

银华中证创新药产业交易型开放式指数证  
券投资基金发起式联接基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 29 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 25 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 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 15        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 15        |
| 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             | 16        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 16        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 16        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 17        |
| 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       | 17        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 17        |
| 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 | 17        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见       | 17        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>17</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 17        |
| 6.2 利润表                                 | 19        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 20        |
| 6.4 报表附注                                | 22        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>42</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 42        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 43        |
| 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       | 43        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 43        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 43        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 43        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 43        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 43        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....    | 43        |
| 7.10 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 .....   | 43        |
| 7.11 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 44        |
| 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 44        |
| 7.13 投资组合报告附注 .....                         | 44        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 45        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 45        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 45        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 46        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>46</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>47</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 47        |
| 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 .....      | 47        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 47        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 47        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 47        |
| 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 .....         | 47        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 47        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 48        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>49</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....    | 49        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 49        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>49</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 49        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 50        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 50        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                     |                                |                       |
|---------------------|--------------------------------|-----------------------|
| 基金名称                | 银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 |                       |
| 基金简称                | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接            |                       |
| 基金主代码               | 012781                         |                       |
| 基金运作方式              | 契约型开放式                         |                       |
| 基金合同生效日             | 2021 年 12 月 30 日               |                       |
| 基金管理人               | 银华基金管理股份有限公司                   |                       |
| 基金托管人               | 上海银行股份有限公司                     |                       |
| 报告期末基金份<br>额总额      | 82,600,717.54 份                |                       |
| 基金合同存续期             | 不定期                            |                       |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 A          | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 C |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 012781                         | 012782                |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 17,598,460.04 份                | 65,002,257.50 份       |

#### 2.1.1 目标基金基本情况

|              |                         |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称         | 银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码        | 159992                  |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                  |
| 基金合同生效日      | 2020 年 3 月 20 日         |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所                 |
| 上市日期         | 2020 年 4 月 10 日         |
| 基金管理人名称      | 银华基金管理股份有限公司            |
| 基金托管人名称      | 上海银行股份有限公司              |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。   |
| 投资策略 | <p>本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF，以实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。</p> <p>本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。本基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | 金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。  |
| 业绩比较基准 | 中证创新药产业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%  |
| 风险收益特征 | 本基金为 ETF 联接基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，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。 |

### 2.2.1 目标基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。   |
| 投资策略   | <p>本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数，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而进行相应调整。</p> <p>在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例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。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证创新药产业指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于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          | 银华基金管理股份有限公司                   | 上海银行股份有限公司                   |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                             | 杨文辉                          |
|             | 联系电话                           | (010) 58163000               |
|             | 电子邮箱                           | yhjj@yhfund.com.cn           |
| 客户服务电话      | 4006783333, (010) 85186558     | 95564                        |
| 传真          | (010) 58163027                 | 021-68476901                 |
| 注册地址        | 广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层   | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号      |
| 办公地址        | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 27 层 |
| 邮政编码        | 100738                         | 200120                       |
| 法定代表人       | 王珠林                            | 金煜                           |

### 2.4 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.yhfund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所            |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                           |
|--------|--------------|--------------------------------|
| 注册登记机构 | 银华基金管理股份有限公司 | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 |

15 层

### § 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-2023年6月30日) |                       |
|---------------|---------------------------|-----------------------|
|               | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 A     | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 C |
| 本期已实现收益       | -91,625.10                | -148,911.43           |
| 本期利润          | -1,616,563.11             | -5,962,122.67         |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1115                   | -0.1965               |
| 本期加权平均净值利润率   | -14.75%                   | -26.99%               |
| 本期基金份额净值增长率   | -12.32%                   | -12.37%               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年6月30日)          |                       |
|               |                           |                       |
| 期末可供分配利润      | -5,804,364.88             | -21,501,053.78        |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.3298                   | -0.3308               |
| 期末基金资产净值      | 11,794,095.16             | 43,501,203.72         |
| 期末基金份额净值      | 0.6702                    | 0.6692                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2023年6月30日)          |                       |
|               |                           |                       |
| 基金份额累计净值增长率   | -32.98%                   | -33.08%               |

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

3、本报告中所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 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

银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | -5.57%   | 1.12%       | -5.69%     | 1.14%         | 0.12%  | -0.02% |
| 过去三个月      | -10.62%  | 1.19%       | -10.39%    | 1.27%         | -0.23% | -0.08% |
| 过去六个月      | -12.32%  | 1.20%       | -11.91%    | 1.26%         | -0.41% | -0.06% |
| 过去一年       | -22.61%  | 1.52%       | -22.62%    | 1.58%         | 0.01%  | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | -32.98%  | 1.63%       | -33.17%    | 1.70%         | 0.19%  | -0.07% |

银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 C

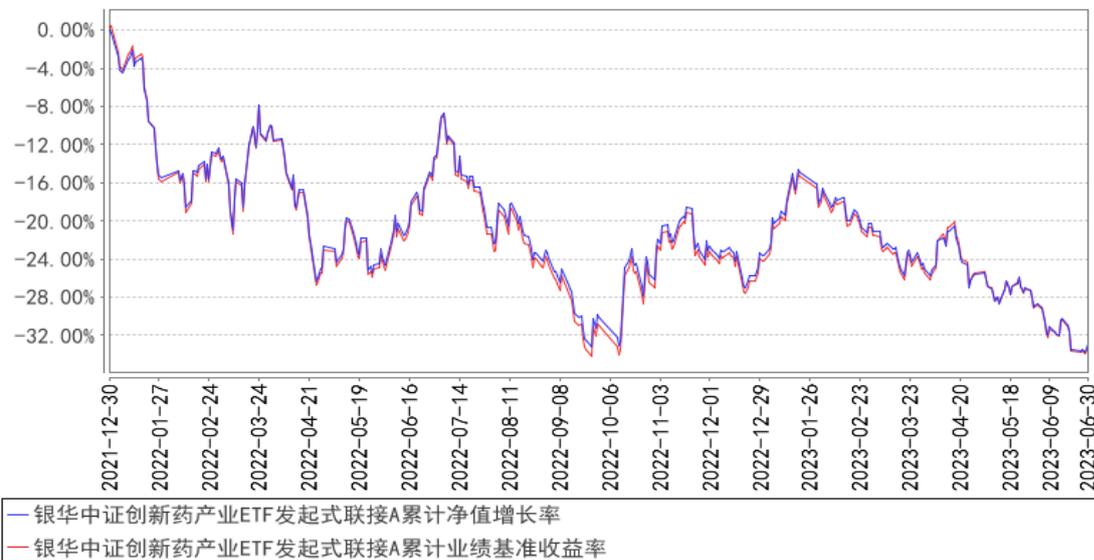
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | -5.59%   | 1.12%       | -5.69%     | 1.14%         | 0.10%  | -0.02% |
| 过去三个月      | -10.64%  | 1.19%       | -10.39%    | 1.27%         | -0.25% | -0.08% |
| 过去六个月      | -12.37%  | 1.20%       | -11.91%    | 1.26%         | -0.46% | -0.06% |
| 过去一年       | -22.69%  | 1.52%       | -22.62%    | 1.58%         | -0.07% | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | -33.08%  | 1.63%       | -33.17%    | 1.70%         | 0.09%  | -0.07% |

注：本基金的业绩比较基准为：中证创新药产业指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%

中证创新药产业指数由中证指数有限公司发布。中证创新药产业指数选取主营业务涉及创新药研发的上市公司作为待选样本，按照市值排序选取不超过 50 家最具代表性公司作为样本股，反映创新药产业上市公司的整体表现，为投资者提供新的投资标的。本基金是以中证创新药产业指数为标的指数的 ETF 联接基金，以银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金为本基金的目标 ETF，投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，具有与目标 ETF 相似的投资目标，选用以上指数作为本基金的业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。

### 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

**银华中证创新药产业ETF发起式联接A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



**银华中证创新药产业ETF发起式联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，每个交易日日终在扣除股指期货合约，股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金，存出保证金和应收申购款等。本基金可以根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2.222 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 44.10%，第一创业证券股份有限公司 26.10%，东北证券股份有限公司 18.90%，山西海鑫实业有限公司 0.90%，珠海银华聚义投资合伙企业（有限合伙）3.57%，珠海银华致信投资合伙企业（有限合伙）3.20%，珠海银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）3.22%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。银华基金管理有限公司的法定名称已于 2016 年 8 月 9 日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人管理 188 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证  
券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优  
选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、  
银华领先策略混合型证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券  
型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数证券投资基金  
(LOF)、银华深证 100 指数证券投资基金(LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用  
双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重 90 指数证  
券投资基金(LOF)、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、  
银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)、银华交易  
型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、  
银华恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币  
市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合  
型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证  
券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、  
银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳  
利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证  
券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券  
型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混  
合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添  
益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、银华通利灵活

配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券

投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华信用精选 15 个月定期开放债券型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金、银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金、银华安盛混合型证券投资基金、银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金 (LOF)、银华华智三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华智能建造股票型发起式证券投资基金、银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华季季盈 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华顺益一年定期开放债券型证券投资基金、银华永丰债券型证券投资基金、银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华集成电路混合型证券投资基金、银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华尊颐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金、银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、银华心兴三年持有期混合型证券投资基金、银华心选一年持有期混合型证券投资基金、银华尊禧稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华全球新能源车

量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）、银华新锐成长混合型证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华鑫峰混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华数字经济股票型发起式证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金、银华核心动力精选混合型证券投资基金、银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金、银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华华利均衡优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、银华绿色低碳债券型证券投资基金、银华卓信成长精选混合型证券投资基金、银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华创新动力优选混合型证券投资基金、银华动力领航混合型证券投资基金、银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金（QDII）、银华心质混合型证券投资基金、银华顺璟 6 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华清洁能源产业混合型证券投资基金、银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

#### 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 |        |   |
| 王帅先生 | 本基金的基金经理 | 2021 年 12 月 30 日 | -    | 10.5 年 | 硕士学位。曾就职于泰康资产管理有限责任公司、工银瑞信基金管理有限公司、工银瑞信投资管理有限公司，2018 年 8 月加入银华基金，历任量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 2 月 25 日担任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 11 月 1 日至 2021 年 5 月 19 日兼任银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 6 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 日起兼任银华中证创新药产业交 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 5 月 28 日至 2023 年 4 月 12 日兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2020 年 12 月 10 日至 2022 年 6 月 20 日兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 5 日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 3 日至 2022 年 6 月 20 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2021 年 2 月 4 日起兼任银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 9 日至 2022 年 6 月 20 日兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 3 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 10 日至 2022 年 6 月 20 日兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 4 月 29 日起兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 29 日起兼任银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 10 月 26 日至 2023 年 4 月 6 日兼任银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 7 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 30 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 1 月 4 日起兼任银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 2 月 18 日至 2023 年 3 月 17 日兼任银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 30 日起兼任银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 9 月 1 日起兼任银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 11 月 24 日起兼任银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资</p> |
|--|--|--|--|--|

|       |            |                  |   |     |  |
|-------|------------|------------------|---|-----|--|
|       |            |                  |   |     | 基金基金经理，自 2022 年 12 月 29 日起兼任银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 6 月 26 日起兼任银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |
| 谭普景先生 | 本基金的基金经理助理 | 2021 年 12 月 30 日 | - | 9 年 | 学士学位。曾就职于上海携宁计算机科技有限公司、上海恒生聚源数据服务有限公司。2013 年 7 月加入银华基金，历任信息技术部开发工程师、开发主管、量化投资部量化研究员，现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。            |

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去两个季度不同时间窗内（1 日内、3 日内及 5 日内）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）和溢价率占优频率等方面进行了专项分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 5 次，原因是量化投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

## 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

2023 年上半年，经济运行经历了一次从脉冲上行到缓慢回落的过程。首先，年初的春节效应叠加疫情政策优化，使一季度经济呈现脉冲式反弹，客流、消费都迎来了大幅度同比上升；而进入四月后，伴随着上述两大效应进入尾声，外需偏弱、地产投资向下等经济周期性因素逐步显现，经济运行从高位开始逐步回落。海外方面，美联储以加息压制通胀的过程仍在持续，这种弱外需状态在全球各个出口型经济体数据上都有体现。在上述因素的作用下，A 股市场主要指数在上半年呈现冲高回落，明显分化的状态。

在报告期内，我们运用自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件，将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 A 基金份额净值为 0.6702 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.32%；截至本报告期末银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 C 基金份额净值为 0.6692 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.37%；业绩比较基准收益率为-11.91%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。

## 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 2023 年下半年，经济的运行自有其内在规律，上半年的经济整体运行状态，包括脉冲回落与行业分化，都是后疫情时代的正常现象，是经济自身周期的体现。我们仍然认为，从经济场景的恢复，到经济活动的扩展，再到收入水平的提升，都将是一个缓慢但可持续的过程。未来一段时期，国内政策、外需出口、海外地缘冲突等指标将是新的边际影响变量，我们也将对此进行持续的观察。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常

估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

#### 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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情形的时间范围为2021年12月30日至2023年4月25日。由于本基金属于发起式基金，无需向中国证监会报告并提出解决方案。

## § 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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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 | 上年度末 |
|----|-----|-----|------|
|----|-----|-----|------|

|               |            | 2023年6月30日                | 2022年12月31日                 |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                           |                             |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 3,678,046.54              | 966,745.00                  |
| 结算备付金         |            | 41,776.86                 | 10,734.29                   |
| 存出保证金         |            | 34,502.44                 | 7,603.35                    |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 52,072,352.74             | 13,935,896.40               |
| 其中：股票投资       |            | -                         | -                           |
| 基金投资          |            | 52,072,352.74             | 13,915,678.81               |
| 债券投资          |            | -                         | 20,217.59                   |
| 资产支持证券投资      |            | -                         | -                           |
| 贵金属投资         |            | -                         | -                           |
| 其他投资          |            | -                         | -                           |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                         | -                           |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | -                         | -                           |
| 其中：债券投资       |            | -                         | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                         | -                           |
| 其他投资          |            | -                         | -                           |
| 其他债权投资        | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                         | -                           |
| 应收清算款         |            | -                         | 203,299.79                  |
| 应收股利          |            | -                         | -                           |
| 应收申购款         |            | 366,440.69                | 28,004.90                   |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         | -                           |
| 资产总计          |            | 56,193,119.27             | 15,152,283.73               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>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         |            | 245,444.01                | -                           |
| 应付赎回款         |            | 572,608.80                | 373,224.16                  |
| 应付管理人报酬       |            | 1,352.67                  | 379.96                      |
| 应付托管费         |            | 135.32                    | 38.04                       |
| 应付销售服务费       |            | 3,482.90                  | 499.31                      |
| 应付投资顾问费       |            | -                         | -                           |
| 应交税费          |            | -                         | -                           |
| 应付利润          |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                         | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 74,796.69                 | 50,000.47                   |

|             |          |                |               |
|-------------|----------|----------------|---------------|
| 负债合计        |          | 897,820.39     | 424,141.94    |
| <b>净资产：</b> |          |                |               |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 82,600,717.54  | 19,274,771.05 |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -              | -             |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | -27,305,418.66 | -4,546,629.26 |
| 净资产合计       |          | 55,295,298.88  | 14,728,141.79 |
| 负债和净资产总计    |          | 56,193,119.27  | 15,152,283.73 |

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额总额82,600,717.54份，其中银华中证创新药产业ETF发起式联接A基金份额总额17,598,460.04份，基金份额净值0.6702元。银华中证创新药产业ETF发起式联接C基金份额总额65,002,257.50份，基金份额净值0.6692元。

## 6.2 利润表

会计主体：银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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<br>2023年1月1日至2023<br>年6月30日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022<br>年6月30日 |
|-----------------------|----------|--------------------------------|-------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>        |          | -7,536,933.94                  | -1,723,863.18                       |
| 1. 利息收入               |          | 9,574.49                       | 4,089.95                            |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.13 | 9,574.49                       | 4,089.95                            |
| 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）     |          | -223,703.62                    | -242,203.52                         |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.14 | -                              | -                                   |
| 基金投资收益                | 6.4.7.15 | -223,591.63                    | -242,318.83                         |
| 债券投资收益                | 6.4.7.16 | -111.99                        | 115.31                              |
| 资产支持证券投资              | 6.4.7.17 | -                              | -                                   |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.18 | -                              | -                                   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.19 | -                              | -                                   |
| 股利收益                  | 6.4.7.20 | -                              | -                                   |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 |          | -                              | -                                   |
| 其他投资收益                |          | -                              | -                                   |

|                            |            |               |               |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.21   | -7,338,149.25 | -1,490,450.45 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -             | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.22   | 15,344.44     | 4,700.84      |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 41,751.84     | 28,435.46     |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 5,450.22      | 2,157.57      |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 545.04        | 215.81        |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 10,857.39     | 1,178.89      |
| 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                  | 6.4.7.23   | -             | -             |
| 7. 税金及附加                   |            | -             | -             |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.24   | 24,899.19     | 24,883.19     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -7,578,685.78 | -1,752,298.64 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -7,578,685.78 | -1,752,298.64 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -7,578,685.78 | -1,752,298.64 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |        |                |               |
|-----------------|----------------------------|--------|----------------|---------------|
|                 | 实收基金                       | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 19,274,771.05              | -      | -4,546,629.26  | 14,728,141.79 |
| 加：会计政策变更        | -                          | -      | -              | -             |
| 前期差错更正          | -                          | -      | -              | -             |
| 其他              | -                          | -      | -              | -             |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 19,274,771.05              | -      | -4,546,629.26  | 14,728,141.79 |
| 三、本期增减变         | 63,325,946.49              | -      | -22,758,789.40 | 40,567,157.09 |

|  |                                 |        |                |                |
|--|---------------------------------|--------|----------------|----------------|
| 动额(减少以“-”号填列)                            |                                 |        |                |                |
| (一)、综合收益总额                               | -                               | -      | -7,578,685.78  | -7,578,685.78  |
| (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)      | 63,325,946.49                   | -      | -15,180,103.62 | 48,145,842.87  |
| 其中:1.基金申购款                               | 104,753,428.61                  | -      | -26,107,053.10 | 78,646,375.51  |
| 2.基金赎回款                                  | -41,427,482.12                  | -      | 10,926,949.48  | -30,500,532.64 |
| (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)、其他综合收益结转留存收益                         | -                               | -      | -              | -              |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 82,600,717.54                   | -      | -27,305,418.66 | 55,295,298.88  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |        |                |                |
|  | 实收基金                            | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                          | 12,472,598.20                   | -      | -29,178.87     | 12,443,419.33  |
| 加:会计政策变更                                 | -                               | -      | -              | -              |
| 前期差错更正                                   | -                               | -      | -              | -              |
| 其他                                       | -                               | -      | -              | -              |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                          | 12,472,598.20                   | -      | -29,178.87     | 12,443,419.33  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 2,501,508.80                    | -      | -1,978,303.08  | 523,205.72     |
| (一)、综合收益总额                               | -                               | -      | -1,752,298.64  | -1,752,298.64  |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数                   | 2,501,508.80                    | -      | -226,004.44    | 2,275,504.36   |

|  |               |   |               |               |
|--|---------------|---|---------------|---------------|
| (净值减少以“-”号填列)                            |               |   |               |               |
| 其中：1. 基金申购款                              | 8,381,934.33  | - | -1,251,939.62 | 7,129,994.71  |
| 2. 基金赎回款                                 | -5,880,425.53 | - | 1,025,935.18  | -4,854,490.35 |
| (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)、其他综合收益结转留存收益                         | -             | - | -             | -             |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 14,974,107.00 | - | -2,007,481.95 | 12,966,625.05 |

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：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1889号《关于准予银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》和证监许可[2021]3821号《关于准予银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金变更注册的批复》注册,由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币12,471,820.27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1303号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》于2021年12月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为12,472,598.20份基金份额,其中认购资金利息折合777.93份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限

公司，基金托管人为上海银行股份有限公司(以下简称“上海银行”)。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,666.73 基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》，本基金根据所收取的认购/申购费用与销售服务费用方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

本基金为银华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“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证创新药产业指数紧密跟踪的被动指数基金，本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》的有关规定，本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包括主板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券资产(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换公司债券、分离交易可转债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、政府支持机构债券、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券等)、银行存款(包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款)、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、衍生工具(股指期货、股票期权)以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金业绩比较基准为：中证创新药产业指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和中国证监会、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

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产

品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(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<br>2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 3,678,046.54           |
| 等于：本金          | 3,677,322.15           |
| 加：应计利息         | 724.39                 |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |

|        |              |
|--------|--------------|
| 加：应计利息 | -            |
| 减：坏账准备 | -            |
| 合计     | 3,678,046.54 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2023年6月30日 |      |               |               |
|-------------------|-------------------|------|---------------|---------------|
|                   | 成本                | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票                | -                 | -    | -             | -             |
| 贵金属投资-金交所<br>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                | 61,632,770.13     | -    | 52,072,352.74 | -9,560,417.39 |
| 其他                | -                 | -    | -             | -             |
| 合计                | 61,632,770.13     | -    | 52,072,352.74 | -9,560,417.39 |

#### 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

注：无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

注：无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 1.50              |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | -                 |
| 其中：交易所市场    | -                 |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 74,795.19         |
| 合计          | 74,796.69         |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 A

| 项目            | 本期<br>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          | 12,429,485.13              | 12,429,485.13 |
| 本期申购          | 6,998,787.80               | 6,998,787.80  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,829,812.89              | -1,829,812.89 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                          | -             |

|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 基金拆分/份额折算调整   | -             | -             |
| 本期申购          | -             | -             |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -             | -             |
| 本期末           | 17,598,460.04 | 17,598,460.04 |

## 银华中证创新药产业ETF发起式联接C

| 项目            | 本期<br>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          | 6,845,285.92               | 6,845,285.92   |
| 本期申购          | 97,754,640.81              | 97,754,640.81  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -39,597,669.23             | -39,597,669.23 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                          | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                          | -              |
| 本期申购          | -                          | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                          | -              |
| 本期末           | 65,002,257.50              | 65,002,257.50  |

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 银华中证创新药产业ETF发起式联接A

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | -1,053,543.44 | -1,875,212.22 | -2,928,755.66 |
| 本期利润           | -91,625.10    | -1,524,938.01 | -1,616,563.11 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -464,735.78   | -794,310.33   | -1,259,046.11 |
| 其中：基金申购款       | -629,618.76   | -1,082,498.06 | -1,712,116.82 |
| 基金赎回款          | 164,882.98    | 288,187.73    | 453,070.71    |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | -1,609,904.32 | -4,194,460.56 | -5,804,364.88 |

## 银华中证创新药产业ETF发起式联接C

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | -585,007.98   | -1,032,865.62  | -1,617,873.60  |
| 本期利润           | -148,911.43   | -5,813,211.24  | -5,962,122.67  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -5,281,259.76 | -8,639,797.75  | -13,921,057.51 |
| 其中：基金申购款       | -8,886,311.18 | -15,508,625.10 | -24,394,936.28 |
| 基金赎回款          | 3,605,051.42  | 6,868,827.35   | 10,473,878.77  |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -              |
| 本期末            | -6,015,179.17 | -15,485,874.61 | -21,501,053.78 |

## 6.4.7.13 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  | 8,981.19             |
| 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 | 467.12               |
| 其他        | 126.18               |
| 合计        | 9,574.49             |

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

注：无。

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

## 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目                | 本期                   |
|-------------------|----------------------|
|                   | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出/赎回基金成交总额       | 2,169,786.17         |
| 减：卖出/赎回基金成本总额     | 2,391,375.53         |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | -                    |
| 减：交易费用            | 2,002.27             |
| 基金投资收益            | -223,591.63          |

## 6.4.7.16 债券投资收益

## 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目           | 本期                   |
|--------------|----------------------|
|              | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 198.41               |

|                              |         |
|------------------------------|---------|
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -310.40 |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -       |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -       |
| 合计                           | -111.99 |

#### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 20,339.07            |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 20,310.40            |
| 减：应计利息总额               | 339.07               |
| 减：交易费用                 | -                    |
| 买卖债券差价收入               | -310.40              |

#### 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

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

注：无。

##### 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

**6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.19 衍生工具收益****6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.20 股利收益**

注：无。

**6.4.7.21 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             | -7,338,149.25        |
| 股票投资                   | -                    |
| 债券投资                   | 234.40               |
| 资产支持证券投资               | -                    |
| 基金投资                   | -7,338,383.65        |
| 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                     | -7,338,149.25        |

**6.4.7.22 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 | 14,657.62            |
| 基金转换费收入 | 686.82               |
| 合计      | 15,344.44            |

**6.4.7.23 信用减值损失**

注：无。

## 6.4.7.24 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    | 24,795.19            |
| 信息披露费   | -                    |
| 证券出借违约金 | -                    |
| 银行费用    | 104.00               |
| 合计      | 24,899.19            |

## 6.4.7.25 分部报告

无。

## 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

无。

## 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        |
|----------------------------------|----------------|
| 西南证券股份有限公司（“西南证券”）               | 基金管理人股东、基金代销机构 |
| 东北证券股份有限公司（“东北证券”）               | 基金管理人股东、基金代销机构 |
| 银华基金管理股份有限公司                     | 基金管理人、基金销售机构   |
| 上海银行股份有限公司（“上海银行”）               | 基金托管人          |
| 银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金（“目标ETF”） | 基金管理人管理的其他基金   |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期                   | 上年度可比期间              |
|-------|----------------------|----------------------|
|       | 2023年1月1日至2023年6月30日 | 2022年1月1日至2022年6月30日 |

|      | 成交金额 | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额      | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) |
|------|------|-------------------------|-----------|-------------------------|
| 西南证券 | -    | -                       | 20,310.40 | 100.00                  |

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                         |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期基金<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期基金<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 西南证券  | 50,056,219.28              | 100.00                  | 4,519,041.61                    | 100.00                  |

#### 6.4.10.1.5 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间<br>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  | 5,450.22                   | 2,157.57                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 23,543.31                  | 3,180.97                        |

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值-前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管

理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 545.04                                   | 215.81  |

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.05% 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-前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方<br>名称 | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日      |                          |        |
|--------------------|--|--------------------------|--------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                          |        |
|                    | 银华中证创新药产业<br>ETF 发起式联接 A                   | 银华中证创新药产业<br>ETF 发起式联接 C | 合计     |
| 东北证券               | -  | 19.00                    | 19.00  |
| 西南证券               | -  | 1.81                     | 1.81   |
| 银华基金管理股份有限公司       | -  | 889.66                   | 889.66 |
| 合计                 | -  | 910.47                   | 910.47 |
| 获得销售服务费的各关联方       | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |                          |        |

| 名称           | 当期发生的基金应支付的销售服务费         |                          |       |
|--------------|--------------------------|--------------------------|-------|
|              | 银华中证创新药产业<br>ETF 发起式联接 A | 银华中证创新药产业<br>ETF 发起式联接 C | 合计    |
| 银华基金管理股份有限公司 | -                        | 20.74                    | 20.74 |
| 合计           | -                        | 20.74                    | 20.74 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性付给基金管理人，由基金管理人代付给各个基金销售机构，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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

注：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

注：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

份额单位：份

| 项目                               | 本期                              | 本期                              |
|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                                  | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|                                  | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 A           | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 C           |
| 基金合同生效日(2021 年 12 月 30 日)持有的基金份额 | -                               | -                               |

|                             |                                 |                                 |
|-----------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| 报告期初持有的基金份额                 | 10,000,666.73                   | -                               |
| 报告期内申购/买入总份额                | -                               | -                               |
| 报告期内因拆分变动份额                 | -                               | -                               |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额              | -                               | -                               |
| 报告期末持有的基金份额                 | 10,000,666.73                   | -                               |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例         | 56.83%                          | -                               |
| 项目                          | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|                             | 银华中证创新药产业ETF发起式联接A              | 银华中证创新药产业ETF发起式联接C              |
| 基金合同生效日(2021年12月30日)持有的基金份额 | 10,000,666.73                   | -                               |
| 报告期初持有的基金份额                 | 10,000,666.73                   | -                               |
| 报告期内申购/买入总份额                | -                               | -                               |
| 报告期内因拆分变动份额                 | -                               | -                               |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额              | -                               | -                               |
| 报告期末持有的基金份额                 | 10,000,666.73                   | -                               |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例         | 88.36%                          | -                               |

注：1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2、对于分级基金，下属分级份额的比例的分母采用各自级别的份额。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

#### 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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |          | 上年度可比期间<br>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   |
| 上海银行  | 3,678,046.54               | 8,981.19 | 1,227,173.36                    | 3,867.15 |

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按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

注：无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本期末，本基金持有 63,425,521.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 0.67%。上年末，本基金持有 14,846,558.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 0.34%。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 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

注：无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

##### 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

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可按合同要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，使得本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资品种符合合同规定，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                | 3,678,046.54 | -    | -    | -             | 3,678,046.54  |
| 结算备付金               | 41,776.86    | -    | -    | -             | 41,776.86     |
| 存出保证金               | 34,502.44    | -    | -    | -             | 34,502.44     |
| 交易性金融资产             | -            | -    | -    | 52,072,352.74 | 52,072,352.74 |
| 应收申购款               | -            | -    | -    | 366,440.69    | 366,440.69    |
| 资产总计                | 3,754,325.84 | -    | -    | 52,438,793.43 | 56,193,119.27 |
| 负债                  |              |      |      |               |               |
| 应付赎回款               | -            | -    | -    | 572,608.80    | 572,608.80    |
| 应付管理人报酬             | -            | -    | -    | 1,352.67      | 1,352.67      |
| 应付托管费               | -            | -    | -    | 135.32        | 135.32        |
| 应付清算款               | -            | -    | -    | 245,444.01    | 245,444.01    |
| 应付销售服务费             | -            | -    | -    | 3,482.90      | 3,482.90      |
| 其他负债                | -            | -    | -    | 74,796.69     | 74,796.69     |
| 负债总计                | -            | -    | -    | 897,820.39    | 897,820.39    |
| 利率敏感度缺口             | 3,754,325.84 | -    | -    | 51,540,973.04 | 55,295,298.88 |
| 上年度末<br>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                | 966,745.00   | -    | -    | -             | 966,745.00    |
| 结算备付金               | 10,734.29    | -    | -    | -             | 10,734.29     |
| 存出保证金               | 7,603.35     | -    | -    | -             | 7,603.35      |
| 交易性金融资产             | 20,217.59    | -    | -    | 13,915,678.81 | 13,935,896.40 |
| 应收申购款               | -            | -    | -    | 28,004.90     | 28,004.90     |
| 应收清算款               | -            | -    | -    | 203,299.79    | 203,299.79    |
| 资产总计                | 1,005,300.23 | -    | -    | 14,146,983.50 | 15,152,283.73 |
| 负债                  |              |      |      |               |               |
| 应付赎回款               | -            | -    | -    | 373,224.16    | 373,224.16    |
| 应付管理人报酬             | -            | -    | -    | 379.96        | 379.96        |
| 应付托管费               | -            | -    | -    | 38.04         | 38.04         |
| 应付销售服务费             | -            | -    | -    | 499.31        | 499.31        |

|         |              |   |   |               |               |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 其他负债    | -            | - | - | 50,000.47     | 50,000.47     |
| 负债总计    | -            | - | - | 424,141.94    | 424,141.94    |
| 利率敏感度缺口 | 1,005,300.23 | - | - | 13,722,841.56 | 14,728,141.79 |

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

注：基金本期末（上期末）持有的资产占基金净资产的比例不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险包含单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，以及市场价格变化或波动所引起的股票、债券和基金等各类资产损失的可能性。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 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<br>2023年6月30日 |                  | 上年度末<br>2022年12月31日 |                  |
|---------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | -                 | -                | -                   | -                |
| 交易性金融资产—基金投资  | 52,072,352.74     | 94.17            | 13,915,678.81       | 94.48            |
| 交易性金融资产—债券投资  | -                 | -                | 20,217.59           | 0.14             |
| 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 | 52,072,352.74 | 94.17 | 13,935,896.40 | 94.62 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |  |                             |                   |
|----|--|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；                        |                             |                   |
|    | 用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；           |                             |                   |
|    | Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。 |                             |                   |
| 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） |
|    | 业绩比较基准上升 5%                                      | 564,586.35                  | 455,590.06        |
|    | 业绩比较基准下降 5%                                      | -564,586.35                 | -455,590.06       |

#### 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<br>2023年6月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 52,072,352.74     | 13,915,678.81       |
| 第二层次          | -                 | 20,217.59           |

|      |               |               |
|------|---------------|---------------|
| 第三层次 | -             | -             |
| 合计   | 52,072,352.74 | 13,935,896.40 |

#### 6.4.14.2.2 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股票和债券，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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均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

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -             | -             |
|    | 其中：股票             | -             | -             |
| 2  | 基金投资              | 52,072,352.74 | 92.67         |
| 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      | 3,719,823.40  | 6.62          |
| 8  | 其他各项资产            | 400,943.13    | 0.71          |

|   |    |               |        |
|---|----|---------------|--------|
| 9 | 合计 | 56,193,119.27 | 100.00 |
|---|----|---------------|--------|

## 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 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

注：本基金本报告期内未买入股票。

### 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

注：本基金本报告期内未卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称       | 基金类型 | 运作方式        | 管理人          | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------|------|-------------|--------------|---------------|---------------|
| 1  | 银华中证创新药产业交 | 股票型  | 交易型开放式(ETF) | 银华基金管理股份有限公司 | 52,072,352.74 | 94.17         |

|  |                       |  |  |    |  |  |
|--|-----------------------|--|--|----|--|--|
|  | 易型开放式<br>指数证券投资<br>基金 |  |  | 公司 |  |  |
|--|-----------------------|--|--|----|--|--|

### 7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在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。

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

本基金本报告期末未持有股票，因此本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

#### 7.13.3 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 | 34,502.44  |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 366,440.69 |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 400,943.13 |

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.13.6 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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 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

| 份额级别                  | 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 (%) |
| 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 A | 897       | 19,619.24 | 10,252,901.27 | 58.26      | 7,345,558.77  | 41.74      |
| 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 C | 6,364     | 10,214.06 | 3,967,729.13  | 6.10       | 61,034,528.37 | 93.90      |
| 合计                    | 7,261     | 11,375.94 | 14,220,630.40 | 17.22      | 68,380,087.14 | 82.78      |

注：对于分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算当中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别                  | 持有份额总数 (份)   | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|-----------------------|--------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 A | 531,147.90   | 3.02         |
|                  | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 C | 533,545.47   | 0.82         |
|                  | 合计                    | 1,064,693.37 | 1.29         |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别                  | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|-----------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 A | 10~50              |
|                                | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 C | -                  |

|                 |                       |       |
|-----------------|-----------------------|-------|
|                 | 合计                    | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 A | 0~10  |
|                 | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 C | -     |
|                 | 合计                    | 0~10  |

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|------------------|---------------|------------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,666.73 | 12.11            | 10,000,666.73 | 12.11            | 3年         |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -                | -             | -                | -          |
| 基金经理等人员     | -             | -                | -             | -                | -          |
| 基金管理人股东     | -             | -                | -             | -                | -          |
| 其他          | -             | -                | -             | -                | -          |
| 合计          | 10,000,666.73 | 12.11            | 10,000,666.73 | 12.11            | 3年         |

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                         | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 A | 银华中证创新药产业 ETF 发起式联接 C |
|----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 基金合同生效日（2021年12月30日）基金份额总额 | 10,252,645.51         | 2,219,952.69          |
| 本报告期期初基金份额总额               | 12,429,485.13         | 6,845,285.92          |
| 本报告期基金总申购份额                | 6,998,787.80          | 97,754,640.81         |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 1,829,812.89          | 39,597,669.23         |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                     | -                     |
| 本报告期期末基金份额总额               | 17,598,460.04         | 65,002,257.50         |

注：如有相应情况，总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2023 年 3 月，项寅同志担任上海银行股份有限公司资产托管部副总经理职务，上述人事变动已进行备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、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，基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

### 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

注：本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 华创证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 华泰证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 西南证券 | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 招商证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中信建投 | 4 | - | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|---|

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

### 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 |                  | 基金交易          |                  |
|------|------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|---------------|------------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) | 成交金额          | 占当期基金成交总额的比例 (%) |
| 华创证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | -             | -                |
| 华泰证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | -             | -                |
| 西南证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | 50,056,219.28 | 100.00           |
| 招商证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | -             | -                |
| 中信建投 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | -             | -                |

### 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  | 《银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金2022年第4季度报告》 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023年1月20日 |
| 2  | 《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金2022年第4季度报告提示性公告》        | 四大证券报                   | 2023年1月20日 |
| 3  | 《银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金2022年年度报告》   | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023年3月31日 |
| 4  | 《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金2022年年度报告提示性公告》          | 四大证券报                   | 2023年3月31日 |
| 5  | 《银华中证创新药产业交易型开放式                            | 本基金管理人网站, 中             | 2023年4月20日 |

|   |  |                   |                 |
|---|--|-------------------|-----------------|
|   | 指数证券投资基金发起式联接基金<br>2023 年第 1 季度报告》               | 中国证监会基金电子披露<br>网站 |                 |
| 6 | 《银华基金管理股份有限公司旗下部<br>分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公<br>告》 | 四大证券报             | 2023 年 4 月 20 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者<br>类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                     |                   |          |          | 报告期末持有基金情况    |                 |
|-----------|----------------|-------------------------------------|-------------------|----------|----------|---------------|-----------------|
|           | 序号             | 持有基金份额<br>比例达到或者<br>超过 20%的时<br>间区间 | 期初<br>份额          | 申购<br>份额 | 赎回<br>份额 | 持有份额          | 份额<br>占比<br>(%) |
| 机构        | 1              | 20230101-202<br>30413               | 10,000,66<br>6.73 | 0.00     | 0.00     | 10,000,666.73 | 12.11           |

#### 产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

### 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 银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金募集申请获中

国证监会注册的文件

12.1.2 《银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》

12.1.3 《银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》

12.1.4 《银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》

12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

## 12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

## 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.yhfund.com.cn](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2023 年 8 月 29 日