

# 摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 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
<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	7
2.5 其他相关资料	7
<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	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>7 投资组合报告</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
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	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
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	40
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	40
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	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 本报告期投资基金情况	41

7.13 投资组合报告附注.....	41
<b>8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	42
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的情况.....	42
<b>9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>43</b>
<b>10 重大事件揭示.....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>45</b>
<b>12 备查文件目录.....</b>	<b>45</b>
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	摩根中证创新药产业 ETF
基金主代码	560900
交易代码	560900
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 5 月 19 日
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	233,969,080.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 6 月 2 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争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>1、资产配置策略</p> <p>为了实现跟踪误差最小化，本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股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 80%。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）投资组合构建</p> <p>本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建股票资产组合，当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红、长期停牌等行为时，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，基金经理将配合使用其他合理的投资方法作为完全复制法的补充，构建本基金实际的投资组合，以追求尽可能贴近标的指数的表现，有效控制跟踪误差。本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代，以期在规定的风险承受限度内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>（2）投资组合调整</p> <p>1) 定期调整</p> <p>本基金所构建的投资组合将定期根据所跟踪标的指数成份股的调整进行相应的跟踪调整。指数调整方案公布后，本基金将及时对现有组合的构成进行相应的调整，若成份股的集中调整短期内会对跟踪误差产生较大影响，将采用逐步调整的方式。</p> <p>2) 不定期调整</p>

	<p>①根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标的指数权重比例的变化，进行相应调整。</p> <p>②当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益，选择相关股票进行适当的替代。</p> <p>③本基金将根据申购和赎回情况对股票投资组合进行调整，保证基金正常运行，从而有效跟踪标的指数。</p> <p>本基金力争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%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金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，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>3、其他投资策略：包括股指期货投资策略、股票期权投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借策略。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数，即中证创新药产业指数收益率。本基金标的指数变更的，相应更换基金名称和业绩比较基准，并在履行适当程序后及时公告。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，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		摩根基金管理（中国）有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邹树波	朱志明
	联系电话	021-38794888	4008-888-108
	电子邮箱	services@jpmamc.com	service@csc.com.cn
客户服务电话		400-889-4888	95587
传真		021-20628400	010-56162085
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号42层和43层	北京市朝阳区安立路66号4号 楼
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号42层和43层	北京市朝阳区景辉街16号院1 号楼泰康集团大厦8层/18层，北 京市朝阳区光华路10号院中信 大厦82层
邮政编码		200120	100010
法定代表人		王琼慧	王常青

## 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	am.jpmorgan.com/cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-9,812,197.57
本期利润	-54,082,707.28
加权平均基金份额本期利润	-0.2295
本期加权平均净值利润率	-30.54%
本期基金份额净值增长率	-25.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-79,779,925.23
期末可供分配基金份额利润	-0.3410
期末基金资产净值	154,189,154.77
期末基金份额净值	0.6590
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-34.10%

注：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。

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（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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

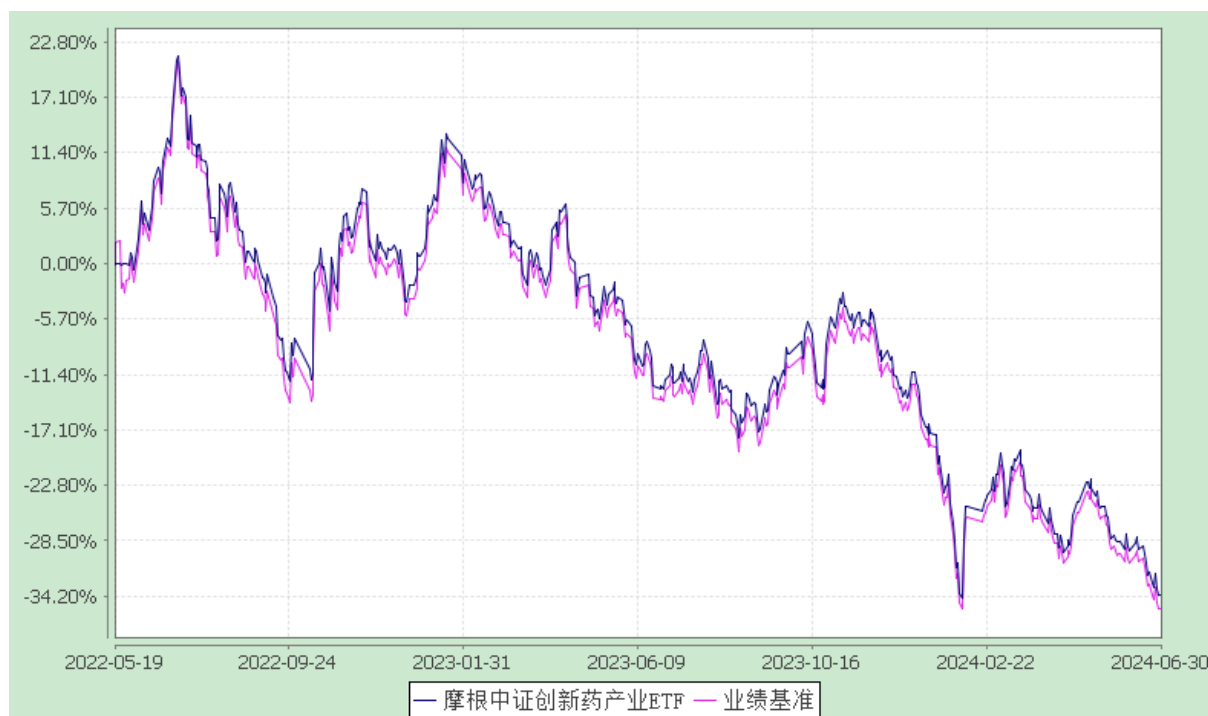
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-7.65%	1.23%	-8.03%	1.21%	0.38%	0.02%

过去三个月	-11.97%	1.29%	-12.63%	1.29%	0.66%	0.00%
过去六个月	-25.84%	1.81%	-26.34%	1.81%	0.50%	0.00%
过去一年	-25.20%	1.61%	-25.81%	1.61%	0.61%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-34.10%	1.60%	-35.54%	1.65%	1.44%	-0.05%

### 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

摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2022 年 5 月 19 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2022 年 5 月 19 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

## 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



摩根基金管理（中国）有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。2023 年 1 月 19 日，经中国证监会批准，本公司原股东之一上海国际信托有限公司将其持有的本公司 51% 股权，与原另一股东 JPMorgan Asset Management (UK) Limited 将其持有的本公司 49% 股权转让给摩根资产管理控股公司(JPMorgan Asset Management Holdings Inc.)，从而摩根资产管理控股公司取得本公司全部股权。2023 年 4 月 10 日，基金管理人的名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理（中国）有限公司”。截至 2024 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有九十八只，均为开放式基金，分别是：摩根中国优势证券投资基金、摩根货币市场基金、摩根阿尔法混合型证券投资基金、摩根双息平衡混合型证券投资基金、摩根成长先锋混合型证券投资基金、摩根内需动力混合型证券投资基金、摩根亚太优势混合型证券投资基金(QDII)、摩根双核平衡混合型证券投资基金、摩根中小盘混合型证券投资基金、摩根纯债债券型证券投资基金、摩根行业轮动混合型证券投资基金、摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)、摩根新兴动力混合型证券投资基金、摩根强化回报债券型证券投资基金、摩根健康品质生活混合型证券投资基金、摩根全球天然资源混合型证券投资基金(QDII)、摩根核心优选混合型证券投资基金、摩根智选 30 混合型证券投资基金、摩根成长动力混合型证券投资基金、摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、摩根双债增利债券型证券投资基金、摩根核心成长股票型证券投资基金、摩根民生需求股票型证券投资基金、摩根纯债丰利债券型证券投资基金、摩根天添盈货币市场基金、摩根天添宝货币市场基金、摩根安全战略股票型证券投资基金、摩根卓越制造股票型证券投资基金、摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、摩根智慧互联股票型证券投资基金、摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、摩根新兴服务股票型证券投资基金、摩根医疗健康股票型证券投资基金、摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、摩根全球多元配置证券投资基金(QDII-FOF)、摩根安通回报混合型证券投资基金、摩根丰瑞债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、摩根安隆回报混合型证券投资基金、摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)、摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、摩根安裕回报混合型证券投资基金、摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)、摩根核心精选股票型证券投资基金、摩根动力精选混合型证券投资基金、摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)、摩根领先优选混合型证券投资基金、摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)、摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、摩根慧选成长股票型证券投资基金、摩根瑞泰 38 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根锦程稳健养老目

标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、摩根研究驱动股票型证券投资基金、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根瑞盛 87 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根慧见两年持有期混合型证券投资基金、摩根远见两年持有期混合型证券投资基金、摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金、摩根行业睿选股票型证券投资基金、摩根优势成长混合型证券投资基金、摩根安荣回报混合型证券投资基金、摩根中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、摩根景气甄选混合型证券投资基金、摩根均衡优选混合型证券投资基金、摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、摩根月月盈 30 天滚动持有发起式短债债券型证券投资基金、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、摩根全景优势股票型证券投资基金、摩根沃享远见一年持有期混合型证券投资基金、摩根鑫睿优选一年持有期混合型证券投资基金、摩根博睿均衡一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、摩根慧享成长混合型证券投资基金、摩根时代睿选股票型证券投资基金、摩根瑞享纯债债券型证券投资基金、摩根中证碳中和 60 交易型开放式指数证券投资基金、摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、摩根标普 500 指数型发起式证券投资基金(QDII)、摩根锦颐养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、摩根海外稳健配置混合型证券投资基金(QDII-FOF)、摩根双季鑫 6 个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)、摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金、摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)、摩根瑞锦纯债债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金、摩根中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、摩根中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、摩根悦享回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、摩根中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、摩根瑞欣利率债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
胡迪	本基金基金经理、指数及量化投资部总监	2022-05-19	-	16 年	胡迪女士曾任纽约美林证券全球资产管理部高级经理,纽约标准普尔量化投资主管,中国国际金融股份有限公司资产管理部执行总经理。2020 年 5 月加入摩根基金管理(中国)有限公司(原上投摩根基金管理有限公司),现任指数及量化投资部总监兼基金经理。

毛时超	本基金基金经理	2022-06-08	-	8 年	毛时超先生曾任平安基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理；自 2021 年 11 月加入摩根基金管理（中国）有限公司（原上投摩根基金管理有限公司），现任指数及量化投资部基金经理。
曲蕾蕾	本基金基金经理助理	2024-04-22	-	8 年	法国文理研究大学金融数学硕士，现任指数及量化投资部基金经理助理。曲蕾蕾女士曾任法国兴业银行衍生品交易部交易助理，摩根资产管理香港股票交易量化研究员，摩根资产管理中国数据科学研究员；自 2024 年 4 月加入摩根基金管理（中国）有限公司担任指数及量化投资部基金经理助理。

- 注：1. 任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2. 胡迪女士为本基金首任基金经理，其任职日期指本基金基金合同生效之日。
3. 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

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

#### 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

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，

本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，公司未发现存在异常交易行为。

报告期内，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% 的情形：无。

### 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

报告期内，创新药行业相关股票，在经历几年的持续调整之后，无论是估值水平还是机构投资者持有占比，均处于历史相对低位。由于股票投资者风险偏好持续下降，高分红、低估值风格股票占优，但是创新药公司处于快速发展时期，自由现金流和现金分红不具优势，导致整体表现依然相对较弱。此外受到美国相关法案的影响，海外收入占比较高的生物制药公司表现较差，拖累指数的整体表现。

从中长期视角来看，伴随着人口老龄化、国家人均医疗卫生支出持续增加等背景，内部医疗改革持续引导产业升级，鼓励高质量创新药研发的总体基调不变，比如正在推进的《全链条支持创新药发展实施方案》。我国创新药企业国际化程度及全球竞争力逐步提升，持续高强度的研发投入，带来了国产新药临床申请数量逐年攀升，预计未来几年会有较多国产创新药在国内外获批上市，龙头创新药企业有望凭借强大的原研创新及商业化变现能力，在国内以及全球市场中迎来业绩爆发。放眼全球，创新仍是推动医药产业发展的第一动力，在肿瘤、减重等前沿治疗领域，国内外不断有突破性的创新品种及亮眼的临床数据出现，我们认为未来在国内重磅产品催化下，创新药板块仍会有较好表现。

本基金采用复制标的指数的投资策略，基于多套系统处理日常的申购赎回，力争将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

本报告期摩根中证创新药产业 ETF 份额净值增长率为:-25.84%，同期业绩比较基准收益率为:-26.34%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，本基金投资跟踪的标的指数估值水平，当前依然处于历史上的较低位置，考虑到创新药产业链发展空间巨大，在人口老龄化与人均医疗卫生支出不断提升的背景下，相关企业或具有较好的投资机会和配置价值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括投资、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理可参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在直接的重大利益冲突。

#### 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

无。

### 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

在本报告期内，本基金托管人在托管摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期本基金未实施利润分配。

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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

## 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：摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
货币资金		987,316.07	289,370.71
结算备付金		10,593.28	22,621.72
存出保证金		8,610.02	10,986.34
交易性金融资产	6.4.7.2	153,541,724.27	209,649,547.79
其中：股票投资		153,541,724.27	209,649,547.79
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		42,236.99	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	11,686.20
资产总计		154,590,480.63	209,984,212.76
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		-	-
应付管理人报酬		40,095.65	53,770.72
应付托管费		13,365.22	17,923.56
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1,026.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	347,864.99	220,648.16
负债合计		401,325.86	293,369.38
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	233,969,080.00	235,969,080.00
未分配利润	6.4.7.8	-79,779,925.23	-26,278,236.62
净资产合计		154,189,154.77	209,690,843.38
负债和净资产总计		154,590,480.63	209,984,212.76

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日,基金份额净值:0.6590 元,基金份额总额:233,969,080.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-53,641,087.66</b>	<b>-28,418,567.04</b>
1.利息收入		1,495.88	8,151.81
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,495.88	8,151.81
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,374,211.32	2,502,698.25
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-10,982,042.30	1,064,024.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	1,553,957.60	1,418,385.02

其他投资收益		53,873.38	20,288.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-44,270,509.71	-30,981,903.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	2,137.49	52,486.87
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>441,619.62</b>	<b>523,171.58</b>
1. 管理人报酬		263,938.53	325,378.77
2. 托管费		87,979.50	108,459.58
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7.税金及附加		193.99	73.08
8. 其他费用	6.4.7.16	89,507.60	89,260.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-54,082,707.28</b>	<b>-28,941,738.62</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-54,082,707.28</b>	<b>-28,941,738.62</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-54,082,707.28</b>	<b>-28,941,738.62</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	235,969,080.00	-	-26,278,236.62	209,690,843.38
二、本期期初净资产	235,969,080.00	-	-26,278,236.62	209,690,843.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,000,000.00	-	-53,501,688.61	-55,501,688.61
（一）、综合收益总额	-	-	-54,082,707.28	-54,082,707.28
（二）、本期基金份额交易产生的	-2,000,000.00	-	581,018.67	-1,418,981.33



净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	8,000,000.00	-	-2,142,133.68	5,857,866.32
2.基金赎回款	-10,000,000.00	-	2,723,152.35	-7,276,847.65
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	233,969,080.00	-	-79,779,925.23	154,189,154.77
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	209,969,080.00	-	1,556,254.20	211,525,334.20
二、本期期初净资产	209,969,080.00	-	1,556,254.20	211,525,334.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	20,000,000.00	-	-28,933,767.23	-8,933,767.23
（一）、综合收益总额	-	-	-28,941,738.62	-28,941,738.62
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	20,000,000.00	-	7,971.39	20,007,971.39
其中：1.基金申购款	24,000,000.00	-	261,990.71	24,261,990.71
2.基金赎回款	-4,000,000.00	-	-254,019.32	-4,254,019.32
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	229,969,080.00	-	-27,377,513.03	202,591,566.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王琼慧，主管会计工作负责人：王敏，会计机构负责人：俞文涵

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金(原名为上投摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金，以下简称“本基金”)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[2020]3654 号《关于准予上投摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》和机构部函[2021]3561 号《关于上投摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金延期募集备案的回函》准予注册，由摩根基金管理(中国)有限公司(原上投摩根基金管理有限公司，已于 2023 年 4 月 10 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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 208,969,080.00 元(含募集股票市值)，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(2022)第 0351 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2022 年 5 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 208,969,080.00 份基金份额，无有效认购资金产生的利息折份额。本基金的基金管理人为摩根基金管理(中国)有限公司，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2022]149 号文核准同意，本基金 208,969,080.00 份基金份额于 2022 年 6 月 2 日在上交所挂牌交易。

根据摩根基金管理(中国)有限公司 2023 年 4 月 12 日发布的《关于公司法定名称变更的公告》，本基金管理人的中文法定名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理(中国)有限公司”。根据同一天发布的《摩根基金管理(中国)有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，上投摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金自该日起更名为摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资

基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为标的指数成份股及备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单以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相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股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 80%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证创新药产业指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人摩根基金管理(中国)有限公司于 2024 年 8 月 29 日批准报出。

#### 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》、《摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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

本基金 2024 年上半年度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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	987,316.07
等于：本金	987,180.51
加：应计利息	135.56
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	987,316.07

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	225,176,345.32	-	153,541,724.27	-71,634,621.05
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所		-		
	市场	-		-	-
	银行间		-		
	市场	-		-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		225,176,345.32	-	153,541,724.27	-71,634,621.05

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 6.4.7.5 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	41,799.20
其中：交易所市场	41,799.20
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	209,507.60
应付替代款	96,558.19
合计	347,864.99

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	235,969,080.00	235,969,080.00
本期申购	8,000,000.00	8,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-10,000,000.00	-10,000,000.00
本期末	233,969,080.00	233,969,080.00

### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,939,871.42	-28,218,108.04	-26,278,236.62
本期期初	1,939,871.42	-28,218,108.04	-26,278,236.62
本期利润	-9,812,197.57	-44,270,509.71	-54,082,707.28
本期基金份额交易产生的变动数	13,086.30	567,932.37	581,018.67
其中：基金申购款	-4,211.45	-2,137,922.23	-2,142,133.68
基金赎回款	17,297.75	2,705,854.60	2,723,152.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,859,239.85	-71,920,685.38	-79,779,925.23

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	259.74
其他	76.01
合计	1,495.88

### 6.4.7.10 股票投资收益

#### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	股票投资收益——买卖股票差价收入

股票投资收益——赎回差价收入	-1,044,567.64
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-10,982,042.30

**6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	23,630,325.24
减：卖出股票成本总额	33,508,212.12
减：交易费用	59,587.78
买卖股票差价收入	-9,937,474.66

**6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	7,276,847.65
减：现金支付赎回款总额	3,169,903.65
减：赎回股票成本总额	5,151,511.64
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,044,567.64

**6.4.7.11 债券投资收益**

无。

**6.4.7.12 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.13 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,553,957.60
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	1,553,957.60

**6.4.7.14 公允价值变动收益**



单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-44,270,509.71
——股票投资	-44,270,509.71
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-44,270,509.71

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	2,137.49
合计	2,137.49

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
合计	89,507.60

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信建投证券股份有限公司	基金托管人
摩根基金管理（中国）有限公司	基金管理人
摩根资产管理(亚太)有限公司	基金管理人的实际控制人摩根大通公司(JPMorgan Chase &Co.)控制的公司

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

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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	263,938.53	325,378.77
其中：支付销售机构的客户维护费	4,720.58	2,313.98
应支付基金管理人的净管理费	259,217.95	323,064.79

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3%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 X 0.3%/ 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	87,979.50	108,459.58

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.1%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 X 0.1% / 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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信建投证券	1,858,700.00	0.79%	1,210,300.00	0.51%
摩根资产管理(亚太)有限公司	200,000,000.00	85.48%	200,000,000.00	84.76%

**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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信建投证券	987,316.07	1,160.13	1,224,495.15	7,616.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中信建投证券保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 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

无。

##### 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

本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金采用完全复制法，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。本基金在日常经营活动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从事风险管理的主要目标是通过进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期或不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律，法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责建立并完善公司市场风险、流动性风险、信用风险管理框架，运用系统化分析工具对以上进行分析和识别，提升公司风险科技水平。运营风险管理部负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。投资准则管理部负责执行和管控投资准则，通过设立投资准则、事前管控、事后管控，保障基金投资运作符合法规、合同及公司内部要求。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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中信建投证券开立于交通银行股份有限公司北京三里河支行的托管专户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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。

### 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 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%。

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。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	987,316.07	-	-	-	987,316.07
结算备付金	10,593.28	-	-	-	10,593.28
存出保证金	8,610.02	-	-	-	8,610.02
交易性金融	-	-	-	153,541,724.27	153,541,724.27

资产					
应收清算款	-	-	-	42,236.99	42,236.99
资产总计	1,006,519.37			153,583,961.26	154,590,480.63
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	40,095.65	40,095.65
应付托管费	-	-	-	13,365.22	13,365.22
其他负债	-	-	-	347,864.99	347,864.99
负债总计	-	-	-	401,325.86	401,325.86
利率敏感度缺口	1,006,519.37			153,182,635.40	154,189,154.77
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	289,370.71	-	-	-	289,370.71
结算备付金	22,621.72	-	-	-	22,621.72
存出保证金	10,986.34	-	-	-	10,986.34
交易性金融资产	-	-	-	209,649,547.79	209,649,547.79
其他资产	-	-	-	11,686.20	11,686.20
资产总计	322,978.77			209,661,233.99	209,984,212.76
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	53,770.72	53,770.72
应付托管费	-	-	-	17,923.56	17,923.56
应交税费	-	-	-	1,026.94	1,026.94
其他负债	-	-	-	220,648.16	220,648.16
负债总计	-	-	-	293,369.38	293,369.38
利率敏感度缺口	322,978.77			209,367,864.61	209,690,843.38



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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 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动而发生波动的风险。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汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用完全复制法，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中标的指数成份股及其备选成份股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 80%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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	上年度末

	2024 年 6 月 30 日		2023 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	153,541,724.27	99.58	209,649,547.79	99.98
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	153,541,724.27	99.58	209,649,547.79	99.98

#### 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: 人民币万元)	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	增加约 770	增加约 1,044
	2.业绩比较基准下降 5%	减少约 770	减少约 1,044

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	153,541,724.27	209,649,547.79
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	153,541,724.27	209,649,547.79

### 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的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 2024 年 6 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(2023 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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	153,541,724.27	99.32
	其中：股票	153,541,724.27	99.32
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	997,909.35	0.65
8	其他各项资产	50,847.01	0.03
9	合计	154,590,480.63	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	119,163,143.85	77.28
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	9,237,066.00	5.99
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	25,141,514.42	16.31
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	153,541,724.27	99.58

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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

#### 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	占基金资产净值比例(%)
1	603259	药明康德	389,165.00	15,251,376.35	9.89
2	600276	恒瑞医药	391,360.00	15,051,705.60	9.76
3	002422	科伦药业	226,700.00	6,875,811.00	4.46
4	300122	智飞生物	241,950.00	6,781,858.50	4.40
5	000661	长春高新	65,400.00	6,001,758.00	3.89
6	600196	复星医药	257,300.00	5,696,622.00	3.69
7	300347	泰格医药	105,000.00	5,103,000.00	3.31
8	603392	万泰生物	76,919.00	5,067,423.72	3.29
9	000963	华东医药	177,400.00	4,933,494.00	3.20
10	601607	上海医药	225,200.00	4,303,572.00	2.79
11	600079	人福医药	231,101.00	3,968,004.17	2.57
12	300142	沃森生物	324,000.00	3,687,120.00	2.39
13	002007	华兰生物	221,900.00	3,503,801.00	2.27
14	300759	康龙化成	180,225.00	3,348,580.50	2.17
15	002821	凯莱英	48,300.00	3,178,140.00	2.06
16	000766	通化金马	195,400.00	3,163,526.00	2.05
17	688180	君实生物	108,149.00	3,141,728.45	2.04
18	002294	信立泰	112,400.00	2,993,212.00	1.94
19	688578	艾力斯	45,558.00	2,903,866.92	1.88

20	000513	丽珠集团	74,286.00	2,764,182.06	1.79
21	688235	百济神州	23,194.00	2,686,792.96	1.74
22	600380	健康元	226,500.00	2,530,005.00	1.64
23	600867	通化东宝	281,339.00	2,354,807.43	1.53
24	600535	天士力	181,400.00	2,282,012.00	1.48
25	300601	康泰生物	135,100.00	2,108,911.00	1.37
26	002653	海思科	67,400.00	2,069,180.00	1.34
27	688266	泽璟制药	37,554.00	2,036,177.88	1.32
28	300009	安科生物	236,600.00	2,020,564.00	1.31
29	002019	亿帆医药	148,300.00	1,832,988.00	1.19
30	688278	特宝生物	32,803.00	1,756,600.65	1.14
31	603858	步长制药	111,500.00	1,689,225.00	1.10
32	300558	贝达药业	50,600.00	1,647,030.00	1.07
33	002675	东诚药业	133,000.00	1,630,580.00	1.06
34	002773	康弘药业	74,100.00	1,604,265.00	1.04
35	002317	众生药业	137,600.00	1,572,768.00	1.02
36	688331	荣昌生物	35,750.00	1,544,400.00	1.00
37	600216	浙江医药	136,200.00	1,495,476.00	0.97
38	603456	九洲药业	108,800.00	1,492,736.00	0.97
39	688062	迈威生物	48,334.00	1,398,785.96	0.91
40	300357	我武生物	63,300.00	1,279,926.00	0.83
41	002020	京新药业	121,500.00	1,272,105.00	0.83
42	600267	海正药业	170,400.00	1,196,208.00	0.78
43	002038	双鹭药业	145,000.00	1,068,650.00	0.69
44	688520	神州细胞	26,933.00	1,059,813.55	0.69
45	603127	昭衍新药	76,336.00	1,012,978.72	0.66
46	688192	迪哲医药	25,231.00	929,510.04	0.60
47	300363	博腾股份	66,100.00	789,895.00	0.51
48	688177	百奥泰	25,043.00	528,908.16	0.34
49	688336	三生国健	24,868.00	506,063.80	0.33
50	688202	美迪西	16,337.00	425,578.85	0.28

### 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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

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	000661	长春高新	6,814,870.01	3.25

2	603259	药明康德	5,404,827.00	2.58
3	000766	通化金马	3,286,781.00	1.57
4	688062	迈威生物	1,586,896.63	0.76
5	002038	双鹭药业	1,140,542.00	0.54
6	002422	科伦药业	966,577.20	0.46
7	688336	三生国健	561,827.17	0.27
8	300122	智飞生物	412,405.00	0.20
9	600380	健康元	264,409.00	0.13
10	000963	华东医药	251,523.00	0.12
11	300347	泰格医药	233,484.00	0.11
12	300142	沃森生物	218,948.00	0.10
13	688180	君实生物	199,404.08	0.10
14	002007	华兰生物	174,869.00	0.08
15	600276	恒瑞医药	167,853.00	0.08
16	300759	康龙化成	159,071.00	0.08
17	688266	泽璟制药	153,747.63	0.07
18	002821	凯莱英	151,675.00	0.07
19	002294	信立泰	128,624.00	0.06
20	300601	康泰生物	112,421.00	0.05

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600276	恒瑞医药	3,221,218.00	1.54
2	002422	科伦药业	2,209,764.00	1.05
3	002099	海翔药业	1,513,056.00	0.72
4	300122	智飞生物	1,277,495.40	0.61
5	300725	药石科技	1,110,679.00	0.53
6	300347	泰格医药	902,178.00	0.43
7	000963	华东医药	844,477.00	0.40
8	300142	沃森生物	668,883.00	0.32
9	600196	复星医药	632,397.00	0.30
10	688131	皓元医药	617,906.13	0.29
11	002007	华兰生物	590,811.00	0.28
12	002821	凯莱英	552,992.00	0.26
13	603392	万泰生物	544,272.00	0.26
14	300759	康龙化成	529,371.00	0.25
15	688185	康希诺	505,229.50	0.24

16	002294	信立泰	473,453.00	0.23
17	600079	人福医药	452,233.00	0.22
18	601607	上海医药	426,116.00	0.20
19	000513	丽珠集团	420,851.20	0.20
20	300601	康泰生物	376,270.00	0.18

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	23,668,433.95
卖出股票的收入（成交）总额	23,630,325.24

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。



## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 报告期内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。

7.13.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 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	8,610.02
2	应收清算款	42,236.99
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,847.01

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## 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
805	290,644.82	209,102,170.00	89.37%	24,866,910.00	10.63%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	摩根资产管理（亚太）有限公司—自有资金（R）	200,000,000.00	85.48%
2	招商证券股份有限公司	4,193,400.00	1.79%
3	广发证券股份有限公司	2,300,070.00	0.98%
4	中信建投证券股份有限公司	1,858,700.00	0.79%
5	乔军	1,400,000.00	0.60%
6	栗新宏	1,000,000.00	0.43%
7	谢盛沛	893,700.00	0.38%
8	华泰证券股份有限公司	750,000.00	0.32%
9	王先基	730,000.00	0.31%
10	陈晓敬	697,300.00	0.30%

### 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的情况

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

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 5 月 19 日）基金份额总额	208,969,080.00
本报告期期初基金份额总额	235,969,080.00
本报告期基金总申购份额	8,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	10,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	233,969,080.00

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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

基金管理人：

基金管理人于 2024 年 1 月 18 日公告，自 2024 年 1 月 18 日起，刘富伟先生担任公司副总经理。

基金托管人：

本报告期内，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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

### 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

报告期内，管理人未受稽查或处罚，亦未发现管理人的高级管理人员受稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其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	
国盛证券	5	47,298,759.19	100.00%	44,739.97	100.00%	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 交易单元的选择标准：

- 1) 资本金雄厚,信誉良好。
- 2) 财务状况良好,经营行为规范。
- 3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需,并能为本基金提供全面的信息服。

5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序：

1) 本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估，确定选用交易单元的券商。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

4. 本基金本期无新增席位，无注销席位。

**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	
	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
国盛证券	-	-	-	-	-	-

**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	摩根基金管理(中国)有限公司关于高级管理	基金管理人公司网站及	2024-01-18

	人员变更的公告	本基金选定的信息披露报纸	
--	---------	--------------	--

## 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	20240101-20240630	200,000,000.00	0.00	0.00	200,000,000.00	85.48%
产品特有风险							
本基金的集中度风险主要体现在有单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%，如果投资者发生大额赎回，可能出现基金可变现资产无法满足投资者赎回需要以及因为资产变现成本过高导致投资者的利益受到损害的风险。							

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会准予本基金募集注册的文件
- (二)摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (三)摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (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
- (七)摩根基金管理（中国）有限公司开放式基金业务规则
- (八)中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

摩根基金管理（中国）有限公司

二〇二四年八月三十日