

# 前海开源中证健康产业指数型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：国信证券股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 31 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。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 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	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
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	12
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 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的真实、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	38
7.1	期末基金资产组合情况	38
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
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	45
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	45
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	45
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	45
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	45
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46

7.12	投资组合报告附注 .....	46
§ 8	基金份额持有人信息 .....	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
§ 9	开放式基金份额变动 .....	47
§ 10	重大事件揭示 .....	48
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4	基金投资策略的改变 .....	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8	其他重大事件 .....	49
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	50
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
§ 12	备查文件目录 .....	51
12.1	备查文件目录 .....	51
12.2	存放地点 .....	51
12.3	查阅方式 .....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源中证健康产业指数型证券投资基金
基金简称	前海开源中证健康指数
场内简称	中证健康
基金主代码	164401
基金运作方式	契约型普通开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 18 日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	国信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	79,821,879.68 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金紧密跟踪标的指数——中证健康产业指数，通过严谨数量化管理和投资纪律约束，力争保持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不超过【0.35%】，年跟踪误差不超过【4%】。
投资策略	<p>本基金采用动态复制标的指数的投资方法，参照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。</p> <p>当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>本基金力争份额净值增长率与同期业绩比较基准的增长率之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>为实现跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值的 90%的比例投资于标的指数成份股及其备选成份股，并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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p> <p>本基金在建仓期内，将参照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，</p>

	<p>以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时,本基金可以根据市场情况,结合研究分析,对基金财产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。</p> <p>(2) 股票投资组合的调整</p> <p>本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化,对其进行适时调整,以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制,基金可能不能按照成份股权重持有成份股,基金将会采用合理方法寻求替代。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金可以根据流动性管理需要,选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择。</p>
业绩比较基准	中证健康产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,理论上其预期风险和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。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司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		前海开源基金管理有限公司	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙辰健	薛璐
	联系电话	0755-88601888	0755-22940163
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	03339@guosen.com.cn
客户服务电话		4001-666-998	0755-61897778
传真		0755-83181169	0755-22940165
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址		深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206	深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦19楼
邮政编码		518040	518000
法定代表人		李强	张纳沙

### 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.qhkyfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 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 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	-25,252,998.35
本期利润	-6,118,236.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0367
本期加权平均净值利润率	-4.11%
本期基金份额净值增长率	-6.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	21,676,006.32
期末可供分配基金份额利润	0.2716
期末基金资产净值	65,575,613.78
期末基金份额净值	0.8215
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-22.72%

注：①上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

### 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	-1.27%	0.78%	-1.58%	0.77%	0.31%	0.01%

过去三个月	-7.36%	0.71%	-7.93%	0.71%	0.57%	0.00%
过去六个月	-6.68%	0.73%	-7.32%	0.73%	0.64%	0.00%
过去一年	-15.88%	0.97%	-17.08%	0.98%	1.20%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-22.72%	1.11%	-28.95%	1.12%	6.23%	-0.01%

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



注：2020年12月18日（含当日）起，本基金转型为“前海开源中证健康产业指数型证券投资基金”。

## § 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

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于2012年12月27日经中国证监会批准，2013年1月23日注册成立，截至报告期末，注册资本为2亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海、广州设立分公司。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司——前海开源资产管理有限公司已于2013年9月5日在深圳市注册成立，并于2013年9月18日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》，截至报告期末，注册资本为1.8亿元人民币。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理 97 只开放式基金，资产管理规模超过 1121 亿元。

#### 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		
梁溥森	本基金的基金经理	2020 年 12 月 18 日	-	9 年	梁溥森先生，金融学硕士。曾任职于招商基金基金核算部，2015 年 6 月加入前海开源基金，历任交易员、研究员，现任公司基金经理。

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，“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的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 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。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的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没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

## 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

疫情干扰消退后的第一年辗转过半，在前期积压需求释放、政策性力量支撑和低基数效应的共同作用下，中国宏观经济呈现出了“触底反弹”的运行特征，但总体来说仍然是“在曲折中前进”。在整体恢复的主基调下，部分经济数据出现了来回拉扯，尤其是二季度受经济动能下降、数据挤水分等原因影响，经济数据弱于市场预期。此外，两会、央行货币政策例会以及4月的政治局会议对经济的表述均较为乐观，在政策方面也有较强的定力，这使得投资者对于政策强刺激的预期逐渐落空，市场进入了“弱预期、弱现实”的状态。在缺乏基本面支撑的情况下，市场炒作呈现出了“存量资金博弈+主题投资”的状态。叠加美国经济的韧性较强而通胀降温的节奏有所反复，美联储年内不降息的信心日益增强，激进的紧缩货币政策加剧了中国资本市场波动的风险。多重因素叠加下，中证健康产业指数上半年下跌7.71%，本基金下跌6.68%，相对于业绩比较基准取得了一定的超额收益。站在当前时点，我们判断，市场已较充分计价经济基本面的复苏压力并且对刺激政策的预期同样悲观。随着美联储加息步伐的减缓，人民币汇率的企稳，中国资产性价比逐渐凸显。此外，从估值来看，A股投资性价比较高，截止2023年6月30日，中证健康产业指数PE(TTM)约为27.02倍，仅处于指数发布以来6.47%的历史分位值，估值相对较低，且其相对于十年期国债的风险溢价约为1.07%，相对吸引力比历史上99.57%的时期更高。投资的机会和风险，不仅取决于我们挑选的投资标的，与我们买入的价格也是息息相关的，当前中证健康产业指数的投资性价比依然较高。当然，也会有部分投资者认为当前经济形势仍不乐观，复苏节奏不及预期等等。但正如西格尔教授在《股市长线法宝》一书中所言“如果一个投资者要等到经济周期触底时才调整投资策略，他将错过大好的投资机会”。因此，与其花费大量的精力预测（难以准确预测的）经济周期何时见底，获得超额收益的最佳途径仍然是以明显低于历史估值的价格买入股票。

作为一个被动指数基金，本基金将依然遵循一贯的投资逻辑，力争实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益，并通过参与新股申购、转债套利等方式获得超额收益。本基金将持续关注成份股的基本面变化情况，通过监控成份股负面信息及其影响，在不影响本基金投资运作的情况下及时对“地雷股”进行出清，并力争通过多种方式对基金业绩进行一定的增厚，积跬步以致千里，力争在紧密跟踪业绩比较基准并追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的同时，能够为持有人贡献一定的业绩正偏离。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源中证健康指数基金份额净值为0.8215元，本报告期内，基金份额净值增

长率为-6.68%，同期业绩比较基准收益率为-7.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，在前期积压需求释放、政策性力量支撑和低基数效应的共同作用下，中国宏观经济呈现出“触底反弹”的运行特征。“重启效应”使得中国经济的需求面和供给面均得到明显改善。在供给端，受疫情影响较为严重的服务业加快反弹，1-5 月份服务业生产指数较 2022 年增速大幅回升；工业保持平稳增长，制造业增加值逆转了去年四季度开始的加速下滑态势。在需求端，受抑制的消费和投资需求得到了较为充分地释放。1-5 月份社零总额同比增长 9.3%，尤其是受疫情防控直接影响的领域反弹幅度较大。在基建投资保持高位和房地产投资跌幅缩小的共同支撑下，固定资产投资增速出现了企稳。出口方面，一方面全球经济增速放缓导致外需收缩，另一方面全球产业链供应链修复下供给能力提升，两方面因素叠加导致中国出口增速出现明显下滑，以美元计价，5 月份出口同比下降 7.5%，出口压力明显增加。总体而言，上半年中国宏观经济恢复性增长势头强劲，需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力得到了不同程度的缓解，但疤痕效应之下，需求不旺和预期低迷问题存在，同时社融-M2 增速差、M1-M2 增速差持续保持较大的负向缺口等种种现象显示出市场主体对未来的悲观预期，经济增长的内生动力仍然有待提振。

考虑到大宗商品价格转入下行通道的成本效应，中国通胀水平保持低位使得货币政策仍具有较大空间。后续，宏观经济政策如能继续发力，成功扭转企业生产性投资、居民消费支出的保守化倾向，并提高货币政策的传导效率，中国经济的产出缺口有望在下半年进一步缩小，就业压力也将得到一定程度的缓解，居民收入和企业绩效有望逐步改善，家庭和企业资产负债表逐步修复，带动信心和预期的改善，共同推进形成经济复苏发展的内生动力。

此外，随着美联储加息步伐的减缓，人民币汇率的企稳，中国资产性价比逐渐凸显。当前 A 股各主流指数仍然处于较低的估值水平，伴随着经济复苏的明朗以及风险偏好的修复，A 股有望迎来估值修复，后续无需悲观。

#### 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。估值委员会主席由总经理办公会指定，估值委员会成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的基金行业实践经

验。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种和流通受限股票的估值相关数据。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，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

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“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的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查。

### 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

托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、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：前海开源中证健康产业指数型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 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	1,956,586.43	2,032,038.05
结算备付金		7,622.53	4,326.69
存出保证金		75,498.82	44,470.99
交易性金融资产	6.4.7.2	64,558,706.11	186,970,091.57
其中：股票投资		62,030,724.60	178,284,829.57
基金投资		-	-
债券投资		2,527,981.51	8,685,262.00
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		20,336.01	193,364.06
应收股利		-	-
应收申购款		28,017.33	18,256.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		66,646,767.23	189,262,548.10
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06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		-	-
应付赎回款		733,976.01	10,247.52
应付管理人报酬		70,650.02	161,788.40
应付托管费		14,130.01	32,357.70
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	252,397.41	256,246.45
负债合计		1,071,153.45	460,640.85
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	43,899,607.46	117,957,117.02
未分配利润	6.4.7.8	21,676,006.32	70,844,790.23
净资产合计		65,575,613.78	188,801,907.25
负债和净资产总计		66,646,767.23	189,262,548.10

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，前海开源中证健康产业指数基金份额净值 0.8215 元，基金份额总

额 79,821,879.68 份。

## 6.2 利润表

会计主体：前海开源中证健康产业指数型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-5,065,124.50	-26,779,461.87
1. 利息收入		17,569.97	22,518.16
其中：存款利息收入	6.4.7.9	17,569.97	22,518.16
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）		-24,287,356.50	-6,135,802.29
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-25,190,634.68	-7,918,779.89
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	92,407.34	234,402.41
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	810,870.84	1,548,575.19
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	19,134,761.55	-20,731,130.64
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	69,900.48	64,952.90
<b>减：二、营业总支出</b>		1,053,112.30	1,441,407.26
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	740,674.76	1,060,122.28
2. 托管费	6.4.10.2.2	148,134.97	212,024.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		0.01	0.32
8. 其他费用	6.4.7.20	164,302.56	169,260.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-6,118,236.80	-28,220,869.13
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-6,118,236.80	-28,220,869.13

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-6,118,236.80	-28,220,869.13

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：前海开源中证健康产业指数型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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）	117,957,117.02	-	70,844,790.23	188,801,907.25
二、本期期初净资产（基金净值）	117,957,117.02	-	70,844,790.23	188,801,907.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-74,057,509.56	-	-49,168,783.91	-123,226,293.47
（一）、综合收益总额	-	-	-6,118,236.80	-6,118,236.80
（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）	-74,057,509.56	-	-43,050,547.11	-117,108,056.67
其中：1. 基金申购款	3,457,735.77	-	2,063,118.10	5,520,853.87
2. 基金赎回款	-77,515,245.33	-	-45,113,665.21	-122,628,910.54
（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）	43,899,607.46	-	21,676,006.32	65,575,613.78
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 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）	172,704,917.98	-	174,556,739.57	347,261,657.55
二、本期期初净资产（基金净值）	172,704,917.98	-	174,556,739.57	347,261,657.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-53,972,928.69	-	-82,464,464.95	-136,437,393.64
（一）、综合收益总额	-	-	-28,220,869.13	-28,220,869.13
（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）	-53,972,928.69	-	-54,243,595.82	-108,216,524.51
其中：1. 基金申购款	4,702,752.20	-	3,607,509.95	8,310,262.15

2. 基金赎回款	-58,675,680.89	-	-57,851,105.77	-116,526,786.66
(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)	118,731,989.29	-	92,092,274.62	210,824,263.91

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：

秦亚峰

何璁

傅智

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

前海开源中证健康产业指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金(以下简称“前海开源健康分级基金”)转型而来。根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)[2020]1995号《关于准予前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金变更注册的批复》以及本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于2020年11月19日发布的《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，前海开源基金管理有限公司于2020年10月20日起至2020年11月16日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议通过了《关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。根据本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于2020年12月17日发布的《前海开源基金管理有限公司关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金转型后基金名称、基金简称变更的公告》及2020年12月21日发布的《前海开源基金管理有限公司关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告》，前海开源健康分级基金以2020年12月17日为基金份额转换基准日，前海开源健康A份额、前海开源健康B份额以前海开源健康分级基础份额在基金份额转换基准日日终的基金份额净值为基准，按照各自的基金份额参考净值转换成本基金基金份额的场内份额，前海开源健康分级份额之场内份额和场外份额自动转换成本基金之场内份额和场外份额。前海开源健康分级基金自2020年12月18日起转型为本基金，经与基金托管人协商一致，基金管理人将《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》修订为《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金合同》。自2020年12月18日起《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》失效，《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金合同》自同一日起生效。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司，基金托管人为国信证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证健康产业指数的成份股、备选成份股、固定收益资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、质押及买断式回购、银行存款等)、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：投资于中证健康产业指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证健康产业指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率(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》、《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的其他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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 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 2023年06月30日
活期存款	1,956,586.43
等于：本金	1,956,059.50
加：应计利息	526.93
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	1,956,586.43

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	75,840,375.72	-	62,030,724.60	-13,809,651.12	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,494,881.81	28,481.51	2,527,981.51	4,618.19
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,494,881.81	28,481.51	2,527,981.51	4,618.19
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	78,335,257.53	28,481.51	64,558,706.11	-13,805,032.93	

### 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

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

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.5 其他资产

无。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	373.64
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	77,721.21
其中：交易所市场	77,721.21
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	134,302.56
应付指数使用费	40,000.00
合计	252,397.41

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	214,477,586.77	117,957,117.02
本期申购	6,287,140.65	3,457,735.77
本期赎回（以“-”号填列）	-140,942,847.74	-77,515,245.33
本期末	79,821,879.68	43,899,607.46

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 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
本期期初	134,703,829.18	-63,859,038.95	70,844,790.23
本期利润	-25,252,998.35	19,134,761.55	-6,118,236.80
本期基金份额交易产生的变动数	-76,538,399.50	33,487,852.39	-43,050,547.11

其中：基金申购款	3,551,316.26	-1,488,198.16	2,063,118.10
基金赎回款	-80,089,715.76	34,976,050.55	-45,113,665.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,912,431.33	-11,236,425.01	21,676,006.32

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
活期存款利息收入		16,886.64
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		328.56
其他		354.77
合计		17,569.97

#### 6.4.7.10 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01月01日至2023年06月30日	
卖出股票成交总额		133,080,546.63
减：卖出股票成本总额		158,012,754.28
减：交易费用		258,427.03
买卖股票差价收入		-25,190,634.68

#### 6.4.7.11 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
债券投资收益—利息收入		59,318.20
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入		33,089.14
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		92,407.34

##### 6.4.7.12.2 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01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,789,931.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,568,482.69
减：应计利息总额	188,355.11
减：交易费用	4.20
买卖债券差价收入	33,089.14

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入

无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益—其他投资收益

无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	810,870.84
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	810,870.84

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	19,134,761.55
--股票投资	19,127,368.85
--债券投资	7,392.70
--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	19,134,761.55

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	69,647.24
转换费收入	253.24
合计	69,900.48

## 6.4.7.19 信用减值损失

无。

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	80,000.00
合计	164,302.56

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

无。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、基金销售机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金托管人、基金销售机构

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

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	740,674.76	1,060,122.28

其中：支付销售机构的客户维护费	94,267.87	100,054.22
-----------------	-----------	------------

注：支付基金管理人前海开源基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	148,134.97	212,024.51

注：支付基金托管人国信证券的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

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

无。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末 2023 年 06 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
001282	三联锻造	2023年05月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	34	949.62	1,123.02	-
001286	陕西能源	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	173	2,055.24	3,636.46	-
001324	长青科技	2023年05月12日	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	51	962.88	999.60	-
001328	登康口腔	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	59	1,220.12	1,503.91	-
001367	海森药业	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	26	1,156.48	1,026.48	-

001380	华纬科技	2023年05月09日	6个月	新股流通受限	28.84	30.78	57	1,643.88	1,754.46	-
301141	中科磁业	2023年03月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	129	5,314.80	5,507.01	-
301157	华塑科技	2023年03月01日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	99	5,593.50	5,240.07	-
301246	宏源药业	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	205	10,250.00	6,295.55	-
301260	格力博	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	405	12,494.25	9,570.15	-
301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	31.51	25.10	143	4,506.36	3,589.30	-
301293	三博脑科	2023年04月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	133	3,936.80	9,498.86	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	1,591	7,955.00	14,255.36	-
301307	美利信	2023年04月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	174	5,627.16	5,543.64	-
301310	鑫宏业	2023年05月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	77	5,180.56	5,038.11	-
301317	鑫磊股份	2023年01月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	459	9,487.53	12,012.03	-
301322	绿通科技	2023年02月27日	6个月	新股流通受限	86.92	53.24	89	7,735.49	4,738.36	-
301323	新莱福	2023年05月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	60	2,343.60	2,361.60	-
301325	曼恩斯特	2023年05月04日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	69	5,299.20	7,448.55	-
301333	德尔	2023年	6个月	新股流	14.81	13.73	251	3,717.31	3,446.23	-

2	玛	05月09日		通受限							
301337	亚华电子	2023年05月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	79	2,575.40	2,399.23	-	
301345	涛涛车业	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	70	5,141.50	3,264.80	-	
301357	北方长龙	2023年04月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	73	3,650.00	3,532.47	-	
301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	245	5,823.65	10,508.05	-	
301360	荣旗科技	2023年04月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	61	4,384.68	5,648.60	-	
301373	凌玮科技	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	177	5,970.21	5,637.45	-	
301382	蜂助手	2023年05月09日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	121	2,879.80	3,973.64	-	
301386	未来电器	2023年03月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	196	5,878.04	4,662.84	-	
301387	光大同创	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	58.32	45.36	116	6,765.12	5,261.76	-	
301408	华人健康	2023年02月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	443	7,194.32	7,508.85	-	
301419	阿莱德	2023年02月02日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	282	6,993.60	12,365.70	-	
301428	世纪恒通	2023年05月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	95	2,503.25	2,907.00	-	
301429	森泰股份	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	28.75	21.02	222	6,382.50	4,666.44	-	
301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	269	5,377.31	4,546.10	-	

601061	中信金属	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	388	2,553.04	2,941.04	-
601065	江盐集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	149	1,543.64	1,764.16	-
601133	柏诚股份	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	137	1,597.42	1,679.62	-
603125	常青科技	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	46	1,195.08	1,128.38	-
603135	中重科技	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	134	2,385.20	2,397.26	-
603137	恒尚节能	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	112	1,780.80	1,914.08	-
688146	中船特气	2023年04月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	108	3,904.20	4,118.04	-
688352	颀中科技	2023年04月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	362	4,380.20	4,369.34	-
688433	华曙高科	2023年04月07日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	120	3,199.20	3,780.00	-
688478	晶升股份	2023年04月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	161	5,235.72	6,821.57	-
688502	茂莱光学	2023年02月28日	6个月	新股流通受限	69.72	178.59	892	62,190.24	159,302.28	-
688535	华海诚科	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	116	4,060.00	5,942.68	-

注：①根据《上海证券交易所首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》和《深圳证券交易所首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分股票设置不低于6个月的限售期。

②基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参

与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

③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。

④本报告期，“科源制药”（股票代码：301281）新股申购持有数量为 102 股，根据《山东科源制药股份有限公司 2022 年年度权益分派实施公告》，以资本公积转增股本 41 股，报告期末本基金持有“科源制药”限售股票数量合计为 143 股，认购价格为除权后的价格；本报告期，“绿通科技”（股票代码：301322）新股申购持有数量为 59 股，根据《广东绿通新能源电动车科技股份有限公司 2022 年年度权益分派实施公告》，以资本公积转增股本 30 股，报告期末本基金持有“绿通科技”限售股票数量合计为 89 股，认购价格为除权后的价格。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 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

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

本基金投资于股票、债券等金融工具，在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理团队和相关业务部门构成的多层级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合

法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理团队负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 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06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,527,981.51	8,609,146.99
合计	2,527,981.51	8,609,146.99

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债等。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	76,115.01
未评级	-	-
合计	-	76,115.01

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 6 月 30 日，本基金组合资产中经确认的当日净赎回金额未超过 7 个工作日可变现资产的账面价值。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久

期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年06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	1,956,586.43	-	-	-	1,956,586.43
结算备付金	7,622.53	-	-	-	7,622.53
存出保证金	75,498.82	-	-	-	75,498.82
交易性金融资产	2,527,981.51	-	-	62,030,724.60	64,558,706.11
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	20,336.01	20,336.01
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	28,017.33	28,017.33
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,567,689.29	-	-	62,079,077.94	66,646,767.23
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	-	-	-	733,976.01	733,976.01
应付管理人报酬	-	-	-	70,650.02	70,650.02
应付托管费	-	-	-	14,130.01	14,130.01
应付销售服务费	-	-	-	-	-
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	-	-	-	252,397.41	252,397.41
负债总计	-	-	-	1,071,153.45	1,071,153.45
利率敏感度缺口	4,567,689.29	-	-	61,007,924.49	65,575,613.78
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	2,032,038.05	-	-	-	2,032,038.05
结算备付金	4,326.69	-	-	-	4,326.69
存出保证金	44,470.99	-	-	-	44,470.99
交易性金融资产	8,609,146.99	-	76,115.01	178,284,829.57	186,970,091.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	193,364.06	193,364.06
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	18,256.74	18,256.74
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,689,982.72	-	76,115.01	178,496,450.37	189,262,548.10
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	-	-	-	10,247.52	10,247.52
应付管理人报酬	-	-	-	161,788.40	161,788.40
应付托管费	-	-	-	32,357.70	32,357.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.78	0.78
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	256,246.45	256,246.45
负债总计	-	-	-	460,640.85	460,640.85
利率敏感度缺口	10,689,982.72	-	76,115.01	178,035,809.52	188,801,907.25

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2023年06月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	市场利率增加0.25%	-2,013.83	-6,733.53

市场利率减少 0.25%	2,017.04	6,744.09
--------------	----------	----------

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变化而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外币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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06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	62,030,724.60	94.59	178,284,829.57	94.43
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	62,030,724.60	94.59	178,284,829.57	94.43

##### 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06月30日)	上年度末（2022年12月31日）
业绩比较基准上升 5%	2,885,558.60	9,389,748.06
业绩比较基准下降 5%	-2,885,558.60	-9,389,748.06

#### 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 2023年06月30日	上年末 2022年12月31日
第一层次	61,617,647.00	177,176,641.18
第二层次	2,527,981.51	8,836,845.90
第三层次	413,077.60	956,604.49
合计	64,558,706.11	186,970,091.57

###### 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

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 年 12 月 31 日：同）。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	62,030,724.60	93.07
	其中：股票	62,030,724.60	93.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,527,981.51	3.79
	其中：债券	2,527,981.51	3.79
	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	1,964,208.96	2.95
8	其他各项资产	123,852.16	0.19
9	合计	66,646,767.23	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	8,391,176.65	12.80
B	采矿业	-	-
C	制造业	35,371,246.12	53.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,436,998.96	3.72
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,608,824.80	3.98
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,370,365.23	3.61
N	水利、环境和公共设施管理业	8,100,991.39	12.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,338,043.85	3.57
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	61,617,647.00	93.96

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	341,171.35	0.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.05
E	建筑业	3,593.70	0.01
F	批发和零售业	14,086.35	0.02
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	9,279.87	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,498.86	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	413,077.60	0.63

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	001269	欧晶科技	10,480	770,594.40	1.18
2	603477	巨星农牧	22,400	747,040.00	1.14
3	003035	南网能源	101,600	723,392.00	1.10
4	600475	华光环能	60,000	712,800.00	1.09
5	688337	普源精电	11,800	711,068.00	1.08
6	300498	温氏股份	38,200	700,970.00	1.07
7	300094	国联水产	137,800	693,134.00	1.06
8	000963	华东医药	15,900	689,583.00	1.05
9	002252	上海莱士	91,000	683,410.00	1.04
10	688526	科前生物	28,600	680,394.00	1.04
11	688686	奥普特	4,100	674,368.00	1.03
12	300595	欧普康视	22,200	670,218.00	1.02
13	002714	牧原股份	15,759	664,241.85	1.01
14	603939	益丰药房	17,940	663,780.00	1.01
15	603392	万泰生物	9,905	661,356.85	1.01
16	688112	鼎阳科技	12,520	660,805.60	1.01
17	603233	大参林	23,380	654,873.80	1.00
18	002266	浙富控股	157,906	652,151.78	0.99
19	002124	天邦食品	143,500	651,490.00	0.99
20	000998	隆平高科	42,400	650,840.00	0.99
21	300832	新产业	11,000	649,000.00	0.99
22	300087	荃银高科	62,610	647,387.40	0.99
23	600276	恒瑞医药	13,512	647,224.80	0.99
24	603882	金域医学	8,567	646,808.50	0.99
25	002840	华统股份	41,300	645,932.00	0.99
26	002645	华宏科技	52,400	642,424.00	0.98
27	002311	海大集团	13,700	641,708.00	0.98
28	000930	中粮科技	79,100	640,710.00	0.98
29	601388	怡球资源	222,300	640,224.00	0.98
30	002100	天康生物	77,200	636,900.00	0.97
31	600196	复星医药	20,554	635,118.60	0.97
32	603568	伟明环保	36,133	632,688.83	0.96
33	002007	华兰生物	28,217	632,342.97	0.96
34	603588	高能环境	67,412	631,650.44	0.96
35	688208	道通科技	20,800	630,448.00	0.96
36	002385	大北农	95,500	630,300.00	0.96
37	002458	益生股份	51,020	630,097.00	0.96
38	600161	天坛生物	23,160	628,794.00	0.96
39	000895	双汇发展	25,620	627,433.80	0.96
40	003039	顺控发展	36,986	627,282.56	0.96
41	603100	川仪股份	16,100	625,646.00	0.95

42	300760	迈瑞医疗	2,085	625,083.00	0.95
43	002534	西子洁能	37,204	625,027.20	0.95
44	603896	寿仙谷	14,100	624,630.00	0.95
45	002299	圣农发展	32,600	624,290.00	0.95
46	002549	凯美特气	54,200	623,300.00	0.95
47	300896	爱美客	1,400	622,930.00	0.95
48	600598	北大荒	46,700	622,511.00	0.95
49	600299	安迪苏	78,000	621,660.00	0.95
50	002034	旺能环境	39,300	621,333.00	0.95
51	600873	梅花生物	69,400	619,742.00	0.95
52	601952	苏垦农发	53,196	619,201.44	0.94
53	301175	中科环保	99,368	619,062.64	0.94
54	002001	新和成	40,173	618,664.20	0.94
55	600085	同仁堂	10,700	615,892.00	0.94
56	000538	云南白药	11,713	614,698.24	0.94
57	601118	海南橡胶	137,200	614,656.00	0.94
58	002041	登海种业	40,200	613,854.00	0.94
59	300761	立华股份	33,280	613,350.40	0.94
60	603456	九洲药业	22,300	610,574.00	0.93
61	600323	瀚蓝环境	32,254	610,568.22	0.93
62	600313	农发种业	70,900	610,449.00	0.93
63	000598	兴蓉环境	112,200	609,246.00	0.93
64	002310	东方园林	358,300	609,110.00	0.93
65	300197	节能铁汉	249,800	607,014.00	0.93
66	000155	川能动力	42,100	606,240.00	0.92
67	600882	妙可蓝多	27,200	606,016.00	0.92
68	300003	乐普医疗	26,700	603,687.00	0.92
69	002422	科伦药业	20,300	602,504.00	0.92
70	601607	上海医药	26,800	600,588.00	0.92
71	600887	伊利股份	21,196	600,270.72	0.92
72	002573	清新环境	108,800	599,488.00	0.91
73	300122	智飞生物	13,494	596,434.80	0.91
74	600436	片仔癀	2,082	596,201.52	0.91
75	300072	海新能科	174,100	595,422.00	0.91
76	000035	中国天楹	129,900	594,942.00	0.91
77	000999	华润三九	9,800	594,468.00	0.91
78	600008	首创环保	206,330	594,230.40	0.91
79	600195	中牧股份	50,732	592,549.76	0.90
80	600763	通策医疗	6,115	592,298.90	0.90
81	603259	药明康德	9,477	590,511.87	0.90
82	603658	安图生物	11,400	589,722.00	0.90

83	300070	碧水源	109,493	586,882.48	0.89
84	300601	康泰生物	23,040	584,985.60	0.89
85	300142	沃森生物	22,073	583,830.85	0.89
86	600597	光明乳业	55,690	579,176.00	0.88
87	300203	聚光科技	28,500	577,695.00	0.88
88	600332	白云山	18,035	574,955.80	0.88
89	002821	凯莱英	4,852	571,856.72	0.87
90	600201	生物股份	59,720	567,937.20	0.87
91	688180	君实生物	14,700	566,538.00	0.86
92	002603	以岭药业	22,000	565,180.00	0.86
93	002294	信立泰	17,900	558,301.00	0.85
94	300015	爱尔眼科	29,999	556,481.45	0.85
95	000661	长春高新	4,029	549,152.70	0.84
96	301267	华夏眼科	8,900	542,455.00	0.83
97	002946	新乳业	37,401	536,704.35	0.82
98	300759	康龙化成	13,999	535,881.72	0.82
99	300347	泰格医药	8,066	520,579.64	0.79

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688502	茂莱光学	892	159,302.28	0.24
2	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.05
3	301301	川宁生物	1,591	14,255.36	0.02
4	301419	阿莱德	282	12,365.70	0.02
5	301317	鑫磊股份	459	12,012.03	0.02
6	301358	湖南裕能	245	10,508.05	0.02
7	301260	格力博	405	9,570.15	0.01
8	301293	三博脑科	133	9,498.86	0.01
9	301408	华人健康	443	7,508.85	0.01
10	301325	曼恩斯特	69	7,448.55	0.01
11	688478	晶升股份	161	6,821.57	0.01
12	301246	宏源药业	205	6,295.55	0.01
13	688535	华海诚科	116	5,942.68	0.01
14	301360	荣旗科技	61	5,648.60	0.01
15	301373	凌玮科技	177	5,637.45	0.01
16	301307	美利信	174	5,543.64	0.01
17	301141	中科磁业	129	5,507.01	0.01
18	301387	光大同创	116	5,261.76	0.01
19	301157	华塑科技	99	5,240.07	0.01
20	301310	鑫宏业	77	5,038.11	0.01

21	301322	绿通科技	89	4,738.36	0.01
22	301429	森泰股份	222	4,666.44	0.01
23	301386	未来电器	196	4,662.84	0.01
24	301439	泓淋电力	269	4,546.10	0.01
25	688352	顾中科技	362	4,369.34	0.01
26	688146	中船特气	108	4,118.04	0.01
27	301382	蜂助手	121	3,973.64	0.01
28	688433	华曙高科	120	3,780.00	0.01
29	001287	中电港	173	3,636.46	0.01
30	301281	科源制药	143	3,589.30	0.01
31	301357	北方长龙	73	3,532.47	0.01
32	301332	德尔玛	251	3,446.23	0.01
33	301345	涛涛车业	70	3,264.80	0.00
34	601061	中信金属	388	2,941.04	0.00
35	301428	世纪恒通	95	2,907.00	0.00
36	301337	亚华电子	79	2,399.23	0.00
37	603135	中重科技	134	2,397.26	0.00
38	301323	新莱福	60	2,361.60	0.00
39	603137	恒尚节能	112	1,914.08	0.00
40	601065	江盐集团	149	1,764.16	0.00
41	001380	华纬科技	57	1,754.46	0.00
42	601133	柏诚股份	137	1,679.62	0.00
43	001328	登康口腔	59	1,503.91	0.00
44	603125	常青科技	46	1,128.38	0.00
45	001282	三联锻造	34	1,123.02	0.00
46	001367	海森药业	26	1,026.48	0.00
47	001324	长青科技	51	999.60	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	603477	巨星农牧	1,114,139.00	0.59
2	688337	普源精电	981,802.38	0.52
3	603233	大参林	978,195.60	0.52
4	600475	华光环能	973,159.00	0.52
5	301267	华夏眼科	948,387.00	0.50
6	002840	华统股份	946,907.00	0.50
7	603658	安图生物	933,809.00	0.49
8	001269	欧晶科技	914,913.00	0.48

9	002034	旺能环境	900,225.00	0.48
10	002422	科伦药业	899,070.00	0.48
11	688112	鼎阳科技	879,828.07	0.47
12	002294	信立泰	846,987.00	0.45
13	603100	川仪股份	827,923.00	0.44
14	300070	碧水源	547,416.00	0.29
15	603392	万泰生物	368,306.40	0.20
16	001286	陕西能源	361,603.20	0.19
17	002549	凯美特气	349,503.00	0.19
18	300203	聚光科技	333,341.00	0.18
19	002714	牧原股份	277,795.00	0.15
20	603456	九洲药业	269,402.00	0.14

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（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	300832	新产业	2,107,136.00	1.12
2	000967	盈峰环境	1,976,227.00	1.05
3	600737	中粮糖业	1,975,400.00	1.05
4	300070	碧水源	1,942,328.00	1.03
5	601827	三峰环境	1,883,472.00	1.00
6	603896	寿仙谷	1,797,470.00	0.95
7	600161	天坛生物	1,783,447.00	0.94
8	000685	中山公用	1,769,920.00	0.94
9	600481	双良节能	1,733,263.00	0.92
10	600276	恒瑞医药	1,732,189.00	0.92
11	601200	上海环境	1,730,257.43	0.92
12	002946	新乳业	1,681,672.00	0.89
13	002007	华兰生物	1,670,436.00	0.88
14	002726	龙大美食	1,650,095.20	0.87
15	601607	上海医药	1,645,376.00	0.87
16	600201	生物股份	1,621,002.00	0.86
17	002252	上海莱士	1,614,064.00	0.85
18	600085	同仁堂	1,599,434.00	0.85
19	688301	奕瑞科技	1,553,140.86	0.82
20	300529	健帆生物	1,517,124.00	0.80

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（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	22,631,280.46
卖出股票收入（成交）总额	133,080,546.63

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照买卖成交金额（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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,527,981.51	3.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,527,981.51	3.86

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019688	22 国债 23	25,000	2,527,981.51	3.86

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

### 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

无。

### 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

无。

### 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

无。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 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

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体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、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	75,498.82
2	应收清算款	20,336.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	28,017.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	123,852.16

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688502	茂莱光学	159,302.28	0.24	新股流通受限
2	001286	陕西能源	35,447.47	0.05	新股流通受限
3	301301	川宁生物	14,255.36	0.02	新股流通受限
4	301419	阿莱德	12,365.70	0.02	新股流通受限
5	301317	鑫磊股份	12,012.03	0.02	新股流通受限

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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

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
10,791	7,397.08	188,212.00	0.24%	79,633,667.68	99.76%

## 8.2 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	959.59	0.0012%

## 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	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 (2020 年 12 月 18 日) 基金份额总额	542,709,705.13
本报告期期初基金份额总额	214,477,586.77

本报告期基金总申购份额	6,287,140.65
减：本报告期基金总赎回份额	140,942,847.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	79,821,879.68

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开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

本报告期内本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内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

本报告期内基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期无托管人及其高级管理人员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	

东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	2	152,742,411.66	100.00%	111,701.44	100.00%	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	17,090,336.54	100.00%	-	-	-	-	-	-

### 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	前海开源中证健康产业指数型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年01月20日
2	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金定期定额投资业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2023年02月08日
3	前海开源中证健康产业指数型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023年03月31日
4	前海开源基金管理有限公司关于变更公司官方电子直销交易平台 APP 名称的公告	中国证监会规定媒介	2023年03月31日
5	前海开源中证健康产业指数型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年04月22日
6	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过蚂蚁（杭州）基金销售有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2023年05月04日
7	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过上海中欧财富基金销售有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2023年05月15日
8	关于旗下部分基金增加杭州银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023年06月08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	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101-20230615	130,699,766.00	-	130,699,766.00	-	-
产品特有风险							
1. 巨额赎回风险							
<p>(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定延缓支付赎回款项、部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务的办理；</p>							

**2. 转换运作方式或终止基金合同的风险**

个别投资者大额赎回后，若本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、持续运作等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会，其他投资者可能面临相应风险；

**3. 流动性风险**

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

**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**

- (1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源中证健康产业指数型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (5) 前海开源中证健康产业指数型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

**12.2 存放地点**

基金管理人或基金托管人处

**12.3 查阅方式**

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998
- (3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)

前海开源基金管理有限公司  
2023 年 08 月 31 日