

# 华宝医药生物优选混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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 2024 年 08 月 28 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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的真实、准确和完整发表意见 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	14
6.3 净资产变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	39
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 .....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	41
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 .....	43
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 .....	43

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 .....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.12 投资组合报告附注 .....	44
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</b>
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 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝医药生物优选混合型证券投资基金	
基金简称	华宝医药生物混合	
基金主代码	240020	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 2 月 28 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
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	386,976,795.69 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝医药生物混合 A	华宝医药生物混合 C
下属分级基金的交易代码	240020	019029
报告期末下属分级基金的份额总额	362,571,187.76 份	24,405,607.93 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	把握医药生物相关行业的投资机会，力争在长期内为基金份额持有人获取超额回报。
投资策略	<p>本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。本基金将在不同医药生物相关子行业之间进行配置，所涉及的子行业主要包括以下几个：化学原料药、化学药制剂、中药饮片、中药制剂、医疗器械、医药商业、医疗服务、生物制药和生物农业等。</p> <p>关于个股投资策略，本基金将医药生物类的上市公司分为以下两类：一类为以医药生物相关业务为主业的上市公司；另一类为当前医药生物业务非主业但是未来可能成为其主要利润来源的上市公司。基金管理人将对两类公司分别进行系统地分析，最终确定投资标的股票，构建投资组合。</p>
业绩比较基准	80%中证医药卫生指数+20%上证国债指数
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

### 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	华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	400-700-5588、400-820-5050	021-60637228
传真	021-38505777	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	黄孔威	张金良

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	华宝医药生物混合 A	华宝医药生物混合 C
本期已实现收益	-119,288,593.46	-8,603,858.35
本期利润	-162,722,213.76	-23,658,528.62
加权平均基金份额 本期利润	-0.3745	-0.9918
本期加权平均净 值利润率	-15.80%	-41.80%
本期基金份额净 值增长率	-14.47%	-14.64%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	438,830,342.71	29,667,016.23
期末可供分配基金份额利润	1.2103	1.2156
期末基金资产净值	801,401,530.47	54,072,624.16
期末基金份额净值	2.210	2.216
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	240.48%	-7.74%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于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. 净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4. 期末可供分配利润采用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

华宝医药生物混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.18%	1.25%	-6.19%	0.72%	-0.99%	0.53%
过去三个月	-9.28%	1.19%	-7.80%	0.82%	-1.48%	0.37%
过去六个月	-14.47%	1.63%	-15.66%	1.14%	1.19%	0.49%
过去一年	-16.94%	1.44%	-18.15%	1.02%	1.21%	0.42%
过去三年	-44.79%	1.55%	-46.84%	1.20%	2.05%	0.35%
自基金合同生效起至今	240.48%	1.64%	59.16%	1.28%	181.32%	0.36%

华宝医药生物混合 C

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	----------	----------	--------------	-----	-----

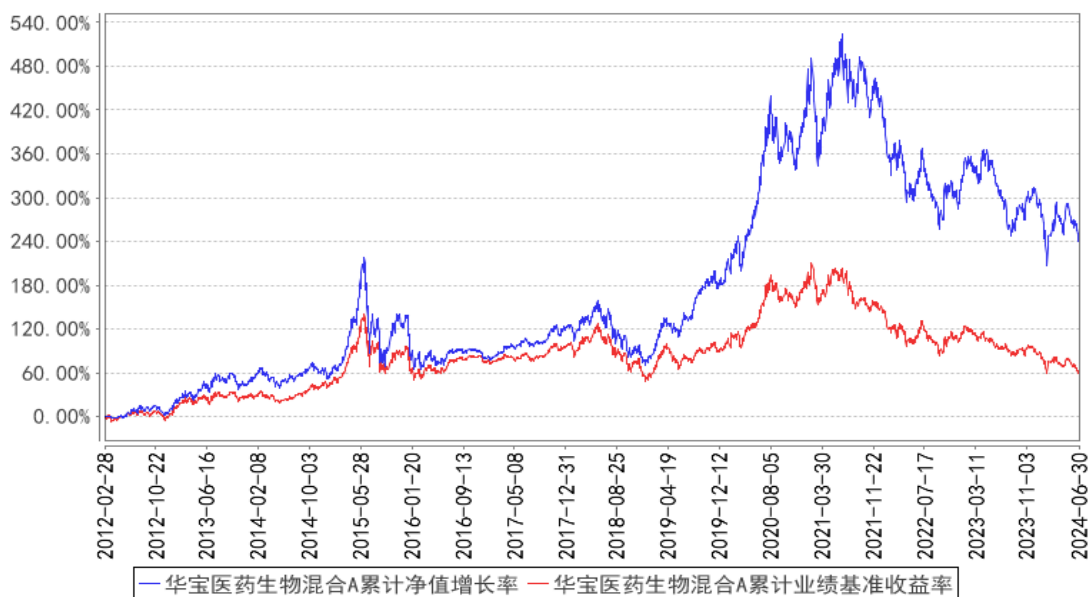
	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	-7.20%	1.25%	-6.19%	0.72%	-1.01%	0.53%
过去三个月	-9.37%	1.19%	-7.80%	0.82%	-1.57%	0.37%
过去六个月	-14.64%	1.63%	-15.66%	1.14%	1.02%	0.49%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-7.74%	1.47%	-15.60%	1.04%	7.86%	0.43%

注：（1）基金业绩基准：80%中证医药卫生指数+20%上证国债指数；

（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

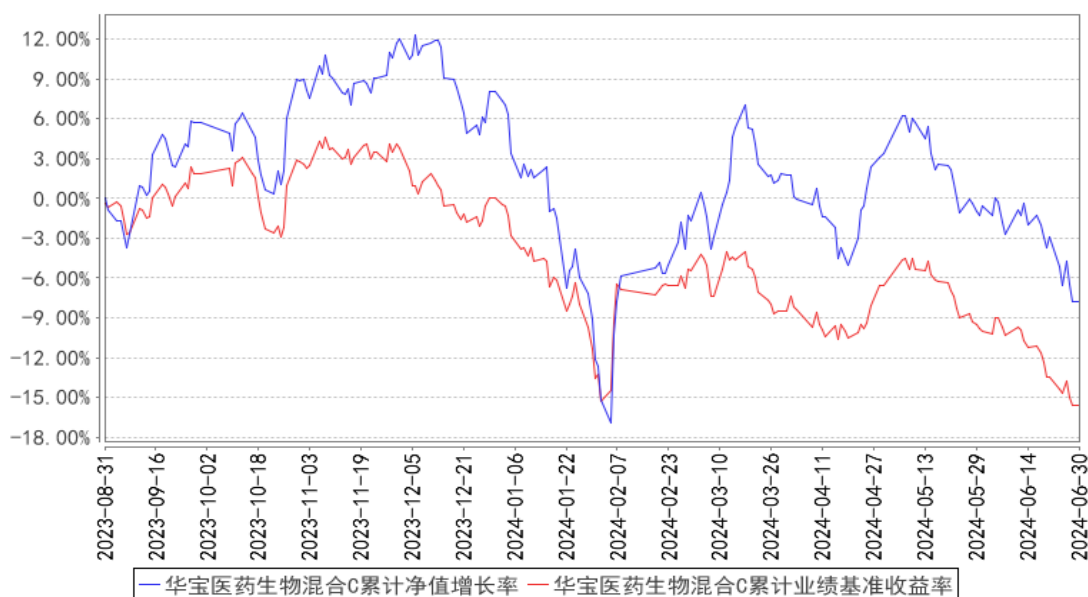
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华宝医药生物混合A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





华宝医药生物混合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：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 6 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 2012 年 08 月 28 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

## § 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

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司。截至本报告期末（2024 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 141 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

#### 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		
张金涛	本基金基金经理	2021-05-07	-	14 年	硕士。曾在华泰联合证券有限责任公司、农银汇理基金管理有限公司、海富通基金

					管理有限公司、国寿养老保险股份有限公司、长江养老保险股份有限公司从事证券研究和投资管理工作。2021 年 4 月加入华宝基金管理有限公司。2021 年 5 月起任华宝大健康混合型证券投资基金、华宝医药生物优选混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月起任华宝创新优选混合型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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 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、《华宝医药生物优选混合型证券投资基金基金合同》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 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，本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 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

报告期内基金继续坚持医药生物行业进入到创新兑现周期的判断，组合配置上绝大部分仓位集中于创新药械板块，获取了较好的相对行业的超额收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为-14.47%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为-14.64%；同期业绩比较基准收益率为-15.66%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管上半年国内医药生物板块受到行业整顿、医保资金担忧、宏观比较等因素的冲击，但是上述因素并没有改变行业进入到创新兑现周期的演进。我们看到创新药的商业化、重点品种的临床数据均有较好的落地，国内自上而下创新支持政策不断出台，也在不断验证创新药械进入到兑现阶段的判断。

医药生物的创新典型的特点就是高研发投入、低成功概率，但是在兑现周期中，资本市场所反映的是创新的第三个重要特征“长周期性”，也就是创新药械研发成功的产品，是以 10 年为维度的领先。在国内创新药专业一轮研发兑现周期中，我们已经看到 ADC 的竞争可能正在缓缓关闭大门，而多抗的竞争进入到白热化。我们所做的就是识别出竞争中的胜者，通过分享从 0 到 1，从 1 到 10 的成长，来获取收益。

我们继续坚持创新药械的配置方向，拥抱这一轮创新药械的兑现周期。而经常担忧的 DRG、行业整顿等仅仅是对行业周期的扰动，并不会改变行业运行方向。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与

托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

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 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，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

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：华宝医药生物优选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	101,232,331.24	109,933,151.64
结算备付金		2,139,628.13	6,309,354.55
存出保证金		365,454.54	419,329.75
交易性金融资产	6.4.7.2	756,264,408.62	1,224,664,892.20
其中：股票投资		756,264,408.62	1,224,664,892.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		1,110,568.28	7,646,788.16
应收股利		-	-
应收申购款		258,614.79	403,702.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		861,371,005.60	1,349,377,218.62
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	-
应付清算款		8,039.57	-
应付赎回款		430,401.86	369,523.62
应付管理人报酬		910,950.09	1,516,971.28
应付托管费		151,825.01	252,828.52
应付销售服务费		33,252.68	66,029.55
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	4,362,381.76	4,323,379.77
负债合计		5,896,850.97	6,528,732.74

<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	386,976,795.69	519,517,575.46
未分配利润	6.4.7.8	468,497,358.94	823,330,910.42
净资产合计		855,474,154.63	1,342,848,485.88
负债和净资产总计		861,371,005.60	1,349,377,218.62

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 386,976,795.69 份，其中华宝医药生物混合 A 基金份额总额 362,571,187.76 份，基金份额净值 2.210 元；华宝医药生物混合 C 基金份额总额 24,405,607.93 份，基金份额净值 2.216 元。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝医药生物优选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-178,579,797.68	2,092,022.32
1. 利息收入		233,839.30	137,645.77
其中：存款利息收入	6.4.7.9	233,839.30	137,645.77
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-120,811,736.77	30,684,537.59
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-126,343,736.07	27,453,282.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	5,531,999.30	3,231,255.40
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-58,488,290.57	-28,805,177.57
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	486, 390. 36	75, 016. 53
<b>减：二、营业总支出</b>		7, 800, 944. 70	6, 043, 792. 77
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	6, 466, 220. 17	5, 100, 193. 93
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	1, 077, 703. 35	850, 032. 29
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	163, 170. 82	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 19	93, 850. 36	93, 566. 55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-186, 380, 742. 38	-3, 951, 770. 45
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-186, 380, 742. 38	-3, 951, 770. 45
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-186, 380, 742. 38	-3, 951, 770. 45

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华宝医药生物优选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	519, 517, 575. 46	-	823, 330, 910. 42	1, 342, 848, 485. 88
二、本期期初净资产	519, 517, 575. 46	-	823, 330, 910. 42	1, 342, 848, 485. 88
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 132, 540, 779. 77	-	- 354, 833, 551. 48	-487, 374, 331. 25
（一）、综合收益总额	-	-	186, 380, 742. 38	-186, 380, 742. 38
（二）、本期基金份额交易产生的	-	-	-	-300, 993, 588. 87

净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	132,540,779.77		168,452,809.10	
其中: 1. 基金申购款	94,421,094.36	-	136,078,151.61	230,499,245.97
2. 基金赎回款	- 226,961,874.13	-	- 304,530,960.71	-531,492,834.84
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	386,976,795.69	-	468,497,358.94	855,474,154.63
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	197,816,956.40	-	425,032,121.68	622,849,078.08
二、本期期初净资产	197,816,956.40	-	425,032,121.68	622,849,078.08
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	16,884,878.81	-	34,973,402.27	51,858,281.08
(一)、综合收益总额	-	-	-3,951,770.45	-3,951,770.45
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	16,884,878.81	-	38,925,172.72	55,810,051.53
其中: 1. 基金申购款	34,996,323.64	-	82,021,948.14	117,018,271.78
2. 基金赎回款	-18,111,444.83	-	-43,096,775.42	-61,208,220.25
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	214,701,835.21	-	460,005,523.95	674,707,359.16



资产				
----	--	--	--	--

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>向辉</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</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

华宝医药生物优选混合型证券投资基金(原名为华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金、华宝兴业医药生物优选混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1115号《关于核准华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于2017年10月17日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币554,322,041.80元,业经安永华明(2012)验字第60737318\_B01号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金合同》于2012年2月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为554,397,242.54份基金份额,其中认购资金利息折合75,200.74份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金于2015年7月22日公告后更名为华宝兴业医药生物优选混合型证券投资基金。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业医药生物优选混合型证券投资基金于2017年12月30日起更名为华宝医药生物优选混合型证券投资基金。

根据《华宝基金管理有限公司关于华宝医药生物优选混合型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》以及更新后的《华宝医药生物优选混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金自2023年8月30日起增设C类基金份额。本基金根据销售服务费及申购费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中,在投资者申购时收取申购费但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者申购时不收取申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类基金份额和

C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝医药生物优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，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 A 股股票(包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于医药生物相关股票的比例不低于股票资产的 80%；现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%-40%，其中，持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：80%×中证医药卫生指数+20%×上证国债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2024 年 8 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝医药生物优选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 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 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023

年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	101,232,331.24
等于：本金	101,221,985.73
加：应计利息	10,345.51
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	101,232,331.24

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	773,962,002.93	-	756,264,408.62	-17,697,594.31
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	773,962,002.93	-	756,264,408.62	-17,697,594.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

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

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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	269.95
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,277,576.45
其中：交易所市场	4,277,576.45
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	4,362,381.76

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝医药生物混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	474,228,162.55	474,228,162.55
本期申购	69,948,034.11	69,948,034.11
本期赎回（以“-”号填列）	-181,605,008.90	-181,605,008.90
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	362,571,187.76	362,571,187.76
-----	----------------	----------------

华宝医药生物混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	45,289,412.91	45,289,412.91
本期申购	24,473,060.25	24,473,060.25
本期赎回 (以“-”号填列)	-45,356,865.23	-45,356,865.23
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	24,405,607.93	24,405,607.93

注：申购含红利再投以及转换入份(金额)，赎回含转换出份(金额)。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华宝医药生物混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	865,501,890.24	-114,443,694.29	751,058,195.95
本期期初	865,501,890.24	-114,443,694.29	751,058,195.95
本期利润	-119,288,593.46	-43,433,620.30	-162,722,213.76
本期基金份额交易产生的变动数	-178,091,970.97	28,586,331.49	-149,505,639.48
其中：基金申购款	114,408,153.81	-13,851,354.90	100,556,798.91
基金赎回款	-292,500,124.78	42,437,686.39	-250,062,438.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	568,121,325.81	-129,290,983.10	438,830,342.71

华宝医药生物混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	82,920,723.99	-10,648,009.52	72,272,714.47
本期期初	82,920,723.99	-10,648,009.52	72,272,714.47
本期利润	-8,603,858.35	-15,054,670.27	-23,658,528.62
本期基金份额交易产生的变动数	-36,084,219.02	17,137,049.40	-18,947,169.62
其中：基金申购款	39,588,866.83	-4,067,514.13	35,521,352.70
基金赎回款	-75,673,085.85	21,204,563.53	-54,468,522.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,232,646.62	-8,565,630.39	29,667,016.23

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	206,097.13
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	24,341.24
其他	3,400.93
合计	233,839.30

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	2,220,676,504.65
减：卖出股票成本总额	2,341,742,981.15
减：交易费用	5,277,259.57
买卖股票差价收入	-126,343,736.07

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

##### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

##### 6.4.7.13.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

## 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,531,999.30
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	5,531,999.30

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-58,488,290.57
股票投资	-58,488,290.57
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	-58,488,290.57

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	320,513.09
基金转换费收入	165,877.27
合计	486,390.36

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

## 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。



## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	315.00
账户维护费	9,000.00
合计	93,850.36

## 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，本基金并无需要披露的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，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
华宝基金管理有限公司(“华宝基金”)	基金管理人, 注册登记机构, 基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人, 基金销售机构
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management. L.P.)	基金管理人的股东
江苏省铁路集团有限公司(“江苏铁集”)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司, 基金销售机构
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司

注：下述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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6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 (%)
华宝证券	62,347,381.77	1.50	6,265,900.33	0.23

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 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 2024年1月1日至2024年6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 (%)
华宝证券	58,977.40	1.51	58,977.40	1.38
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6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 (%)
华宝证券	5,835.53	0.23	5,835.53	0.26

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

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

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	6,466,220.17

其中：应支付销售机构的客户维护费	1,435,793.15	1,609,584.33
应支付基金管理人的净管理费	5,030,427.02	3,490,609.60

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,077,703.35	850,032.29

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝医药生物混合 A	华宝医药生物混合 C	合计
华宝基金	-	155,491.57	155,491.57
合计	-	155,491.57	155,491.57
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝医药生物混合 A	华宝医药生物混合 C	合计
合计	-	-	-

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.6% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$ ，H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	101,232,331.24	206,097.13	60,369,219.19	121,722.16

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年6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	受限期	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
001359	平	2024	6个月	新股	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-

	安电工	年3月19日		锁定						
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股锁定	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股锁定	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股锁定	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024年5月22日	3个月	新股锁定-送股	-	91.24	43	-	3,923.32	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股锁定	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股锁定	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股锁定	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美	2024	6个月	新股	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-

	新科技	年 3 月 6 日		锁定						
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股锁定	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股锁定	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁定	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股锁定	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股锁定	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688691	灿	2024	6 个月	新股	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-

	芯股份	年 4 月 2 日		锁定						
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股锁定	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括股票和债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现风险和收益相匹配的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金净资产的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险（上年度末：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，

##### 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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上

上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算

备付金和存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	101,232,331.24	-	-	-	101,232,331.24
结算备付金	2,139,628.13	-	-	-	2,139,628.13
存出保证金	365,454.54	-	-	-	365,454.54
交易性金融资产	-	-	-	756,264,408.62	756,264,408.62
应收申购款	-	-	-	258,614.79	258,614.79
应收清算款	-	-	-	1,110,568.28	1,110,568.28
资产总计	103,737,413.91	-	-	757,633,591.69	861,371,005.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	430,401.86	430,401.86
应付管理人报酬	-	-	-	910,950.09	910,950.09
应付托管费	-	-	-	151,825.01	151,825.01
应付清算款	-	-	-	8,039.57	8,039.57
应付销售服务费	-	-	-	33,252.68	33,252.68
其他负债	-	-	-	4,362,381.76	4,362,381.76
负债总计	-	-	-	5,896,850.97	5,896,850.97
利率敏感度缺口	103,737,413.91	-	-	751,736,740.72	855,474,154.63
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	109,933,151.64	-	-	-	109,933,151.64
结算备付金	6,309,354.55	-	-	-	6,309,354.55
存出保证金	419,329.75	-	-	-	419,329.75
交易性金融资产	-	-	-	1,224,664,892.20	1,224,664,892.20
应收申购款	-	-	-	403,702.32	403,702.32
应收清算款	-	-	-	7,646,788.16	7,646,788.16
资产总计	116,661,835.94	-	-	1,232,715,382.68	1,349,377,218.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	369,523.62	369,523.62
应付管理人报酬	-	-	-	1,516,971.28	1,516,971.28
应付托管费	-	-	-	252,828.52	252,828.52
应付销售服务费	-	-	-	66,029.55	66,029.55
其他负债	-	-	-	4,323,379.77	4,323,379.77
负债总计	-	-	-	6,528,732.74	6,528,732.74
利率敏感度缺口	116,661,835.94	-	-	-1,226,186,649.94	1,342,848,485.88

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于医药生物相关股票的比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%-40%，其中，持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2024年6月30日		上年度末 2023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	756,264,408.62	88.40	1,224,664,892.20	91.20
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	756,264,408.62	88.40	1,224,664,892.20	91.20

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升5%	51,764,420.14	79,967,621.25
	2. 业绩比较基准下降5%	-51,764,420.14	-79,967,621.25

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	-		
	-		
	-		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	合计	-	0.00

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	756,023,701.77	1,223,000,327.00
第二层次	45,611.11	-
第三层次	195,095.74	1,664,565.20
合计	756,264,408.62	1,224,664,892.20

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，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等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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	756,264,408.62	87.80
	其中：股票	756,264,408.62	87.80
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	103,371,959.37	12.00
8	其他各项资产	1,734,637.61	0.20
9	合计	861,371,005.60	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

## 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

金额单位：人民币元

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	756,215,008.48	88.40
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	46,981.02	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,419.12	0.00
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	756,264,408.62	88.40

### 7.2.2 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。

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	002653	海思科	1,965,383	60,337,258.10	7.05
2	600276	恒瑞医药	1,522,091	58,539,619.86	6.84
3	002422	科伦药业	1,651,954	50,103,764.82	5.86
4	688062	迈威生物	1,623,669	46,988,980.86	5.49
5	688266	泽璟制药	819,268	44,420,710.96	5.19
6	688235	百济神州	297,295	34,438,652.80	4.03
7	300705	九典制药	1,129,134	30,193,043.16	3.53
8	002294	信立泰	1,102,600	29,362,238.00	3.43
9	300181	佐力药业	1,790,000	27,064,800.00	3.16
10	300049	福瑞股份	525,200	26,438,568.00	3.09
11	688351	微电生理	1,024,896	22,588,707.84	2.64
12	300633	开立医疗	567,100	22,445,818.00	2.62
13	688575	亚辉龙	918,769	21,425,693.08	2.50
14	603998	方盛制药	2,052,000	21,074,040.00	2.46
15	688197	首药控股	432,559	18,885,525.94	2.21
16	002262	恩华药业	741,300	17,598,462.00	2.06
17	688076	诺泰生物	215,881	16,899,164.68	1.98
18	688506	百利天恒	88,066	15,975,172.40	1.87
19	688192	迪哲医药	411,144	15,146,544.96	1.77
20	688578	艾力斯	199,067	12,688,530.58	1.48
21	688443	智翔金泰	397,255	11,814,363.70	1.38
22	002432	九安医疗	264,400	10,718,776.00	1.25
23	000423	东阿阿胶	170,300	10,660,780.00	1.25
24	300573	兴齐眼药	55,900	9,167,600.00	1.07
25	301301	川宁生物	684,000	8,741,520.00	1.02
26	000999	华润三九	202,110	8,605,843.80	1.01
27	300760	迈瑞医疗	29,547	8,595,517.77	1.00
28	688428	诺诚健华	1,058,068	8,580,931.48	1.00
29	300677	英科医疗	319,800	8,573,838.00	1.00
30	300003	乐普医疗	572,000	8,488,480.00	0.99
31	300832	新产业	122,840	8,284,329.60	0.97
32	688321	微芯生物	464,409	8,173,598.40	0.96
33	300298	三诺生物	305,084	7,730,828.56	0.90
34	300636	同和药业	703,300	7,152,561.00	0.84
35	688336	三生国健	346,861	7,058,621.35	0.83
36	688488	艾迪药业	668,319	6,830,220.18	0.80
37	688136	科兴制药	385,444	6,460,041.44	0.76
38	688085	三友医疗	364,548	6,160,861.20	0.72
39	002793	罗欣药业	1,322,000	4,732,760.00	0.55



40	688687	凯因科技	171,642	4,378,587.42	0.51
41	688212	澳华内镜	56,867	2,275,248.67	0.27
42	301580	爱迪特	2,018	153,513.06	0.02
43	603381	永臻股份	1,778	49,273.14	0.01
44	301526	国际复材	9,723	32,377.59	0.00
45	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
46	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
47	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
48	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
49	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
50	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
51	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
52	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
53	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
54	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
55	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
56	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
57	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
58	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
59	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
60	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
61	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
62	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
63	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
64	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
65	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
66	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
67	603373	安邦护卫	88	2,419.12	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	688192	迪哲医药	62,419,891.05	4.65
2	603939	益丰药房	54,837,184.83	4.08
3	688266	泽璟制药	52,093,821.62	3.88
4	000423	东阿阿胶	49,986,008.80	3.72
5	688575	亚辉龙	47,867,276.49	3.56
6	688235	百济神州	47,658,329.00	3.55
7	300181	佐力药业	44,736,144.10	3.33
8	000999	华润三九	42,883,888.68	3.19
9	688351	微电生理	41,468,063.46	3.09
10	300049	福瑞股份	38,777,740.77	2.89

11	300347	泰格医药	37,762,774.84	2.81
12	688578	艾力斯	37,702,125.08	2.81
13	688488	艾迪药业	35,851,172.15	2.67
14	600422	昆药集团	35,760,251.00	2.66
15	603998	方盛制药	35,118,718.00	2.62
16	300832	新产业	34,594,500.60	2.58
17	300573	兴齐眼药	34,431,503.40	2.56
18	688506	百利天恒	33,265,770.30	2.48
19	002262	恩华药业	31,809,291.12	2.37
20	688443	智翔金泰	31,773,555.71	2.37
21	600161	天坛生物	31,338,251.44	2.33
22	002422	科伦药业	30,799,760.39	2.29
23	688062	迈威生物	30,045,469.57	2.24
24	002294	信立泰	29,941,182.00	2.23
25	600566	济川药业	29,663,152.54	2.21
26	600557	康缘药业	29,565,795.98	2.20
27	300765	新诺威	29,193,227.55	2.17
28	300705	九典制药	28,816,708.40	2.15
29	002432	九安医疗	28,346,151.15	2.11
30	688212	澳华内镜	27,418,089.72	2.04

注：买入金额不包括相关交易费用。

#### 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	688192	迪哲医药	59,676,643.07	4.44
2	600079	人福医药	54,861,673.41	4.09
3	600422	昆药集团	54,548,356.00	4.06
4	600276	恒瑞医药	53,110,508.10	3.96
5	603939	益丰药房	52,572,960.57	3.92
6	688235	百济神州	52,346,152.01	3.90
7	600566	济川药业	48,605,511.68	3.62
8	603439	贵州三力	47,765,882.45	3.56
9	300832	新产业	47,746,674.70	3.56
10	688443	智翔金泰	46,614,799.94	3.47
11	688177	百奥泰	44,778,287.44	3.33
12	000423	东阿阿胶	43,730,354.70	3.26
13	002262	恩华药业	40,985,892.82	3.05
14	688212	澳华内镜	40,883,486.45	3.04
15	688336	三生国健	40,205,984.77	2.99
16	688278	特宝生物	39,027,682.37	2.91
17	300049	福瑞股份	38,400,383.57	2.86
18	688351	微电生理	37,084,309.76	2.76

19	688575	亚辉龙	36,280,564.37	2.70
20	688626	翔宇医疗	36,113,648.80	2.69
21	300347	泰格医药	35,297,057.00	2.63
22	688266	泽璟制药	34,951,782.59	2.60
23	688062	迈威生物	34,476,803.78	2.57
24	000999	华润三九	33,832,655.60	2.52
25	688506	百利天恒	33,785,461.40	2.52
26	002422	科伦药业	33,750,325.21	2.51
27	688578	艾力斯	33,228,916.42	2.47
28	300765	新诺威	32,709,603.04	2.44
29	300122	智飞生物	32,354,453.09	2.41
30	600161	天坛生物	31,617,368.12	2.35
31	300705	九典制药	28,282,163.20	2.11

注：卖出金额不包括相关交易费用。

#### 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	1,931,830,788.14
卖出股票收入（成交）总额	2,220,676,504.65

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

#### 7.5 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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 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。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

#### 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	365,454.54
2	应收清算款	1,110,568.28
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	258,614.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,734,637.61

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
华宝医药 生物混合 A	42,009	8,630.80	189,777,975.33	52.34	172,793,212.43	47.66
华宝医药 生物混合 C	393	62,100.78	22,959,194.15	94.07	1,446,413.78	5.93
合计	42,402	9,126.38	212,737,169.48	54.97	174,239,626.21	45.03

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例 (%)
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	华宝医药生物混合 A	753,588.56	0.2078
	华宝医药生物混合 C	10,261.35	0.0420
	合计	763,849.91	0.1974

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人 员、基金投资和研 究部门负责人持有本开 放式基金	华宝医药生物混合 A	0~10
	华宝医药生物混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	华宝医药生物混合 A	0~10
	华宝医药生物混合 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝医药生物混合 A	华宝医药生物混合 C
基金合同生效日 (2012年2月28 日)基金份额总额	554,397,242.54	-
本报告期期初基金 份额总额	474,228,162.55	45,289,412.91

本报告期基金总申购份额	69,948,034.11	24,473,060.25
减：本报告期基金总赎回份额	181,605,008.90	45,356,865.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	362,571,187.76	24,405,607.93

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：自 2015 年 12 月 15 日起至本报告期末。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

### 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 (%)	
中信证券	3	724,023,521.23	17.44	684,844.07	17.56	-
东海证券	1	369,558,579.92	8.90	345,870.70	8.87	-
广发证券	2	344,487,593.38	8.30	325,851.25	8.35	-
国泰君安	2	333,284,113.39	8.03	315,262.14	8.08	-
民生证券	1	321,010,068.79	7.73	303,639.36	7.78	-
方正证券	2	285,557,574.89	6.88	269,053.10	6.90	-
申万宏源	2	235,882,607.92	5.68	223,123.11	5.72	-
国信证券	1	215,448,243.48	5.19	203,791.43	5.22	-
中泰证券	2	203,171,531.03	4.89	190,147.62	4.87	-
华福证券	2	199,764,217.79	4.81	188,553.87	4.83	-
华创证券	1	132,543,141.37	3.19	125,367.97	3.21	-
瑞银证券	1	121,604,916.47	2.93	115,028.34	2.95	-
长城证券	3	94,945,985.83	2.29	89,809.53	2.30	-
山西证券	2	84,309,891.49	2.03	79,086.91	2.03	-
西部证券	1	82,614,318.90	1.99	60,795.43	1.56	-
银河证券	1	71,460,496.81	1.72	67,595.29	1.73	-
东兴证券	1	70,383,683.82	1.70	65,872.63	1.69	-
华宝证券	1	62,347,381.77	1.50	58,977.40	1.51	-
长江证券	1	51,828,148.53	1.25	49,023.54	1.26	-
华西证券	2	47,372,806.35	1.14	44,809.96	1.15	-

中金财富	1	46,601,197.43	1.12	44,081.78	1.13	-
华安证券	1	26,331,418.11	0.63	24,907.58	0.64	-
兴业证券	2	18,390,943.30	0.44	17,395.48	0.45	-
海通证券	1	8,326,297.95	0.20	7,876.55	0.20	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
大和证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	3	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
中山证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-



注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人 员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元新增的有：华福证券、中信证券；退租交易单元：申港证券。

#### 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

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

#### 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	华宝基金关于旗下部分基金新增银泰证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-01-05
2	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-01-19
3	关于华宝现金宝货币基金 E 类份额转换、赎回转申购、定期转换、定期赎回转申购业务费率优惠公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-03-27
4	华宝基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-03-29
5	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-04-19
6	华宝基金关于旗下部分基金新增华福证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-05-20
7	华宝基金关于旗下部分基金新增国信证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-05-21
8	华宝基金关于旗下部分基金新增平	基金管理人网站, 上海	2024-06-07

	安证券股份有限公司为代销机构的公告	证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	
9	华宝基金关于旗下部分基金新增湘财证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-06-21
10	华宝医药生物优选混合型证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2024-06-28
11	华宝医药生物优选混合型证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2024-06-28

## § 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝医药生物优选混合型证券投资基金基金合同;

华宝医药生物优选混合型证券投资基金招募说明书;

华宝医药生物优选混合型证券投资基金托管协议;

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。

### 12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

### 12.3 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

2024 年 8 月 30 日