

# 广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

## 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

## § 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。

基金托管人交通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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发中证香港创新药（QDII-ETF）
场内简称	HK 创新药
基金主代码	513120
交易代码	513120
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 7 月 1 日
报告期末基金份额总额	5,143,135,422.00 份
投资目标	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	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股（含存托凭证）的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股（含存托凭证）及

	<p>其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的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%。</p> <p>在正常情况下，本基金力争控制投资组合的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%，年化跟踪误差不超过 4%。</p> <p>具体投资策略包括：1、股票（含存托凭证）投资策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、股指期货投资策略；5、参与转融通证券出借业务策略。</p>
业绩比较基准	中证香港创新药指数收益率（人民币计价）
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。此外，本基金投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。</p>
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
境外资产托管人中文名称	香港上海汇丰银行有限公司

注：本基金的扩位证券简称为“港股创新药 ETF”。

### § 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7月1日-2023年9月30日)
1.本期已实现收益	-12,613,125.19
2.本期利润	-43,353,824.70
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0098
4.期末基金资产净值	4,066,157,064.90
5.期末基金份额净值	0.7906

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

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

#### 3.2 基金净值表现

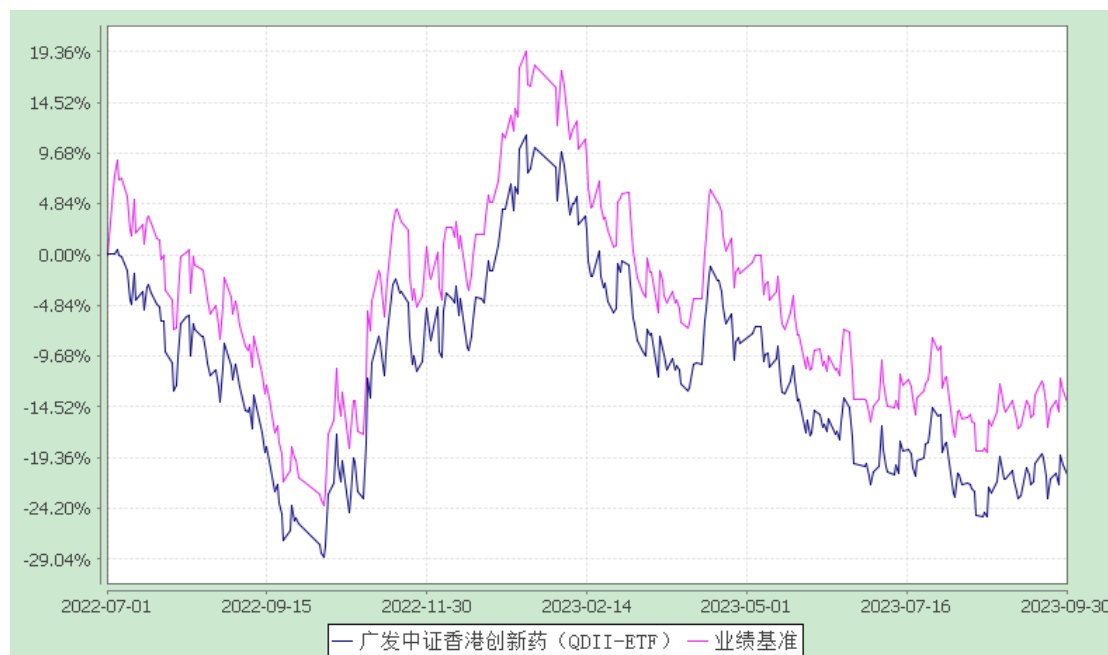
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.25%	1.94%	0.47%	1.93%	-0.72%	0.01%
过去六个月	-9.79%	1.88%	-8.17%	1.89%	-1.62%	-0.01%
过去一年	6.31%	2.24%	9.06%	2.20%	-2.75%	0.04%
自基金合同生效起至今	-20.94%	2.19%	-14.10%	2.20%	-6.84%	-0.01%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金（QDII）  
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2022年7月1日至2023年9月30日）



注：本基金建仓期为基金合同生效后6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

## § 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		
刘杰	本基金的基金经理；广发中证500交易型开放式指数证券投资基金的	2022-07-01	-	19年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、

	<p>基金经理；广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF) 的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII) 的基金经理；广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII) 的基金经理；广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理；广发全球医疗保健</p>				<p>数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理 (自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 30 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工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 2016 年 9 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保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</p>
--	---	--	--	--	--

	<p>指数证券投资基金的基金经理；广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发北证 50 成份指数型证券投资基金的基金经理；广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理；指数投资部总经理助理</p>			<p>(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 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 5 月 21 日至 2021 年 7 月 2 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (自 2019 年 12 月 16 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 9 月 20 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (自 2019 年 11 月 6 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发纳斯达克 100 指数证</p>
--	---	--	--	--

				券投资基金基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日至 2022 年 3 月 31 日)、广 发恒生中国企业精明指 数型发起式证券投资基 金(QDII)基金经理(自 2019 年 5 月 9 日至 2022 年 4 月 28 日)、广发沪 深 300 交易型开放式指 数证券投资基金基金经 理(自 2015 年 8 月 20 日 至 2023 年 2 月 22 日)、 广发沪深 300 交易型开 放式指数证券投资基金 联接基金基金经理(自 2016 年 1 月 18 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发恒 生科技指数证券投资基 金（QDII）基金经理(自 2021 年 8 月 11 日至 2023 年 3 月 7 日)。
--	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

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》的相关规定。

#### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权



制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 23 次，其中 19 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 4 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2023 年 3 季度，受到国内国际市场情绪影响，港股市场呈现震荡行情，恒生指数下跌 5.85%，恒生科技指数上涨 0.24%，港股创新药指数下跌 0.17%，港股市场整体表现上看对于来自美联储加息政策的影响更为敏感。国内经济边际转好，海外流动性环境偏紧，港股维持底部震荡态势。国内经济数据显示消费、投资和生产等逐步回暖。同时，相关货币政策支持也有助于实体经济持续转好。

对于恒生科技中互联网企业而言，在宏观以及房地产等稳增长相关的政策持续出台后，线上消费也受益于经济和消费信心的回暖，2023 年 8 月线上零售总额 1.23 万亿元，同比上升 9.5%，增速相比 2023 年 7 月的 8.9% 有所提升，业绩层面，2023 年 2 季度主要公司收入及利润均超预期，在宏观预期回暖及各公司更加积极的经营举措下，降本增效取得成果，成为重要看点。

港股创新药企业研发投入过程较长，资金投入较大，美联储加息上升周期中，港股创新药企业 2 季度的表现受到较大压制，同时在 3 季度整体美联储加息预期好转的过程中，港股创新药的表现整体在港股中相对较好，同时医药反腐对于创

新药企业的影响相对较小。

作为ETF，本基金秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低基金的跟踪误差。报告期内，本基金跟踪误差来源主要是汇率波动、成份股调整、申购赎回和停牌股票估值调整等因素。

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-0.25%，同期业绩比较基准收益率为0.47%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,987,817,873.32	96.58
	其中：普通股	3,987,817,873.32	96.58
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-

	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	131,465,432.56	3.18
8	其他资产	9,603,410.69	0.23
9	合计	4,128,886,716.57	100.00

注：（1）上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

（2）权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 3,594,751,747.91 元，占基金资产净值比例 88.41%。

## 5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
中国香港	3,987,817,873.32	98.07
合计	3,987,817,873.32	98.07

注：（1）国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

（2）ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	3,987,817,873.32	98.07
金融	-	-
信息技术	-	-
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-

合计	3,987,817,873.32	98.07
----	------------------	-------

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

#### 5.4 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股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Wuxi Biologics Cayman Inc	药明生物	2269 HK	香港交易所	中国香港	10,735,000.00	449,687,104.99	11.06
2	Innovent Biologics Inc	信达生物	1801 HK	香港交易所	中国香港	11,460,500.00	402,256,072.03	9.89
3	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	石药集团	1093 HK	香港交易所	中国香港	69,842,000.00	367,871,517.00	9.05
4	BeiGene Ltd	百济神州	6160 HK	香港交易所	中国香港	3,513,700.00	346,932,154.74	8.53
5	WuXi AppTec Co Ltd	药明康德	2359 HK	香港交易所	中国香港	3,043,900.00	261,860,058.47	6.44
6	Sino Biopharmaceuti	中国	1177	香港	中国	85,358,000.00	221,665,584.16	5.45

	cal Ltd	生物制药	HK	交易所	香港			
7	Genscript Biotech Corp	金斯瑞生物科技	1548 HK	香港交易所	中国香港	9,608,000.00	182,062,563.67	4.48
8	Akeso Inc	康方生物	9926 HK	香港交易所	中国香港	5,087,000.00	168,047,417.16	4.13
9	Zai Lab Ltd	再鼎医药	9688 HK	香港交易所	中国香港	7,401,700.00	128,640,896.13	3.16
10	China Medical System Holdings Ltd	康哲药业	867 HK	香港交易所	中国香港	11,117,000.00	120,987,331.54	2.98

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

#### 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

### 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.10.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

#### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	46.09
2	应收证券清算款	697,074.65
3	应收股利	8,868,482.03
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	37,807.92
8	其他	-
9	合计	9,603,410.69

#### 5.10.4 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。

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	3,134,635,422.00
-------------	------------------

报告期期间基金总申购份额	2,525,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	516,500,000.00
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	5,143,135,422.00

## § 7 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，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金（QDII）募集的文件
- （二）《广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》
- （三）《广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照

### 8.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

### 8.3 查阅方式

1. 书面查阅：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. 网站查阅：基金管理人网址 [www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司  
二〇二三年十月二十五日