

# 易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十日

## § 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
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	11
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
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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真实、准确和完整发表意见	12
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1	资产负债表	12
6.2	利润表	14
6.3	净资产（基金净值）变动表	15
6.4	报表附注	16
§ 7	投资组合报告	51
7.1	期末基金资产组合情况	51
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	57
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	57
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	57
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	57

7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	57
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12	投资组合报告附注.....	57
§ 8	基金份额持有人信息.....	58
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	59
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	60
§ 9	开放式基金份额变动.....	60
§ 10	重大事件揭示.....	60
10.1	基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4	基金投资策略的改变.....	60
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8	其他重大事件.....	64
§ 11	备查文件目录.....	64
11.1	备查文件目录.....	64
11.2	存放地点.....	65
11.3	查阅方式.....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证创新药产业 ETF
场内简称	创新医药、创新药 ETF 易方达
基金主代码	516080
交易代码	516080
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 3 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	458,554,800.00 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 2 月 23 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>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。</p> <p>为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。</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，即中证创新药产业指数收益率。
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，具有与标的指数相似的风险收益特征。

## 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		易方达基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66596688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38798812	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘晓艳	葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

## 2.5 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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-2,798,135.47
本期利润	-33,044,862.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0841

本期加权平均净值利润率	-12.32%
本期基金份额净值增长率	-11.10%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>
期末可供分配利润	-180,543,447.60
期末可供分配基金份额利润	-0.3937
期末基金资产净值	278,011,352.40
期末基金份额净值	0.6063
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	-39.37%

注：1.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。

2.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。

3.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

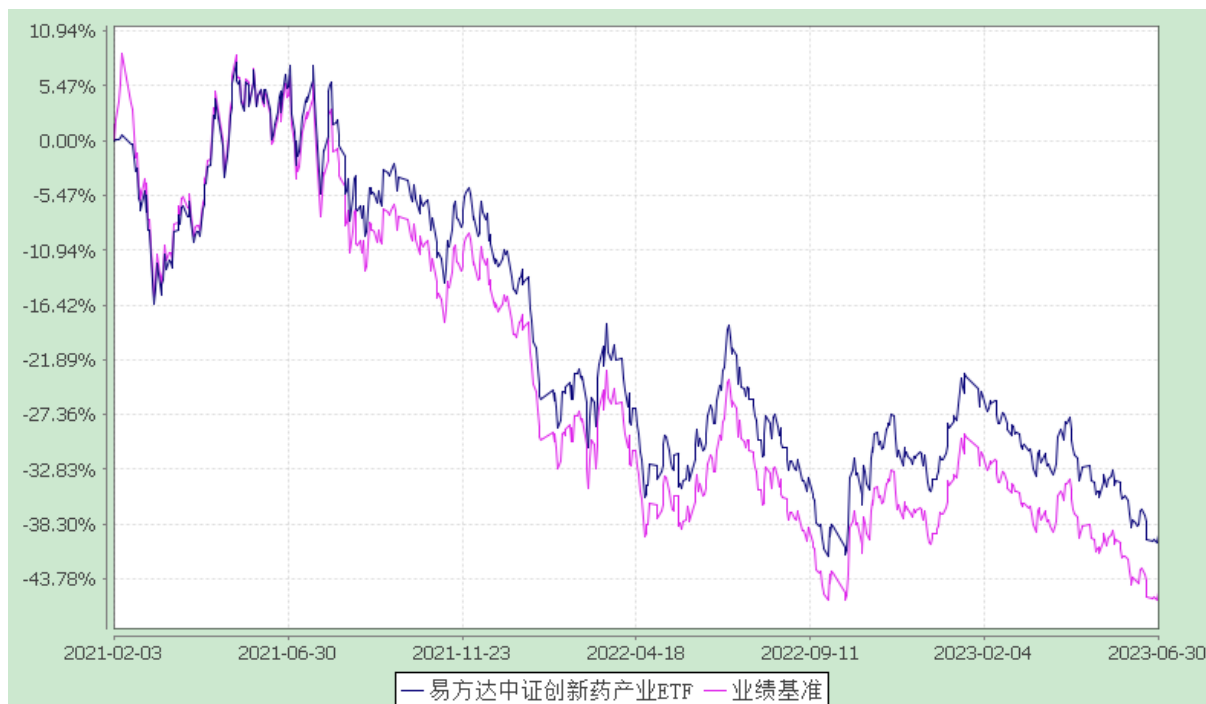
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.49%	1.19%	-5.99%	1.20%	0.50%	-0.01%
过去三个月	-9.79%	1.33%	-10.94%	1.34%	1.15%	-0.01%
过去六个月	-11.10%	1.31%	-12.55%	1.32%	1.45%	-0.01%
过去一年	-21.32%	1.64%	-23.80%	1.66%	2.48%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-39.37%	1.77%	-45.18%	1.84%	5.81%	-0.07%

### 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

易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2021年2月3日至2023年6月30日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-39.37%，同期业绩比较基准收益率为-45.18%。

## § 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

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

#### 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		
伍臣东	本基金的基金经理，易方达中证科创创业 50 联接、易方达中证科创创业 50ETF、易方达中证 500 质量成长 ETF、易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达中证智能电动汽	2022-11-01	-	6 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司研究支持专员、指数研究员。



<p>车 ETF、易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF)、易方达中证港股通医药卫生综合 ETF、易方达中证上海环交所碳中和 ETF 联接、易方达中证绿色电力 ETF、易方达中证光伏产业指数发起式、易方达中证软件服务 ETF 的基金经理, 易方达上证科创 50 联接、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证稀土产业 ETF、易方达中证沪港深 500ETF、易方达中证消费电子主题 ETF、易方达中证消费 50ETF 的基金经理助理</p>				
---	--	--	--	--

注: 1.对基金的首任基金经理, 其“任职日期”为基金合同生效日, “离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期; 对此后的非首任基金经理/基金经理助理, “任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理, 本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

#### 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, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定, 以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在控制风险的前提下, 为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内, 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人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。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、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”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。本报告期内, 公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 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 23 次，其中 20 次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，3 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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

本基金跟踪中证创新药产业指数，该指数从沪深市场主营业务涉及创新药研发的上市公司证券中，选取不超过 50 只最具代表性上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场创新药产业上市公司证券的整体表现。报告期内本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

2023 年上半年，经济社会全面恢复常态化运行，前期受疫情影响较大的消费和服务业需求加快恢复，按不变价格计算的 GDP 同比增长 5.5%，反映出国内经济运行整体回升向好，但地产和出口对于宏观经济仍产生一定程度拖累。流动性方面，货币政策保持相对稳健，央行下调 MLF、LPR 等政策利率，同时引导金融更大力度支持实体经济。海外方面，外部环境严峻复杂，通胀高位运行，发达经济体货币政策持续紧缩，全球金融市场波动加剧。A 股市场表现来看，在国内外不确定性因素影响下，市场行情波动较大，主要宽基指数呈先扬后抑走势，行业板块间分化明显，通信、传媒、计算机板块领涨市场，商贸零售、房地产等行业则跌幅较大，医药生物板块整体呈震荡下跌态势。创新药产业指数由化学药、生物药和医药外包类等企业构成，市场表现受医药监管政策影响较大，同时由于创新药企特别是初创公司，财务上融资压力较大，对利率也较为敏感。本报告期内，受海外持续加息的负面影响，中证创新药产业指数下跌 12.5%。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，力求跟踪误差最小化。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.6063 元，本报告期份额净值增长率为-11.10%，同期业绩比较基准收益率为-12.55%，年化跟踪误差 0.52%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，尽管面临诸多压力和挑战，但随着稳增长政策持续发力，就业改善、居民收入增加、供给结构优化调整等促进发展的积极因素累积增多，内生动力和市场需求有望稳步恢复，国内经济企稳向好。长期来看，中国经济增长和结构转型的趋势不改，战略性新兴产业也将在经济新旧动能转换、实现高质量发展中继续发挥重要作用。在国内人口总量增长、老龄化日趋严峻的背景下，医药行业前景广阔，而创新仍是行业持续发展的本源，创新药产业链发展空间较大。中国的人口红利和工程师红利也将继续推动产能向国内转移，在全球竞争中获取份额，相关企业的长期投资价值 and 配置价值值得关注。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，为投资者提供质地优良的指数投资工具，为长期看好创新药产业投资前景的投资者提供方便、高效的工具。

#### 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相关指引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。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 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：易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,355,435.32	3,069,503.67
结算备付金		42,940.84	74,748.33
存出保证金		33,580.96	23,927.96
交易性金融资产	6.4.7.2	275,055,830.44	251,788,359.45
其中：股票投资		275,055,830.44	251,788,359.45
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	-	-
应收清算款		642,355.45	141,079.06
应收股利		7,020.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	86,999.20	10,577.44
资产总计		278,224,162.21	255,108,195.91
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 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		-	7,316.37
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		34,149.13	32,421.89
应付托管费		11,383.04	10,807.30
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,986.23	1,670.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	165,291.41	305,253.66
负债合计		212,809.81	357,469.37
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	458,554,800.00	373,554,800.00
未分配利润	6.4.7.8	-180,543,447.60	-118,804,073.46
净资产合计		278,011,352.40	254,750,726.54

负债和净资产总计		278,224,162.21	255,108,195.91
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6063 元，基金份额总额 458,554,800.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-32,605,197.54	-42,011,847.47
1.利息收入		287,894.27	162,119.92
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,428.91	8,665.32
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		282,465.36	153,454.60
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,711,305.65	-14,669,685.54
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,596,597.01	-16,097,916.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	133,587.18
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,885,291.36	1,294,643.62
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-30,246,727.27	-27,555,721.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	64,941.11	51,440.02
<b>减：二、营业总支出</b>		439,665.20	435,449.33
1. 管理人报酬		199,680.71	198,579.16
2. 托管费		66,560.31	66,193.03
3. 销售服务费		-	-
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	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		1,017.19	552.87

8. 其他费用	6.4.7.18	172,406.99	170,124.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		<b>-33,044,862.74</b>	<b>-42,447,296.80</b>
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		<b>-33,044,862.74</b>	<b>-42,447,296.80</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		<b>-33,044,862.74</b>	<b>-42,447,296.80</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	373,554,800.00	-118,804,073.46	254,750,726.54
二、本期期初净资产（基金净值）	373,554,800.00	-118,804,073.46	254,750,726.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	85,000,000.00	-61,739,374.14	23,260,625.86
（一）、综合收益总额	-	-33,044,862.74	-33,044,862.74
（二）、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）	85,000,000.00	-28,694,511.40	56,305,488.60
其中：1.基金申购款	109,000,000.00	-35,015,058.68	73,984,941.32
2.基金赎回款	-24,000,000.00	6,320,547.28	-17,679,452.72
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	458,554,800.00	-180,543,447.60	278,011,352.40

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	339,554,800.00	-37,302,402.52	302,252,397.48
二、本期期初净资产(基金净值)	339,554,800.00	-37,302,402.52	302,252,397.48
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	13,000,000.00	-43,578,432.13	-30,578,432.13
(一)、综合收益总额	-	-42,447,296.80	-42,447,296.80
(二)、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)	13,000,000.00	-1,131,135.33	11,868,864.67
其中：1.基金申购款	95,000,000.00	-20,524,021.69	74,475,978.31
2.基金赎回款	-82,000,000.00	19,392,886.36	-62,607,113.64
(三)、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)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	352,554,800.00	-80,880,834.65	271,673,965.35

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：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3470 号《关于准予易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达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《易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募



集。经向中国证监会备案，《易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 2 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 561,554,800.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 800.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值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 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

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

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,355,435.32
等于：本金	2,355,154.68
加：应计利息	280.64
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	2,355,435.32

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	379,658,929.08	-	275,055,830.44	-104,603,098.64
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		379,658,929.08	-	275,055,830.44	-104,603,098.64

#### 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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	11,382.96
待摊费用	75,616.24
合计	86,999.20

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	-
应付交易费用	49,039.23
其中：交易所市场	49,039.23
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	116,252.18
合计	165,291.41

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	373,554,800.00	373,554,800.00
本期申购	109,000,000.00	109,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-24,000,000.00	-24,000,000.00
本期末	458,554,800.00	458,554,800.00

## 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,087,302.92	-113,716,770.54	-118,804,073.46
本期利润	-2,798,135.47	-30,246,727.27	-33,044,862.74
本期基金份额交易产生的变动数	-1,797,839.52	-26,896,671.88	-28,694,511.40
其中：基金申购款	-2,243,835.24	-32,771,223.44	-35,015,058.68
基金赎回款	445,995.72	5,874,551.56	6,320,547.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,683,277.91	-170,860,169.69	-180,543,447.60

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	728.03
其他	182.00
合计	5,428.91

## 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

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	股票投资收益——买卖股票差价收入
股票投资收益——赎回差价收入	-1,105,026.02
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-4,596,597.01

**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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	46,766,799.93
减：卖出股票成本总额	50,140,080.99
减：交易费用	118,289.93
买卖股票差价收入	-3,491,570.99

**6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	17,679,452.72
减：现金支付赎回款总额	9,938,804.72
减：赎回股票成本总额	8,845,674.02
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,105,026.02

**6.4.7.11 债券投资收益**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,885,291.36
其中：证券出借权益补偿收入	165,437.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,885,291.36

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-30,246,727.27
——股票投资	-30,246,727.27
——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	-30,246,727.27

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	64,941.11
合计	64,941.11

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	26,827.82
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,771.05
其他	84,300.75
合计	172,406.99

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作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
易方达基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

**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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	199,680.71	198,579.16
其中：支付销售机构的客户维护费	6,823.03	6,681.78

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值



基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照基金销售机构所销售基金的保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	66,560.31	66,193.03

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（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

单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券	17,363,913.00	12,039.70	0.00	0.00
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

广发证券	4,196,000.00	2,011.58	1,480,800.00	207.94
------	--------------	----------	--------------	--------

## 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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:股)	出借期限 (单位:天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券	2023010600007962	我武生物	2023-01-06	59,950.00	1,100.00	14	3.20	74.60	0.00	0.00
广发证券	2023010900002239	康龙化成	2023-01-09	999,271.00	13,900.00	14	3.20	1,865.31	0.00	0.00
广发证券	2023011300009372	我武生物	2023-01-13	85,500.00	1,500.00	14	3.40	137.28	0.00	0.00
广发证券	2023011300009374	我武生物	2023-01-13	176,700.00	3,100.00	14	3.20	267.01	0.00	0.00
广发证券	2023011300011962	微芯生物	2023-01-13	118,384.00	4,900.00	14	3.20	178.89	0.00	0.00
广发证券	2023011700000373	君实生物	2023-01-17	375,420.00	6,000.00	14	3.40	496.39	0.00	0.00
广发证券	2023013000078657	我武生物	2023-01-30	85,500.00	1,500.00	14	3.40	113.05	0.00	0.00
广发证券	2023013000078659	我武生物	2023-01-30	176,700.00	3,100.00	14	3.20	219.89	0.00	0.00
广发证券	202301300130	微芯生物	2023-01-30	138,670.00	4,900.00	14	3.20	172.57	0.00	0.00

	0008 0997									
广发证 券	2023 0131 0002 2563	君实生 物	2023- 01-31	344,4 60.00	6,000.00	14	3.4 0	455.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0214 0002 7097	君实生 物	2023- 02-14	326,7 00.00	6,000.00	14	3.4 0	431.9 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0228 0002 1192	君实生 物	2023- 02-28	316,8 00.00	6,000.00	14	3.4 0	418.8 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0302 0000 0974	康龙化 成	2023- 03-02	229,6 32.00	3,900.00	14	3.2 0	285.7 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0314 0002 8134	君实生 物	2023- 03-14	303,3 00.00	6,000.00	14	3.4 0	401.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0316 0001 4902	康龙化 成	2023- 03-16	210,6 00.00	3,900.00	14	3.2 0	262.0 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0328 0002 3805	君实生 物	2023- 03-28	294,6 00.00	6,000.00	14	3.4 0	389.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0329 0000 1250	安科生 物	2023- 03-29	65,31 3.00	5,900.00	14	3.2 0	81.28	0.00	0.00
广发证 券	2023 0329 0000 1252	智飞生 物	2023- 03-29	82,88 0.00	1,000.00	14	3.2 0	103.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0330 0000 2316	博腾股 份	2023- 03-30	655,6 70.00	17,300.00	14	3.2 0	815.9 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0330 0001	康龙化 成	2023- 03-30	222,4 95.00	3,900.00	14	3.2 0	276.8 8	0.00	0.00

	6465									
广发证 券	2023 0404 0000 1474	康龙化 成	2023- 04-04	892,9 25.00	18,700.00	14	3.4 1	1,184 .12	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0001 7628	君实生 物	2023- 04-11	308,0 40.00	6,000.00	14	3.4 0	407.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0413 0000 0476	众生药 业	2023- 04-13	63,98 4.00	3,100.00	14	3.2 0	79.62	0.00	0.00
广发证 券	2023 0413 0001 7927	康龙化 成	2023- 04-13	211,7 70.00	3,900.00	14	3.2 0	263.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0414 0000 2363	科伦药 业	2023- 04-14	299,0 96.00	9,800.00	14	3.2 0	372.2 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0000 2070	贝达药 业	2023- 04-25	145,3 76.00	2,200.00	14	3.2 0	180.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 6807	君实生 物	2023- 04-25	300,2 40.00	6,000.00	14	3.4 0	396.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0427 0000 9496	康龙化 成	2023- 04-27	176,8 65.00	3,900.00	14	3.2 0	220.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0427 0001 7326	众生药 业	2023- 04-27	69,81 2.00	3,100.00	14	3.1 0	84.16	0.00	0.00
广发证 券	2023 0505 0000 4404	科伦药 业	2023- 05-05	66,12 9.00	2,100.00	14	3.2 0	82.29	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 2713	贝达药 业	2023- 05-09	144,3 20.00	2,200.00	14	3.2 0	179.6 0	0.00	0.00

广发证 券	2023 0509 0001 2731	君实生 物	2023- 05-09	304,2 00.00	6,000.00	14	3.4 0	402.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0511 0002 0033	众生药 业	2023- 05-11	51,61 5.00	3,100.00	14	3.1 0	62.22	0.00	0.00
广发证 券	2023 0519 0000 8683	科伦药 业	2023- 05-19	67,07 4.00	2,100.00	7	3.2 0	41.73	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0000 1824	京新药 业	2023- 05-23	315,8 13.00	19,900.00	14	3.2 0	393.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 2432	贝达药 业	2023- 05-23	153,7 58.00	2,200.00	7	3.2 0	95.67	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0002 1878	君实生 物	2023- 05-23	304,9 20.00	6,000.00	7	3.4 0	201.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 1382	众生药 业	2023- 05-25	63,70 5.00	3,100.00	7	3.1 0	38.40	0.00	0.00
广发证 券	2023 0526 0001 2059	科伦药 业	2023- 05-26	69,34 2.00	2,100.00	7	3.2 0	43.15	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0001 9913	君实生 物	2023- 05-30	278,3 40.00	6,000.00	7	3.4 0	184.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0372	贝达药 业	2023- 05-30	124,5 42.00	2,200.00	7	3.2 0	77.49	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0000 3980	泰格医 药	2023- 06-01	1,104 ,160. 00	13,400.00	14	3.2 0	1,374 .07	0.00	0.00
广发证	2023	昭衍新	2023-	521,8	11,200.00	14	3.2	649.3	0.00	0.00

券	0601 0000 3996	药	06-01	08.00			0	6		
广发证 券	2023 0601 0003 2385	众生药 业	2023- 06-01	57,44 3.00	3,100.00	7	3.1 0	34.63	0.00	0.00
广发证 券	2023 0602 0001 3670	科伦药 业	2023- 06-02	64,72 2.00	2,100.00	7	3.2 0	40.27	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 6905	君实生 物	2023- 06-06	243,2 40.00	6,000.00	7	3.4 0	160.8 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 7118	贝达药 业	2023- 06-06	117,0 84.00	2,200.00	7	3.2 0	72.85	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 1030	众生药 业	2023- 06-08	53,59 9.00	3,100.00	7	3.1 0	32.31	0.00	0.00
广发证 券	2023 0609 0001 0919	科伦药 业	2023- 06-09	63,21 0.00	2,100.00	7	3.2 0	39.33	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 7262	复星医 药	2023- 06-12	994,9 86.00	33,100.00	14	3.2 1	1,242 .07	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 8921	贝达药 业	2023- 06-13	109,6 04.00	2,200.00	7	3.2 0	68.20	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 0191	君实生 物	2023- 06-13	245,4 00.00	6,000.00	7	3.4 0	162.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0614 0002 2162	凯莱英	2023- 06-14	1,210 ,395. 00	9,300.00	14	3.2 1	1,510 .98	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615	东诚药 业	2023- 06-15	50,50 5.00	3,500.00	14	3.2 1	63.05	0.00	0.00

	0001 3728									
广发证 券	2023 0615 0003 1640	泰格医 药	2023- 06-15	993,3 42.00	13,400.00	14	3.2 0	1,236 .16	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 2103	众生药 业	2023- 06-15	53,81 6.00	3,100.00	14	3.1 0	64.88	0.00	0.00
广发证 券	2023 0616 0002 0576	科伦药 业	2023- 06-16	63,29 4.00	2,100.00	14	3.2 0	78.77	0.00	0.00
广发证 券	2023 0619 0000 8315	百济神 州	2023- 06-19	491,4 00.00	4,200.00	14	3.2 1	481.9 8	458,262.00	481.98
广发证 券	2023 0620 0003 1457	贝达药 业	2023- 06-20	107,8 66.00	2,200.00	14	3.2 0	95.88	105,666.00	95.88
广发证 券	2023 0620 0003 2317	君实生 物	2023- 06-20	238,2 60.00	6,000.00	14	3.4 0	225.0 2	231,240.00	225.02
广发证 券	2023 0626 0004 2824	复星医 药	2023- 06-26	1,013 ,522. 00	33,100.00	14	3.2 1	361.4 9	1,022,790.0 0	361.49
广发证 券	2023 0627 0000 8160	凯莱英	2023- 06-27	363,6 02.00	2,900.00	14	3.2 1	97.26	341,794.00	97.26
广发证 券	2023 0628 0004 8807	凯莱英	2023- 06-28	1,139 ,622. 00	9,300.00	14	3.2 1	203.2 3	1,096,098.0 0	203.23
广发证 券	2023 0629 0000 8827	康希诺	2023- 06-29	301,7 96.00	3,800.00	14	3.2 1	26.91	309,700.00	26.91
广发证 券	2023 0629 0003	东诚药 业	2023- 06-29	52,04 5.00	3,500.00	14	3.2 1	4.64	51,485.00	4.64

	7650									
广发证 券	2023 0629 0003 9930	众生药 业	2023- 06-29	52,04 9.00	3,100.00	14	3.1 0	4.48	52,669.00	4.48
广发证 券	2023 0629 0004 4426	泰格医 药	2023- 06-29	852,2 40.00	13,400.00	14	3.2 0	75.75	864,836.00	75.75
广发证 券	2023 0630 0000 4715	美迪西	2023- 06-30	196,0 75.00	2,300.00	14	3.2 1	0.00	196,075.00	0.00
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日										
关联方 名称	合约 编号	证券名 称	成 交 时 间	交 易 金 额	交易数量 (单位: 股)	出 借 期 限 (单 位: 天)	费 率 ( %)	利 息 收 入	期 末 证 券 出 借 业 务 余 额	期 末 应 收 利 息 余 额
广发证 券	2022 0316 0000 1235	君实生 物	2022- 03-16	728,7 45.00	9,500.00	14	3.2 0	906.8 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0325 0000 0413	神州细 胞	2022- 03-25	54,00 0.00	1,000.00	14	2.0 0	42.00	0.00	0.00
广发证 券	2022 0330 0000 6591	君实生 物	2022- 03-30	816,9 05.00	9,500.00	14	3.2 0	1,016 .59	0.00	0.00
广发证 券	2022 0401 0000 0757	微芯生 物	2022- 04-01	53,36 0.00	2,000.00	14	3.3 0	68.48	0.00	0.00
广发证 券	2022 0413 0001 1276	君实生 物	2022- 04-13	674,6 90.00	9,500.00	14	3.2 0	839.6 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0420 0000 0775	博腾股 份	2022- 04-20	882,2 00.00	11,000.00	14	2.0 0	735.1 7	0.00	0.00
广发证	2022	微芯生	2022-	50,64	2,000.00	14	2.0	42.20	0.00	0.00



券	0420 0000 0818	物	04-20	0.00			0			
广发证 券	2022 0427 0000 9435	君实生 物	2022- 04-27	775,7 70.00	9,500.00	14	3.2 0	965.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 0231	微芯生 物	2022- 05-05	44,08 0.00	2,000.00	14	2.0 0	34.28	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 5317	博腾股 份	2022- 05-05	785,9 50.00	11,000.00	14	2.0 0	611.2 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 0623	博腾股 份	2022- 05-19	764,7 20.00	11,000.00	7	2.0 0	297.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0001 0828	博腾股 份	2022- 05-26	714,6 70.00	11,000.00	7	2.0 0	277.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0530 0000 0836	泰格医 药	2022- 05-30	83,63 0.00	1,000.00	14	3.2 0	104.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0000 0710	神州细 胞	2022- 06-02	51,17 0.00	1,000.00	14	3.2 0	63.68	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 9878	博腾股 份	2022- 06-02	725,0 10.00	11,000.00	7	2.0 0	281.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 5701	博腾股 份	2022- 06-09	843,8 10.00	11,000.00	7	2.0 0	328.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0613 0002 0943	泰格医 药	2022- 06-13	91,73 0.00	1,000.00	7	3.2 0	57.08	0.00	0.00
广发证 券	2022 0614	诚达药 业	2022- 06-14	81,18 0.00	1,200.00	14	3.2 0	101.0 2	0.00	0.00

	0000 0651									
广发证 券	2022 0615 0000 2342	药石科 技	2022- 06-15	410,8 72.00	4,600.00	14	3.2 0	511.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0616 0001 4729	博腾股 份	2022- 06-16	819,9 40.00	11,000.00	14	2.0 0	637.7 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0616 0001 8607	神州细 胞	2022- 06-16	51,43 0.00	1,000.00	14	3.2 0	64.00	0.00	0.00
广发证 券	2022 0620 0001 5052	泰格医 药	2022- 06-20	99,26 0.00	1,000.00	14	3.2 0	88.23	114,450.00	88.23
广发证 券	2022 0628 0001 0794	诚达药 业	2022- 06-28	86,61 6.00	1,200.00	14	3.2 0	15.40	87,840.00	15.40
广发证 券	2022 0629 0002 3306	药石科 技	2022- 06-29	431,3 88.00	4,600.00	14	3.2 0	38.35	455,354.00	38.35
广发证 券	2022 0630 0001 6471	博腾股 份	2022- 06-30	857,8 90.00	11,000.00	14	2.0 0	0.00	857,890.00	0.00
广发证 券	2022 0630 0001 6479	神州细 胞	2022- 06-30	51,73 0.00	1,000.00	14	3.2 0	0.00	51,730.00	0.00

#### 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

本报告期内和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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
-------	---------------------	-----------------------

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发证券股份有限公司	4,300,500.00	0.9378%	700,000.00	0.1874%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中国银行-活期存款	2,355,435.32	4,518.88	3,489,067.69	6,709.67

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业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

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301376	致欧科技	新股网下发行	3,563	87,863.58
中银国际证券股份有限公司	301397	溯联股份	新股网下发行	2,135	113,731.45
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301181	标榜股份	新股网下发行	2,564	103,201.00
广发证券股份有限公司	301220	亚香股份	新股网下发行	2,849	102,507.02

中银国际证 券股份有限 公司	600938	中国海油	新股网上 发行	4,000	43,200.00
----------------------	--------	------	------------	-------	-----------

注：中银国际证券股份有限公司为本基金托管人中国银行股份有限公司的关联方。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 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
00128 2	三联 锻造	2023-0 5-15	6 个月	新股 流通 受限	27.93	33.03	94	2,625. 42	3,104. 82	-
00128 6	陕西 能源	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	9.60	9.41	3,767	36,163 .20	35,447 .47	-
00128 7	中电 港	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	11.88	21.02	329	3,908. 52	6,915. 58	-
00132 8	登康 口腔	2023-0 3-29	6 个月	新股 流通 受限	20.68	25.49	103	2,130. 04	2,625. 47	-
00136 0	南矿 集团	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	15.38	14.87	131	2,014. 78	1,947. 97	-
00136 7	海森 药业	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	44.48	39.48	48	2,135. 04	1,895. 04	-
30080 4	广康 生化	2023-0 6-15	6 个月	新股 流通 受限	42.45	32.97	226	9,593. 70	7,451. 22	-
30114 1	中科 磁业	2023-0 3-27	6 个月	新股 流通	41.20	42.69	234	9,640. 80	9,989. 46	-

				受限						
301157	华塑科技	2023-03-01	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	129	7,288.50	6,827.97	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	234	7,956.00	8,173.62	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月以内	新股流通受限	25.82	25.82	2,227	57,501.14	57,501.14	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	248	6,403.36	6,403.36	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新股流通受限	72.50	58.42	161	11,672.50	9,405.62	-
301281	科源制药	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	44.18	25.10	263	8,305.84	6,601.30	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	38.13	31.03	393	14,985.09	12,194.79	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	253	7,488.80	18,069.26	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	新股流通受限	5.00	8.96	2,118	10,590.00	18,977.28	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	25.25	19.69	381	9,620.25	7,501.89	-
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	348	11,254.32	11,087.28	-
301315	威士顿	2023-06-13	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	191	7,460.46	7,517.76	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	559	8,278.79	7,675.07	-
301333	亚华	2023-0	6 个月	新股	32.60	30.37	195	6,357.	5,922.	-

7	电子	5-16		流通受限				00	15	
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	106	7,785.70	4,943.84	-
301355	南王科技	2023-06-02	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	507	8,897.85	8,492.25	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	336	7,986.72	14,411.04	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	108	7,763.04	10,000.80	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	256	8,634.88	8,153.60	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	357	8,803.62	8,036.07	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	330	7,854.00	10,837.20	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	268	8,037.32	6,375.72	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	214	11,399.78	8,602.80	-
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	新股流通受限	43.99	51.57	209	9,193.91	10,778.13	-
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	582	9,451.68	9,864.90	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	342	6,836.58	5,779.80	-

30148 6	致尚 科技	2023-0 6-30	1 个月 以内	新股 流通 受限	57.66	57.66	1,774	102,28 8.84	102,28 8.84	-
30148 6	致尚 科技	2023-0 6-30	6 个月	新股 流通 受限	57.66	57.66	198	11,416 .68	11,416 .68	-
30148 8	豪恩 汽电	2023-0 6-26	1 个月 以内	新股 流通 受限	39.78	39.78	2,255	89,703 .90	89,703 .90	-
30148 8	豪恩 汽电	2023-0 6-26	6 个月	新股 流通 受限	39.78	39.78	251	9,984. 78	9,984. 78	-
60106 1	中信 金属	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	6.58	7.58	758	4,987. 64	5,745. 64	-
60106 5	江盐 集团	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	10.36	11.84	314	3,253. 04	3,717. 76	-
60113 3	柏诚 股份	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	11.66	12.26	238	2,775. 08	2,917. 88	-
60312 5	常青 科技	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	25.98	24.53	83	2,156. 34	2,035. 99	-
60313 5	中重 科技	2023-0 3-29	6 个月	新股 流通 受限	17.80	17.89	249	4,432. 20	4,454. 61	-
60313 7	恒尚 节能	2023-0 4-10	6 个月	新股 流通 受限	15.90	17.09	139	2,210. 10	2,375. 51	-
60317 2	万丰 股份	2023-0 4-28	6 个月	新股 流通 受限	14.58	16.13	122	1,778. 76	1,967. 86	-
68814 6	中船 特气	2023-0 4-13	6 个月	新股 流通 受限	36.15	38.13	251	9,073. 65	9,570. 63	-
68824 9	晶合 集成	2023-0 4-24	6 个月	新股 流通 受限	19.86	18.06	1,518	30,147 .48	27,415 .08	-
68833 4	西高 院	2023-0 6-09	6 个月	新股 流通 受限	14.16	16.21	615	8,708. 40	9,969. 15	-
68835 2	颀中 科技	2023-0 4-11	6 个月	新股 流通	12.10	12.07	732	8,857. 20	8,835. 24	-

				受限						
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	236	5,569.60	15,262.12	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	340	6,528.00	8,680.20	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	230	6,131.80	7,245.00	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	642	24,318.96	18,932.58	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	1,169	12,975.90	19,919.76	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	新股流通受限	32.52	42.37	285	9,268.20	12,075.45	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	197	6,696.03	5,809.53	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	420	9,181.20	10,017.00	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	87	13,257.06	11,829.39	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	153	5,355.00	7,838.19	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新股流通受限	21.17	23.50	372	7,875.24	8,742.00	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	520	6,593.60	11,601.20	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	354	10,712.04	8,966.82	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	61	7,673.80	7,199.83	-
68858	芯动	2023-0	6 个月	新股	26.74	40.68	311	8,316.	12,651	-



2	联科	6-21		流通受限				14	.48	
688593	新相微	2023-05-25	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	701	7,837.18	10,227.59	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	862	9,206.16	10,637.08	-
688623	二元科技	2023-05-31	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	79	9,944.52	6,856.41	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	223	5,637.44	6,661.01	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

#### 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

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末 估值 单价	数量(单位： 股)	期末估值总 额
1	000661	长春高新	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	136.30	15,600.00	2,126,280.00
2	000963	华东医药	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 13 日	43.37	2,000.00	86,740.00
3	002019	亿帆医药	2023 年 7 月 13 日	14.60	22,400.00	327,040.00

			-2023 年 7 月 14 日			
4	002099	海翔药业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	8.59	44,800.00	384,832.00
5	002294	信立泰	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 3 日	31.19	22,800.00	711,132.00
6	002317	众生药业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	16.99	36,200.00	615,038.00
7	002422	科伦药业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	29.68	54,400.00	1,614,592.00
8	002653	海思科	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 11 日	23.60	12,100.00	285,560.00
9	002675	东诚药业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	14.71	36,800.00	541,328.00
10	002821	凯莱英	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 12 日	117.86	13,200.00	1,555,752.00
11	300122	智飞生物	2023 年 7 月 14 日 -2023 年 7 月 14 日	44.20	7,100.00	313,820.00
12	300142	沃森生物	2023 年 7 月 14 日 -2023 年 7 月 14 日	26.45	35,200.00	931,040.00
13	300347	泰格医药	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 13 日	64.54	13,400.00	864,836.00
14	300363	博腾股份	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	29.59	12,800.00	378,752.00
15	300558	贝达药业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	48.03	3,200.00	153,696.00
16	300601	康泰生物	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 3 日	25.39	22,300.00	566,197.00
17	300725	药石科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	48.43	8,700.00	421,341.00
18	300759	康龙化成	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	38.28	32,200.00	1,232,616.00
19	600079	人福医药	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 10 日	26.94	35,800.00	964,452.00
20	600196	复星医药	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	30.90	33,100.00	1,022,790.00
21	600216	浙江医药	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 4 日	10.95	28,300.00	309,885.00
22	600267	海正药业	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 11 日	11.38	8,000.00	91,040.00
23	600380	健康元	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	12.71	27,000.00	343,170.00
24	600535	天士力	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 10 日	14.51	19,000.00	275,690.00
25	601607	上海医药	2023 年 7 月 4 日	22.41	50,200.00	1,124,982.00

			-2023 年 7 月 4 日			0
26	603127	昭衍新药	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 14 日	40.90	14,800.00	605,320.00
27	603229	奥翔药业	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 14 日	20.98	11,400.00	239,172.00
28	603259	药明康德	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 3 日	62.31	32,000.00	1,993,920.00
29	603456	九洲药业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	27.38	400.00	10,952.00
30	603858	步长制药	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	20.59	28,000.00	576,520.00
31	688180	君实生物	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	38.54	7,400.00	285,196.00
32	688185	康希诺	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 13 日	81.50	3,800.00	309,700.00
33	688202	美迪西	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	85.25	3,300.00	281,325.00
34	688235	百济神州	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 11 日	109.11	6,200.00	676,482.00
35	688238	和元生物	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	11.29	17,800.00	200,962.00
36	688278	特宝生物	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 5 日	43.91	1,000.00	43,910.00
37	688315	诺禾致源	2023 年 7 月 14 日 -2023 年 7 月 14 日	26.55	2,600.00	69,030.00
38	688321	微芯生物	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	22.64	16,000.00	362,240.00
39	688331	荣昌生物	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	55.75	7,600.00	423,700.00
合计	-	-	-	-	748,900.00	23,321,030.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

#### 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

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”

的健全的风险监控体系。

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益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，具有与标的指数相似的风险收益特征。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。本基金参与转融通证券出借业务，其中非约定申报出借证券均为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金的基金管理人对于约定申报的借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，因此，本基金违约风险可能性很小。于 2023 年 6 月 30 日，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占基金资产净值的比例为 0.00%(2022 年 12 月 31 日：0.00%)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	0.00	0.00
----	------	------

## 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

## 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

## 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

## 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

## 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限

证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	2,355,435.32	-	-	-	2,355,435.32
结算备付金	42,940.84	-	-	-	42,940.84
存出保证金	33,580.96	-	-	-	33,580.96
交易性金融资产	-	-	-	275,055,830.44	275,055,830.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	642,355.45	642,355.45
应收股利	-	-	-	7,020.00	7,020.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	86,999.20	86,999.20
资产总计	2,431,957.12	-	-	275,792,205.09	278,224,162.21
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	34,149.13	34,149.13
应付托管费	-	-	-	11,383.04	11,383.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,986.23	1,986.23
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	165,291.41	165,291.41
负债总计	-	-	-	212,809.81	212,809.81

利率敏感度缺口	2,431,957.12	-	-	275,579,395.28	278,011,352.40
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,069,503.67	-	-	-	3,069,503.67
结算备付金	74,748.33	-	-	-	74,748.33
存出保证金	23,927.96	-	-	-	23,927.96
交易性金融资产	-	-	-	251,788,359.45	251,788,359.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	141,079.06	141,079.06
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	10,577.44	10,577.44
资产总计	3,168,179.96	-	-	251,940,015.95	255,108,195.91
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	7,316.37	7,316.37
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	32,421.89	32,421.89
应付托管费	-	-	-	10,807.30	10,807.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,670.15	1,670.15
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	305,253.66	305,253.66
负债总计	-	-	-	357,469.37	357,469.37



利率敏感度缺口	3,168,179.96	-	-	251,582,546.58	254,750,726.54
---------	--------------	---	---	----------------	----------------

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 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(不包括可转债)，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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 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采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	275,055,830.44	98.94	251,788,359.45	98.84
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	275,055,830.44	98.94	251,788,359.45	98.84

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	13,710,122.14	12,555,409.36
2.业绩比较基准下降 5%	-13,710,122.14	-12,555,409.36	

#### 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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	274,156,573.84
第二层次	277,298.70
第三层次	621,957.90
合计	275,055,830.44

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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金融工具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，确定相关金融工具的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

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	275,055,830.44	98.86
	其中：股票	275,055,830.44	98.86
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	2,398,376.16	0.86
8	其他各项资产	769,955.61	0.28
9	合计	278,224,162.21	100.00

注：本基金本报告期末融出证券市值为 23,321,030.00 元，占净值比例 8.39%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	206,343,990.63	74.22

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	5,293.39	0.00
F	批发和零售业	17,588,205.19	6.33
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	59,391.61	0.02
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	50,997,931.00	18.34
N	水利、环境和公共设施管理业	7,501.89	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,069.26	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	275,055,830.44	98.94

### 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	占基金资产净值 比例（%）
1	600276	恒瑞医药	625,452	29,959,150.80	10.78
2	603259	药明康德	438,636	27,331,409.16	9.83
3	300122	智飞生物	334,775	14,797,055.00	5.32
4	000661	长春高新	90,300	12,307,890.00	4.43
5	300142	沃森生物	448,300	11,857,535.00	4.27
6	600196	复星医药	354,900	10,966,410.00	3.94
7	000963	华东医药	244,600	10,608,302.00	3.82
8	002422	科伦药业	328,457	9,748,603.76	3.51
9	300347	泰格医药	146,300	9,442,202.00	3.40
10	600079	人福医药	318,800	8,588,472.00	3.09
11	002821	凯莱英	66,935	7,888,959.10	2.84
12	603392	万泰生物	106,200	7,090,974.00	2.55
13	601607	上海医药	310,100	6,949,341.00	2.50
14	002007	华兰生物	305,333	6,842,512.53	2.46

15	300759	康龙化成	165,800	6,346,824.00	2.28
16	002294	信立泰	155,600	4,853,164.00	1.75
17	300601	康泰生物	186,980	4,747,422.20	1.71
18	688180	君实生物	106,876	4,119,001.04	1.48
19	600380	健康元	322,875	4,103,741.25	1.48
20	000513	丽珠集团	104,690	4,073,487.90	1.47
21	600867	通化东宝	389,300	4,064,292.00	1.46
22	600535	天士力	251,040	3,642,590.40	1.31
23	688235	百济神州	32,090	3,501,339.90	1.26
24	603456	九洲药业	125,500	3,436,190.00	1.24
25	300558	贝达药业	70,000	3,362,100.00	1.21
26	300009	安科生物	326,744	3,267,440.00	1.18
27	603858	步长制药	154,439	3,179,899.01	1.14
28	002317	众生药业	181,800	3,088,782.00	1.11
29	603127	昭衍新药	75,510	3,088,359.00	1.11
30	002019	亿帆医药	205,000	2,993,000.00	1.08
31	300357	我武生物	87,700	2,949,351.00	1.06
32	002099	海翔药业	316,100	2,715,299.00	0.98
33	002675	东诚药业	184,000	2,706,640.00	0.97
34	300363	博腾股份	91,400	2,704,526.00	0.97
35	600267	海正药业	198,500	2,258,930.00	0.81
36	688331	荣昌生物	39,569	2,205,971.75	0.79
37	300725	药石科技	44,580	2,159,009.40	0.78
38	688520	神州细胞	37,262	2,114,245.88	0.76
39	600216	浙江医药	188,500	2,064,075.00	0.74
40	688278	特宝生物	45,485	1,997,246.35	0.72
41	002773	康弘药业	102,628	1,962,247.36	0.71
42	688321	微芯生物	80,469	1,821,818.16	0.66
43	688185	康希诺	19,208	1,565,452.00	0.56
44	002653	海思科	62,200	1,467,920.00	0.53
45	688202	美迪西	16,989	1,448,312.25	0.52
46	688131	皓元医药	25,138	1,432,363.24	0.52
47	603229	奥翔药业	59,140	1,240,757.20	0.45
48	002399	海普瑞	104,400	1,197,468.00	0.43
49	688238	和元生物	89,410	1,009,438.90	0.36
50	688315	诺禾致源	33,486	889,053.30	0.32
51	301486	致尚科技	1,972	113,705.52	0.04
52	301488	豪恩汽电	2,506	99,688.68	0.04
53	301202	朗威股份	2,475	63,904.50	0.02
54	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
55	688249	晶合集成	1,518	27,415.08	0.01
56	688472	阿特斯	1,169	19,919.76	0.01
57	301301	川宁生物	2,118	18,977.28	0.01
58	688443	智翔金泰	642	18,932.58	0.01

59	301293	三博脑科	253	18,069.26	0.01
60	688361	中科飞测	236	15,262.12	0.01
61	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
62	301358	湖南裕能	336	14,411.04	0.01
63	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
64	688582	芯动联科	311	12,651.48	0.00
65	301291	明阳电气	393	12,194.79	0.00
66	688478	晶升股份	285	12,075.45	0.00
67	688531	日联科技	87	11,829.39	0.00
68	688562	航天软件	520	11,601.20	0.00
69	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
70	301307	美利信	348	11,087.28	0.00
71	301382	蜂助手	330	10,837.20	0.00
72	301399	英特科技	209	10,778.13	0.00
73	688620	安凯微	862	10,637.08	0.00
74	688593	新相微	701	10,227.59	0.00
75	688523	航天环宇	420	10,017.00	0.00
76	301360	荣旗科技	108	10,000.80	0.00
77	301141	中科磁业	234	9,989.46	0.00
78	688334	西高院	615	9,969.15	0.00
79	301408	华人健康	582	9,864.90	0.00
80	688146	中船特气	251	9,570.63	0.00
81	301232	飞沃科技	161	9,405.62	0.00
82	688570	天玛智控	354	8,966.82	0.00
83	688352	硕中科技	732	8,835.24	0.00
84	688552	航天南湖	372	8,742.00	0.00
85	688429	时创能源	340	8,680.20	0.00
86	301397	溯联股份	214	8,602.80	0.00
87	301355	南王科技	507	8,492.25	0.00
88	301170	锡南科技	234	8,173.62	0.00
89	301373	凌玮科技	256	8,153.60	0.00
90	301376	致欧科技	357	8,036.07	0.00
91	688535	华海诚科	153	7,838.19	0.00
92	301332	德尔玛	559	7,675.07	0.00
93	301323	新莱福	191	7,517.76	0.00
94	301305	朗坤环境	381	7,501.89	0.00
95	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
96	688433	华曙高科	230	7,245.00	0.00
97	688581	安杰思	61	7,199.83	0.00
98	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
99	001287	中电港	329	6,915.58	0.00
100	688623	双元科技	79	6,856.41	0.00
101	301157	华塑科技	129	6,827.97	0.00
102	688631	莱斯信息	223	6,661.01	0.00

103	301281	科源制药	263	6,601.30	0.00
104	301386	未来电器	268	6,375.72	0.00
105	301337	亚华电子	195	5,922.15	0.00
106	688479	友车科技	197	5,809.53	0.00
107	301439	泓淋电力	342	5,779.80	0.00
108	601061	中信金属	758	5,745.64	0.00
109	301345	涛涛车业	106	4,943.84	0.00
110	603135	中重科技	249	4,454.61	0.00
111	601065	江盐集团	314	3,717.76	0.00
112	001282	三联锻造	94	3,104.82	0.00
113	601133	柏诚股份	238	2,917.88	0.00
114	001328	登康口腔	103	2,625.47	0.00
115	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
116	603125	常青科技	83	2,035.99	0.00
117	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
118	001360	南矿集团	131	1,947.97	0.00
119	001367	海森药业	48	1,895.04	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	603392	万泰生物	7,098,845.00	2.79
2	300122	智飞生物	4,616,118.09	1.81
3	688235	百济神州	4,183,181.56	1.64
4	300142	沃森生物	4,174,158.00	1.64
5	000661	长春高新	3,786,551.00	1.49
6	603259	药明康德	3,679,681.00	1.44
7	300347	泰格医药	3,491,455.00	1.37
8	002821	凯莱英	3,156,987.00	1.24
9	000963	华东医药	3,051,535.00	1.20
10	300759	康龙化成	2,913,541.00	1.14
11	688331	荣昌生物	2,659,981.43	1.04
12	002422	科伦药业	2,588,427.00	1.02
13	688520	神州细胞	2,353,544.87	0.92
14	002007	华兰生物	1,856,966.00	0.73
15	002294	信立泰	1,630,728.00	0.64
16	002653	海思科	1,490,944.00	0.59
17	300601	康泰生物	1,482,655.60	0.58
18	300558	贝达药业	1,448,149.00	0.57

19	300363	博腾股份	1,235,516.00	0.48
20	688238	和元生物	1,170,625.55	0.46

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	600276	恒瑞医药	7,153,738.62	2.81
2	002020	京新药业	2,462,630.00	0.97
3	688266	泽璟制药	2,434,927.39	0.96
4	002038	双鹭药业	2,155,375.00	0.85
5	688578	艾力斯	1,867,381.72	0.73
6	300122	智飞生物	1,668,544.00	0.65
7	300142	沃森生物	1,582,162.00	0.62
8	688658	悦康药业	1,443,620.31	0.57
9	600812	华北制药	1,418,099.00	0.56
10	000661	长春高新	1,327,966.00	0.52
11	300347	泰格医药	1,152,419.00	0.45
12	000963	华东医药	1,149,417.00	0.45
13	300363	博腾股份	998,994.00	0.39
14	300357	我武生物	862,299.00	0.34
15	002294	信立泰	640,918.00	0.25
16	603456	九洲药业	627,946.00	0.25
17	300558	贝达药业	625,436.00	0.25
18	002007	华兰生物	605,960.00	0.24
19	300759	康龙化成	587,135.00	0.23
20	002422	科伦药业	580,581.00	0.23

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	80,002,085.27
卖出股票收入（成交）总额	46,766,799.93

注：“买入股票成本”或“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。

#### 7.5 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。



**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。

**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**

本基金本报告期末投资股指期货。

**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**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

**7.12.2** 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	33,580.96
2	应收清算款	642,355.45
3	应收股利	7,020.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	11,382.96
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	769,955.61

#### 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

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	000661	长春高新	2,126,280.00	0.76	转融通流通受限
2	603259	药明康德	1,993,920.00	0.72	转融通流通受限
3	002422	科伦药业	1,614,592.00	0.58	转融通流通受限
4	600196	复星医药	1,022,790.00	0.37	转融通流通受限
5	600079	人福医药	964,452.00	0.35	转融通流通受限
6	300142	沃森生物	931,040.00	0.33	转融通流通受限
7	300347	泰格医药	864,836.00	0.31	转融通流通受限
8	300122	智飞生物	313,820.00	0.11	转融通流通受限
9	000963	华东医药	86,740.00	0.03	转融通流通受限

## § 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	持有份额	占总份额

			比例		比例
9,395	48,808.39	32,860,898.00	7.17%	425,693,902.00	92.83%

## 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	张群	13,030,900.00	2.84%
2	民生加银基金—中信银行—民生加银基金泰利 1 号集合资产管理计划	7,121,000.00	1.55%
3	宋立成	6,309,800.00	1.38%
4	胡平飞	4,899,700.00	1.07%
5	广发证券股份有限公司	4,300,500.00	0.94%
6	中国国际金融股份有限公司	3,495,298.00	0.76%
7	陈楚怡	3,294,100.00	0.72%
8	陈辉华	3,100,000.00	0.68%
9	南京彤天科技实业股份有限公司	3,000,000.00	0.65%
10	方正证券股份有限公司	2,715,706.00	0.59%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

#### 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

#### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年2月3日）基金份额总额	561,554,800.00
本报告期期初基金份额总额	373,554,800.00
本报告期基金总申购份额	109,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	24,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	458,554,800.00

#### § 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

本基金管理人于 2023 年 4 月 22 日发布公告，自 2023 年 4 月 22 日起聘任王骏先生为副总经理级高级管理人员（首席市场官）。

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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、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有重大变化。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

### 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，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

## 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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	5	48,692,845.13	40.48%	24,348.46	40.48%	-
高盛高华	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	20,865,296.51	17.34%	10,433.58	17.34%	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	49,125,112.25	40.84%	24,562.66	40.83%	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	1,617,336.40	1.34%	808.67	1.34%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

## 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

## 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	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2023-01-20
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	证券时报	2023-03-30
3	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2023-04-21
5	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-22
6	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加德邦证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-26
7	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华福证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-06
8	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
9	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-16

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。



## 11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

## 11.3 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。

易方达基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日