
永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金

2023年第3季度报告

2023年09月30日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2023年10月25日

§1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年07月01日起至2023年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	医疗器械ETF
场内简称	医疗器械
基金主代码	159883
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021年04月22日
报告期末基金份额总额	3,969,037,843.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内。主要投资策略有：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略和存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证全指医疗器械指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023年07月01日 - 2023年09月30日）
1.本期已实现收益	-59,038,317.33
2.本期利润	-177,314,564.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0450
4.期末基金资产净值	2,217,195,549.56
5.期末基金份额净值	0.5586

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.65%	1.07%	-7.78%	1.08%	0.13%	-0.01%
过去六个月	-15.21%	0.98%	-16.70%	0.99%	1.49%	-0.01%
过去一年	-10.35%	1.26%	-11.43%	1.27%	1.08%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-44.14%	1.58%	-42.58%	1.61%	-1.56%	-0.03%

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

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



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万纯	指数与量化投资部主管兼基金经理	2021-04-22	2023-08-29	9	万纯先生，北京大学硕士，9年证券相关从业经验。曾任中国证券登记结算有限责任公司技术部基金业务组经理助理，平安基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，永赢基金管理有限公司权益投资部指数与数量投资部副总监，永赢基金管理有限公司指数与量化投资部主管。
储可凡	基金经理	2023-08-14	-	7	储可凡女士，清华大学应用统计硕士，7年证券相关从

					业经验。曾任中银国际证券股份有限公司基金经理助理，永赢基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理助理。现任永赢基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理。
刘庭宇	基金经理助理	2022-11-07	-	5	刘庭宇先生，上海财经大学金融硕士，5年证券相关从业经验。曾任鹏扬基金管理有限公司量化分析师，永赢基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理助理。现任永赢基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理。

注：

- 1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。
- 2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》及行业协会关于从业人员的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023年三季度，医药板块整体震荡下跌，申万医药生物指数跌1.57%，本基金标的指数中证全指医疗器械指数跌7.78%，高于医药板块整体跌幅，下跌原因主要有几点：其一，部分新冠业务相关的公司业绩承压，中报业绩同比仍下滑；其二，药品和器械的集采仍在逐步推进，对于集采或可能集采的品种，集采降价对上市公司利润率的影响或仍存在一些担忧；其三，为期一年的医疗领域集中反腐引发了市场避险情绪，行情短期波动加大。当前时点而言，新冠业务基数影响逐渐出清、反腐信号好转、市场对集采的预期趋于稳定，医药行情已见企稳，9月11日至报告期末，医药领涨申万一级行业，后市或无需过分悲观。估值上，当前中证全指医疗器械指数PE（TTM）处于过去十年20%的低分位数水平，投资价值突出。

中长期角度而言，医疗器械仍是医药板块中具备高增长潜力的行业，增速或将延续高于医疗行业整体增速。医疗器械受益于国内人口老龄化与不断提升的诊疗需求，行业长期刚性需求不变，从药械比来看，我国医疗器械相对于药品存在更高的增长空间，在新基建的推动下，国内医疗器械需求将加速释放。近年来，医疗器械国产化率加速提升，整体仍具备较大的国产替代空间。

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

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末医疗器械ETF基金份额净值为0.5586元，本报告期内，基金份额净值增长率为-7.65%，同期业绩比较基准收益率为-7.78%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,207,627,686.81	99.40
	其中：股票	2,207,627,686.81	99.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,366,293.45	0.56
8	其他资产	1,046,301.18	0.05
9	合计	2,221,040,281.44	100.00

注：（1）上述股票投资包括可退替代款估值增值。

（2）本基金通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为人民币202,831,402.00元，占基金资产净值的比例为9.15%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,011,529,899.98	90.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	90,564,550.18	4.08
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	102,807,032.04	4.64
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,204,901,482.20	99.45

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,284,337.18	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,369.83	0.00
F	批发和零售业	62,929.14	0.00
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	267,126.78	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	32,809.24	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	46,446.98	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	21,185.46	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,726,204.61	0.12

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300760	迈瑞医疗	1,225,021	330,522,916.01	14.91
2	300896	爱美客	379,993	148,299,868.11	6.69
3	300003	乐普医疗	4,625,469	75,996,455.67	3.43
4	002223	鱼跃医疗	2,114,000	72,806,160.00	3.28
5	300832	新产业	1,103,770	70,111,470.40	3.16
6	603882	金域医学	984,089	61,367,790.04	2.77
7	688617	惠泰医疗	141,136	54,032,506.24	2.44
8	600529	山东药玻	1,865,000	51,940,250.00	2.34
9	002432	九安医疗	1,363,200	50,874,624.00	2.29
10	300595	欧普康视	1,886,158	48,436,537.44	2.18

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	301559	中集环科	13,144	318,347.68	0.01
2	688249	晶合集成	7,405	122,700.85	0.01
3	688657	浩辰软件	1,008	104,227.20	0.00
4	688563	航材股份	1,501	87,568.34	0.00
5	688472	阿特斯	6,261	85,149.60	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	137,468.26
2	应收证券清算款	773,873.32
3	应收股利	440.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	134,519.60
7	其他	-
8	合计	1,046,301.18

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300896	爱美客	38,558,676.00	1.74	转融通证券出借
2	688617	惠泰医疗	6,087,156.00	0.27	转融通证券出借
3	002432	九安医疗	3,228,180.00	0.15	转融通证券出借
4	300832	新产业	1,772,208.00	0.08	转融通证券出借
5	300760	迈瑞医疗	1,403,012.00	0.06	转融通证券出借
6	300595	欧普康视	487,920.00	0.02	转融通证券出借
7	300003	乐普医疗	318,742.00	0.01	转融通证券出借
8	002223	鱼跃医疗	303,072.00	0.01	转融通证券出借
9	603882	金域医学	261,912.00	0.01	转融通证券出借
10	600529	山东药玻	217,230.00	0.01	转融通证券出借

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301559	中集环科	318,347.68	0.01	认购新发证券
2	688249	晶合集成	122,700.85	0.01	新股限售

3	688657	浩辰软件	104,227.20	0.00	认购新发证券
4	688563	航材股份	87,568.34	0.00	新股限售
5	688472	阿特斯	85,149.60	0.00	新股限售

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	3,764,037,843.00
报告期期间基金总申购份额	853,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	648,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	3,969,037,843.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

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

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：400-805-8888

永赢基金管理有限公司
2023年10月25日