

交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型 证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 01 月 01 日起至 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
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合规守信情况的说明	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	12
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合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	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	39
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	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	44
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	44

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	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	48
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	48
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
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	交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金	
基金简称	交银恒生港股通创新药精选指数	
基金主代码	024926	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 8 月 20 日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	266,527,646.83 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银恒生港股通创新药精选指数 A	交银恒生港股通创新药精选指数 C
下属分级基金的交易代码	024926	024927
报告期末下属分级基金的份额总额	186,552,762.82 份	79,974,884.01 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪恒生港股通创新药精选指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。在正常市场情况下，力争控制本基金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%。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。 当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	恒生港股通创新药精选指数收益率（经估值汇率调整） $\times$ 95%+人民币银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，其预期风险和预期收益理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪恒生港股通创新药精选指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	交银施罗德基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	王晚婷	任航
	联系电话	(021) 61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95599
传真		(021) 61055054	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层（裙）	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-23楼	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		袁庆伟	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.fund001.com
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	交银施罗德基金管理有限公司	上海浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-23楼

§ 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(2026年1月1日-2026年6月30日)	
	交银恒生港股通创新药精选指数 A	交银恒生港股通创新药精选指数 C
本期已实现收益	-3,553,754.58	-1,347,134.92
本期利润	-30,836,587.29	-12,523,399.48
加权平均基金份额 本期利润	-0.1627	-0.1796
本期加权平均净 值利润率	-18.95%	-21.09%
本期基金份额净 值增长率	-18.22%	-18.30%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026年6月30日)	

期末可供分配利润	-52,547,286.00	-22,626,349.18
期末可供分配基金份额利润	-0.2817	-0.2829
期末基金资产净值	134,005,476.82	57,348,534.83
期末基金份额净值	0.7183	0.7171
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-28.17%	-28.29%

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，计入费用后的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

交银恒生港股通创新药精选指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-18.64%	2.10%	-19.75%	2.15%	1.11%	-0.05%
过去六个月	-18.22%	2.13%	-19.01%	2.19%	0.79%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-28.17%	1.71%	-35.10%	2.13%	6.93%	-0.42%

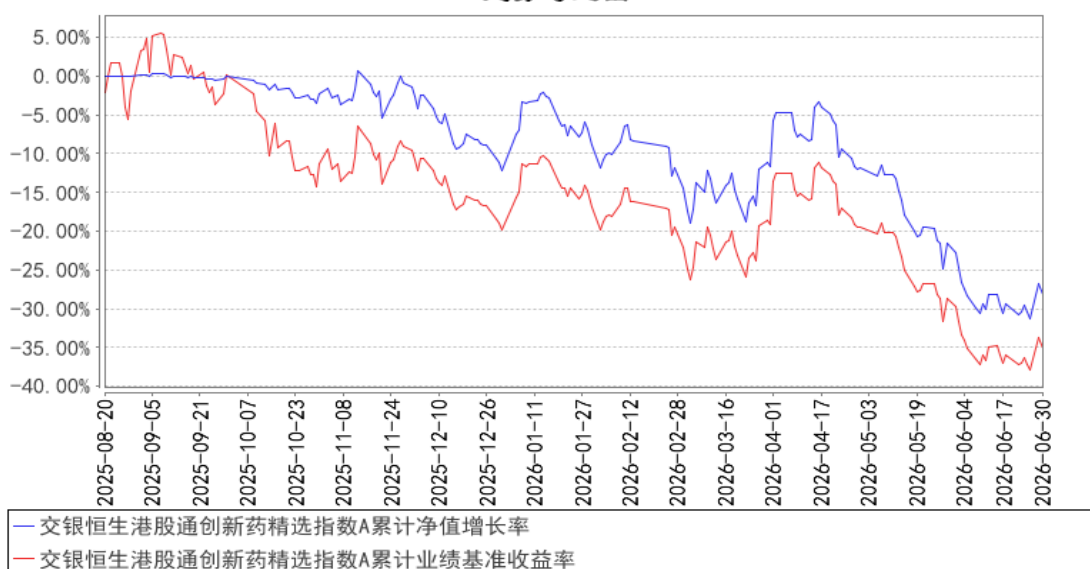
交银恒生港股通创新药精选指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-18.68%	2.10%	-19.75%	2.15%	1.07%	-0.05%
过去六个月	-18.30%	2.13%	-19.01%	2.19%	0.71%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-28.29%	1.71%	-35.10%	2.13%	6.81%	-0.42%

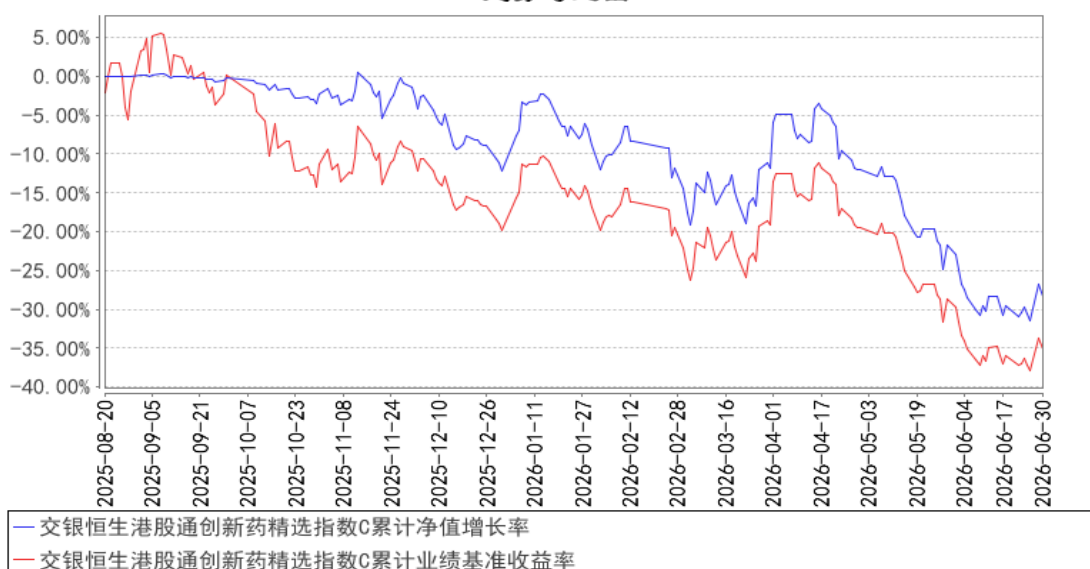
注：本基金的业绩比较基准为恒生港股通创新药精选指数收益率（经估值汇率调整）×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%，每日进行再平衡过程。

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

交银恒生港股通创新药精选指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



交银恒生港股通创新药精选指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2025 年 8 月 20 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§ 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

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行

股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65% 的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30% 的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5% 的股份。公司并下设交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、混合型和股票型在内的 148 只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII 等不同类型基金。

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		
邵文婷	基金经理、多资产研究部副总监	2025 年 8 月 20 日	—	10 年	硕士。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任量化投资部研究员/投资经理。

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告（如适用）之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

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》、其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循公平交易分配原则对交易结果进行分配。

公司中央交易室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，于每季度和每年度分别对公司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以及不同时间窗口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。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

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，本公司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总成交量 5% 的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差未出现异常。

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

2026 年上半年，国内经济延续修复态势但弹性有限，财政政策超预期发力对冲货币政策的审慎转向，市场在内生修复与外部扰动间寻求平衡。上半年制造业景气度先抑后稳：1 月受淡季效应和需求不足影响，PMI 回落至荣枯线下；2 月春节假期压缩生产节奏，PMI 进一步收缩至 49.0%；3-6 月景气企稳，制造业 PMI 在荣枯线附近窄幅波动，但整体扩张力度有限。非制造业景气度波折回升：3 月服务业随春节消费回暖呈现季节性走强，带动非制造业商务活动指数重返扩张区间；4 月受季节性因素影响商务活动指数一度回落至 49.4% 的年内低点；5 月、6 月逐月改善，连续回升至扩张区间。资金层面，上半年南向资金维持净流入，但流入态势放缓，二季度仅累计净流入 701 亿人民币，为近 10 个季度最低水平。一季度美联储暂停降息，其中 3 月议息会议整体表态偏鹰，降息预期进一步降温；二季度议息会议延续偏鹰立场，4 月维持利率不变，但内部分歧加大；6 月全票赞成通过“维持联邦基金利率 3.50%-3.75%”的利率决议、并利用前瞻指引，年内利率预期由“降息”翻转为“加息”。

上半年创新药板块的核心事件主要集中在商业化加速、外部环境博弈与政策预期等维度：根据国家药监局数据，上半年我国创新药对外 BD 交易合计 81 笔，潜在交易总额 1100 亿美元，达到 2025 年全年 BD 总额的 80%，创历史新高；板块 4 月下旬至 5 月因美国 BD 禁令传闻扰动；6 月底国家医保局公布新一批通过初步形式审查的药品名单后，市场博弈焦点从外部风险转向国内支付政策落地。拥有核心品种入围的创新药企，其商业化预期得到强化，带动板块情绪逐步企稳，并推动了盈利确定性较强的个股率先修复估值。

回顾上半年市场行情，A 股在科技产业链业绩兑现驱动下震荡上行，期间上证指数上涨 3.2%，科创 50 大涨 64%；港股市场则受到外部流动性收紧预期、内地经济复苏节奏波折以及地缘政治不确定性等多重因素压制，呈现震荡调整态势，恒生指数、恒生科技分别下跌 10.7%、18.9%，创新药板块亦震荡走弱，仅阶段性存在脉冲行情。具体来看，年初市场博弈创新药政策宽松预期，叠加年报、一季报减亏预期升温，信达生物、荣昌生物等扭亏标的获资金持续布局。3 月 ASCO 年会前瞻催化升温，多款国产 ADC、双抗管线进入关键临床数据披露节点，板块震荡走强。4 月中下旬至 5 月中旬，受美联储降息预期反复及生物安全法案相关传闻扰动，板块风险偏好急剧收缩，前期涨幅较大的个股遭遇获利回吐，港股医药板块大幅回调。5 月下旬随着相关法案推进明朗化、部分龙头药企核心管线注册性临床达预期，以及国家医保局连续释放创新药多元支付机制积极信号，板块情绪逐步企稳修复。6 月进入业绩前瞻窗口，市场博弈半年报减亏逻辑，康方生物、科伦博泰等双抗/ADC 龙头凭借重磅品种放量预期领涨，板块呈现结构性行情，盈利确定性较强的标的率先收复前期跌幅。作为跟踪基准指数的指数基金，本基金上半年总体呈现波动下行态势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

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 2026 年下半年，创新药板块有望迎来关键转折，核心驱动力将从前期的政策预期博弈切换至业绩与估值的双重验证。中东地缘风险阶段性缓和，市场不确定性的主要来源由地缘政治切换至货币政策路径。年内加息预期是否会兑现，将是下半年全球资产定价的核心变量，市场需在“基本面韧性”与“流动性收紧预期”之间重新寻找平衡。从宏观政策看，国内政策执行已进入深水区，财政发力的方向性判断得到验证；经济基本面企稳向好的方向预计延续，但弹性仍待观察。往后可重点关注下半年专项债与特别国债剩余额度的发行节奏，以及总量货币宽松情况。产业政策方面，“未来产业”已从顶层设计加速进入中观执行：人工智能领域“人工智能+”行动配套文件持续落地，制造、医疗、能源等十余个行业专项指导文件相继推出并布局应用中试基地；具身智能、脑机接口加速产业化；6G 通信被纳入“六网”中的“新一代通信网”统筹规划。前沿领域政策已从方向性部署转向行业细则与地方配套，为下半年科技成长主线的持续性提供支撑。展望后市，三季度进入中报披露期，科技成长主线仍是业绩与主题共振较强的方向，预计将维持主导；顺周期有望受益于财政拨付加快，但业绩验证尚不及科技链，配置宜审慎；消费修复存在阶段性机会但弹性有限。

对于创新药板块，下半年将密集落地多项重磅催化剂：医保谈判进入实质性定价阶段，有望

消除支付端的不确定性；中报季将集中检验头部药企盈利修复的可持续性；而 9 月即将召开的 ESMO 大会则有望再次点燃市场对国产双抗/ADC 管线的价值重估热情。在出海 BD 持续高景气与国内政策环境不断优化的背景下，板块有望演绎出趋势性的估值修复行情，但考虑到外部地缘扰动与港股流动性仍存变数，反弹将更多体现为盈利确定性强的龙头个股的结构性机会。总体而言，从中长期来看，我们对港股创新药板块维持谨慎乐观的看法。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、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。保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。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。

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及应用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人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，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 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：交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,595,978.34	12,907,882.98
结算备付金		-	4,600,491.92
存出保证金		5,544.31	378.48
交易性金融资产	6.4.7.2	189,191,477.68	199,009,632.65
其中：股票投资		178,283,118.17	195,991,542.24
基金投资		-	-
债券投资		10,908,359.51	3,018,090.41
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		2,033,242.23	-
应收股利		622,595.80	-
应收申购款		629,538.23	459,324.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		196,078,376.59	216,977,710.25

负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
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		-	86.79
应付赎回款		4,537,146.45	1,605,846.07
应付管理人报酬		79,529.51	98,021.02
应付托管费		15,905.92	19,604.18
应付销售服务费		9,414.04	10,158.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		329.39	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	82,039.63	117,441.15
负债合计		4,724,364.94	1,851,157.52
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	266,527,646.83	244,976,537.03
未分配利润	6.4.7.12	-75,173,635.18	-29,849,984.30
净资产合计		191,354,011.65	215,126,552.73
负债和净资产总计		196,078,376.59	216,977,710.25

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 266,527,646.83 份，其中交银恒生港股通创新药精选指数 A 基金份额总额 186,552,762.82 份，基金份额净值 0.7183 元；交银恒生港股通创新药精选指数 C 基金份额总额 79,974,884.01 份，基金份额净值 0.7171 元。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-42,556,738.29
1. 利息收入		26,816.27
其中：存款利息收入	6.4.7.13	26,816.27
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）		-4,161,944.83

其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,914,656.17
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	46,824.85
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	705,886.49
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-38,459,097.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	37,487.54
减：二、营业总支出		803,248.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	552,594.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	110,518.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	58,958.36
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		96.23
其中：卖出回购金融资产支出		96.23
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		98.30
8. 其他费用	6.4.7.23	80,982.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-43,359,986.77
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-43,359,986.77
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-43,359,986.77

6.3 净资产变动表

会计主体：交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	244,976,537.03	-	-29,849,984.30	215,126,552.73

二、本期期初净资产	244,976,537.03	-	-29,849,984.30	215,126,552.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	21,551,109.80	-	-45,323,650.88	-23,772,541.08
(一)、综合收益总额	-	-	-43,359,986.77	-43,359,986.77
(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)	21,551,109.80	-	-1,963,664.11	19,587,445.69
其中：1. 基金申购款	149,011,869.62	-	-19,038,850.64	129,973,018.98
2. 基金赎回款	- 127,460,759.82	-	17,075,186.53	-110,385,573.29
(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	266,527,646.83	-	-75,173,635.18	191,354,011.65

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：

<u>袁庆伟</u>	<u>周云康</u>	<u>许颖</u>
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

交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金(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[2025]1374号《关于准予交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金注册的批复》准予注册，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，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 264,995,505.11 元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报

(验)字(25)第 00243 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金基金合同》于 2025 年 8 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 265,063,973.30 份基金份额,其中认购资金利息折合 68,468.19 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购、赎回时收取认购/申购、赎回费用且不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用,并从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德恒生港股通创新药精选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,包括恒生港股通创新药精选指数的成份股(含存托凭证)及备选成份股(含存托凭证)、其他股票(含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指期货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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下,本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:本基金投资于恒生港股通创新药精选指数成份股(含存托凭证)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%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:恒生港股通创新药精选指数收益率(经估值汇率调整)×95%+人民币银行活期存款利率(税后)×5%

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2026 年 8 月 28 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”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集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》以及参考本基金的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其允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	3,595,978.34
等于：本金	3,595,503.08
加：应计利息	475.26
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,595,978.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		246,881,229.87	-	178,283,118.17	- 68,598,111.70
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	10,805,731.00	101,339.51	10,908,359.51	1,289.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	10,805,731.00	101,339.51	10,908,359.51	1,289.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		257,686,960.87	101,339.51	189,191,477.68	- 68,596,822.70

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。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	12,615.27
其中：交易所市场	12,615.27
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	9,916.99
预提信息披露费	59,507.37
合计	82,039.63

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

交银恒生港股通创新药精选指数 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	181,786,745.71	181,786,745.71
本期申购	80,205,727.17	80,205,727.17
本期赎回（以“-”号填列）	-75,439,710.06	-75,439,710.06
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	186,552,762.82	186,552,762.82

交银恒生港股通创新药精选指数 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,189,791.32	63,189,791.32
本期申购	68,806,142.45	68,806,142.45
本期赎回（以“-”号填列）	-52,021,049.76	-52,021,049.76
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	79,974,884.01	79,974,884.01

注：1、如果本报告期间发生红利再投、转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

交银恒生港股通创新药精选指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-216,550.71	-21,903,574.66	-22,120,125.37
本期期初	-216,550.71	-21,903,574.66	-22,120,125.37
本期利润	-3,553,754.58	-27,282,832.71	-30,836,587.29
本期基金份额交易产生的变动数	19,075.23	390,351.43	409,426.66
其中：基金申购款	-797,340.66	-8,243,478.26	-9,040,818.92
基金赎回款	816,415.89	8,633,829.69	9,450,245.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,751,230.06	-48,796,055.94	-52,547,286.00

交银恒生港股通创新药精选指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-120,588.72	-7,609,270.21	-7,729,858.93
本期期初	-120,588.72	-7,609,270.21	-7,729,858.93
本期利润	-1,347,134.92	-11,176,264.56	-12,523,399.48
本期基金份额交易产生的变动数	-264,299.72	-2,108,791.05	-2,373,090.77
其中：基金申购款	-990,722.83	-9,007,308.89	-9,998,031.72
基金赎回款	726,423.11	6,898,517.84	7,624,940.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,732,023.36	-20,894,325.82	-22,626,349.18

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	24,654.07
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	1,287.60
其他	874.60
合计	26,816.27

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,914,656.17
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	-4,914,656.17

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	37,886,681.00
减：卖出股票成本总额	42,660,149.14
减：交易费用	141,188.03
买卖股票差价收入	-4,914,656.17

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	46,320.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	504.00
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	46,824.85

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,516,939.21
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,500,030.00
减：应计利息总额	16,405.21
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	504.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	705,886.49
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	705,886.49

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-38,459,097.27
股票投资	-38,458,436.27
债券投资	-661.00
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	-38,459,097.27

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	37,487.54
合计	37,487.54

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的赎回费收入包括转换费收入，其中转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	3,109.32
其他	8,448.63
合计	80,982.31

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、关联关系

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

本报告期内上海直源投资管理有限公司已完成工商注销登记。

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
交银施罗德基金管理有限公司（“交银施罗德基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金管理人的股东、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 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	552,594.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	259,218.69
应支付基金管理人的净管理费	293,375.68

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%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×适用费率÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	110,518.91

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×适用费率÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银恒生港股通创新 药精选指数 A	交银恒生港股通创新 药精选指数 C	合计
交通银行股份有限公司	-	8,245.83	8,245.83
交银施罗德基金管理有 限公司	-	547.48	547.48
合计	-	8,793.31	8,793.31

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日该类基金份额对应的基金资产净值约定的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

交银恒生港股通创新药精选指数 A 类份额日基金销售服务费 = 前一日交银恒生港股通创新药精选指数 A 类基金份额对应的资产净值 $\times 0.00\% \div$ 当年天数；

交银恒生港股通创新药精选指数 C 类份额日基金销售服务费 = 前一日交银恒生港股通创新药精选指数 C 类基金份额对应的资产净值 $\times 0.20\% \div$ 当年天数。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行_活期存款	3,595,978.34	24,654.07

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，存款利率参考银行同业利率及银行存款利率确定。

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（2026 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
02627 HK	中慧生物-B	2026 年 04 月 01 日	重大事项停牌	25.47	-	-	4,600	233,653.25	117,143.08	-
02629 HK	MIRXES-B	2026 年 04 月 01 日	重大事项停牌	10.78	-	-	8,700	467,723.30	93,774.74	-

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

本基金为指数型基金，且为股票型基金，其预期风险和预期收益理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括恒生港股通创新药精选指数的成份股（含存托凭证）及备选成份股（含存托凭证）、其他股票（含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、

定期存款及其他银行存款)、股指期货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)。本基金主要采用完全复制法跟踪恒生港股通创新药精选指数,即按照恒生港股通创新药精选指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金投资港股通标的股票,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、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成份股流动性不足时,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,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,在董事会下设立合规风险及审计委员会,负责对公司经营管理及基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估;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风险管理部负责协调并与各部门合作完成基金运作的风险管理。督察长直接对董事会负责,就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能,定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规风险及审计委员会为核心的,由督察长、风险控制委员会、风险管理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。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,及时对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应措施,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行或其他国内大中型商业银行,按银行同业利率计息,与该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,因此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。

本期末及上年度末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券，因此信用风险对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

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

无。

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随时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。

于报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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公司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该比例限制）。

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%。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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货币资金、结算备付金、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 2026 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	3,595,978.34	-	-	-	3,595,978.34
存出保证金	5,544.31	-	-	-	5,544.31
交易性金融资产	10,908,359.51	-	-	178,283,118.17	189,191,477.68
应收股利	-	-	-	622,595.80	622,595.80
应收申购款	2,260.00	-	-	627,278.23	629,538.23
应收清算款	-	-	-	2,033,242.23	2,033,242.23
资产总计	14,512,142.16	-	-	181,566,234.43	196,078,376.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,537,146.45	4,537,146.45
应付管理人报酬	-	-	-	79,529.51	79,529.51
应付托管费	-	-	-	15,905.92	15,905.92
应付销售服务费	-	-	-	9,414.04	9,414.04
应交税费	-	-	-	329.39	329.39
其他负债	-	-	-	82,039.63	82,039.63
负债总计	-	-	-	4,724,364.94	4,724,364.94
利率敏感度缺口	14,512,142.16	-	-	176,841,869.49	191,354,011.65
上年度末 2025 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	12,907,882.98	-	-	-	12,907,882.98
结算备付金	4,600,491.92	-	-	-	4,600,491.92
存出保证金	378.48	-	-	-	378.48
交易性金融资产	3,018,090.41	-	-	195,991,542.24	199,009,632.65
应收申购款	4,501.00	-	-	454,823.22	459,324.22
资产总计	20,531,344.79	-	-	196,446,365.46	216,977,710.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,605,846.07	1,605,846.07
应付管理人报酬	-	-	-	98,021.02	98,021.02

应付托管费	-	-	-	19,604.18	19,604.18
应付清算款	-	-	-	86.79	86.79
应付销售服务费	-	-	-	10,158.31	10,158.31
其他负债	-	-	-	117,441.15	117,441.15
负债总计	-	-	-	1,851,157.52	1,851,157.52
利率敏感度缺口	20,531,344.79	-	-	-194,595,207.94	215,126,552.73

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予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末持有的交易性债券投资比例较低，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	178,283,118.17	-	178,283,118.17
应收股利	-	622,595.80	-	622,595.80
资产合计	-	178,905,713.97	-	178,905,713.97
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	178,905,713.97	-	178,905,713.97
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计

以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	195,991,542.24	-	195,991,542.24
资产合计	-	195,991,542.24	-	195,991,542.24
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	195,991,542.24	-	195,991,542.24

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	8,945,285.70	9,799,577.11
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-8,945,285.70	-9,799,577.11

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。

本基金绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照恒生港股通创新药精选指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、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成份股流动性不足时，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，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于恒生港股通创新药精选指数成份股（含存托凭证）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%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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、应收申购款等。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，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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	178,283,118.17	93.17	195,991,542.24	91.11
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	178,283,118.17	93.17	195,991,542.24	91.11

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 06 月 30 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于其他价格风险的敏感性作定量分析。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	178,283,118.17	195,991,542.24
第二层次	10,908,359.51	3,018,090.41
第三层次	-	-
合计	189,191,477.68	199,009,632.65

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。对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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	178,283,118.17	90.92
	其中：股票	178,283,118.17	90.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,908,359.51	5.56
	其中：债券	10,908,359.51	5.56
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,595,978.34	1.83
8	其他各项资产	3,290,920.57	1.68
9	合计	196,078,376.59	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 178,283,118.17 元，占基金资产净值比例为 93.17%。

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

无。

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

无。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
医药卫生	178,283,118.17	93.17
合计	178,283,118.17	93.17

注：本报告采用中证 CICS 一级分类标准编制。

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	01801 HK	信达生物	296,000	20,464,427.68	10.69
2	06160 HK	百济神州	135,700	20,083,724.84	10.50
3	09926 HK	康方生物	221,000	16,901,157.88	8.83
4	01093 HK	石药集团	2,588,000	15,667,217.58	8.19
5	01177 HK	中国生物制药	3,397,000	13,011,547.78	6.80
6	03692 HK	翰森制药	494,000	12,708,866.79	6.64
7	01530 HK	三生制药	653,500	9,586,720.51	5.01
8	06990	科伦博泰生物	21,500	8,145,522.47	4.26

	HK				
9	09688 HK	再鼎医药	379,100	4,761,205.23	2.49
10	02162 HK	康诺亚-B	73,500	4,516,568.57	2.36
11	09969 HK	诺诚健华	394,000	4,058,595.18	2.12
12	00867 HK	康哲药业	449,000	4,008,983.61	2.10
13	09995 HK	荣昌生物	61,000	3,936,529.17	2.06
14	09606 HK	映恩生物-B	23,600	3,714,197.74	1.94
15	01276 HK	恒瑞医药	68,600	3,446,849.36	1.80
16	03933 HK	联邦制药	390,000	2,855,531.84	1.49
17	06855 HK	亚盛医药	98,600	2,843,215.80	1.49
18	00013 HK	和黄医药	187,500	2,732,675.44	1.43
19	02096 HK	先声药业	308,000	2,635,006.99	1.38
20	03320 HK	华润医药	622,500	2,292,450.87	1.20
21	00512 HK	远大医药	529,500	2,161,516.96	1.13
22	02196 HK	复星医药	162,000	2,126,054.06	1.11
23	01952 HK	云顶新耀	94,500	2,010,910.39	1.05
24	02171 HK	科济药业-B	123,000	1,523,419.33	0.80
25	02186 HK	绿叶制药	932,000	1,457,079.48	0.76
26	02157 HK	乐普生物	328,000	1,108,200.32	0.58
27	01877 HK	君实生物	72,000	1,041,217.74	0.54
28	01513 HK	丽珠医药	49,200	1,020,455.92	0.53
29	00460 HK	四环医药	1,391,000	1,002,767.03	0.52
30	03696	英矽智能	27,500	946,328.65	0.49

	HK				
31	01681 HK	康臣药业	85,000	928,740.52	0.49
32	06185 HK	康希诺生物	33,200	642,462.96	0.34
33	02595 HK	劲方医药-B	22,600	577,884.53	0.30
34	02315 HK	百奥赛图-B	11,500	466,854.31	0.24
35	09887 HK	维立志博-B	10,200	436,936.24	0.23
36	02410 HK	同源康医药-B	80,500	400,631.72	0.21
37	02637 HK	海西新药	2,050	320,494.95	0.17
38	02005 HK	石四药集团	164,000	301,977.46	0.16
39	02575 HK	轩竹生物-B	21,000	243,133.20	0.13
40	06955 HK	博安生物	50,600	205,679.59	0.11
41	02659 HK	宝济药业-B	10,000	156,339.00	0.08
42	02652 HK	长风药业(一百)	7,500	136,796.63	0.07
43	00719 HK	山东新华制药股份	28,000	135,215.86	0.07
44	09989 HK	海普瑞	34,000	119,008.72	0.06
45	02627 HK	中慧生物-B	4,600	117,143.08	0.06
46	02629 HK	MIRXES-B	8,700	93,774.74	0.05
47	01349 HK	复旦张江	43,000	88,513.93	0.05
48	02591 HK	银诺医药-B	11,200	68,969.82	0.04
49	02617 HK	药捷安康-B	6,000	60,190.52	0.03
50	02565 HK	派格生物医药-B	2,900	13,425.18	0.01

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

无。

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	09926 HK	康方生物	10,595,603.73	4.93
2	01801 HK	信达生物	5,776,872.50	2.69
3	03692 HK	翰森制药	4,636,098.06	2.16
4	09606 HK	映恩生物-B	4,614,398.25	2.14
5	01177 HK	中国生物制药	3,870,533.91	1.80
6	06160 HK	百济神州	3,637,877.01	1.69
7	01093 HK	石药集团	3,631,193.89	1.69
8	02171 HK	科济药业-B	2,050,630.15	0.95
9	01530 HK	三生制药	1,919,932.89	0.89
10	03696 HK	英矽智能	1,621,627.17	0.75
11	01681 HK	康臣药业	1,324,443.39	0.62
12	02096 HK	先声药业	1,073,167.50	0.50
13	06990 HK	科伦博泰生物	1,014,165.24	0.47
14	09688 HK	再鼎医药	1,005,999.69	0.47
15	03933 HK	联邦制药	988,044.49	0.46
16	02575 HK	轩竹生物-B	965,283.14	0.45
17	01276 HK	恒瑞医药	945,696.03	0.44
18	02659 HK	宝济药业-B	927,137.03	0.43
19	00460 HK	四环医药	827,370.73	0.38
20	02410	同源康医药-	764,569.41	0.36

	HK	B		
--	----	---	--	--

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（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	09926 HK	康方生物	7,124,972.85	3.31
2	06160 HK	百济神州	4,618,968.79	2.15
3	01093 HK	石药集团	3,771,129.02	1.75
4	01801 HK	信达生物	3,400,806.89	1.58
5	01177 HK	中国生物制药	3,283,519.36	1.53
6	03692 HK	翰森制药	2,816,872.43	1.31
7	01530 HK	三生制药	2,021,096.48	0.94
8	06990 HK	科伦博泰生物	1,134,311.09	0.53
9	09688 HK	再鼎医药	1,046,491.51	0.49
10	00867 HK	康哲药业	870,805.77	0.40
11	09995 HK	荣昌生物	746,218.05	0.35
12	09969 HK	诺诚健华	673,805.34	0.31
13	06855 HK	亚盛医药	627,346.87	0.29
14	02162 HK	康诺亚-B	607,412.51	0.28
15	00013 HK	和黄医药	557,501.23	0.26
16	02096 HK	先声药业	510,485.95	0.24
17	03320 HK	华润医药	485,515.86	0.23
18	00512 HK	远大医药	468,676.59	0.22

19	03933 HK	联邦制药	431,477.66	0.20
20	01952 HK	云顶新耀	401,271.20	0.19

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（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	63,410,161.34
卖出股票收入（成交）总额	37,886,681.00

注：“买入股票成本”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

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	10,908,359.51	5.70
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	10,908,359.51	5.70

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	019792	25 国债 19	65,000	6,568,200.14	3.43
2	019827	26 国债 01	23,000	2,314,908.41	1.21
3	019785	25 国债 13	20,000	2,025,250.96	1.06

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

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，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	5,544.31
2	应收清算款	2,033,242.23
3	应收股利	622,595.80
4	应收利息	—
5	应收申购款	629,538.23
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,290,920.57

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

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
交银恒生港股通创新药精选指数 A	1,480	126,049.16	2,110,860.78	1.13	184,441,902.04	98.87
交银恒生港股通创新药精选指数 C	2,928	27,313.83	5,008,433.69	6.26	74,966,450.32	93.74
合计	4,408	60,464.53	7,119,294.47	2.67	259,408,352.36	97.33

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	交银恒生港股通创新药精选指数 A	76,051.45	0.04
	交银恒生港股通创新药精选指数 C	2,113.27	0.00
	合计	78,164.72	0.03

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

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银恒生港股通创新药精选指数 A	交银恒生港股通创新药精选指数 C
基金合同生效日 (2025 年 8 月 20 日) 基金份额总额	184,912,255.25	80,151,718.05
本报告期期初基金份额总额	181,786,745.71	63,189,791.32
本报告期基金总申购份额	80,205,727.17	68,806,142.45
减: 本报告期基金总赎回份额	75,439,710.06	52,021,049.76
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	186,552,762.82	79,974,884.01

注: 1、如果本报告期间发生转换入、份额类别调整、红利再投业务, 则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换出、份额类别调整业务, 则总赎回份额中包含该业务。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本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

- 1、基金管理人的重大人事变动: 本报告期内, 张宏良先生不再担任公司董事长(法定代表人), 由公司总经理袁庆伟女士代为履行公司董事长(法定代表人)职责。
- 2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动: 本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内, 经履行适当程序, 本基金聘请容诚会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金托管人受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
中信证券	3	101,296,842.34	100.00	25,324.32	100.00	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	10,807,645.00	100.00	2,500,000.00	100.00	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

2、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

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	交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 1 月 21 日
2	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金于 2026 年非港股通交易日暂停基金交易业务的提示性公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 2 月 14 日
3	交银施罗德基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年）	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 3 月 28 日
4	交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 3 月 28 日
5	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 3 月 31 日
6	交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 4 月 21 日
7	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 5 月 21 日
8	交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 6 月 12 日
9	交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 6 月 12 日
10	交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 6 月 12 日
11	交银施罗德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 6 月 13 日
12	交银施罗德基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒体及	2026 年 6 月 30 日

	旗下部分基金非港股通交易日暂停 申购、赎回等业务安排的公告	公司网站	
--	----------------------------------	------	--

§ 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

无。

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、中国证监会准予交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内交银施罗德恒生港股通创新药精选指数型证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。