泰 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华 菁 证 券	-	-	224,900,000.00	100.00	-	-	-	-	-
方 正 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
野 村 东 方 国 际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华 泰 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

海 通 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
太 平 洋 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
联 讯 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 2 个交易单元：野村东方国际（深交所单元，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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加民生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
3	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
4	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
5	汇添富基金管理股份有限公司关于使用自有资金投资旗下基金的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2020 年 02 月 04 日
6	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	2020 年 03 月 30 日

		券日报	
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	汇添富创新医药主题混合型证券投资基金更新招募说明书 (2020 年 5 月 30 日更新)	公司网站, 证券日报	2020 年 05 月 30 日

13	汇添富基金管理股份有限公司关于调整基金经理的公告（创新医药）	公司网站, 证券日报	2020 年 05 月 30 日
14	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创新医药主题混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富创新医药主题混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富创新医药主题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、报告期内汇添富创新医药主题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