
永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金

2023年第1季度报告

2023年03月31日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2023年04月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年04月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	医疗器械ETF
场内简称	医疗器械
基金主代码	159883
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021年04月22日
报告期末基金份额总额	3,069,037,843.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内。主要投资策略有：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略和存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证全指医疗器械指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟

	踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023年01月01日 - 2023年03月31日）
1.本期已实现收益	-8,222,266.13
2.本期利润	63,564,567.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.0209
4.期末基金资产净值	2,021,995,029.59
5.期末基金份额净值	0.6588

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.11%	0.97%	2.25%	0.98%	-0.14%	-0.01%
过去六个月	5.73%	1.49%	6.32%	1.51%	-0.59%	-0.02%
过去一年	-5.21%	1.53%	-5.49%	1.55%	0.28%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-34.12%	1.70%	-31.07%	1.73%	-3.05%	-0.03%

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

永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万纯	权益投资部指数与数量投资部副总监/ 基金经理	2021-04-22	-	8	万纯先生，北京大学硕士，8年证券相关从业经验。曾任中国证券登记结算有限责任公司技术部基金业务组经理助理，平安基金管理有限公司指数投资部基金经理助理。现任永赢基金管理有限公司权益投资部指数与数量投资部副总监（主持工作）兼权益投资部智能投研部副总监（主持工作）。
刘庭宇	基金经理助理	2022-	-	4	刘庭宇先生，上海财经大

		11-07			学金融硕士，4年证券相关从业经验。曾任鹏扬基金管理有限公司量化分析师，现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理助理。
--	--	-------	--	--	---

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《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》及行业协会关于从业人员的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，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，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资授权管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先、比例分配”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。

本基金管理人交易部和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，分别于每季度和每年度对所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，每季度对连续四个季度期间内、不同时间窗下不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现显著违反公平交易的行为。本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023年一季度，A股在年初快速上涨后维持震荡，其中沪深300上涨4.63%、中证1000上涨9.46%、创业板指上涨2.25%。受国内经济复苏预期和季节效应影响，中小盘股明显强于大盘股。行业层面，随着数字中国建设整体布局规划的发布和以ChatGPT为代表的人工智能应用迎来突破性进展，TMT板块表现突出，其中计算机和传媒的涨幅靠前；受益央企价值重估逻辑，建筑装饰（基建）、石油石化和机械设备表现较好；房地产市场需求偏弱带动板块回调较多；随着线下消费场景恢复预期兑现，商贸零售行业迎来回调。医疗器械上涨2.25%，略高于整个医药板块，医疗器械行业短期基本面变化不大，一季度的波动主要来自市场风险偏好和资金风格的变化。

中期来看，医疗器械板块有望迎来历史配置机遇。随着我国人口老龄化加速和医疗资源发展不充分等问题日益凸显，医疗器械需求将持续增长，医院数量和重症床位的增长与基层医院的医疗水平提升是必然趋势，预计未来若干年内，国内医疗设备等需求将加速释放。长期来看，医疗器械国产化率低，行业具备较强的技术壁垒，未来国产替代空间巨大。当前中证全指医疗器械指数PE（TTM）不到20倍，处于过去十年4%的低分位数水平，长期投资价值突出。

报告期内，本基金坚持既定的指数化投资策略，主要采取完全复制法进行投资，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重分配投资于每只股票的具体金额，进而形成股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。报告期内，本基金根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票发生增发或配股、成份股停牌或因法律法规原因被限制投资、市场流动性不足等情况，对股票投资组合进行调整，力争基金净值增长率与标的指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末医疗器械ETF基金份额净值为0.6588元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.11%，同期业绩比较基准收益率为2.25%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,004,849,928.71	98.94
	其中：股票	2,004,849,928.71	98.94
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	17,963,102.19	0.89
8	其他资产	3,587,864.84	0.18
9	合计	2,026,400,895.74	100.00

注：（1）上述股票投资包括可退替代款估值增值。

（2）本基金通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为人民币72,813,643.00元，占基金资产净值的比例为3.60%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,796,678,520.19	88.86
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	14,655,514.00	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	75,972,898.72	3.76
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	114,110,654.99	5.64
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,001,417,587.90	98.98

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,871,402.91	0.09
D	电力、热力、燃气及水 生产和供应业	6,619.60	0.00
E	建筑业	77,329.12	0.00
F	批发和零售业	280,277.61	0.01
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	1,096,287.12	0.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施 管理业	103,469.59	0.01

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,435,385.95	0.17

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300760	迈瑞医疗	933,321	290,925,488.91	14.39
2	300896	爱美客	289,693	161,865,963.75	8.01
3	300003	乐普医疗	3,524,469	81,697,191.42	4.04
4	603882	金域医学	747,889	65,889,020.90	3.26
5	603392	万泰生物	487,805	56,658,550.75	2.80
6	300832	新产业	842,070	51,509,421.90	2.55
7	002223	鱼跃医疗	1,605,800	51,128,672.00	2.53
8	300676	华大基因	663,329	45,769,701.00	2.26
9	002432	九安医疗	1,028,200	45,415,594.00	2.25
10	002030	达安基因	2,631,151	42,387,842.61	2.10

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688343	云天励飞	24,961	1,096,287.12	0.05
2	688484	南芯科技	10,071	402,739.29	0.02
3	601061	中信金属	40,154	264,213.32	0.01
4	688522	纳睿雷达	4,299	258,842.79	0.01

5	301317	鑫磊股份	6,936	177,345.74	0.01
---	--------	------	-------	------------	------

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	199,044.55
2	应收证券清算款	3,348,082.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	40,737.59
7	其他	-
8	合计	3,587,864.84

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002223	鱼跃医疗	442,576.00	0.02	转融通证券出借
2	002030	达安基因	186,876.00	0.01	转融通证券出借

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688343	N云天	1,096,287.12	0.05	认购新发证券
2	688484	南芯科技	402,739.29	0.02	认购新发证券
3	601061	中信金属	264,213.32	0.01	认购新发证券
4	688522	纳睿雷达	258,842.79	0.01	新股限售
5	301317	鑫磊股份	16,426.98	0.00	新股限售

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	3,539,037,843.00
报告期期间基金总申购份额	470,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	940,000,000.00

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	3,069,037,843.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.《永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新（如有）；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6.基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

地点为管理人地址：上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦21、22、23、27层

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：www.maxwealthfund.com。

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：400-805-8888

永赢基金管理有限公司

2023年04月21日