

博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券
投资基金（QDII）
2021 年中期报告
2021 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

§ 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 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 2021 年 3 月 18 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	5
2.5 信息披露方式	5
2.6 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	7
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.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	8
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	9
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.....	9
§5 托管人报告	9
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	9
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.....	10
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.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	12
6.4 报表附注	13
§7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况	29
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	29
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	30
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	30
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	37
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	37
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	37
7.11 投资组合报告附注	37
§8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末上市基金前十名持有人	38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	38

§ 9 开放式基金份额变动	38
§ 10 重大事件揭示	39
10.1 基金份额持有人大会决议	39
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	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	39
10.4 基金投资策略的改变	39
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	39
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	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	39
10.8 其他重大事件	40
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	41
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	42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	42
§ 12 备查文件目录	42
12.1 备查文件目录	42
12.2 存放地点	42
12.3 查阅方式	42

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金简称	博时恒生医疗保健（QDII-ETF）
场内简称	证券简称：恒生医疗，扩位证券简称：恒生医疗 ETF
基金主代码	513060
交易代码	513060
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年3月18日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	90,393,320.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021年3月29日

2.2 基金产品说明

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	<p>1、组合复制策略，本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。2、债券和货币市场工具投资策略；3、金融衍生品投资策略；4、融资及转融通证券出借；5、资产支持证券的投资策略；6、非成份股的股票投资策略；7、存托凭证投资策略。</p> <p>未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明更新中公告。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即恒生医疗保健指数收益率（经汇率调整后）。
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪恒生医疗保健指数，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。此外，本基金可投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。</p>

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		博时基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	秦一楠
	联系电话	0755-83169999	010-66060069
	电子邮箱	service@bosera.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105568	95599
传真		0755-83195140	010-68121816
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	北京市东城区建国门内大街69号

办公地址	广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	江向阳	谷澍

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Bank of New York Mellon
	中文	-	纽约梅隆银行
注册地址		-	240 Greenwich Street New York, NY 10286
办公地址		-	240 Greenwich Street New York, NY 10286
邮政编码		-	-

注：本基金未聘请境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.6 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021 年 3 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,591,302.33
本期利润	19,302,003.50
加权平均基金份额本期利润	0.1709
本期加权平均净值利润率	15.89%
本期基金份额净值增长率	21.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,006,053.18
期末可供分配基金份额利润	0.0222
期末基金资产净值	109,636,870.14
期末基金份额净值	1.2129
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	21.29%

注：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。

期末可供分配利润是指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。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	3.40%	1.43%	3.31%	1.44%	0.09%	-0.01%
过去三个月	19.08%	1.56%	19.79%	1.59%	-0.71%	-0.03%
自基金合同生效起至今	21.29%	1.57%	17.26%	1.72%	4.03%	-0.15%

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



注：本基金的基金合同于 2021 年 3 月 18 日生效。按照本基金的基金合同规定，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本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。

§ 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

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2021 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 276 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 15482 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 4383 亿元人民币，累计分红逾 1465 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
万琼	基金经理	2021-03-18	-	14.3	万琼女士，硕士。2004年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017年9月29日-2019年9月5日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015年6月8日-2019年10月11日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015年6月8日-2019年10月11日)的基金经理。现任上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015年6月8日一至今)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015年6月8日一至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015年10月8日一至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015年10月8日一至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019年8月1日一至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2019年12月30日一至今)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金(2020年1月19日一至今)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020年3月20日一至今)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020年4月3日一至今)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020年4月30日一至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021年3月18日一至今)、博时创业板指数证券投资基金(2021年4月2日一至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金(2021年5月11日一至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021年5月17日一至今)、博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021年6月8日一至今)的基金经理。

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公

平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 24 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

回顾上半年，虽然国内以及全球疫情出现了一定的反复，特别是印度出现了 Delta 变异毒株，但整体看不管是国内还是全球经济从疫情中逐渐复苏仍是主线。上半年国内经济延续了去年下半年以来良好的增长状态，上半年 GDP 同比增长 12.7%，相比 2019 年两年平均增长 5.3%。规模以上工业增加值同比增加 15.90%，两年平均增长 6.5%。6 月的 PMI 为 50.9，自去年 3 月以来持续保持在 50 以上。货币政策整体保持稳健，市场流动性充裕。上半年，美国经济正快速从疫情影响中恢复，最新公布的 6 月份经济数据也反应美国经济正处在良好的复苏中。

从 A 股市场来看，过去持续多时的“白马抱团”行情，上半年逐渐出现瓦解松动，市场风格也出现了较大的波动。以创业板为代表的中小盘成长风格表现最好。创业板指上半年上涨 17.2%，中证 500 上涨 6.93%，而沪深 300 只微涨 0.24%，上证 50 则下跌 3.9%。从港股市场来看，上半年港股前高后低，恒生指数上涨 5.86%，恒生中国企业指数下跌 0.7%。能源行业以及医疗保健行业表现出色，涨幅均超过 20%。从海外市场来看，标普 500 在美国经济全面复苏的推动下上半年上涨 14.41%，纳斯达克指数上涨 12.54%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.2129 元，份额累计净值为 1.2129 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 21.29%，同期业绩基准增长率 17.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计随着疫苗的逐步普及，受疫情影响中断的海外产能逐步恢复，支撑疫情后中国经济超预期增长的出口面临边际放缓，同时，上半年大宗商品等原材料价格大幅上涨对企业经营造成的压力，也将在下半年逐渐体现。但下半年流动性相比上半年会更加充裕。在流动性边际宽松，而增速边际放缓的宏观背景下，预计下半年 A 股市场将维持震荡格局。香港情况和国内稍有不同，从基本面看，随着疫情的

逐渐消除，下半年内地和香港将有望逐步迎来通关的正常化，这将对香港经济的恢复提供重要支撑。但由于香港的货币政策主要受美国影响，考虑到美国经济良好的恢复势头，以及潜在的通胀风险，美元流动性面临拐点。下半年关注受益于疫情恢复的香港本地消费以及人口老龄化的医疗保健板块的投资机会。特别是港股的医疗保健板块，上半年，中国公布了第 7 次人口普查结果，未来中国将不可避免的迎来人口的老齡化趋势，这给整个医疗板块带来了巨大的长期需求，而相比 A 股市场，港股医疗保健板块汇聚了一批独特而稀缺的创新药、互联网医疗以及专科医院等优质医药上市公司，具备长期配置价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—博时基金管理有

限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，博时基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为

§ 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：博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
资产：		-
银行存款	6.4.7.1	534,537.28
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	108,965,806.89
其中：股票投资		108,965,806.89
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
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		-
应收利息	6.4.7.5	242.05
应收股利		131,953.70
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	83,333.20

资产总计		109,715,873.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日
负债:		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		42,835.89
应付托管费		12,850.78
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	-
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	23,316.31
负债合计		79,002.98
所有者权益:		-
实收基金	6.4.7.9	90,393,320.00
未分配利润	6.4.7.10	19,243,550.14
所有者权益合计		109,636,870.14
负债和所有者权益总计		109,715,873.12

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2129 元，基金份额总额 90,393,320.00 份。

6.2 利润表

会计主体：博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

本报告期：2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年6月 30日
一、收入		20,715,980.99
1. 利息收入		119,327.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	119,327.23
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,872,605.68
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,592,452.42
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	6.4.7.15	-

衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	280,153.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	17,710,701.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		914,656.07
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-901,309.16
减：二、费用		1,413,977.49
1. 管理人报酬		169,078.44
2. 托管费		50,723.54
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	1,121,358.02
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.21	72,817.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,302,003.50
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,302,003.50

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	307,893,320.00	-	307,893,320.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,302,003.50	19,302,003.50
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）	-217,500,000.00	-58,453.36	-217,558,453.36
其中：1. 基金申购款	15,000,000.00	1,434,917.12	16,434,917.12
2. 基金赎回款	-232,500,000.00	-1,493,370.48	-233,993,370.48
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）	90,393,320.00	19,243,550.14	109,636,870.14

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：

基金管理人负责人：江向阳

主管会计工作负责人：孙献

会计机构负责人：倡方方

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(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[2021]456号《关于准予博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复》核准,由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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307,889,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0261号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》于2021年3月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为307,893,320.00份基金份额,其中认购资金利息折合4,320.00份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司,境外托管人为纽约梅隆银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于境外市场和境内市场依法发行的金融工具,其中境外市场投资工具包括在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF));依法发行上市的内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”);已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证(包括全球存托凭证、美国存托凭证等)、房地产信托凭证;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的期权、期货等金融衍生产品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;其中在投资香港市场时,本基金可通过合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。未来如果证券投资基金成为互联互通机制标的,则本基金可直接参与,无需召开基金份额持有人大会。境内市场投资工具包括国内依法发行或上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、国债期货、股指期货、股票期权、货币市场工具(包括银行存款、同业存单等)、债券回购、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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下,本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人可以将其纳入投资范围,其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。本基

金投资标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：恒生医疗保健指数收益率（经汇率调整后）。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2021 年 8 月 31 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》、各项具体会计准则及相关规定（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》、《博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”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

本基金本报告期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本期末和上年度末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。当收益评价日核定的基金份额净值增

长率超过标的指数同期增长率达到 0.01% 以上时，可进行收益分配；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、对证券投资基金管理人运用基金买卖国债、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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	534,537.28
定期存款	-
其他存款	-
合计	534,537.28

注：于 2021 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为港币 280,293.86 元（折合人民币 233,226.92 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	91,255,105.72	108,965,806.89	17,710,701.17
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	91,255,105.72	108,965,806.89	17,710,701.17

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	242.05

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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	242.05

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	83,333.20
合计	83,333.20

6.4.7.7 应付交易费用

无余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	23,316.31
合计	23,316.31

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
本期申购	322,893,320.00	322,893,320.00
本期赎回（以“-”号填列）	-232,500,000.00	-232,500,000.00
本期末	90,393,320.00	90,393,320.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,591,302.33	17,710,701.17	19,302,003.50
本期基金份额交易产生的变动数	414,750.85	-473,204.21	-58,453.36

其中：基金申购款	231,619.29	1,203,297.83	1,434,917.12
基金赎回款	183,131.56	-1,676,502.04	-1,493,370.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,006,053.18	17,237,496.96	19,243,550.14

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
活期存款利息收入	67,830.04	
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	817.60	
其他	50,679.59	
合计	119,327.23	

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
卖出股票成交总额	210,249,701.41	
减：卖出股票成本总额	207,657,248.99	
买卖股票差价收入	2,592,452.42	

6.4.7.13 基金投资收益

无发生额。

6.4.7.14 债券投资收益

无发生额。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

无发生额。

6.4.7.16 衍生工具收益

无发生额。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
股票投资产生的股利收益	280,153.26	
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	280,153.26	

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	
	2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
1. 交易性金融资产	17,710,701.17	
——股票投资	17,710,701.17	

——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	17,710,701.17

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-901,309.16
合计	-901,309.16

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,121,358.02
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,121,358.02

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	18,166.05
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	7,434.38
IOPV 计算与发布费	5,150.26
中登结算服务费	41,666.80
开户费	400.00
合计	72,817.49

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人
纽约梅隆银行（“纽约梅隆”）	境外资产托管人

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

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	169,078.44
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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 X 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	50,723.54

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 X 0.15% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券	1,972,860.00	2.18%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

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 2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	295,850.85	119,327.23

注：本基金的银行存款分别由基金托管人农业银行和境外资产托管人纽约梅隆银行保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2021 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理
6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，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。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪恒生医疗保健指数，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。此外，本基金可投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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。紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去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同类风险损失的频度。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特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，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同责任，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行农业银行及境外资产托管人纽约梅隆银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险不重大。在场外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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。

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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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。

本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.8 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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%。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及部分应收申购款，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	295,850.85	-	-	238,686.43	534,537.28
交易性金融资产	-	-	-	108,965,806.89	108,965,806.89
应收利息	-	-	-	242.05	242.05
应收股利	-	-	-	131,953.70	131,953.70
其他资产	-	-	-	83,333.20	83,333.20
资产总计	295,850.85	-	-	109,420,022.27	109,715,873.12
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	42,835.89	42,835.89
应付托管费	-	-	-	12,850.78	12,850.78
其他负债	-	-	-	23,316.31	23,316.31
负债总计	-	-	-	79,002.98	79,002.98
利率敏感度缺口	295,850.85	-	-	109,341,019.29	109,636,870.14

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转换债券、可交换债券)或资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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 2021年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
银行存款	-	233,226.92	233,226.92
交易性金融资产	-	108,965,806.89	108,965,806.89
应收红利	-	62,492.30	62,492.30
资产合计	-	109,261,526.11	109,261,526.11
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	109,261,526.11	109,261,526.11

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
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：人民币万元)
		本期末 2021年6月30日
	所有外币均相对人民币升值5%	增加约546
	所有外币均相对人民币贬值5%	减少约546

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的基金和股票，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。

本基金采用完全复制法，跟踪恒生医疗指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人

将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

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，指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%。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 2021 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	108,965,806.89	99.39
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	108,965,806.89	99.39

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：人民币万元)
		本期末 2021 年 6 月 30 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 549
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 549	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 108,965,806.89 元，属于第二层次的余额为 0.00 元，属于第三层次的余额为 0.00 元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关

股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	108,965,806.89	99.32
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	534,537.28	0.49
8	其他各项资产	215,528.95	0.20
9	合计	109,715,873.12	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

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

中国香港	108,965,806.89	99.39
合计	108,965,806.89	99.39

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
医疗保健	100,843,865.69	91.98
非日常生活消费品	8,121,941.20	7.41
合计	108,965,806.89	99.39

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	药明生物	2269 HK	中国香港证券交易所	中国香港	104,000.00	12,314,118.34	11.23
2	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	京东健康	6618 HK	中国香港证券交易所	中国香港	87,700.00	8,121,941.20	7.41
3	INNOVENT BIOLOGICS INC	信达生物	1801 HK	中国香港证券交易所	中国香港	103,000.00	7,760,518.93	7.08
4	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	石药集团	1093 HK	中国香港证券交易所	中国香港	706,000.00	6,602,920.92	6.02
5	SINO BIOPHARMACEUTICAL	中国生物制药	1177 HK	中国香港证券交易所	中国香港	890,000.00	5,643,000.14	5.15
6	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	阿里健康	241 HK	中国香港证券交易所	中国香港	370,000.00	5,301,514.51	4.84
7	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	微创医疗	853 HK	中国香港证券交易所	中国香港	71,000.00	4,114,760.41	3.75
8	WUXI APPTTEC CO	药明康德	2359	中国香	中	26,740.00	4,033,892.22	3.68

	LTD-H		HK	港证券交易所	国香港			
9	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	威高股份	1066 HK	中国香港证券交易所	中国香港	196,000.00	2,955,148.76	2.70
10	CANSINO BIOLOGICS INC-H	康希诺生物-B	6185 HK	中国香港证券交易所	中国香港	7,800.00	2,677,866.42	2.44
11	HANSON PHARMACEUTICAL GROUP	翰森制药	3692 HK	中国香港证券交易所	中国香港	92,000.00	2,602,746.24	2.37
12	GENSCRIPT BIOTECH CORP	金斯瑞生物科技	1548 HK	中国香港证券交易所	中国香港	92,000.00	2,595,091.10	2.37
13	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	锦欣生殖	1951 HK	中国香港证券交易所	中国香港	138,000.00	2,250,609.98	2.05
14	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	平安好医生	1833 HK	中国香港证券交易所	中国香港	27,000.00	2,172,477.67	1.98
15	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	复星医药	2196 HK	中国香港证券交易所	中国香港	39,000.00	2,034,685.22	1.86
16	SINOPHARM GROUP CO-H	国药控股	1099 HK	中国香港证券交易所	中国香港	105,600.00	2,029,742.67	1.85
17	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	海吉亚医疗	6078 HK	中国香港证券交易所	中国香港	21,800.00	1,850,213.09	1.69
18	PHARMARON BEIJING CO LTD-H	康龙化成	3759 HK	中国香港证券交易所	中国香港	10,500.00	1,808,525.88	1.65
19	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	中国香港证券交易所	中国香港	106,000.00	1,803,699.82	1.65
20	HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	泰格医药	3347 HK	中国香港证券交易所	中国香	9,600.00	1,453,810.18	1.33

					港			
21	AKESO INC	康方生物 -B	9926 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	26,000.00	1,355,375.11	1.24
22	VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	启明医疗 -B	2500 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	25,000.00	1,346,929.50	1.23
23	LIFETECH SCIENTIFIC CORP	先健科技	1302 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	308,000.00	1,319,845.30	1.20
24	ZAI LAB LTD	再鼎医药 -SB	9688 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	1,100.00	1,248,452.83	1.14
25	PEIJIA MEDICAL LTD	沛嘉医疗 -B	9996 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	39,000.00	1,173,107.99	1.07
26	MICROPORT CARDIOFLOW MEDTECH	心通医疗 -B	2160 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	84,000.00	1,142,079.72	1.04
27	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	中国中药	570 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	256,000.00	1,133,226.39	1.03
28	INNOCARE PHARMA LTD	诺诚健华 -B	9969 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	47,000.00	1,116,526.55	1.02
29	YIDU TECH INC	医渡科技	2158 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	29,100.00	987,911.94	0.90
30	3SBIO INC	三生制药	1530 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	120,000.00	958,556.16	0.87
31	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	四环医药	460 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	335,000.00	925,439.38	0.84
32	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	上海医药	2607 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	65,100.00	918,696.20	0.84
33	NEW HORIZON HEALTH	诺辉健康	6606	中国香	中	13,500.00	889,659.94	0.81

	LTD	-B	HK	港证券 交易所	国 香港			
34	REMEGEN CO LTD-H	荣昌生物 -B	9995 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	8,500.00	837,405.31	0.76
35	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	195,000.00	829,126.12	0.76
36	CHINA GRAND PHARMACEUTICAL A	远大医药	512 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	125,500.00	758,133.05	0.69
37	ALPHAMAB ONCOLOGY	康宁杰瑞 制药-B	9966 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	36,000.00	744,378.77	0.68
38	EVEREST MEDICINES LTD	云顶新耀 -B	1952 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	11,500.00	739,199.07	0.67
39	SSY GROUP LTD	石四药集 团	2005 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	118,000.00	681,406.95	0.62
40	CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	华润医药	3320 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	148,000.00	596,035.55	0.54
41	SIMCERE PHARMACEUTICAL GROUP	先声药业	2096 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	51,000.00	593,256.40	0.54
42	ANTENGENE CORP LTD	德琪医药 -B	6996 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	36,500.00	581,299.41	0.53
43	BEIGENE LTD	百济神州	6160 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	3,100.00	544,779.42	0.50
44	ASCENTAGE PHARMA GROUP INTER	亚盛医药 -B	6855 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	13,900.00	543,597.86	0.50
45	SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-H	君实生物	1877 HK	中国香 港证券 交易所	中国香	10,000.00	536,691.60	0.49

					港			
46	CHINA RESOURCES MEDICAL HOLD	华润医疗	1515 HK	中国香港证券交易所	中国香港	66,000.00	517,869.95	0.47
47	AK MEDICAL HOLDINGS LTD	爱康医疗	1789 HK	中国香港证券交易所	中国香港	44,000.00	501,577.82	0.46
48	VIVA BIOTECH HOLDINGS	维亚生物	1873 HK	中国香港证券交易所	中国香港	60,500.00	500,387.95	0.46
49	FRONTAGE HOLDINGS CORP	方达控股	1521 HK	中国香港证券交易所	中国香港	72,000.00	494,255.52	0.45
50	JACOBIO PHARMACEUTICALS GROU	加科思-B	1167 HK	中国香港证券交易所	中国香港	27,300.00	494,068.30	0.45
51	OCUMENSION THERAPEUTICS	欧康维视生物-B	1477 HK	中国香港证券交易所	中国香港	19,000.00	431,599.90	0.39
52	THE UNITED LABORATORIES INTE	联邦制药	3933 HK	中国香港证券交易所	中国香港	78,000.00	413,427.27	0.38
53	LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-H	丽珠医药	1513 HK	中国香港证券交易所	中国香港	12,500.00	397,838.25	0.36
54	JHBP CY HOLDINGS LTD	嘉和生物-B	6998 HK	中国香港证券交易所	中国香港	21,000.00	328,505.18	0.30
55	GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARM-H	白云山	874 HK	中国香港证券交易所	中国香港	16,000.00	326,841.02	0.30
56	JW CAYMAN THERAPEUTICS CO LT	药明巨诺-B	2126 HK	中国香港证券交易所	中国香港	15,500.00	321,786.14	0.29
57	HBM HOLDINGS LTD	和铂医药-B	2142 HK	中国香港证券交易所	中国香港	39,000.00	321,266.09	0.29
58	KANGJI MEDICAL	康基医疗	9997	中国香	中	29,500.00	317,138.97	0.29

	HOLDINGS LTD		HK	港证券交易所	国香港			
59	C-MER EYE CARE HOLDINGS LTD	希玛眼科	3309 HK	中国香港证券交易所	中国香港	36,000.00	298,949.70	0.27
60	BEIJING TONG REN TANG CHINES	同仁堂国药	3613 HK	中国香港证券交易所	中国香港	20,000.00	213,345.31	0.19
61	CK LIFE SCIENCES INTL HLDGS	长江生命科技	775 HK	中国香港证券交易所	中国香港	226,000.00	167,364.57	0.15
62	CHINA SHINWAY PHARMACEUTICA	神威药业	2877 HK	中国香港证券交易所	中国香港	22,000.00	145,713.85	0.13
63	YICHANG HEC CHANGJIANG PHA-H	东阳光药	1558 HK	中国香港证券交易所	中国香港	20,400.00	145,470.88	0.13

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	32,457,553.62	29.60
2	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6618 HK	27,673,592.02	25.24
3	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	21,996,968.27	20.06
4	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	21,213,221.70	19.35
5	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	20,835,992.50	19.00
6	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	18,857,291.36	17.20
7	HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	3692 HK	9,823,630.20	8.96
8	WUXI APTEC CO LTD-H	2359 HK	9,634,373.08	8.79
9	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	8,514,007.82	7.77
10	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1066 HK	7,459,675.73	6.80
11	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1833 HK	6,507,544.49	5.94
12	CANSINO BIOLOGICS INC-H	6185 HK	6,352,059.20	5.79
13	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	1951 HK	5,900,791.93	5.38
14	SINOPHARM GROUP CO-H	1099 HK	5,875,851.91	5.36
15	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	867 HK	4,981,629.23	4.54
16	PHARMARON BEIJING CO LTD-H	3759 HK	4,222,517.74	3.85
17	HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	3347 HK	4,008,165.65	3.66
18	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	2196 HK	3,991,017.16	3.64
19	VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	2500 HK	3,909,150.29	3.57

20	GENSCRIPT BIOTECH CORP	1548 HK	3,846,312.35	3.51
21	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	570 HK	3,516,857.11	3.21
22	ZAI LAB LTD	9688 HK	3,243,869.58	2.96
23	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	6078 HK	2,892,085.60	2.64
24	AKESO INC	9926 HK	2,882,657.38	2.63
25	EVEREST MEDICINES LTD	1952 HK	2,860,137.55	2.61
26	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2607 HK	2,828,407.05	2.58
27	LIFETECH SCIENTIFIC CORP	1302 HK	2,727,545.98	2.49
28	INNOCARE PHARMA LTD	9969 HK	2,590,501.64	2.36
29	PEIJIA MEDICAL LTD	9996 HK	2,520,695.30	2.30
30	3SBIO INC	1530 HK	2,434,031.02	2.22
31	REMEGEN CO LTD-H	9995 HK	2,394,010.75	2.18
32	CHINA GRAND PHARMACEUTICAL A	512 HK	2,360,174.11	2.15
33	LUYE PHARMA GROUP LTD	2186 HK	2,232,005.08	2.04

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	24,191,908.43	22.07
2	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6618 HK	19,699,016.63	17.97
3	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	15,594,354.22	14.22
4	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	14,544,765.49	13.27
5	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	14,124,656.81	12.88
6	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	13,682,863.08	12.48
7	HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	3692 HK	6,987,664.66	6.37
8	WUXI APPTec CO LTD-H	2359 HK	6,880,022.26	6.28
9	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	6,175,252.53	5.63
10	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1066 HK	5,757,327.12	5.25
11	CANSINO BIOLOGICS INC-H	6185 HK	4,622,666.80	4.22
12	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1833 HK	4,434,655.18	4.04
13	SINOPHARM GROUP CO-H	1099 HK	4,229,204.06	3.86
14	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	1951 HK	4,084,339.38	3.73
15	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	867 HK	3,499,413.46	3.19
16	PHARMARON BEIJING CO LTD-H	3759 HK	3,117,988.53	2.84
17	HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	3347 HK	3,026,188.13	2.76
18	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	2196 HK	2,923,968.80	2.67
19	GENSCRIPT BIOTECH CORP	1548 HK	2,673,181.82	2.44
20	VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	2500 HK	2,665,716.08	2.43
21	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	570 HK	2,554,809.23	2.33

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	298,912,354.64
卖出收入（成交）总额	210,249,701.43

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有衍生品投资。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.11.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	131,953.70
4	应收利息	242.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	83,333.20
8	其他	-
9	合计	215,528.95

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
3,184	28,389.86	18,485,920.00	20.45%	71,907,400.00	79.55%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	孟永良	5,000,000.00	5.53%
2	BARCLAYS BANK PLC	4,231,200.00	4.68%
3	中信证券股份有限公司	3,935,260.00	4.35%
4	招商证券股份有限公司	1,972,860.00	2.18%
5	东方证券资管—鸿鼎财富—半年开放净值型6期—东证资管鸿鼎1号 FOF 单一资产管	1,640,600.00	1.81%
6	方正证券股份有限公司	1,482,900.00	1.64%
7	余海菁	1,040,100.00	1.15%
8	于玲丽	1,000,100.00	1.11%
9	黄俊	1,000,000.00	1.11%
9	李鸿	1,000,000.00	1.11%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2021 年 3 月 18 日) 基金份额总额	307,893,320.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	15,000,000.00

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	232,500,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	90,393,320.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于 2021 年 2 月 6 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，高阳先生担任公司总经理职务。

本报告期内，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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

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，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

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	
ABC International Holdings Limited	-	61,940,159.41	12.17%	-	-	-
CLSA	-	447,221,896.66	87.83%	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
ABC International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)暂停申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-30
2	关于博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)2021年6月28日暂停申购、赎回等业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-28
3	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通邮储银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-29
4	博时基金管理有限公司关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-26
5	关于博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)暂停申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-18
6	关于博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)暂停申购业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-30
7	博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的交通银行、平安银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-28
8	博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联支付提供的兴业银行、广发银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
9	博时基金管理有限公司关于修改博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)扩位简称的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-12
10	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-08
11	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-06
12	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)暂停申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-02

13	博时基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》修改基金法律文件的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
14	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
15	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
16	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-30
17	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-26
18	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）开放日常申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-24
19	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）上市交易公告书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-24
20	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-22
21	博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支付提供的交通银行快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-20
22	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同生效公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-19
23	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210310	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-10
24	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-26
25	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-26
26	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-26
27	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金份额发售公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-26
28	博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）产品资料概要	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-26

§ 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

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

12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）设立的文件

12.1.2 《博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》

12.1.3 《博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.1.5 博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）各年度审计报告正本

12.1.6 报告期内博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二一年八月三十一日