

**广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金  
2022 年年度报告  
2022 年 12 月 31 日**

基金管理人：广发基金管理有限公司  
基金托管人：中国银行股份有限公司  
送出日期：二〇二三年三月三十日

## §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。本年度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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 27 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§4 管理人报告</b>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
<b>§5 托管人报告</b>	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§6 审计报告</b>	15
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	15
6.3 其他信息	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	16
<b>§7 年度财务报表</b>	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
<b>§8 投资组合报告</b>	120
8.1 期末基金资产组合情况	120
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	121
8.3 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	122

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	130
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	131
8.6 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 .....	132
8.7 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 .....	132
8.8 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 .....	132
8.9 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 .....	132
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	132
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	132
8.12 投资组合报告附注 .....	133
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>134</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	134
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	134
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	135
9.4 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 .....	135
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>135</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>135</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	135
11.2 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 .....	135
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	135
11.4 基金投资策略的改变 .....	136
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	136
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	136
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	136
11.8 其他重大事件 .....	138
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>140</b>
12.1 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 .....	140
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	140
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>141</b>
13.1 备查文件目录 .....	141
13.2 存放地点 .....	141
13.3 查阅方式 .....	141

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指医药卫生 ETF
场内简称	医药卫生 ETF
基金主代码	159938
交易代码	159938
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 1 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,179,567,236.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015-01-08

### 2.2 基金产品说明

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及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的比例不低于基金资产净值的 95%。
业绩比较基准	中证全指医药卫生指数
风险收益特征	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。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。

### 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	广发基金管理有限公司		中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66596688
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	95105828		95566
传真	020-89899158		010-66594942
注册地址	广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室		北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼		北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510308		100818
法定代表人	孙树明		刘连舸

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联 网网址	www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国 北京
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	<b>2022 年</b>	<b>2021 年</b>	<b>2020 年</b>
本期已实现收益	-61,900,170.63	285,347,584.59	964,005,794.08
本期利润	-363,515,727.44	-29,298,772.62	1,196,147,864.24
加权平均基金份额本期利润	-0.1243	-0.0368	0.8939
本期加权平均净值利润率	-13.17%	-1.77%	50.52%
本期基金份额净值增长率	-20.76%	-5.68%	52.66%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2022 年末</b>	<b>2021 年末</b>	<b>2020 年末</b>
期末可供分配利润	1,204,385,140.67	863,987,989.65	696,341,445.10
期末可供分配基金份额利润	0.2882	0.9894	0.8238
期末基金资产净值	3,294,168,759.09	1,737,271,607.65	1,782,901,902.81
期末基金份额净值	0.7882	1.9894	2.1092
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2022 年末</b>	<b>2021 年末</b>	<b>2020 年末</b>
基金份额累计净值增长率	57.64%	98.94%	110.92%

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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

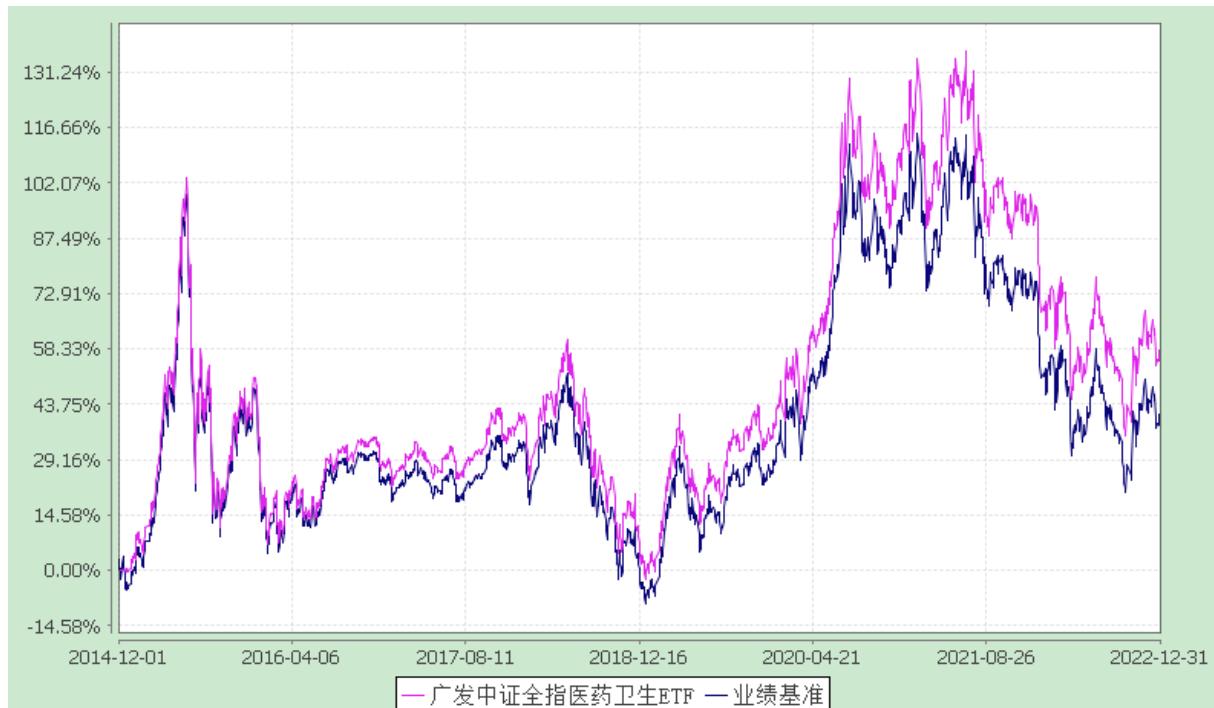
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去三个月	9.95%	1.85%	10.14%	1.86%	-0.19%	-0.01%
过去六个月	-7.96%	1.66%	-7.97%	1.67%	0.01%	-0.01%
过去一年	-20.76%	1.74%	-21.16%	1.75%	0.40%	-0.01%
过去三年	14.10%	1.69%	9.46%	1.70%	4.64%	-0.01%
过去五年	14.92%	1.64%	8.20%	1.65%	6.72%	-0.01%
自基金合同生效起至今	57.64%	1.72%	40.75%	1.74%	16.89%	-0.02%

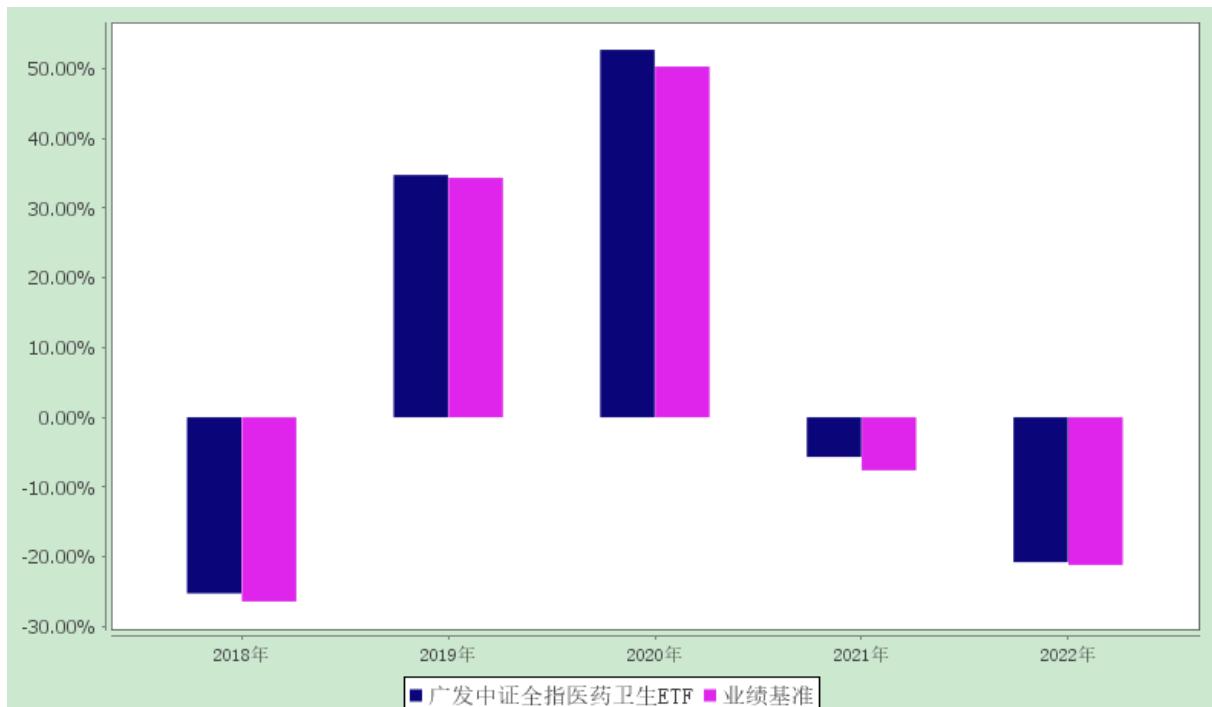
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证全指医药卫生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的历史走势对比图  
(2014 年 12 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日)



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金  
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## §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

经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，本基金管理人于2003年8月5日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII、QDLP等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF投资、另类投资等类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

#### 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		
霍华明	本基金的基金经理；广发中证全指信息技术交易型开放	2017-04-20	-	15年	霍华明先生，理学硕士，持有中国证券投资基金管理从业证书。曾任广发基金管理有限公司注册登记部核算专员、数量投资部数据

	式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指信息技术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；广发中证全指医药卫生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；广发中证基建工程交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；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的基金经理；广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金管理的基金经理；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的基金经理；广发中证养老产业指数量型发起式证券投资基金的基金经理。			分析员、ETF 基金助理兼研究员、广发中证京津冀协同发展主题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 2018 年 4 月 19 日至 2021 年 6 月 29 日)、广发中证基建工程指数量型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 2 月 1 日至 2021 年 7 月 26 日)、广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 4 月 19 日至 2021 年 11 月 23 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 2019 年 11 月 14 日至 2021 年 11 月 23 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 2019 年 11 月 14 日至 2021 年 11 月 23 日)。
--	--	--	--	--

理；广发上海 金交易型开放 式证券投资基 金的基金经理； 广发上海 金交易型开放 式证券投资基 金联接基金的 基金经理；广 发中证基建工 程交易型开放 式指数证券投资 基金的基金经 理；广发恒 生科技指数证 券投资基金 (QDII)的基金 经理；广发中 证医疗指数证 券投资基金 (LOF)的基 金经理				
--	--	--	--	--

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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。公司原则上禁止不同投资组合之间（完全复制指数组合及量化组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司金融工程与风险管理部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。在本年度本基金与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差专项分析中，未发现存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

#### 4.3.3 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 19 次，其中 16 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 3 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 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，本基金主要采取完全复制法跟踪指数，即按照标的指数的成份股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及其权重的变动进行相应的调整。报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

2022 年，全球面临地缘政治局势动荡不安、世界经济下行风险加大、通胀压力高企等多重问题，

国际关系日益复杂。国内经济受到多重因素的反复冲击，面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，经济发展环境的复杂性、严峻性、不确定性上升。面对风高浪急的国际环境，国内宏观经济大盘总体稳定，高质量发展取得新的成效，2022 年国内生产总值同比增长 3.0%。A 股市场方面，二级市场波动较大，上证指数下跌 15.13%，深证成指下跌 25.85%，创业板指数下跌 29.37%，中证全指医药卫生指数下跌 21.16%。2022 年医药板块整体受关注度较高，医药板块的新冠口服液、抗疫中药、感冒发烧类用药、疫苗、抗原检测以及药店等领域受到市场关注。另外，医疗器械等领域也随着 ICU 床位的扩容有所利好，在集采方面，药品器械的降价幅度也有所减少，基本符合市场预期。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-20.76%，同期业绩比较基准收益率为-21.16%。

#### 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，随着企业复工复产的开展和人员流动的恢复，我国经济发展总体向好，将会表现出强韧性、高潜力。预计随着稳经济政策措施的落实，有效需求会得到扩大，经济发展势头将会延续。医药板块是攻守兼备的板块，长远看，人口老龄化是中国人口结构发展的大趋势，中国人均医疗卫生支出跟发达国家相比有一定距离，医药行业的发展空间依然很大。预计疫情后，人们对身体的健康有望更加重视，将会更加重视医药医疗方面的支出。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度，公司严格按照法律法规和监管部门要求，稳步推进各项监察稽核工作。主要工作情况如下：

（一）积极推进内部制度修订完善，不折不扣做好监管新规内化工作，扎实推进制度全覆盖工作，确保公司经营管理与业务开展有章可循，规范有序。

（二）强化投资组合日常风险监控，有效执行关联交易内控措施，大力推进统一风险监控平台建设，提升信息化管理水平，实现对投资组合更精细化的风险管理。

（三）加强稽核审计工作闭环管理，通过专项检查、组织自查等方式进行了常规稽核检查，制定整改方案，并做好持续跟踪与督办。

（四）建立合规培训长效机制，持续落实常规化培训，积极拓展多元化培训，不断探索培训创新，提高员工的主动合规意识，强化第一道防线风险意识。

（五）加强公司员工对外言行管理，通过发布通知等规范性文件明确对全体员工的要求，压实管理级员工的监督管理责任。

(六) 扎实推进反洗钱日常工作，围绕反洗钱工作的基本要求，按时保质完成洗钱风险自评估、反洗钱主题宣传等工作，不断完善工作机制、提升工作质量。

(七) 完善子公司日常管理机制，推动境内子公司相关制度修订与完善，增强对子公司合规负责人的履职监督与保障，加强对子公司报告事项的研究分析。

(八) 强化疫情防控远程权限及行为管理，制定远程办公应急预案及各类远程办公合规指引，强调信息技术安全及合规要求，全力保障疫情期间公司各项业务合规、平稳运作。

(九) 推进信息披露自动化和智能化建设，探索运用信息技术手段提升管理效能，并不断完善工作指引，在降低操作风险、提高工作效率的同时确保工作质量。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

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。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

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，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

#### 4.9 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

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 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

安永华明(2023)审字第 60873695\_G53 号

广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报

表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

### 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发

现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 黄浩松

中国 北京

2023 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
		2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	10,441,552.02	14,123,942.01
结算备付金		73,046.75	1,113,723.29

存出保证金		241,069.72	41,448.97
交易性金融资产	7.4.7.2	3,285,770,366.74	1,723,812,188.68
其中：股票投资		3,285,647,653.02	1,723,812,188.68
基金投资		-	-
债券投资		122,713.72	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		597,725.40	903,079.70
应收股利		-	6,165.60
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	264,895.77	41,001.67
资产总计		3,297,388,656.40	1,740,041,549.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,131.23	725,924.94
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,439,805.48	717,040.65
应付托管费		287,961.08	143,408.11

应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		25,757.18	5,029.73
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	1,464,242.34	1,178,538.84
负债合计		3,219,897.31	2,769,942.27
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.8	2,089,783,618.42	873,283,618.00
未分配利润	7.4.7.9	1,204,385,140.67	863,987,989.65
净资产合计		3,294,168,759.09	1,737,271,607.65
负债和净资产总计		3,297,388,656.40	1,740,041,549.92

注：(1) 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 0.7882 元，基金份额总额 4,179,567,236.00 份。

(2) 以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-345,984,751.39</b>	<b>-16,436,238.51</b>
1.利息收入		3,470,166.46	1,228,143.57
其中：存款利息收入	7.4.7.10	97,682.51	50,360.54
债券利息收入		-	531.99

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		3,372,483.95	1,177,251.04
其他利息收入		-	-
<b>2. 投资收益（损失以“-”填列）</b>		<b>-47,689,275.36</b>	<b>291,499,984.33</b>
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-75,955,495.09	280,292,401.23
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	822,091.95	485,296.65
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	27,444,127.78	10,722,286.45
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		-	-
<b>3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）</b>	7.4.7.18	<b>-301,615,556.81</b>	<b>-314,646,357.21</b>
<b>4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）</b>		-	-
<b>5. 其他收入（损失以“-”号填列）</b>	7.4.7.19	<b>-150,085.68</b>	<b>5,481,990.80</b>
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>17,530,976.05</b>	<b>12,862,534.11</b>
1. 管理人报酬		13,732,756.25	8,276,328.16
2. 托管费		2,746,551.16	1,655,265.68
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	7.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		12,146.40	4,240.39
8. 其他费用	7.4.7.21	1,039,522.24	2,926,699.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填</b>		<b>-363,515,727.44</b>	<b>-29,298,772.62</b>

列)			
减： 所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-363,515,727.44</b>	<b>-29,298,772.62</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-363,515,727.44</b>	<b>-29,298,772.62</b>

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基 金净值)	873,283,618.00	863,987,989.65	1,737,271,607.65
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基 金净值)	873,283,618.00	863,987,989.65	1,737,271,607.65
三、本期增减变动额(减 少以“-”号填列)	1,216,500,000.42	340,397,151.02	1,556,897,151.44
(一)、综合收益总额	-	-363,515,727.44	-363,515,727.44
(二)、本期基金份额交 易产生的基金净值变动 数(净值减少以“-”号填 列)	1,216,500,000.42	703,912,878.46	1,920,412,878.88
其中：1.基金申购款	1,705,500,000.45	1,013,338,870.45	2,718,838,870.90
2.基金赎回款	-489,000,000.03	-309,425,991.99	-798,425,992.02
(三)、本期向基金份额 持有人分配利润产生的 基金净值变动(净值减 少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基 金净值)	2,089,783,618.42	1,204,385,140.67	3,294,168,759.09

项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021年12月31日	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金份额净值)	845,283,618.00	937,618,284.81	1,782,901,902.81	
加：会计政策变更	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金份额净值)	845,283,618.00	937,618,284.81	1,782,901,902.81	
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	28,000,000.00	-73,630,295.16	-45,630,295.16	
(一)、综合收益总额	-	-29,298,772.62	-29,298,772.62	
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	28,000,000.00	-44,331,522.54	-16,331,522.54	
其中：1.基金申购款	501,000,000.00	472,386,811.93	973,386,811.93	
2.基金赎回款	-473,000,000.00	-516,718,334.47	-989,718,334.47	
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	
四、本期期末净资产(基金份额净值)	873,283,618.00	863,987,989.65	1,737,271,607.65	

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明 主管会计工作负责人：窦刚 会计机构负责人：张晓章

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2013]1263 号《关于核准广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2014 年 12 月 1 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为 2014 年 11 月 3 日至 2014 年 11 月 21 日，本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 473,283,618.00 元，有效认购户数为 6,298 户。其中，认购资金在募

集期间产生的利息共计人民币 48,050.00 元，折合基金份额 48,050.00 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 2023 年 3 月 27 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

## (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发

生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

- (1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的

报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

- (2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够的可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；
- (3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；
- (4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。基金份额拆分/折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分/折算日根据拆分/折算前的基金份额数及确定的拆分/折算比例计算认列。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金指申购、赎回等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 黄金租借的租金收入，在租约持有期间按租借合同约定的费率和计算方法逐日确认；

(9) 黄金质押的利息收入，在质押期间按质押合同约定的费率和计算方法逐日确认；

(10) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算，计算方法参见《招募说明书》；
- (2) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次；
- (3) 本基金的收益分配采取现金分红的方式；
- (4) 《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- (5) 每一基金份额享有同等分配权；
- (6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》(财会[2022]14 号)。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于

以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 14,123,942.01 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,218.97 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 14,125,160.98 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,113,723.29 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 339.40 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,114,062.69 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 41,448.97 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 18.70 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 41,467.67 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 41,001.67 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 1,218.97 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 339.40 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 18.70 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 39,424.60 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

其他资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 39,424.60 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。

经上述重分类和重新计量后，其他资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 39,424.60 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

#### (1) 印花税

境内证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

#### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

证券投资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，股权的股息、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。

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### （5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	10,441,552.02	14,123,942.01
等于：本金	10,440,616.35	14,123,942.01
加：应计利息	935.67	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	10,441,552.02	14,123,942.01

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,423,110,738.02	-	3,285,647,653.02	-137,463,085.0

				0
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	122,700.00	13.72	122,713.72
	银行间市场	-	-	-
	合计	122,700.00	13.72	122,713.72
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,423,233,438.02	13.72	3,285,770,366.74	-137,463,085.00
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,559,659,716.87	-	1,723,812,188.68	164,152,471.81
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	1,559,659,716.87	-	1,723,812,188.68	164,152,471.81

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末及上年度末无债权投资。

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	41,001.67
其他应收款	264,895.77	-
待摊费用	-	-
合计	264,895.77	41,001.67

#### 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 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	343,198.06	506,352.08
其中：交易所市场	343,198.06	506,352.08
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	194,000.00	194,000.00
应付替代款	670,321.60	350,665.15
应付指数使用费	256,722.68	127,114.35
可退替代款	-	407.26
合计	1,464,242.34	1,178,538.84

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	873,283,618.00	873,283,618.00
本期申购	933,000,000.00	933,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-179,000,000.00	-179,000,000.00
2022年5月27日基金拆分/份额 折算前	1,627,283,618.00	1,627,283,618.00
基金拆分/份额折算调整	1,627,283,618.00	—
本期申购	1,545,000,000.00	772,500,000.45
本期赎回(以“-”号填列)	-620,000,000.00	-310,000,000.03
本期末	4,179,567,236.00	2,089,783,618.42

注：本基金已于2022年5月27日进行了基金份额拆分，拆分比例为2，即每一份基金份额拆分成2份。

#### 7.4.7.9 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	1,034,831,553.20	-170,843,563.55	863,987,989.65
本期利润	-61,900,170.63	-301,615,556.81	-363,515,727.44
本期基金份额交易产生的 变动数	1,428,077,693.16	-724,164,814.70	703,912,878.46
其中：基金申购款	1,996,743,062.86	-983,404,192.41	1,013,338,870.45
基金赎回款	-568,665,369.70	259,239,377.71	-309,425,991.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,401,009,075.73	-1,196,623,935.06	1,204,385,140.67

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	70,204.67	36,735.34
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	1,633.63
结算备付金利息收入	23,296.84	11,991.57
其他	4,181.00	-
合计	97,682.51	50,360.54

注：“其他”包含保证金利息收入，以往期间在“其他存款利息收入”列示。

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-59,150,548.19	160,756,117.39
股票投资收益——赎回差价收入	-16,804,946.90	119,536,283.84
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	-75,955,495.09	280,292,401.23

##### 7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	857,596,011.28	803,628,116.82
减：卖出股票成本总额	913,818,097.28	642,871,999.43
减：交易费用	2,928,462.19	-
买卖股票差价收入	-59,150,548.19	160,756,117.39

##### 7.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年

	12月31日	12月31日
赎回基金份额对价总额	798,425,992.02	989,718,334.47
减：现金支付赎回款总额	340,919,831.02	407,461,731.47
减：赎回股票成本总额	474,311,107.90	462,720,319.16
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-16,804,946.90	119,536,283.84

#### 7.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
债券投资收益——利息收入	905.38	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	821,186.57	485,296.65
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	822,091.95	485,296.65

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,481,681.32	2,803,764.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,659,400.00	2,317,900.00
减：应计利息总额	919.49	568.11
减：交易费用	175.26	-
买卖债券差价收入	821,186.57	485,296.65

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	27,444,127.78	10,722,286.45
其中：证券出借权益补偿收入	878,488.06	446,216.18
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	27,444,127.78	10,722,286.45

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-301,615,556.81	-314,646,357.21
——股票投资	-301,615,556.81	-314,646,357.21
——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	-301,615,556.81	-314,646,357.21

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-159,662.94	1,220,316.62
其他	9,577.26	4,261,674.18
合计	-150,085.68	5,481,990.80

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代成分证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

#### 7.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间内无信用减值损失。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月 31日	2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	74,000.00	74,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	21,556.84	16,742.20
指数使用费	823,965.40	496,579.64
其他	-	2,219,378.04
合计	1,039,522.24	2,926,699.88

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、申购赎回代办证券公司
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited(广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人全资子公司
广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金 金发起式联接基金	本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股 票成交总	成交金额	占当期股 票成交总

		额的比例		额的比例
广发证券股份有限公司	518,181,771.38	21.57%	387,505,801.08	24.45%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年12月31日	成交金额	2021年1月1日至2021年12月31日	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	4,861,247.07	58.83%	2,440,919.10	49.96%

#### 7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2022年1月1日至2022年12月31日			
当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例	
广发证券股份有限公司	482,591.52	25.94%	170,459.38	49.67%
关联方名称	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021年12月31日			
当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例	
广发证券股份有限公司	360,887.11	29.19%	190,016.34	37.53%

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、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；  
 3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,732,756.25	8,276,328.16
其中：支付销售机构的客户维护费	99,093.35	85,906.41

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,746,551.16	1,655,265.68

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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

单位：人民币元

本期				
2022年1月1日至2022年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	346,834,688.00	290,455.43	53,414,749.00	27,786.21
上年度可比期间				
2021年1月1日至2021年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	12,543,350.00	17,182.68	1,286,910.00	1,386.06

##### 7.4.10.4.2 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

单位：人民币元

本期										
2022年1月1日至2022年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位： 股)	出借期限 (单位： 天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	2022 0104 0001 9481	爱尔眼科	2022-01-04	2,110 ,500. 00	50,000.00	14	3.1 0	2,544 .33	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0106 0000 1317	英科医疗	2022-01-06	457,6 00.00	8,000.00	14	3.1 0	551.6 6	-	-

广发证券股份有限公司	2022 0107 0000 9935	英科医疗	2022-01-07	1,992 ,210. 00	33,000.00	28	3.1 0	5,318 .09	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0111 0001 2355	英科医疗	2022-01-11	61,83 0.00	1,000.00	28	3.1 0	149.0 8	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0114 0000 0909	爱尔眼科	2022-01-14	3,545 ,000. 00	100,000.0 0	28	3.1 0	8,547 .39	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0114 0001 9832	微芯生物	2022-01-14	1,052 ,100. 00	30,000.00	28	3.1 0	2,536 .73	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0117 0000 2573	爱尔眼科	2022-01-17	2,842 ,400. 00	80,000.00	28	3.1 0	6,853 .34	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0117 0000 2577	华大基因	2022-01-17	3,122 ,880. 00	32,000.00	28	3.1 0	7,529 .61	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0120 0001 1166	爱尔眼科	2022-01-20	4,206 ,000. 00	120,000.0 0	28	3.1 0	10,14 1.13	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0120 0001 1168	英科医疗	2022-01-20	494,8 00.00	8,000.00	14	3.1 0	766.9 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0121 0000 0353	爱美客	2022-01-21	1,468 ,800. 00	3,200.00	28	3.1 0	3,541 .44	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0207 0005 2837	英科医疗	2022-02-07	1,754 ,610. 00	33,000.00	28	3.1 0	4,230 .56	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0207 0005 2839	英科医疗	2022-02-07	425,3 60.00	8,000.00	14	3.1 0	512.8 0	-	-
广发证	2022	圣湘生	2022-	1,128	22,000.00	28	3.1	2,721	-	-

券股份有限公司	0208 0000 2143	物	02-08	,820. 00			0	.71		
广发证券股份有限公司	2022 0208 0001 5634	英科医疗	2022- 02-08	54,26 0.00	1,000.00	28	3.1 0	130.8 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0211 0001 9466	微芯生物	2022- 02-11	892,5 00.00	30,000.00	28	3.1 0	2,151 .92	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0211 0001 9468	爱尔眼科	2022- 02-11	3,240 ,000. 00	100,000.0 0	28	3.1 0	7,812 .00	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0214 0000 3658	爱尔眼科	2022- 02-14	2,672 ,000. 00	80,000.00	28	3.1 0	6,442 .49	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0214 0000 3660	华大基因	2022- 02-14	2,752 ,000. 00	32,000.00	28	3.1 0	6,635 .38	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0217 0000 3016	爱尔眼科	2022- 02-17	4,200 ,000. 00	120,000.0 0	28	3.1 0	10,12 6.67	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0218 0000 2708	爱美客	2022- 02-18	1,430 ,400. 00	3,200.00	28	3.1 0	3,448 .85	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0221 0000 1040	迪安诊断	2022- 02-21	400,0 64.00	13,300.00	28	3.5 0	1,089 .06	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0221 0000 1071	迈克生物	2022- 02-21	370,8 72.00	13,600.00	28	3.5 0	1,009 .60	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0221 0000 1075	万孚生物	2022- 02-21	363,7 55.00	9,500.00	28	3.5 0	990.2 2	-	-
广发证券股份	2022 0221	普利制药	2022- 02-21	371,1 20.00	8,000.00	28	3.5 0	1,010 .27	-	-

有限公司	0000 1080								
广发证券股份有限公司	2022 0221 0004 6943	英科医疗	2022- 02-21	423,8 40.00	8,000.00	14	3.1 0	510.9 6	-
广发证券股份有限公司	2022 0228 0000 0826	华大基因	2022- 02-28	1,572 ,280. 00	18,400.00	28	3.1 0	3,790 .94	-
广发证券股份有限公司	2022 0307 0004 1978	英科医疗	2022- 03-07	401,7 60.00	8,000.00	14	3.1 0	484.3 4	-
广发证券股份有限公司	2022 0307 0004 1980	英科医疗	2022- 03-07	1,657 ,260. 00	33,000.00	28	3.1 0	4,281 .26	-
广发证券股份有限公司	2022 0308 0001 5054	圣湘生物	2022- 03-08	960,0 80.00	22,000.00	28	3.1 0	2,397 .53	-
广发证券股份有限公司	2022 0308 0001 5058	英科医疗	2022- 03-08	48,05 0.00	1,000.00	28	3.1 0	119.9 9	-
广发证券股份有限公司	2022 0311 0000 0679	爱尔眼科	2022- 03-11	2,600 ,000. 00	80,000.00	28	3.1 0	6,268 .89	-
广发证券股份有限公司	2022 0311 0001 7666	微芯生物	2022- 03-11	798,3 00.00	30,000.00	28	3.1 0	1,924 .79	-
广发证券股份有限公司	2022 0311 0001 7748	爱尔眼科	2022- 03-11	3,250 ,000. 00	100,000.0 0	28	3.1 0	7,836 .11	-
广发证券股份有限公司	2022 0314 0000 5876	华大基因	2022- 03-14	3,146 ,240. 00	32,000.00	28	3.1 0	7,585 .93	-
广发证券股份有限公司	2022 0315 0000	爱尔眼科	2022- 03-15	3,232 ,800. 00	120,000.0 0	28	3.1 0	7,794 .64	-

司	0862									
广发证券股份有限公司	2022 0318 0000 5046	爱美客	2022-03-18	1,401 ,280. 00	3,200.00	28	3.1 0	3,378 .64	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0321 0003 1865	迪安诊断	2022-03-21	383,0 40.00	13,300.00	28	3.5 0	1,042 .72	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0321 0003 1879	普利制药	2022-03-21	354,9 60.00	8,000.00	28	3.5 0	966.2 8	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0321 0003 1883	迈克生物	2022-03-21	367,4 72.00	13,600.00	28	3.5 0	1,000 .34	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0321 0003 1895	英科医疗	2022-03-21	392,4 80.00	8,000.00	14	3.1 0	540.7 5	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0321 0003 1897	万孚生物	2022-03-21	519,7 45.00	9,500.00	28	3.5 0	1,414 .86	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0406 0005 0867	英科医疗	2022-04-06	1,567 ,500. 00	33,000.00	28	3.1 0	3,914 .40	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0406 0005 8297	圣湘生物	2022-04-06	1,001 ,660. 00	22,000.00	28	3.1 0	2,501 .37	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0406 0005 8299	英科医疗	2022-04-06	47,50 0.00	1,000.00	28	3.1 0	118.6 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0406 0005 8301	英科医疗	2022-04-06	380,0 00.00	8,000.00	14	3.1 0	458.1 1	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0408 0001 7193	爱尔眼科	2022-04-08	3,214 ,000. 00	100,000.0 0	28	3.1 0	7,749 .31	-	-

广发证券股份有限公司	2022 0408 0001 7307	爱尔眼科	2022-04-08	2,571 ,200. 00	80,000.00	28	3.1 0	6,199 .45	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0408 0001 7311	微芯生物	2022-04-08	782,1 00.00	30,000.00	28	3.1 0	1,885 .73	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0411 0000 6837	华大基因	2022-04-11	2,505 ,920. 00	32,000.00	28	3.1 0	6,042 .05	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0412 0001 0663	爱尔眼科	2022-04-12	3,950 ,400. 00	120,000.0 0	28	3.1 0	9,524 .85	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0415 0000 4714	爱美客	2022-04-15	1,580 ,800. 00	3,200.00	28	3.1 0	3,811 .48	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0418 0000 4115	迪安诊断	2022-04-18	393,0 15.00	13,300.00	28	3.5 0	1,069 .87	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0418 0000 4127	万孚生物	2022-04-18	471,2 00.00	9,500.00	28	3.5 0	1,282 .71	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0418 0000 4135	普利制药	2022-04-18	226,4 80.00	8,000.00	28	3.5 0	616.5 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0418 0000 4141	迈克生物	2022-04-18	305,8 64.00	13,600.00	28	3.5 0	832.6 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0419 0000 1452	华大基因	2022-04-19	366,6 67.00	4,900.00	28	3.1 0	884.0 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0420 0004 0378	英科医疗	2022-04-20	340,2 40.00	8,000.00	14	3.1 0	439.4 8	-	-
广发证	2022	英科医	2022-	1,210	34,000.00	28	3.1	2,918	-	-

券股份有限公司	042800001357	疗	04-28	,400.00			0	.41		
广发证券股份有限公司	2022050500071337	圣湘生物	2022-05-05	974,600.00	22,000.00	28	3.10	2,349.87	-	-
广发证券股份有限公司	2022050500071339	英科医疗	2022-05-05	229,680.00	8,000.00	14	3.10	276.89	-	-
广发证券股份有限公司	2022050600018099	爱尔眼科	2022-05-06	3,618,000.00	100,000.00	28	3.10	9,658.05	-	-
广发证券股份有限公司	2022050600018101	爱尔眼科	2022-05-06	2,894,400.00	80,000.00	28	3.10	7,726.44	-	-
广发证券股份有限公司	2022050900010275	华大基因	2022-05-09	2,134,080.00	32,000.00	28	3.10	5,145.50	-	-
广发证券股份有限公司	2022051000013339	爱尔眼科	2022-05-10	4,058,400.00	120,000.00	28	3.10	9,785.25	-	-
广发证券股份有限公司	2022051300006024	爱美客	2022-05-13	1,500,800.00	3,200.00	28	3.10	3,618.60	-	-
广发证券股份有限公司	2022051600003705	万孚生物	2022-05-16	402,800.00	9,500.00	28	3.50	1,096.51	-	-
广发证券股份有限公司	2022051600003713	普利制药	2022-05-16	217,360.00	8,000.00	28	3.50	591.70	-	-
广发证券股份有限公司	2022051600003721	迈克生物	2022-05-16	262,208.00	13,600.00	28	3.50	713.79	-	-
广发证券股份	20220516	迪安诊断	2022-05-16	442,225.00	13,300.00	28	3.50	1,203.83	-	-

有限公司	0000 3927								
广发证券股份有限公司	2022 0517 0000 3397	华大基因	2022- 05-17	321,4 40.00	4,900.00	28	3.1 0	775.0 3	-
广发证券股份有限公司	2022 0519 0000 0734	华大基因	2022- 05-19	330,8 37.00	5,100.00	14	3.2 0	411.7 1	-
广发证券股份有限公司	2022 0519 0004 9593	英科医疗	2022- 05-19	225,0 40.00	8,000.00	14	3.1 0	271.3 0	-
广发证券股份有限公司	2022 0526 0000 8768	英科医疗	2022- 05-26	929,9 00.00	34,000.00	28	3.1 0	2,242 .09	-
广发证券股份有限公司	2022 0531 0000 0432	爱美客	2022- 05-31	2,704 ,500. 00	5,000.00	28	3.1 0	6,520 .85	-
广发证券股份有限公司	2022 0531 0000 1274	圣湘生物	2022- 05-31	285,3 24.00	5,900.00	28	3.1 0	687.9 5	-
广发证券股份有限公司	2022 0602 0000 0949	华大基因	2022- 06-02	407,2 16.00	6,200.00	28	3.1 0	981.8 4	-
广发证券股份有限公司	2022 0602 0001 8750	圣湘生物	2022- 06-02	718,3 00.00	22,000.00	28	3.1 0	1,731 .90	-
广发证券股份有限公司	2022 0602 0001 8762	英科医疗	2022- 06-02	218,0 00.00	8,000.00	14	3.1 0	262.8 1	-
广发证券股份有限公司	2022 0602 0001 8764	华大基因	2022- 06-02	334,9 68.00	5,100.00	14	3.2 0	416.8 5	-
广发证券股份有限公司	2022 0606 0001	爱尔眼科	2022- 06-06	3,573 ,000. 00	100,000.0 0	28	3.1 0	8,614 .90	-

司	0398									
广发证券股份有限公司	2022 0606 0001 0400	爱尔眼科	2022-06-06	2,858 ,400. 00	80,000.00	28	3.1 0	6,891 .92	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0606 0001 2036	华大基因	2022-06-06	2,151 ,680. 00	32,000.00	14	3.1 0	2,593 .97	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0607 0000 7176	爱尔眼科	2022-06-07	4,312 ,800. 00	120,000.0 0	28	3.1 0	10,39 8.64	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0609 0000 0819	英科医疗	2022-06-09	79,57 6.00	2,800.00	28	3.1 0	191.8 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0610 0000 4017	爱美客	2022-06-10	1,691 ,200. 00	3,200.00	28	3.1 0	4,077 .67	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0613 0001 9261	万孚生物	2022-06-13	380,4 75.00	9,500.00	28	3.5 0	1,035 .74	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0613 0001 9269	迈克生物	2022-06-13	262,8 88.00	13,600.00	28	3.5 0	715.6 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0613 0001 9275	普利制药	2022-06-13	220,5 60.00	8,000.00	28	3.5 0	600.4 1	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0613 0002 1111	迪安诊断	2022-06-13	394,4 78.00	13,300.00	28	3.5 0	1,073 .86	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0614 0000 6376	华大基因	2022-06-14	322,0 28.00	4,900.00	28	3.1 0	776.4 5	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0616 0000 1214	华大基因	2022-06-16	368,1 15.00	5,500.00	28	3.1 0	887.5 7	-	-

广发证券股份有限公司	2022 0616 0000 1700	香雪制药	2022-06-16	56,90 0.00	10,000.00	28	3.1 0	137.1 9	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0616 0000 1704	欧普康视	2022-06-16	1,939 ,600. 00	40,000.00	28	3.1 0	4,676 .59	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0616 0000 1709	翰宇药业	2022-06-16	124,2 00.00	10,000.00	28	3.1 0	299.4 6	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0616 0000 1714	天智航	2022-06-16	141,5 00.00	10,000.00	28	3.1 0	341.1 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0616 0001 4971	华大基因	2022-06-16	341,3 43.00	5,100.00	14	3.2 0	424.7 8	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0616 0001 4973	英科医疗	2022-06-16	192,8 80.00	8,000.00	14	3.1 0	232.5 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0623 0000 8523	英科医疗	2022-06-23	818,3 80.00	34,000.00	28	3.1 0	1,973 .21	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0628 0000 9938	圣湘生物	2022-06-28	177,2 36.00	5,900.00	28	3.1 0	427.3 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0628 0000 9940	爱美客	2022-06-28	2,882 ,500. 00	5,000.00	28	3.1 0	6,950 .03	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0630 0001 5577	圣湘生物	2022-06-30	651,4 20.00	22,000.00	28	3.1 0	1,570 .65	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0630 0001 7403	华大基因	2022-06-30	365,6 70.00	5,100.00	14	3.2 0	455.0 6	-	-
广发证	2022	华大基	2022-	444,5	6,200.00	28	3.1	1,071	-	-

券股份有限公司	0630 0001 7405	因	06-30	40.00			0	.84		
广发证券股份有限公司	2022 0704 0001 4640	爱尔眼科	2022- 07-04	3,572 ,800. 00	80,000.00	28	3.1 0	8,614 .42	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0705 0001 0862	爱尔眼科	2022- 07-05	5,358 ,000. 00	120,000.0 0	28	3.1 0	12,91 8.73	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0707 0000 7770	英科医疗	2022- 07-07	68,57 2.00	2,800.00	28	3.1 0	165.3 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0711 0001 8866	迪安诊断	2022- 07-11	429,1 91.00	13,300.00	28	3.5 0	1,168 .35	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0711 0001 8886	迈克生物	2022- 07-11	283,0 16.00	13,600.00	28	3.5 0	770.4 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0711 0001 8926	普利制药	2022- 07-11	259,2 80.00	8,000.00	28	3.5 0	705.8 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0711 0001 8930	万孚生物	2022- 07-11	402,2 30.00	9,500.00	28	3.5 0	1,094 .96	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0712 0000 8579	华大基因	2022- 07-12	327,7 12.00	4,900.00	28	3.1 0	790.1 5	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0714 0001 1286	华大基因	2022- 07-14	368,8 85.00	5,500.00	28	3.1 0	889.4 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0714 0001 1290	华大基因	2022- 07-14	342,0 57.00	5,100.00	14	3.2 0	425.6 7	-	-
广发证券股份	2022 0714	欧普康视	2022- 07-14	2,101 ,200.	40,000.00	28	3.1 0	5,066 .23	-	-

有限公司	0001 1300			00						
广发证券股份有限公司	2022 0721 0000 8424	英科医疗	2022- 07-21	795,6 00.00	34,000.00	28	3.1 0	1,918 .28	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0726 0000 9346	圣湘生物	2022- 07-26	168,8 58.00	5,900.00	28	3.1 0	407.1 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0726 0001 0510	爱美客	2022- 07-26	3,013 ,300. 00	5,000.00	28	3.1 0	7,265 .40	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0728 0001 2073	华大基因	2022- 07-28	326,5 02.00	5,100.00	14	3.2 0	406.3 1	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0728 0001 2075	华大基因	2022- 07-28	396,9 24.00	6,200.00	28	3.1 0	957.0 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0728 0001 4411	圣湘生物	2022- 07-28	658,0 20.00	22,000.00	12	3.1 0	679.9 5	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0801 0001 3707	爱尔眼科	2022- 08-01	2,550 ,400. 00	80,000.00	28	3.1 0	6,149 .30	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0802 0001 2261	爱尔眼科	2022- 08-02	3,718 ,800. 00	120,000.0 0	28	3.1 0	8,966 .44	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0803 0000 2149	迈克生物	2022- 08-03	244,2 56.00	13,600.00	28	3.1 0	588.9 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0803 0000 2156	红日药业	2022- 08-03	324,0 24.00	55,200.00	28	3.1 0	781.2 6	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0804 0001	英科医疗	2022- 08-04	61,20 8.00	2,800.00	28	3.1 0	147.5 8	-	-

广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告

司	4026									
广发证券股份有限公司	2022 0809 0000 1553	迪安诊断	2022-08-09	416,157.00	13,300.00	28	3.10	1,003.40	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0809 0000 1570	普利制药	2022-08-09	233,280.00	8,000.00	28	3.10	562.46	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0809 0001 5108	华大基因	2022-08-09	300,615.00	4,900.00	28	3.10	724.82	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0811 0001 5300	华大基因	2022-08-11	315,333.00	5,100.00	14	3.20	392.41	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0811 0001 5870	华大基因	2022-08-11	340,065.00	5,500.00	28	3.10	819.93	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0818 0001 6505	英科医疗	2022-08-18	779,280.00	34,000.00	28	3.10	1,878.93	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0819 0000 0678	圣湘生物	2022-08-19	1,128,000.00	40,000.00	28	3.10	2,719.73	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0823 0001 3994	爱美客	2022-08-23	2,736,900.00	5,000.00	28	3.10	6,598.97	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0823 0001 5118	圣湘生物	2022-08-23	163,607.00	5,900.00	28	3.10	394.47	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1576	爱博医疗	2022-08-24	466,104.00	2,400.00	14	3.10	561.91	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1578	普门科技	2022-08-24	113,096.00	6,700.00	14	3.10	136.34	-	-

广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1580	惠泰医疗	2022-08-24	217,776.00	1,300.00	14	3.10	262.54	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1582	复旦张江	2022-08-24	65,249.00	7,100.00	14	3.10	78.66	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1584	天智航	2022-08-24	136,122.00	9,800.00	14	3.10	164.10	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1586	海尔生物	2022-08-24	529,618.00	7,400.00	14	3.10	638.48	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1588	心脉医疗	2022-08-24	239,940.00	1,800.00	14	3.10	289.26	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1590	三友医疗	2022-08-24	104,275.00	4,300.00	14	3.10	125.71	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1592	硕世生物	2022-08-24	148,372.00	1,400.00	14	3.10	178.87	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1594	奕瑞科技	2022-08-24	663,600.00	1,400.00	14	3.10	800.01	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1596	博瑞医药	2022-08-24	208,620.00	9,500.00	14	3.10	251.50	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1598	键凯科技	2022-08-24	240,072.00	1,200.00	14	3.10	289.42	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1602	昊海生科	2022-08-24	75,150.00	1,000.00	14	3.10	90.60	-	-
广发证	2022	东方生	2022-	304,7	3,000.00	14	3.1	367.4	-	-

券股份有限公司	0824 0000 1606	物	08-24	70.00			0	2		
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1610	佰仁医疗	2022-08-24	155,974.00	1,400.00	14	3.10	188.04	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1659	尔康制药	2022-08-24	157,788.00	48,700.00	14	3.10	190.22	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1668	博雅生物	2022-08-24	370,480.00	11,000.00	14	3.10	446.63	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1670	凯利泰	2022-08-24	205,247.00	26,900.00	14	3.10	247.44	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1790	花园生物	2022-08-24	288,017.00	14,900.00	14	3.10	347.22	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1802	莱美药业	2022-08-24	90,900.00	22,500.00	14	3.10	109.59	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0824 0000 1814	上海凯宝	2022-08-24	161,184.00	29,200.00	14	3.10	194.32	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0825 0000 0691	奕瑞科技	2022-08-25	689,556.00	1,400.00	14	3.10	831.30	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0825 0000 0693	海尔生物	2022-08-25	542,568.00	7,400.00	14	3.10	654.10	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0825 0000 0695	东方生物	2022-08-25	308,070.00	3,000.00	14	3.10	371.40	-	-
广发证券股份	2022 0825	昊海生科	2022-08-25	74,710.00	1,000.00	14	3.10	90.07	-	-

有限公司	0000 0697								
广发证券股份有限公司	2022 0825 0000 0699	键凯科技	2022- 08-25	253,9 20.00	1,200.00	14	3.1 0	306.1 1	-
广发证券股份有限公司	2022 0825 0000 0701	博瑞医药	2022- 08-25	200,3 55.00	9,500.00	14	3.1 0	241.5 4	-
广发证券股份有限公司	2022 0825 0000 0703	天智航	2022- 08-25	133,7 70.00	9,800.00	14	3.1 0	161.2 7	-
广发证券股份有限公司	2022 0825 0000 0705	普门科技	2022- 08-25	112,0 91.00	6,700.00	14	3.1 0	135.1 3	-
广发证券股份有限公司	2022 0825 0000 0707	复旦张江	2022- 08-25	65,53 3.00	7,100.00	14	3.1 0	79.00	-
广发证券股份有限公司	2022 0825 0000 0709	惠泰医疗	2022- 08-25	217,0 74.00	1,300.00	14	3.1 0	261.6 9	-
广发证券股份有限公司	2022 0825 0000 0711	佰仁医疗	2022- 08-25	152,6 00.00	1,400.00	14	3.1 0	183.9 7	-
广发证券股份有限公司	2022 0825 0000 0713	硕世生物	2022- 08-25	149,9 54.00	1,400.00	14	3.1 0	180.7 8	-
广发证券股份有限公司	2022 0825 0000 0715	三友医疗	2022- 08-25	104,1 89.00	4,300.00	14	3.1 0	125.6 1	-
广发证券股份有限公司	2022 0825 0000 0717	心脉医疗	2022- 08-25	244,7 10.00	1,800.00	14	3.1 0	295.0 1	-
广发证券股份有限公司	2022 0825 0000	爱博医疗	2022- 08-25	476,3 52.00	2,400.00	14	3.1 0	574.2 7	-

司	0739									
广发证券股份有限公司	2022082500000803	尔康制药	2022-08-25	158,762.00	48,700.00	14	3.10	191.40	-	-
广发证券股份有限公司	2022082500000807	凯利泰	2022-08-25	203,095.00	26,900.00	14	3.10	244.84	-	-
广发证券股份有限公司	2022082500000808	上海凯宝	2022-08-25	162,936.00	29,200.00	14	3.10	196.43	-	-
广发证券股份有限公司	2022082500000809	博雅生物	2022-08-25	363,000.00	11,000.00	14	3.10	437.62	-	-
广发证券股份有限公司	2022082500000857	花园生物	2022-08-25	288,613.00	14,900.00	14	3.10	347.94	-	-
广发证券股份有限公司	2022082500013412	华大基因	2022-08-25	302,532.00	5,100.00	14	3.20	376.48	-	-
广发证券股份有限公司	2022082500013498	华大基因	2022-08-25	367,784.00	6,200.00	28	3.10	886.77	-	-
广发证券股份有限公司	2022082900018499	爱尔眼科	2022-08-29	2,270,400.00	80,000.00	11	3.10	2,150.57	-	-
广发证券股份有限公司	2022083000014750	爱尔眼科	2022-08-30	3,438,000.00	120,000.00	14	3.10	4,144.70	-	-
广发证券股份有限公司	2022083100014930	迈克生物	2022-08-31	236,232.00	13,600.00	28	3.10	569.58	-	-
广发证券股份有限公司	2022083100014946	红日药业	2022-08-31	309,672.00	55,200.00	28	3.10	746.65	-	-

广发证券股份有限公司	2022 0901 0001 5708	英科医疗	2022-09-01	61,768.00	2,800.00	28	3.10	148.93	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0906 0001 5283	普利制药	2022-09-06	213,600.00	8,000.00	28	3.10	625.37	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0906 0001 5327	华大基因	2022-09-06	295,862.00	4,900.00	28	3.10	866.22	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0906 0001 7753	迪安诊断	2022-09-06	418,817.00	13,300.00	28	3.10	1,226.20	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0002 8150	海尔生物	2022-09-07	476,042.00	7,400.00	14	3.10	573.90	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0002 8152	硕世生物	2022-09-07	159,978.00	1,400.00	14	3.10	192.86	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0002 8158	普门科技	2022-09-07	110,818.00	6,700.00	14	3.10	133.60	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0002 8160	复旦张江	2022-09-07	65,178.00	7,100.00	14	3.10	78.58	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0002 8176	奕瑞科技	2022-09-07	711,662.00	1,400.00	14	3.10	857.95	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0002 8178	博瑞医药	2022-09-07	202,065.00	9,500.00	14	3.10	243.60	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0002 8180	键凯科技	2022-09-07	252,924.00	1,200.00	14	3.10	304.91	-	-
广发证	2022	昊海生	2022-	71,99	1,000.00	14	3.1	86.79	-	-

券股份有限公司	0907 0002 8182	科	09-07	0.00			0			
广发证券股份有限公司	2022 0907 0002 8184	东方生物	2022-09-07	266,100.00	3,000.00	14	3.10	320.80	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0002 8186	佰仁医疗	2022-09-07	173,236.00	1,400.00	14	3.10	208.85	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0002 8198	天智航	2022-09-07	135,044.00	9,800.00	14	3.10	162.80	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0002 8200	惠泰医疗	2022-09-07	262,860.00	1,300.00	14	3.10	316.89	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0003 2336	凯利泰	2022-09-07	197,715.00	26,900.00	14	3.10	238.36	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0003 2348	花园生物	2022-09-07	302,768.00	14,900.00	14	3.10	365.00	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0003 2364	爱博医疗	2022-09-07	471,960.00	2,400.00	14	3.10	568.97	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0003 2366	心脉医疗	2022-09-07	274,770.00	1,800.00	14	3.10	331.25	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0003 2368	三友医疗	2022-09-07	118,250.00	4,300.00	14	3.10	142.56	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0003 2400	尔康制药	2022-09-07	161,197.00	48,700.00	14	3.10	194.33	-	-
广发证券股份	2022 0907	上海凯宝	2022-09-07	164,688.00	29,200.00	14	3.10	198.54	-	-

有限公司	0003 2424								
广发证券股份有限公司	2022 0907 0003 2474	博雅生物	2022- 09-07	374,0 00.00	11,000.00	14	3.1 0	450.8 8	-
广发证券股份有限公司	2022 0907 0003 2534	莱美药业	2022- 09-07	91,57 5.00	22,500.00	14	3.1 0	110.4 0	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 1666	海尔生物	2022- 09-08	470,3 44.00	7,400.00	14	3.1 0	567.0 3	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 1686	佰仁医疗	2022- 09-08	170,4 50.00	1,400.00	14	3.1 0	205.4 9	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 1690	博瑞医药	2022- 09-08	196,4 60.00	9,500.00	14	3.1 0	236.8 4	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 1728	华大基因	2022- 09-08	324,5 00.00	5,500.00	28	3.1 0	894.1 8	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 5858	东方生物	2022- 09-08	262,0 50.00	3,000.00	14	3.1 0	315.9 2	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 5860	昊海生科	2022- 09-08	72,07 0.00	1,000.00	14	3.1 0	86.88	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 5862	键凯科技	2022- 09-08	254,4 00.00	1,200.00	14	3.1 0	306.6 9	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 5894	凯利泰	2022- 09-08	193,4 11.00	26,900.00	14	3.1 0	233.1 7	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001	奕瑞科技	2022- 09-08	716,9 54.00	1,400.00	14	3.1 0	864.3 3	-

司	5902									
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 5906	尔康制药	2022-09-08	159,249.00	48,700.00	14	3.10	191.98	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 6112	普门科技	2022-09-08	109,612.00	6,700.00	14	3.10	132.14	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 6114	复旦张江	2022-09-08	64,752.00	7,100.00	14	3.10	78.06	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 6116	惠泰医疗	2022-09-08	264,745.00	1,300.00	14	3.10	319.16	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 6118	硕世生物	2022-09-08	157,640.00	1,400.00	14	3.10	190.04	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 6132	花园生物	2022-09-08	301,427.00	14,900.00	14	3.10	363.39	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 6198	爱博医疗	2022-09-08	489,456.00	2,400.00	14	3.10	590.07	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 6202	心脉医疗	2022-09-08	268,308.00	1,800.00	14	3.10	323.46	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 6218	三友医疗	2022-09-08	117,777.00	4,300.00	14	3.10	141.99	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 6220	天智航	2022-09-08	132,692.00	9,800.00	14	3.10	159.97	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 6236	上海凯宝	2022-09-08	164,104.00	29,200.00	14	3.10	197.84	-	-

广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 6238	博雅生物	2022-09-08	373,670.00	11,000.00	14	3.10	450.48	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0908 0001 6362	华大基因	2022-09-08	300,900.00	5,100.00	14	3.20	374.45	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0915 0001 6223	英科医疗	2022-09-15	735,080.00	34,000.00	28	3.10	1,772.36	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0916 0001 0266	圣湘生物	2022-09-16	965,600.00	40,000.00	28	3.10	2,328.17	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0920 0001 5143	爱美客	2022-09-20	2,458,350.00	5,000.00	28	3.10	5,927.36	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0920 0001 7369	圣湘生物	2022-09-20	140,951.00	5,900.00	28	3.10	339.85	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 5960	复旦张江	2022-09-21	61,415.00	7,100.00	14	3.10	100.48	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 5982	键凯科技	2022-09-21	204,000.00	1,200.00	14	3.10	333.77	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 5984	昊海生科	2022-09-21	67,260.00	1,000.00	14	3.10	110.04	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 5994	普门科技	2022-09-21	100,433.00	6,700.00	14	3.10	164.32	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 5996	硕世生物	2022-09-21	146,370.00	1,400.00	14	3.10	239.48	-	-
广发证	2022	凯利泰	2022-	184,2	26,900.00	14	3.1	301.4	-	-

券股份有限公司	0921 0002 9428		09-21	65.00			0	8		
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 9480	花园生物	2022-09-21	277,736.00	14,900.00	14	3.10	454.41	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 9684	尔康制药	2022-09-21	150,483.00	48,700.00	14	3.10	246.21	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 9688	博雅生物	2022-09-21	350,350.00	11,000.00	14	3.10	573.21	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 9750	惠泰医疗	2022-09-21	243,347.00	1,300.00	14	3.10	398.14	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 9752	天智航	2022-09-21	120,148.00	9,800.00	14	3.10	196.58	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 9758	奕瑞科技	2022-09-21	665,686.00	1,400.00	14	3.10	1,089.14	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 9766	海尔生物	2022-09-21	439,486.00	7,400.00	14	3.10	719.05	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 9768	博瑞医药	2022-09-21	179,930.00	9,500.00	14	3.10	294.39	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 9774	心脉医疗	2022-09-21	252,324.00	1,800.00	14	3.10	412.83	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 9788	东方生物	2022-09-21	232,230.00	3,000.00	14	3.10	379.95	-	-
广发证券股份	2022 0921	莱美药业	2022-09-21	88,650.00	22,500.00	14	3.10	145.04	-	-

有限公司	0002 9810								
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 9816	爱博医疗	2022-09-21	434,832.00	2,400.00	14	3.10	711.43	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 9826	三友医疗	2022-09-21	118,594.00	4,300.00	14	3.10	194.03	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0002 9828	佰仁医疗	2022-09-21	154,042.00	1,400.00	14	3.10	252.03	-
广发证券股份有限公司	2022 0921 0003 1372	上海凯宝	2022-09-21	157,096.00	29,200.00	14	3.10	257.03	-
广发证券股份有限公司	2022 0922 0000 9911	天智航	2022-09-22	118,090.00	9,800.00	14	3.10	183.04	-
广发证券股份有限公司	2022 0922 0000 9927	惠泰医疗	2022-09-22	240,864.00	1,300.00	14	3.10	373.34	-
广发证券股份有限公司	2022 0922 0000 9933	博瑞医药	2022-09-22	176,795.00	9,500.00	14	3.10	274.03	-
广发证券股份有限公司	2022 0922 0000 9951	心脉医疗	2022-09-22	247,554.00	1,800.00	14	3.10	383.71	-
广发证券股份有限公司	2022 0922 0000 9957	佰仁医疗	2022-09-22	151,788.00	1,400.00	14	3.10	235.27	-
广发证券股份有限公司	2022 0922 0000 9967	昊海生科	2022-09-22	66,510.00	1,000.00	14	3.10	103.09	-
广发证券股份有限公司	2022 0922 0000	爱博医疗	2022-09-22	424,248.00	2,400.00	14	3.10	657.58	-

司	9969									
广发证券股份有限公司	2022092200009975	键凯科技	2022-09-22	202,800.00	1,200.00	14	3.10	314.34	-	-
广发证券股份有限公司	2022092200009985	三友医疗	2022-09-22	116,186.00	4,300.00	14	3.10	180.09	-	-
广发证券股份有限公司	2022092200009991	东方生物	2022-09-22	236,340.00	3,000.00	14	3.10	366.33	-	-
广发证券股份有限公司	2022092200009993	奕瑞科技	2022-09-22	665,518.00	1,400.00	14	3.10	1,031.55	-	-
广发证券股份有限公司	2022092200009995	海尔生物	2022-09-22	431,346.00	7,400.00	14	3.10	668.59	-	-
广发证券股份有限公司	2022092200010025	普门科技	2022-09-22	97,887.00	6,700.00	14	3.10	151.72	-	-
广发证券股份有限公司	2022092200010027	硕世生物	2022-09-22	148,120.00	1,400.00	14	3.10	229.59	-	-
广发证券股份有限公司	2022092200013411	尔康制药	2022-09-22	148,535.00	48,700.00	14	3.10	230.23	-	-
广发证券股份有限公司	2022092200013435	博雅生物	2022-09-22	342,430.00	11,000.00	14	3.10	530.77	-	-
广发证券股份有限公司	2022092200013455	上海凯宝	2022-09-22	154,468.00	29,200.00	14	3.10	239.43	-	-
广发证券股份有限公司	2022092200013511	凯利泰	2022-09-22	181,306.00	26,900.00	14	3.10	281.02	-	-

广发证券股份有限公司	2022 0922 0001 3549	华大基因	2022-09-22	278,103.00	5,100.00	14	3.20	444.96	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0922 0001 3877	复旦张江	2022-09-22	61,415.00	7,100.00	14	3.10	95.19	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0922 0001 3889	华大基因	2022-09-22	338,086.00	6,200.00	28	3.10	815.16	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0922 0001 3893	花园生物	2022-09-22	280,120.00	14,900.00	14	3.10	434.19	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0928 0001 6259	红日药业	2022-09-28	280,416.00	55,200.00	28	3.10	676.11	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0928 0001 6265	迈克生物	2022-09-28	223,448.00	13,600.00	28	3.10	538.76	-	-
广发证券股份有限公司	2022 0929 0001 4527	英科医疗	2022-09-29	55,748.00	2,800.00	28	3.10	134.41	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0008 7185	莱美药业	2022-10-10	83,925.00	22,500.00	14	3.10	101.18	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0008 7359	尔康制药	2022-10-10	149,022.00	48,700.00	14	3.10	179.65	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0008 7385	凯利泰	2022-10-10	190,183.00	26,900.00	14	3.10	229.28	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0008 8557	尔康制药	2022-10-10	149,022.00	48,700.00	14	3.10	179.65	-	-
广发证	2022	凯利泰	2022-	190,1	26,900.00	14	3.1	229.2	-	-

券股份有限公司	1010 0008 8581		10-10	83.00			0	8		
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 0593	复旦张江	2022-10-10	57,510.00	7,100.00	14	3.10	69.33	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 0647	海尔生物	2022-10-10	491,064.00	7,400.00	14	3.10	592.00	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 0687	博瑞医药	2022-10-10	168,625.00	9,500.00	14	3.10	203.29	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 2031	心脉医疗	2022-10-10	273,600.00	1,800.00	14	3.10	329.84	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 2161	普门科技	2022-10-10	104,855.00	6,700.00	14	3.10	126.41	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 2171	硕世生物	2022-10-10	149,100.00	1,400.00	14	3.10	179.75	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 2187	惠泰医疗	2022-10-10	277,849.00	1,300.00	14	3.10	334.96	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 3643	天智航	2022-10-10	114,660.00	9,800.00	14	3.10	138.23	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 3651	佰仁医疗	2022-10-10	147,154.00	1,400.00	14	3.10	177.40	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 3653	爱博医疗	2022-10-10	451,680.00	2,400.00	14	3.10	544.53	-	-
广发证券股份	2022 1010	爱博医疗	2022-10-10	451,680.00	2,400.00	14	3.10	544.53	-	-

有限公司	0009 3747								
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 3757	三友医疗	2022- 10-10	125,0 44.00	4,300.00	14	3.1 0	150.7 5	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 3765	惠泰医疗	2022- 10-10	277,8 49.00	1,300.00	14	3.1 0	334.9 6	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 3773	天智航	2022- 10-10	114,6 60.00	9,800.00	14	3.1 0	138.2 3	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 3785	海尔生物	2022- 10-10	491,0 64.00	7,400.00	14	3.1 0	592.0 0	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 3787	博瑞医药	2022- 10-10	168,6 25.00	9,500.00	14	3.1 0	203.2 9	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 5119	普门科技	2022- 10-10	104,8 55.00	6,700.00	14	3.1 0	126.4 1	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 5127	硕世生物	2022- 10-10	149,1 00.00	1,400.00	14	3.1 0	179.7 5	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 6373	上海凯宝	2022- 10-10	152,4 24.00	29,200.00	14	3.1 0	183.7 6	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 6467	博雅生物	2022- 10-10	346,5 00.00	11,000.00	14	3.1 0	417.7 3	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 6995	复旦张江	2022- 10-10	57,51 0.00	7,100.00	14	3.1 0	69.33	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009	佰仁医疗	2022- 10-10	147,1 54.00	1,400.00	14	3.1 0	177.4 0	-

司	7001									
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 7025	心脉医疗	2022- 10-10	273,6 00.00	1,800.00	14	3.1 0	329.8 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 7081	三友医疗	2022- 10-10	125,0 44.00	4,300.00	14	3.1 0	150.7 5	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 8773	键凯科技	2022- 10-10	193,8 48.00	1,200.00	14	3.1 0	233.6 9	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 8777	昊海生科	2022- 10-10	64,00 0.00	1,000.00	14	3.1 0	77.16	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 8787	东方生物	2022- 10-10	228,6 30.00	3,000.00	14	3.1 0	275.6 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 8789	奕瑞科技	2022- 10-10	682,0 94.00	1,400.00	14	3.1 0	822.3 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 8845	博雅生物	2022- 10-10	346,5 00.00	11,000.00	14	3.1 0	417.7 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 8871	花园生物	2022- 10-10	245,1 05.00	14,900.00	14	3.1 0	295.4 9	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 8883	上海凯宝	2022- 10-10	152,4 24.00	29,200.00	14	3.1 0	183.7 6	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 8887	奕瑞科技	2022- 10-10	682,0 94.00	1,400.00	14	3.1 0	822.3 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 8889	东方生物	2022- 10-10	228,6 30.00	3,000.00	14	3.1 0	275.6 3	-	-

广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 8901	花园生物	2022- 10-10	245,1 05.00	14,900.00	14	3.1 0	295.4 9	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0009 9967	昊海生科	2022- 10-10	64,00 0.00	1,000.00	14	3.1 0	77.16	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0010 0095	键凯科技	2022- 10-10	193,8 48.00	1,200.00	14	3.1 0	233.6 9	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0010 0425	迪安诊断	2022- 10-10	379,5 82.00	13,300.00	28	3.1 0	915.2 1	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1010 0010 0431	普利制药	2022- 10-10	191,7 60.00	8,000.00	28	3.1 0	462.3 5	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1011 0000 2842	健帆生物	2022- 10-11	546,2 44.00	11,600.00	14	3.2 0	679.7 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1011 0000 2848	迪安诊断	2022- 10-11	452,5 12.00	15,800.00	14	3.2 0	563.1 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1013 0000 1322	海泰新光	2022- 10-13	1,190 ,000. 00	10,000.00	14	3.2 0	1,480 .89	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1013 0000 1361	乐普医疗	2022- 10-13	218,1 00.00	10,000.00	14	3.5 0	296.8 6	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1013 0001 7060	英科医疗	2022- 10-13	686,1 20.00	34,000.00	14	3.1 0	827.1 6	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1014 0001 1188	圣湘生物	2022- 10-14	1,005 ,600. 00	40,000.00	28	3.1 0	2,424 .61	-	-
广发证	2022	迈克生	2022-	347,3	16,500.00	14	3.2	432.2	-	-

券股份有限公司	1018 0000 2083	物	10-18	25.00			0	3		
广发证券股份有限公司	2022 1018 0000 2094	君实生物	2022- 10-18	866,4 00.00	16,000.00	14	3.5 0	1,179 .27	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1018 0000 6797	爱美客	2022- 10-18	2,373 ,050. 00	5,000.00	28	3.1 0	5,721 .69	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1018 0000 6805	圣湘生物	2022- 10-18	149,6 24.00	5,900.00	28	3.1 0	360.7 6	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0008 8409	博雅生 物	2022- 10-24	353,2 10.00	11,000.00	14	3.1 0	425.8 1	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0008 8425	尔康制 药	2022- 10-24	151,4 57.00	48,700.00	14	3.1 0	182.5 9	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0008 8445	凯利泰	2022- 10-24	208,4 75.00	26,900.00	14	3.1 0	251.3 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0008 8517	上海凯 宝	2022- 10-24	159,4 32.00	29,200.00	14	3.1 0	192.2 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0008 8601	博雅生 物	2022- 10-24	353,2 10.00	11,000.00	14	3.1 0	425.8 1	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 0007	凯利泰	2022- 10-24	208,4 75.00	26,900.00	14	3.1 0	251.3 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 0029	花园生 物	2022- 10-24	215,7 52.00	14,900.00	14	3.1 0	260.1 0	-	-
广发证券股份	2022 1024	花园生 物	2022- 10-24	215,7 52.00	14,900.00	14	3.1 0	260.1 0	-	-

有限公司	0009 0105								
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 0107	尔康制药	2022- 10-24	151,4 57.00	48,700.00	14	3.1 0	182.5 9	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 0167	上海凯宝	2022- 10-24	159,4 32.00	29,200.00	14	3.1 0	192.2 0	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 0191	莱美药业	2022- 10-24	89,10 0.00	22,500.00	14	3.1 0	107.4 2	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 5975	海尔生物	2022- 10-24	581,6 40.00	7,400.00	14	3.1 0	701.2 0	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 5977	博瑞医药	2022- 10-24	185,7 25.00	9,500.00	14	3.1 0	223.9 0	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6013	复旦张江	2022- 10-24	59,99 5.00	7,100.00	14	3.1 0	72.33	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6019	普门科技	2022- 10-24	137,2 83.00	6,700.00	14	3.1 0	165.5 0	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6043	三友医疗	2022- 10-24	145,5 55.00	4,300.00	14	3.1 0	175.4 7	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6045	博瑞医药	2022- 10-24	185,7 25.00	9,500.00	14	3.1 0	223.9 0	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6051	硕世生物	2022- 10-24	140,5 88.00	1,400.00	14	3.1 0	169.4 9	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009	心脉医疗	2022- 10-24	450,0 00.00	1,800.00	14	3.1 0	542.5 0	-

司	6085									
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6097	惠泰医疗	2022- 10-24	452,2 70.00	1,300.00	14	3.1 0	545.2 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6115	海尔生物	2022- 10-24	581,6 40.00	7,400.00	14	3.1 0	701.2 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6131	天智航	2022- 10-24	135,0 44.00	9,800.00	14	3.1 0	162.8 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6137	爱博医疗	2022- 10-24	532,5 12.00	2,400.00	14	3.1 0	641.9 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6141	佰仁医疗	2022- 10-24	173,3 34.00	1,400.00	14	3.1 0	208.9 6	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6143	爱博医疗	2022- 10-24	532,5 12.00	2,400.00	14	3.1 0	641.9 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6567	东方生物	2022- 10-24	238,4 70.00	3,000.00	14	3.1 0	287.4 9	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6569	奕瑞科技	2022- 10-24	728,0 00.00	1,400.00	14	3.1 0	877.6 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6587	东方生物	2022- 10-24	238,4 70.00	3,000.00	14	3.1 0	287.4 9	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6605	复旦张江	2022- 10-24	59,99 5.00	7,100.00	14	3.1 0	72.33	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6617	佰仁医疗	2022- 10-24	173,3 34.00	1,400.00	14	3.1 0	208.9 6	-	-

广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6629	天智航	2022- 10-24	135,0 44.00	9,800.00	14	3.1 0	162.8 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6643	昊海生科	2022- 10-24	70,65 0.00	1,000.00	14	3.1 0	85.17	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6647	键凯科技	2022- 10-24	211,2 72.00	1,200.00	14	3.1 0	254.7 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6651	昊海生科	2022- 10-24	70,65 0.00	1,000.00	14	3.1 0	85.17	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6657	普门科技	2022- 10-24	137,2 83.00	6,700.00	14	3.1 0	165.5 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6661	硕世生物	2022- 10-24	140,5 88.00	1,400.00	14	3.1 0	169.4 9	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6673	键凯科技	2022- 10-24	211,2 72.00	1,200.00	14	3.1 0	254.7 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6677	心脉医疗	2022- 10-24	450,0 00.00	1,800.00	14	3.1 0	542.5 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6699	三友医疗	2022- 10-24	145,5 55.00	4,300.00	14	3.1 0	175.4 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6701	惠泰医疗	2022- 10-24	452,2 70.00	1,300.00	14	3.1 0	545.2 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1024 0009 6705	奕瑞科技	2022- 10-24	728,0 00.00	1,400.00	14	3.1 0	877.6 4	-	-
广发证	2022	君实生	2022-	698,8	11,200.00	14	3.5	951.2	-	-

券股份有限公司	1025 0000 2424	物	10-25	80.00			0	5		
广发证券股份有限公司	2022 1025 0002 5986	健帆生物	2022-10-25	584,988.00	11,600.00	14	3.20	727.99	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1026 0001 8550	迈克生物	2022-10-26	274,992.00	13,600.00	28	3.10	663.04	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1026 0001 8556	红日药业	2022-10-26	361,008.00	55,200.00	28	3.10	870.43	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1027 0001 6229	乐普医疗	2022-10-27	247,900.00	10,000.00	14	3.50	337.42	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1027 0001 6231	海泰新光	2022-10-27	1,350,000.00	10,000.00	14	3.20	1,680.00	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1101 0000 1482	健帆生物	2022-11-01	108,290.00	3,400.00	14	3.20	134.76	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1101 0000 8726	君实生物	2022-11-01	1,237,120.00	16,000.00	14	3.50	1,683.86	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0000 1273	翰宇药业	2022-11-07	388,546.00	26,200.00	14	3.10	468.41	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0007 8481	硕世生物	2022-11-07	152,894.00	1,400.00	14	3.10	184.32	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0007 8617	东方生物	2022-11-07	311,340.00	3,000.00	14	3.10	375.34	-	-
广发证券股份	2022 1107	东方生物	2022-11-07	311,340.00	3,000.00	14	3.10	375.34	-	-

有限公司	0007 8635								
广发证券股份有限公司	2022 1107 0007 8637	奕瑞科技	2022- 11-07	662,0 32.00	1,400.00	14	3.1 0	798.1 2	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0007 8673	天智航	2022- 11-07	140,5 32.00	9,800.00	14	3.1 0	169.4 2	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0007 9661	花园生物	2022- 11-07	239,7 41.00	14,900.00	14	3.1 0	289.0 2	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0007 9673	天智航	2022- 11-07	140,5 32.00	9,800.00	14	3.1 0	169.4 2	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 1257	复旦张江	2022- 11-07	67,80 5.00	7,100.00	14	3.1 0	81.74	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 1943	花园生物	2022- 11-07	239,7 41.00	14,900.00	14	3.1 0	289.0 2	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 1977	奕瑞科技	2022- 11-07	662,0 32.00	1,400.00	14	3.1 0	798.1 2	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 1987	海尔生物	2022- 11-07	560,6 24.00	7,400.00	14	3.1 0	675.8 6	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 1991	博瑞医药	2022- 11-07	213,8 45.00	9,500.00	14	3.1 0	257.8 0	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 1993	博瑞医药	2022- 11-07	213,8 45.00	9,500.00	14	3.1 0	257.8 0	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008	佰仁医疗	2022- 11-07	206,0 94.00	1,400.00	14	3.1 0	248.4 6	-

司	2011									
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 2019	佰仁医疗	2022- 11-07	206,0 94.00	1,400.00	14	3.1 0	248.4 6	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 2045	普利制药	2022- 11-07	214,2 40.00	8,000.00	28	3.1 0	516.5 6	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 2115	硕世生物	2022- 11-07	152,8 94.00	1,400.00	14	3.1 0	184.3 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 7263	复旦张江	2022- 11-07	67,80 5.00	7,100.00	14	3.1 0	81.74	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 7319	海尔生物	2022- 11-07	560,6 24.00	7,400.00	14	3.1 0	675.8 6	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 7423	惠泰医疗	2022- 11-07	419,9 00.00	1,300.00	14	3.1 0	506.2 1	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 7451	爱博医疗	2022- 11-07	581,1 60.00	2,400.00	14	3.1 0	700.6 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 9467	三友医疗	2022- 11-07	128,6 13.00	4,300.00	14	3.1 0	155.0 5	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 9471	心脉医疗	2022- 11-07	393,0 30.00	1,800.00	14	3.1 0	473.8 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 9477	键凯科技	2022- 11-07	215,0 40.00	1,200.00	14	3.1 0	259.2 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 9507	爱博医疗	2022- 11-07	581,1 60.00	2,400.00	14	3.1 0	700.6 2	-	-

广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 9519	昊海生科	2022- 11-07	84,69 0.00	1,000.00	14	3.1 0	102.1 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 9587	三友医疗	2022- 11-07	128,6 13.00	4,300.00	14	3.1 0	155.0 5	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0008 9589	惠泰医疗	2022- 11-07	419,9 00.00	1,300.00	14	3.1 0	506.2 1	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0009 0043	昊海生科	2022- 11-07	84,69 0.00	1,000.00	14	3.1 0	102.1 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0009 0047	键凯科技	2022- 11-07	215,0 40.00	1,200.00	14	3.1 0	259.2 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0009 0055	普门科技	2022- 11-07	142,1 74.00	6,700.00	14	3.1 0	171.4 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0009 0077	心脉医疗	2022- 11-07	393,0 30.00	1,800.00	14	3.1 0	473.8 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0009 0085	普门科技	2022- 11-07	142,1 74.00	6,700.00	14	3.1 0	171.4 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0009 0481	上海凯宝	2022- 11-07	171,4 04.00	29,200.00	14	3.1 0	206.6 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0009 3037	凯利泰	2022- 11-07	211,1 65.00	26,900.00	14	3.1 0	254.5 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0009 3051	博雅生物	2022- 11-07	345,0 70.00	11,000.00	14	3.1 0	416.0 0	-	-
广发证	2022	莱美药	2022-	92,70	22,500.00	14	3.1	111.7	-	-

券股份有限公司	1107 0009 3061	业	11-07	0.00			0	6		
广发证券股份有限公司	2022 1107 0009 3069	上海凯宝	2022-11-07	171,404.00	29,200.00	14	3.10	206.64	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0009 4153	尔康制药	2022-11-07	158,762.00	48,700.00	14	3.10	191.40	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0009 4163	迪安诊断	2022-11-07	384,636.00	13,300.00	28	3.10	927.40	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0009 4195	凯利泰	2022-11-07	211,165.00	26,900.00	14	3.10	254.57	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0009 5799	博雅生物	2022-11-07	345,070.00	11,000.00	14	3.10	416.00	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1107 0009 5869	尔康制药	2022-11-07	158,762.00	48,700.00	14	3.10	191.40	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1108 0000 1959	科美诊断	2022-11-08	99,200.00	8,000.00	14	3.20	123.45	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1108 0000 1966	科兴制药	2022-11-08	250,400.00	10,000.00	14	3.20	311.61	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1108 0002 4629	健帆生物	2022-11-08	387,208.00	11,600.00	14	3.20	481.86	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1108 0002 4783	君实生物	2022-11-08	795,088.00	11,200.00	14	3.50	1,082.20	-	-
广发证券股份	2022 1110	欧普康视	2022-11-10	320,700.00	10,000.00	14	3.50	436.51	-	-

有限公司	0000 2236								
广发证券股份有限公司	2022 1110 0000 2267	科美诊断	2022- 11-10	30,67 5.00	2,500.00	14	3.2 0	38.17	-
广发证券股份有限公司	2022 1110 0001 8514	乐普医疗	2022- 11-10	239,5 00.00	10,000.00	14	3.5 0	325.9 9	-
广发证券股份有限公司	2022 1110 0001 9572	海泰新光	2022- 11-10	1,265 ,400. 00	10,000.00	14	3.2 0	1,574 .72	-
广发证券股份有限公司	2022 1111 0001 3947	圣湘生物	2022- 11-11	1,038 ,000. 00	40,000.00	28	3.1 0	2,502 .73	-
广发证券股份有限公司	2022 1115 0000 1592	振东制药	2022- 11-15	226,0 72.00	30,800.00	14	3.2 0	281.3 3	-
广发证券股份有限公司	2022 1115 0000 1595	红日药业	2022- 11-15	130,6 40.00	18,400.00	14	3.2 0	162.5 7	-
广发证券股份有限公司	2022 1115 0000 8618	爱美客	2022- 11-15	2,405 ,000. 00	5,000.00	14	3.1 0	2,899 .36	-
广发证券股份有限公司	2022 1115 0000 8826	君实生物	2022- 11-15	1,102 ,880. 00	16,000.00	14	3.5 0	1,501 .14	-
广发证券股份有限公司	2022 1115 0000 8832	健帆生物	2022- 11-15	114,2 40.00	3,400.00	14	3.2 0	142.1 7	-
广发证券股份有限公司	2022 1115 0000 9198	圣湘生物	2022- 11-15	157,9 43.00	5,900.00	14	3.1 0	190.4 1	-
广发证券股份有限公司	2022 1117 0000	振东制药	2022- 11-17	157,4 88.00	20,400.00	14	3.5 0	214.3 6	-

司	0644									
广发证券股份有限公司	2022 1117 0000 0651	红日药业	2022- 11-17	109,4 30.00	15,500.00	14	3.2 0	136.1 8	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 3560	三友医疗	2022- 11-21	81,66 4.00	2,900.00	14	3.1 0	98.45	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 3564	心脉医疗	2022- 11-21	216,6 01.00	1,100.00	14	3.1 0	261.1 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 3570	键凯科技	2022- 11-21	152,0 00.00	800.00	14	3.1 0	183.2 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 3598	爱博医疗	2022- 11-21	333,5 10.00	1,500.00	14	3.1 0	402.0 6	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 3606	昊海生科	2022- 11-21	81,22 0.00	1,000.00	14	3.1 0	97.92	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 3640	硕世生物	2022- 11-21	102,5 82.00	900.00	14	3.1 0	123.6 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 3672	心脉医疗	2022- 11-21	216,6 01.00	1,100.00	14	3.1 0	261.1 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 4876	爱博医疗	2022- 11-21	333,5 10.00	1,500.00	14	3.1 0	402.0 6	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 4886	三友医疗	2022- 11-21	81,66 4.00	2,900.00	14	3.1 0	98.45	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 4982	奕瑞科技	2022- 11-21	426,4 65.00	900.00	14	3.1 0	514.1 3	-	-

广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 5004	昊海生科	2022- 11-21	81,22 0.00	1,000.00	14	3.1 0	97.92	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 5008	键凯科技	2022- 11-21	152,0 00.00	800.00	14	3.1 0	183.2 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 5016	硕世生物	2022- 11-21	102,5 82.00	900.00	14	3.1 0	123.6 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 5020	普门科技	2022- 11-21	97,15 2.00	4,600.00	14	3.1 0	117.1 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 5366	复旦张江	2022- 11-21	69,72 2.00	7,100.00	14	3.1 0	84.05	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 5376	海尔生物	2022- 11-21	344,7 84.00	4,800.00	14	3.1 0	415.6 6	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 5518	东方生物	2022- 11-21	252,1 86.00	2,200.00	14	3.1 0	304.0 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 6352	惠泰医疗	2022- 11-21	270,4 50.00	900.00	14	3.1 0	326.0 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 6860	东方生物	2022- 11-21	252,1 86.00	2,200.00	14	3.1 0	304.0 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 6862	奕瑞科技	2022- 11-21	426,4 65.00	900.00	14	3.1 0	514.1 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 6874	天智航	2022- 11-21	91,45 5.00	6,500.00	14	3.1 0	110.2 5	-	-
广发证	2022	尔康制	2022-	113,9	32,100.00	14	3.1	137.3	-	-

券股份有限公司	1121 0007 6966	药	11-21	55.00			0	8		
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 6988	花园生物	2022-11-21	165,500.00	10,000.00	14	3.10	199.52	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 7000	花园生物	2022-11-21	163,845.00	9,900.00	14	3.10	197.52	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 7014	天智航	2022-11-21	91,455.00	6,500.00	14	3.10	110.25	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 7016	上海凯宝	2022-11-21	133,245.00	18,900.00	14	3.10	160.63	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 7930	凯利泰	2022-11-21	150,035.00	18,500.00	14	3.10	180.88	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 7954	海尔生物	2022-11-21	344,784.00	4,800.00	14	3.10	415.66	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 7980	佰仁医疗	2022-11-21	156,860.00	1,100.00	14	3.10	189.10	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 7988	佰仁医疗	2022-11-21	142,600.00	1,000.00	14	3.10	171.91	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0007 8010	博雅生物	2022-11-21	264,097.00	7,900.00	14	3.10	318.38	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0008 0006	惠泰医疗	2022-11-21	240,400.00	800.00	14	3.10	289.82	-	-
广发证券股份	2022 1121	复旦张江	2022-11-21	65,794.00	6,700.00	14	3.10	79.32	-	-

有限公司	0008 1748								
广发证券股份有限公司	2022 1121 0008 1752	博瑞医药	2022- 11-21	148,1 13.00	6,300.00	14	3.1 0	178.5 6	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0008 1754	博瑞医药	2022- 11-21	148,1 13.00	6,300.00	14	3.1 0	178.5 6	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0008 1762	尔康制药	2022- 11-21	115,0 20.00	32,400.00	14	3.1 0	138.6 6	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0008 1764	普门科技	2022- 11-21	92,92 8.00	4,400.00	14	3.1 0	112.0 3	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0008 1766	凯利泰	2022- 11-21	150,8 46.00	18,600.00	14	3.1 0	181.8 5	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0008 1774	博雅生物	2022- 11-21	264,0 97.00	7,900.00	14	3.1 0	318.3 8	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0008 1792	莱美药业	2022- 11-21	83,84 9.00	19,100.00	14	3.1 0	101.0 8	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0008 1804	上海凯宝	2022- 11-21	131,1 30.00	18,600.00	14	3.1 0	158.0 8	-
广发证券股份有限公司	2022 1121 0008 3674	翰宇药业	2022- 11-21	387,7 60.00	26,200.00	14	3.1 0	467.4 7	-
广发证券股份有限公司	2022 1122 0000 1105	康龙化成	2022- 11-22	481,8 96.00	7,200.00	14	3.2 0	599.6 9	-
广发证券股份有限公司	2022 1122 0001	科美诊断	2022- 11-22	95,28 0.00	8,000.00	14	3.2 0	118.5 7	-

司	5421									
广发证券股份有限公司	2022 1122 0001 5423	科兴制药	2022- 11-22	263,6 00.00	10,000.00	14	3.2 0	328.0 .4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1122 0001 5493	君实生物	2022- 11-22	774,4 80.00	11,200.00	14	3.5 0	1,054 .15	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1123 0001 4866	迈克生物	2022- 11-23	258,2 64.00	13,600.00	28	3.1 0	622.7 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1123 0001 4870	红日药业	2022- 11-23	357,6 96.00	55,200.00	28	3.1 0	862.4 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1124 0001 3964	海泰新光	2022- 11-24	1,211 ,100. 00	10,000.00	14	3.2 0	1,507 .15	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1124 0001 6404	乐普医疗	2022- 11-24	228,8 00.00	10,000.00	14	3.5 0	311.4 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1124 0001 6490	欧普康视	2022- 11-24	306,1 00.00	10,000.00	14	3.5 0	416.6 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1124 0001 9728	科美诊断	2022- 11-24	28,75 0.00	2,500.00	14	3.2 0	35.78	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1128 0000 0731	乐普医疗	2022- 11-28	67,20 0.00	3,000.00	14	3.2 0	83.63	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1129 0000 2845	科兴制药	2022- 11-29	292,8 00.00	10,000.00	14	3.2 0	364.3 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1129 0001 5382	君实生物	2022- 11-29	1,048 ,000. 00	16,000.00	14	3.5 0	1,426 .44	-	-

广发证券股份有限公司	2022 1129 0001 8254	振东制药	2022- 11-29	222,6 84.00	30,800.00	14	3.2 0	277.1 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 1800	尔康制药	2022- 12-05	116,9 64.00	32,400.00	14	3.1 0	141.0 1	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 2170	尔康制药	2022- 12-05	115,8 81.00	32,100.00	14	3.1 0	139.7 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 2246	凯利泰	2022- 12-05	148,9 86.00	18,600.00	14	3.1 0	179.6 1	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 2284	翰宇药业	2022- 12-05	487,3 20.00	26,200.00	14	3.1 0	587.4 9	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 6108	海尔生物	2022- 12-05	322,8 96.00	4,800.00	14	3.1 0	389.2 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 6114	佰仁医疗	2022- 12-05	153,3 40.00	1,100.00	14	3.1 0	184.8 6	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 6120	佰仁医疗	2022- 12-05	139,4 00.00	1,000.00	14	3.1 0	168.0 5	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 6126	心脉医疗	2022- 12-05	207,0 86.00	1,100.00	14	3.1 0	249.6 5	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 6140	爱博医疗	2022- 12-05	333,7 50.00	1,500.00	14	3.1 0	402.3 5	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 6156	三友医疗	2022- 12-05	80,59 1.00	2,900.00	14	3.1 0	97.16	-	-
广发证	2022	博瑞医	2022-	142,2	6,300.00	14	3.1	171.5	-	-

券股份有限公司	1205 0002 6204	药	12-05	54.00			0	0		
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 6206	博瑞医药	2022- 12-05	142,2 54.00	6,300.00	14	3.1 0	171.5 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 6714	心脉医疗	2022- 12-05	207,0 86.00	1,100.00	14	3.1 0	249.6 5	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 6718	爱博医疗	2022- 12-05	333,7 50.00	1,500.00	14	3.1 0	402.3 5	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 7738	硕世生物	2022- 12-05	90,90 0.00	900.00	14	3.1 0	109.5 9	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 7752	普门科技	2022- 12-05	92,23 0.00	4,600.00	14	3.1 0	111.1 9	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 7798	复旦张江	2022- 12-05	66,03 0.00	7,100.00	14	3.1 0	79.60	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 7800	海尔生物	2022- 12-05	322,8 96.00	4,800.00	14	3.1 0	389.2 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 7812	硕世生物	2022- 12-05	90,90 0.00	900.00	14	3.1 0	109.5 9	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 7826	博雅生物	2022- 12-05	267,6 52.00	7,900.00	14	3.1 0	322.6 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 7840	东方生 物	2022- 12-05	231,0 00.00	2,200.00	14	3.1 0	278.4 8	-	-
广发证券股份	2022 1205	东方生 物	2022- 12-05	231,0 00.00	2,200.00	14	3.1 0	278.4 8	-	-

有限公司	0002 7844								
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 7846	奕瑞科技	2022- 12-05	418,5 90.00	900.00	14	3.1 0	504.6 3	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 7856	天智航	2022- 12-05	84,95 5.00	6,500.00	14	3.1 0	102.4 2	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 8386	天智航	2022- 12-05	84,95 5.00	6,500.00	14	3.1 0	102.4 2	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 8540	惠泰医疗	2022- 12-05	259,6 50.00	900.00	14	3.1 0	313.0 2	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 8546	莱美药业	2022- 12-05	80,79 3.00	19,100.00	14	3.1 0	97.40	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 8556	上海凯宝	2022- 12-05	129,2 70.00	18,600.00	14	3.1 0	155.8 4	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 8584	花园生物	2022- 12-05	161,2 00.00	10,000.00	14	3.1 0	194.3 4	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 8600	花园生物	2022- 12-05	159,5 88.00	9,900.00	14	3.1 0	192.3 9	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 8632	普门科技	2022- 12-05	88,22 0.00	4,400.00	14	3.1 0	106.3 5	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002 9242	奕瑞科技	2022- 12-05	418,5 90.00	900.00	14	3.1 0	504.6 3	-
广发证券股份有限公司	2022 1205 0002	上海凯宝	2022- 12-05	131,3 55.00	18,900.00	14	3.1 0	158.3 6	-

司	9388									
广发证券股份有限公司	2022120500029404	复旦张江	2022-12-05	62,310.00	6,700.00	14	3.10	75.12	-	-
广发证券股份有限公司	2022120500029420	惠泰医疗	2022-12-05	230,800.00	800.00	14	3.10	278.24	-	-
广发证券股份有限公司	2022120500029532	博雅生物	2022-12-05	267,652.00	7,900.00	14	3.10	322.67	-	-
广发证券股份有限公司	2022120500029564	昊海生科	2022-12-05	82,430.00	1,000.00	14	3.10	99.37	-	-
广发证券股份有限公司	2022120500029568	键凯科技	2022-12-05	125,440.00	800.00	14	3.10	151.22	-	-
广发证券股份有限公司	2022120500029622	三友医疗	2022-12-05	80,591.00	2,900.00	14	3.10	97.16	-	-
广发证券股份有限公司	2022120500029626	键凯科技	2022-12-05	125,440.00	800.00	14	3.10	151.22	-	-
广发证券股份有限公司	2022120500029632	凯利泰	2022-12-05	148,185.00	18,500.00	14	3.10	178.65	-	-
广发证券股份有限公司	2022120500029640	昊海生科	2022-12-05	82,430.00	1,000.00	14	3.10	99.37	-	-
广发证券股份有限公司	2022120500030062	迪安诊断	2022-12-05	342,209.00	13,300.00	28	3.10	766.17	334,229.00	766.17
广发证券股份有限公司	2022120500030086	普利制药	2022-12-05	211,120.00	8,000.00	28	3.10	472.67	197,280.00	472.67

广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告

广发证券股份有限公司	2022 1206 0000 1797	英科医疗	2022- 12-06	23,18 0.00	1,000.00	14	3.2 0	28.85	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1206 0000 1805	红日药业	2022- 12-06	154,2 08.00	24,400.00	14	3.2 0	191.9 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1206 0001 5490	康龙化成	2022- 12-06	478,1 52.00	7,200.00	14	3.2 0	595.0 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1206 0001 6528	科兴制药	2022- 12-06	245,2 00.00	10,000.00	14	3.2 0	305.1 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1206 0001 6530	君实生物	2022- 12-06	646,4 64.00	11,200.00	14	3.5 0	879.9 1	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1208 0000 1204	英科医疗	2022- 12-08	28,17 6.00	1,200.00	14	3.2 0	35.06	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1208 0001 5179	乐普医疗	2022- 12-08	228,1 00.00	10,000.00	14	3.5 0	310.4 7	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1208 0001 5667	欧普康视	2022- 12-08	330,2 00.00	10,000.00	14	3.5 0	449.4 4	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1208 0001 5809	海泰新光	2022- 12-08	1,156 ,000. 00	10,000.00	14	3.2 0	1,438 .58	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1209 0000 6804	圣湘生物	2022- 12-09	979,2 00.00	40,000.00	28	3.1 0	1,855 .04	878,000.00	1,855.04
广发证券股份有限公司	2022 1212 0000 9296	华大基因	2022- 12-12	591,5 00.00	10,000.00	14	3.2 0	736.0 9	-	-
广发证	2022	迈克生	2022-	1,432	70,400.00	14	3.2	1,782	-	-

券股份有限公司	1212 0000 9308	物	12-12	,640. 00			0	.84		
广发证券股份有限公司	2022 1212 0003 7667	乐普医疗	2022-12-12	72,39 0.00	3,000.00	14	3.2 0	90.09	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1213 0000 2950	药石科技	2022-12-13	296,5 17.00	3,900.00	14	3.2 0	369.0 0	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1213 0001 4301	君实生物	2022-12-13	1,005 ,920. 00	16,000.00	14	3.5 0	1,369 .17	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1213 0001 4307	科兴制药	2022-12-13	259,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	322.3 1	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1213 0001 4745	振东制药	2022-12-13	369,6 00.00	30,800.00	14	3.2 0	459.9 5	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1215 0000 2571	硕世生物	2022-12-15	102,8 80.00	1,000.00	14	3.1 0	124.0 3	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1215 0000 2575	键凯科技	2022-12-15	155,6 30.00	1,000.00	14	3.1 0	187.6 2	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1215 0000 2579	惠泰医疗	2022-12-15	287,0 70.00	1,000.00	14	3.1 0	346.0 8	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1215 0000 2582	天智航	2022-12-15	73,71 8.00	5,800.00	14	3.1 0	88.87	-	-
广发证券股份有限公司	2022 1215 0000 2836	沃森生物	2022-12-15	377,0 34.00	9,400.00	14	3.2 0	469.2 0	-	-
广发证券股份	2022 1215	普利制药	2022-12-15	54,34 0.00	2,000.00	14	3.5 0	73.96	-	-

有限公司	0000 2847								
广发证券股份有限公司	2022 1215 0000 2988	爱博医疗	2022- 12-15	302,5 40.00	1,400.00	14	3.1 0	364.7 3	-
广发证券股份有限公司	2022 1215 0000 2992	心脉医疗	2022- 12-15	196,6 50.00	1,000.00	14	3.1 0	237.0 7	-
广发证券股份有限公司	2022 1215 0000 3122	花园生物	2022- 12-15	154,5 00.00	10,000.00	14	3.1 0	186.2 6	-
广发证券股份有限公司	2022 1215 0000 3384	凯利泰	2022- 12-15	130,5 36.00	16,800.00	14	3.1 0	157.3 7	-
广发证券股份有限公司	2022 1215 0000 3414	上海凯宝	2022- 12-15	194,1 98.00	17,800.00	14	3.1 0	234.1 2	-
广发证券股份有限公司	2022 1216 0000 1020	百普赛斯	2022- 12-16	111,0 00.00	1,000.00	14	3.1 0	133.8 2	-
广发证券股份有限公司	2022 1216 0000 1021	拓新药业	2022- 12-16	285,3 00.00	3,000.00	14	3.1 0	343.9 5	-
广发证券股份有限公司	2022 1219 0002 4286	翰宇药业	2022- 12-19	543,6 50.00	26,200.00	14	3.1 0	561.7 7	460,596.00 561.77
广发证券股份有限公司	2022 1220 0001 6314	科兴制药	2022- 12-20	242,1 00.00	10,000.00	14	3.2 0	236.7 2	214,400.00 236.72
广发证券股份有限公司	2022 1220 0001 6318	君实生物	2022- 12-20	609,9 52.00	11,200.00	14	3.5 0	652.3 1	701,120.00 652.31
广发证券股份有限公司	2022 1220 0001	红日药业	2022- 12-20	141,7 64.00	24,400.00	14	3.2 0	138.6 1	138,592.00 138.61

广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告

司	6426									
广发证券股份有限公司	2022122000019586	英科医疗	2022-12-20	22,900.00	1,000.00	14	3.20	22.39	21,030.00	22.39
广发证券股份有限公司	2022122100000399	上海凯宝	2022-12-21	514,332.00	46,800.00	14	3.10	442.90	377,208.00	442.90
广发证券股份有限公司	2022122100004913	红日药业	2022-12-21	367,773.00	63,300.00	14	3.20	326.91	359,544.00	326.91
广发证券股份有限公司	2022122100005036	爱尔眼科	2022-12-21	9,961,000.00	350,000.00	14	3.10	8,577.53	10,874,500.00	8,577.53
广发证券股份有限公司	2022122100020413	红日药业	2022-12-21	320,712.00	55,200.00	28	3.10	276.17	313,536.00	276.17
广发证券股份有限公司	2022122100020427	迈克生物	2022-12-21	243,984.00	13,600.00	28	3.10	210.10	235,280.00	210.10
广发证券股份有限公司	2022122200014393	乐普医疗	2022-12-22	213,600.00	10,000.00	14	3.50	186.90	229,700.00	186.90
广发证券股份有限公司	2022122200016631	欧普康视	2022-12-22	325,700.00	10,000.00	14	3.50	284.99	357,000.00	284.99
广发证券股份有限公司	2022122200016669	英科医疗	2022-12-22	25,728.00	1,200.00	14	3.20	20.58	25,236.00	20.58
广发证券股份有限公司	2022122200016729	海泰新光	2022-12-22	1,049,200.00	10,000.00	14	3.20	839.36	1,130,000.00	839.36
广发证券股份有限公司	2022122600002406	新产业	2022-12-26	126,204.00	2,600.00	14	3.20	56.09	130,364.00	56.09

广发证券股份有限公司	2022122600023287	乐普医疗	2022-12-26	67,470.00	3,000.00	14	3.20	29.99	68,910.00	29.99
广发证券股份有限公司	2022122700002113	新产业	2022-12-27	563,644.00	11,600.00	14	3.20	200.41	581,624.00	200.41
广发证券股份有限公司	2022122700002117	迈克生物	2022-12-27	668,040.00	38,000.00	14	3.20	237.53	657,400.00	237.53
广发证券股份有限公司	2022122700011475	药石科技	2022-12-27	300,144.00	3,900.00	14	3.20	106.72	313,950.00	106.72
广发证券股份有限公司	2022122700011725	振东制药	2022-12-27	233,772.00	30,800.00	14	3.20	83.12	229,460.00	83.12
广发证券股份有限公司	2022122700011915	君实生物	2022-12-27	845,280.00	16,000.00	14	3.50	328.72	1,001,600.00	328.72
广发证券股份有限公司	2022122700011917	科兴制药	2022-12-27	214,600.00	10,000.00	14	3.20	76.30	214,400.00	76.30
广发证券股份有限公司	2022122800002167	智飞生物	2022-12-28	183,351.00	2,100.00	14	3.20	48.89	184,443.00	48.89
广发证券股份有限公司	2022122900010951	花园生物	2022-12-29	142,700.00	10,000.00	14	3.10	24.58	143,900.00	24.58
广发证券股份有限公司	2022122900012171	上海凯宝	2022-12-29	147,028.00	17,800.00	14	3.10	25.32	143,468.00	25.32
广发证券股份有限公司	2022122900012993	硕世生物	2022-12-29	88,660.00	1,000.00	14	3.10	15.27	87,710.00	15.27
广发证	2022	惠泰医	2022-	309,5	1,000.00	14	3.1	53.30	306,930.00	53.30

券股份有限公司	1229 0001 2995	疗	12-29	00.00			0			
广发证券股份有限公司	2022 1229 0001 2997	天智航	2022-12-29	68,73 0.00	5,800.00	14	3.1 0	11.84	68,962.00	11.84
广发证券股份有限公司	2022 1229 0001 2999	键凯科技	2022-12-29	157,7 00.00	1,000.00	14	3.1 0	27.16	156,550.00	27.16
广发证券股份有限公司	2022 1229 0001 3283	爱博医疗	2022-12-29	322,5 46.00	1,400.00	14	3.1 0	55.55	322,980.00	55.55
广发证券股份有限公司	2022 1229 0001 3303	心脉医疗	2022-12-29	194,1 00.00	1,000.00	14	3.1 0	33.43	189,040.00	33.43
广发证券股份有限公司	2022 1229 0001 3679	凯利泰	2022-12-29	121,6 32.00	16,800.00	14	3.1 0	20.95	120,960.00	20.95
广发证券股份有限公司	2022 1230 0001 3431	百普赛斯	2022-12-30	102,6 90.00	1,000.00	14	3.1 0	8.84	102,690.00	8.84
广发证券股份有限公司	2022 1230 0001 3437	拓新药业	2022-12-30	216,0 00.00	3,000.00	14	3.1 0	18.60	216,000.00	18.60

上年度可比期间

2021年1月1日至2021年12月31日

关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位: 股)	出借期限 (单位: 天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	2021 0803 0000 0290	爱尔眼科	2021-08-03	2,963 ,500. 00	50,000.00	28	3.1 0	7,145 .33	-	-
广发证券股份有限公司	2021 0831 0001	爱尔眼科	2021-08-31	2,110 ,000. 00	50,000.00	28	3.1 0	5,087 .44	-	-

司	1523									
广发证券股份有限公司	2021090600000863	英科医疗	2021-09-06	505,050.00	5,000.00	28	3.10	1,391.69	-	-
广发证券股份有限公司	2021092300001046	爱尔眼科	2021-09-23	6,282,000.00	120,000.00	7	3.10	3,786.65	-	-
广发证券股份有限公司	2021092700000512	爱尔眼科	2021-09-27	4,365,600.00	80,000.00	28	3.10	10,525.95	-	-
广发证券股份有限公司	2021092800011578	爱尔眼科	2021-09-28	2,684,000.00	50,000.00	28	3.10	6,471.42	-	-
广发证券股份有限公司	2021093000012915	爱尔眼科	2021-09-30	6,408,000.00	120,000.00	28	3.10	15,450.40	-	-
广发证券股份有限公司	2021100800000801	英科医疗	2021-10-08	286,600.00	5,000.00	28	3.20	713.32	-	-
广发证券股份有限公司	2021100800065377	英科医疗	2021-10-08	286,600.00	5,000.00	28	3.10	691.02	-	-
广发证券股份有限公司	2021102500018514	爱尔眼科	2021-10-25	3,785,600.00	80,000.00	28	3.10	9,127.50	-	-
广发证券股份有限公司	2021102600013718	爱尔眼科	2021-10-26	2,409,500.00	50,000.00	28	3.10	5,809.57	-	-
广发证券股份有限公司	2021102800012993	爱尔眼科	2021-10-28	5,491,200.00	120,000.00	28	3.10	13,239.89	-	-
广发证券股份有限公司	2021110500056611	英科医疗	2021-11-05	278,000.00	5,000.00	28	3.20	691.91	-	-

广发证券股份有限公司	2021 1105 0005 6613	英科医疗	2021- 11-05	278,0 00.00	5,000.00	28	3.1 0	670.2 9	-	-
广发证券股份有限公司	2021 1112 0000 0780	英科医疗	2021- 11-12	1,811 ,370. 00	33,000.00	28	3.1 0	4,367 .41	-	-
广发证券股份有限公司	2021 1116 0000 1082	英科医疗	2021- 11-16	57,89 0.00	1,000.00	28	3.1 0	139.5 8	-	-
广发证券股份有限公司	2021 1119 0000 1034	微芯生物	2021- 11-19	1,117 ,500. 00	30,000.00	28	3.1 0	2,694 .42	-	-
广发证券股份有限公司	2021 1122 0001 4116	爱尔眼科	2021- 11-22	3,767 ,200. 00	80,000.00	28	3.1 0	9,083 .14	-	-
广发证券股份有限公司	2021 1123 0001 4278	爱尔眼科	2021- 11-23	2,343 ,000. 00	50,000.00	14	3.1 0	2,824 .62	-	-
广发证券股份有限公司	2021 1125 0000 7722	爱尔眼科	2021- 11-25	5,662 ,800. 00	120,000.0 0	28	3.1 0	13,65 3.64	-	-
广发证券股份有限公司	2021 1207 0000 9021	爱尔眼科	2021- 12-07	2,149 ,500. 00	50,000.00	14	3.1 0	2,591 .34	-	-
广发证券股份有限公司	2021 1210 0000 4025	英科医疗	2021- 12-10	1,974 ,390. 00	33,000.00	28	3.1 0	3,570 .36	1,908,720.0 0	3,570.36
广发证券股份有限公司	2021 1213 0000 1293	爱美客	2021- 12-13	6,099 ,900. 00	10,000.00	28	3.1 0	9,454 .85	5,361,100.0 0	9,454.85
广发证券股份有限公司	2021 1214 0001 1498	英科医疗	2021- 12-14	60,06 0.00	1,000.00	28	3.1 0	87.92	57,840.00	87.92
广发证	2021	微芯生	2021-	1,024	30,000.00	28	3.1	1,235	1,050,300.0	1,235.09

券股份有限公司	1217 0002 6090	物	12-17	,500. 00			0	.09	0	
广发证券股份有限公司	2021 1220 0000 0003	华大基因	2021- 12-20	2,880 ,640. 00	32,000.00	28	3.1 0	2,728 .61	2,809,600.0 0	2,728.61
广发证券股份有限公司	2021 1220 0000 9193	爱尔眼科	2021- 12-20	3,376 ,000. 00	80,000.00	28	3.1 0	3,197 .82	3,382,400.0 0	3,197.82
广发证券股份有限公司	2021 1221 0001 8779	爱尔眼科	2021- 12-21	2,156 ,000. 00	50,000.00	14	3.1 0	1,856 .56	2,114,000.0 0	1,856.56
广发证券股份有限公司	2021 1223 0001 1687	爱尔眼科	2021- 12-23	5,124 ,000. 00	120,000.0 0	28	3.1 0	3,529 .87	5,073,600.0 0	3,529.87

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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		上年度末	
	2022 年 12 月 31 日	持有的基金份额	2021 年 12 月 31 日	持有的基金份额
广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1,978,096,676.00	47.33%	516,277,438.00	59.12%
广发证券股份有限公司	2,304,319.00	0.06%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

#### 7.4.10.6 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	
	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	10,441,552.02	70,204.67	14,123,942.01	36,735.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301269	华大九天	2022-07-21	6 个月	新股流通受限	32.69	87.94	1,168.00	38,181.92	102,713.92	-
688455	科捷智能	2022-09-07	6 个月	新股流通受限	21.88	13.12	5,277.00	115,460.76	69,234.24	-
30132	华宝	2022-0	6 个月	新股	237.50	176.97	242.00	57,475	42,826	-

7	新能	9-08		流通受限				.00	.74	
30132 6	捷邦 科技	2022-0 9-09	6 个月	新股 流通 受限	51.72	36.62	227.00	11,740 .44	8,312. 74	-
30116 1	唯万 密封	2022-0 9-06	6 个月	新股 流通 受限	18.66	21.73	346.00	6,456. 36	7,518. 58	-
30130 9	万得 凯	2022-0 9-08	6 个月	新股 流通 受限	39.00	24.46	228.00	8,892. 00	5,576. 88	-

#### 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
12317 2	漱玉 转债	2022-1 2-15	1 个月内(含)	新债 流通 受限	100.00	100.01	1,227. 00	122,70 0.00	122,71 3.72	-

注：截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限权证。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末 估值 单价	数量(单位: 股)	期末估值总 额
1	300015	爱尔眼科	2023年1月2日 -2023年1月5日	31.07	738,000.00	22,929,660.00
2	600436	片仔癀	2023年1月3日 -2023年1月12日	288.46	51,800.00	14,942,228.00
3	300347	泰格医药	2023年1月3日 -2023年1月4日	104.80	128,700.00	13,487,760.00
4	000661	长春高新	2023年1月13日	166.45	70,000.00	11,651,500.00
5	600196	复星医药	2023年1月3日 -2023年1月30日	35.24	328,600.00	11,579,864.00
6	300760	迈瑞医疗	2023年1月3日 -2023年1月9日	315.97	34,200.00	10,806,174.00
7	603259	药明康德	2023年1月3日 -2023年1月30日	81.00	119,000.00	9,639,000.00
8	600276	恒瑞医药	2023年1月3日 -2023年1月5日	38.53	221,200.00	8,522,836.00
9	300003	乐普医疗	2023年1月4日 -2023年1月9日	22.97	353,000.00	8,108,410.00
10	300759	康龙化成	2023年1月3日 -2023年1月30日	68.00	111,000.00	7,548,000.00
11	002603	以岭药业	2023年1月2日 -2023年1月13日	29.96	228,500.00	6,845,860.00
12	688180	君实生物-U	2023年1月3日 -2023年1月19日	62.60	105,800.00	6,623,080.00
13	002422	科伦药业	2023年1月3日 -2023年1月18日	26.61	241,000.00	6,413,010.00
14	600763	通策医疗	2023年1月2日 -2023年1月17日	152.99	40,000.00	6,119,600.00
15	600079	人福医药	2023年1月3日 -2023年1月30日	23.89	241,400.00	5,767,046.00
16	002821	凯莱英	2023年1月3日 -2023年1月12日	148.00	36,500.00	5,402,000.00
17	300142	沃森生物	2023年1月3日 -2023年1月12日	40.19	126,200.00	5,071,978.00
18	603939	益丰药房	2023年1月3日 -2023年1月13日	63.84	73,200.00	4,673,088.00
19	000423	东阿阿胶	2023年1月3日 -2023年1月12日	40.70	114,700.00	4,668,290.00
20	002317	众生药业	2023年1月3日 -2023年1月30日	26.99	172,000.00	4,642,280.00
21	002432	九安医疗	2023年1月3日	51.11	88,800.00	4,538,568.00

			-2023 年 1 月 12 日			0
22	002223	鱼跃医疗	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	31.86	135,000.00	4,301,100.00
23	002044	美年健康	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	6.13	680,500.00	4,171,465.00
24	002030	达安基因	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	15.56	264,000.00	4,107,840.00
25	601607	上海医药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 30 日	17.83	229,800.00	4,097,334.00
26	300595	欧普康视	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 19 日	35.70	112,300.00	4,009,110.00
27	603456	九洲药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	42.43	91,600.00	3,886,588.00
28	600529	山东药玻	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 30 日	28.40	133,400.00	3,788,560.00
29	600521	华海药业	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	21.86	170,200.00	3,720,572.00
30	603233	大参林	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	39.60	92,800.00	3,674,880.00
31	600380	健康元	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 30 日	11.29	323,900.00	3,656,831.00
32	600998	九州通	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	13.04	273,200.00	3,562,528.00
33	000999	华润三九	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	46.81	75,000.00	3,510,750.00
34	600771	广誉远	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 9 日	27.82	122,500.00	3,407,950.00
35	002262	恩华药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	24.55	138,700.00	3,405,085.00
36	300896	爱美客	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	566.35	5,900.00	3,341,465.00
37	300122	智飞生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	87.83	37,000.00	3,249,710.00
38	002252	上海莱士	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	6.34	494,800.00	3,137,032.00
39	600056	中国医药	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 19 日	17.23	177,500.00	3,058,325.00
40	000739	普洛药业	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	21.54	141,900.00	3,056,526.00
41	688050	爱博医疗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	230.70	13,100.00	3,022,170.00
42	688139	海尔生物	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 13 日	63.30	47,600.00	3,013,080.00
43	002007	华兰生物	2023 年 1 月 3 日	22.63	130,700.00	2,957,741.00

			-2023 年 1 月 12 日			0
44	600129	太极集团	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 11 日	30.06	97,800.00	2,939,868.00
45	603858	步长制药	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 30 日	21.01	137,900.00	2,897,279.00
46	600511	国药股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	27.90	102,900.00	2,870,910.00
47	300199	翰宇药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	17.58	159,100.00	2,796,978.00
48	300026	红日药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	5.68	488,700.00	2,775,816.00
49	000538	云南白药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 9 日	54.36	49,700.00	2,701,692.00
50	300633	开立医疗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 10 日	54.83	48,800.00	2,675,704.00
51	603883	老百姓	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	40.47	64,600.00	2,614,362.00
52	688617	惠泰医疗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	306.93	8,300.00	2,547,519.00
53	603392	万泰生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	126.70	20,000.00	2,534,000.00
54	600566	济川药业	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	27.22	92,600.00	2,520,572.00
55	000403	派林生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	22.76	109,700.00	2,496,772.00
56	002001	新和成	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 9 日	18.75	129,600.00	2,430,000.00
57	300482	万孚生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	31.87	73,800.00	2,352,006.00
58	300294	博雅生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 9 日	36.56	61,200.00	2,237,472.00
59	600085	同仁堂	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 9 日	44.68	49,600.00	2,216,128.00
60	002675	东诚药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	16.56	132,700.00	2,197,512.00
61	300676	华大基因	2023 年 1 月 10 日 -2023 年 1 月 13 日	51.69	42,300.00	2,186,487.00
62	002219	新里程	2023 年 1 月 9 日 -2023 年 1 月 12 日	3.94	532,500.00	2,098,050.00
63	002294	信立泰	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	32.85	62,700.00	2,059,695.00
64	300725	药石科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 10 日	80.50	25,400.00	2,044,700.00
65	002727	一心堂	2023 年 1 月 3 日	31.51	64,700.00	2,038,697.00

			-2023 年 1 月 13 日			0
66	300832	新产业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	50.14	40,600.00	2,035,684.00
67	000963	华东医药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	46.80	43,400.00	2,031,120.00
68	002332	仙琚制药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	11.30	176,400.00	1,993,320.00
69	600062	华润双鹤	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	17.89	110,300.00	1,973,267.00
70	300677	英科医疗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	21.03	92,900.00	1,953,687.00
71	603882	金域医学	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	78.20	24,600.00	1,923,720.00
72	600422	昆药集团	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	14.12	133,100.00	1,879,372.00
73	688520	神州细胞-U	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	60.60	30,600.00	1,854,360.00
74	603087	甘李药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 10 日	32.58	56,500.00	1,840,770.00
75	300573	兴齐眼药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	125.08	14,700.00	1,838,676.00
76	002424	贵州百灵	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	8.16	225,300.00	1,838,448.00
77	002020	京新药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	12.18	146,500.00	1,784,370.00
78	600216	浙江医药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	11.69	152,000.00	1,776,880.00
79	300233	金城医药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	22.77	77,600.00	1,766,952.00
80	300298	三诺生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	33.73	51,800.00	1,747,214.00
81	600252	中恒集团	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	2.63	652,400.00	1,715,812.00
82	600332	白云山	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 9 日	29.79	56,300.00	1,677,177.00
83	002019	亿帆医药	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 30 日	12.25	136,200.00	1,668,450.00
84	688202	美迪西	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	213.89	7,800.00	1,668,342.00
85	688321	微芯生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	21.98	75,900.00	1,668,282.00
86	600557	康缘药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	18.75	88,000.00	1,650,000.00
87	688298	东方生物	2023 年 1 月 3 日	77.11	21,300.00	1,642,443.00

			-2023 年 1 月 9 日			0
88	002099	海翔药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	7.01	230,800.00	1,617,908.00
89	600993	马应龙	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 9 日	22.60	71,500.00	1,615,900.00
90	000513	丽珠集团	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	32.48	48,700.00	1,581,776.00
91	600055	万东医疗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	19.54	80,500.00	1,572,970.00
92	000756	新华制药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	30.10	52,000.00	1,565,200.00
93	300158	振东制药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	7.45	207,400.00	1,545,130.00
94	600682	南京新百	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 12 日	9.13	168,900.00	1,542,057.00
95	688016	心脉医疗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	189.04	8,100.00	1,531,224.00
96	000650	仁和药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	6.19	244,400.00	1,512,836.00
97	600285	羚锐制药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	13.04	114,000.00	1,486,560.00
98	002737	葵花药业	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 9 日	23.18	64,100.00	1,485,838.00
99	600587	新华医疗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 9 日	21.42	69,200.00	1,482,264.00
100	300039	上海凯宝	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	8.06	183,400.00	1,478,204.00
101	002038	双鹭药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 10 日	8.22	177,600.00	1,459,872.00
102	688289	圣湘生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 10 日	21.95	65,800.00	1,444,310.00
103	688677	海泰新光	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	113.00	12,700.00	1,435,100.00
104	000028	国药一致	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	32.89	43,200.00	1,420,848.00
105	688575	亚辉龙	2023 年 1 月 9 日 -2023 年 1 月 12 日	19.65	72,000.00	1,414,800.00
106	000078	海王生物	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 12 日	3.32	423,500.00	1,406,020.00
107	300630	普利制药	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	24.66	57,000.00	1,405,620.00
108	688029	南微医学	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	82.13	17,100.00	1,404,423.00
109	002390	信邦制药	2023 年 1 月 2 日	4.70	293,800.00	1,380,860.00

			-2023 年 1 月 13 日			0
110	688301	奕瑞科技	2023 年 1 月 9 日	457.8 8	3,000.00	1,373,640.0 0
111	600200	江苏吴中	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 10 日	7.65	179,300.00	1,371,645.0 0
112	002349	精华制药	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 19 日	12.08	113,000.00	1,365,040.0 0
113	000915	华特达因	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 12 日	45.50	30,000.00	1,365,000.0 0
114	600267	海正药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	11.02	123,300.00	1,358,766.0 0
115	600750	江中药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	14.45	94,000.00	1,358,300.0 0
116	002581	未名医药	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 12 日	15.75	82,800.00	1,304,100.0 0
117	300049	福瑞股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	24.43	52,800.00	1,289,904.0 0
118	600645	中源协和	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	17.01	75,500.00	1,284,255.0 0
119	603301	振德医疗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	38.05	33,700.00	1,282,285.0 0
120	688276	百克生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	69.11	18,300.00	1,264,713.0 0
121	603658	安图生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	61.85	20,300.00	1,255,555.0 0
122	300869	康泰医学	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	32.57	38,400.00	1,250,688.0 0
123	600351	亚宝药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	5.88	212,500.00	1,249,500.0 0
124	002653	海思科	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	22.25	56,000.00	1,246,000.0 0
125	002589	瑞康医药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	4.12	301,300.00	1,241,356.0 0
126	002773	康弘药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	15.69	77,500.00	1,215,975.0 0
127	600664	哈药股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 10 日	3.01	403,300.00	1,213,933.0 0
128	300463	迈克生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	17.30	69,100.00	1,195,430.0 0
129	603368	柳药集团	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 12 日	18.67	64,000.00	1,194,880.0 0
130	688166	博瑞医药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	22.57	52,900.00	1,193,953.0 0
131	600812	华北制药	2023 年 1 月 3 日	6.40	185,300.00	1,185,920.0

			-2023 年 1 月 12 日			0
132	002382	蓝帆医疗	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 6 日	7.79	148,500.00	1,156,815.00
133	000989	九芝堂	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	8.81	128,000.00	1,127,680.00
134	300244	迪安诊断	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	25.13	44,200.00	1,110,746.00
135	600420	国药现代	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	9.10	122,000.00	1,110,200.00
136	301047	义翘神州	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	99.66	11,100.00	1,106,226.00
137	300267	尔康制药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 6 日	3.55	308,300.00	1,094,465.00
138	300401	花园生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	14.39	76,000.00	1,093,640.00
139	600789	鲁抗医药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	7.26	145,500.00	1,056,330.00
140	300601	康泰生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	31.53	33,300.00	1,049,949.00
141	300357	我武生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	55.10	18,300.00	1,008,330.00
142	688356	键凯科技	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 12 日	156.55	6,400.00	1,001,920.00
143	300143	盈康生命	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	10.17	96,300.00	979,371.00
144	603567	珍宝岛	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 19 日	12.75	76,500.00	975,375.00
145	600329	达仁堂	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	29.10	33,300.00	969,030.00
146	300326	凯利泰	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	7.20	133,300.00	959,760.00
147	300009	安科生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	9.36	102,400.00	958,464.00
148	603229	奥翔药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	23.80	40,000.00	952,000.00
149	300194	福安药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 6 日	3.60	255,600.00	920,160.00
150	000534	万泽股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 10 日	14.10	65,100.00	917,910.00
151	300149	睿智医药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	10.41	87,200.00	907,752.00
152	603707	健友股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	18.04	49,600.00	894,784.00
153	300685	艾德生物	2023 年 1 月 3 日	26.45	33,700.00	891,365.00

			-2023 年 1 月 12 日			
154	688198	佰仁医疗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 9 日	129.00	6,900.00	890,100.00
155	301015	百洋医药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	23.84	37,300.00	889,232.00
156	600161	天坛生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	23.73	37,300.00	885,129.00
157	002437	誉衡药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	2.54	343,100.00	871,474.00
158	603538	美诺华	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 10 日	25.75	33,000.00	849,750.00
159	000766	通化金马	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	5.27	160,000.00	843,200.00
160	000813	德展健康	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 9 日	3.71	224,000.00	831,040.00
161	300147	香雪制药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 10 日	6.07	136,600.00	829,162.00
162	600211	西藏药业	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 13 日	35.92	22,900.00	822,568.00
163	000931	中关村	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 9 日	6.15	132,300.00	813,645.00
164	000950	重药控股	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 12 日	5.08	160,100.00	813,308.00
165	603387	基蛋生物	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 12 日	12.50	64,700.00	808,750.00
166	000566	海南海药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 9 日	4.27	188,900.00	806,603.00
167	002932	明德生物	2023 年 1 月 13 日	57.27	14,000.00	801,780.00
168	301060	兰卫医学	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 12 日	19.61	40,200.00	788,322.00
169	603108	润达医疗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 9 日	10.11	77,200.00	780,492.00
170	300363	博腾股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	40.85	19,000.00	776,150.00
171	600222	太龙药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	6.37	120,000.00	764,400.00
172	002118	紫鑫药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 10 日	2.33	321,900.00	750,027.00
173	300529	健帆生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	30.97	23,800.00	737,086.00
174	600594	益佰制药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	5.53	131,400.00	726,642.00
175	002435	长江健康	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 12 日	4.67	153,100.00	714,977.00

176	300006	莱美药业	2023年1月3日 -2023年1月11日	3.81	185,500.00	706,755.00
177	300110	华仁药业	2023年1月3日 -2023年1月18日	4.24	164,700.00	698,328.00
178	688131	皓元医药	2023年1月3日 -2023年1月5日	108.3 8	6,400.00	693,632.00
179	688266	泽璟制药-U	2023年1月3日 -2023年1月5日	41.70	16,500.00	688,050.00
180	301089	拓新药业	2023年1月5日 -2023年1月13日	72.00	9,500.00	684,000.00
181	688399	硕世生物	2023年1月3日 -2023年1月12日	87.71	7,700.00	675,367.00
182	688366	昊海生科	2023年1月3日 -2023年1月9日	97.54	6,900.00	673,026.00
183	600624	复旦复华	2023年1月3日 -2023年1月5日	5.72	115,100.00	658,372.00
184	002198	嘉应制药	2023年1月3日 -2023年1月12日	6.52	99,500.00	648,740.00
185	300841	康华生物	2023年1月3日 -2023年1月5日	84.62	7,600.00	643,112.00
186	000623	吉林敖东	2023年1月3日	14.99	42,200.00	632,578.00
187	600867	通化东宝	2023年1月3日 -2023年1月5日	9.18	68,900.00	632,502.00
188	301101	明月镜片	2023年1月10日	63.02	10,000.00	630,200.00
189	603222	济民医疗	2023年1月3日 -2023年1月11日	8.75	71,700.00	627,375.00
190	300406	九强生物	2023年1月3日 -2023年1月12日	16.37	38,000.00	622,060.00
191	000790	华神科技	2023年1月10日 -2023年1月12日	4.55	136,300.00	620,165.00
192	301080	百普赛斯	2023年1月9日 -2023年1月13日	102.6 9	6,000.00	616,140.00
193	300558	贝达药业	2023年1月3日 -2023年1月5日	49.27	12,500.00	615,875.00
194	301211	亨迪药业	2023年1月3日 -2023年1月12日	34.65	17,400.00	602,910.00
195	688085	三友医疗	2023年1月3日 -2023年1月9日	27.75	21,400.00	593,850.00
196	002275	桂林三金	2023年1月4日 -2023年1月5日	13.22	43,900.00	580,358.00
197	600572	康恩贝	2023年1月5日	4.73	121,100.00	572,803.00
198	301087	可孚医疗	2023年1月3日 -2023年1月11日	36.48	15,700.00	572,736.00
199	688185	康希诺	2023年1月3日	146.0	3,700.00	540,274.00

			-2023年1月5日	2		
200	688389	普门科技	2023年1月3日 -2023年1月9日	17.83	30,000.00	534,900.00
201	300653	正海生物	2023年1月3日 -2023年1月5日	43.00	12,100.00	520,300.00
202	688278	特宝生物	2023年1月3日 -2023年1月5日	38.93	12,600.00	490,518.00
203	300497	富祥药业	2023年1月3日 -2023年1月5日	13.20	37,100.00	489,720.00
204	688578	艾力斯-U	2023年1月3日 -2023年1月5日	19.68	23,200.00	456,576.00
205	688690	纳微科技	2023年1月3日 -2023年1月5日	51.77	8,800.00	455,576.00
206	002901	大博医疗	2023年1月13日	34.03	13,100.00	445,793.00
207	002750	龙津药业	2023年1月6日 -2023年1月18日	11.13	39,700.00	441,861.00
208	002393	力生制药	2023年1月13日	21.29	20,400.00	434,316.00
209	300639	凯普生物	2023年1月3日 -2023年1月12日	16.85	25,700.00	433,045.00
210	688136	科兴制药	2023年1月3日 -2023年1月10日	21.44	20,000.00	428,800.00
211	300981	中红医疗	2023年1月3日 -2023年1月11日	18.78	22,300.00	418,794.00
212	688277	天智航-U	2023年1月3日 -2023年1月12日	11.89	33,400.00	397,126.00
213	688767	博拓生物	2023年1月3日 -2023年1月10日	46.20	7,900.00	364,980.00
214	688315	诺禾致源	2023年1月3日 -2023年1月5日	26.39	13,100.00	345,709.00
215	301166	优宁维	2023年1月10日 -2023年1月11日	45.73	6,000.00	274,380.00
216	688091	上海谊众-U	2023年1月3日 -2023年1月5日	69.80	3,900.00	272,220.00
217	688317	之江生物	2023年1月3日 -2023年1月5日	33.40	7,500.00	250,500.00
218	301235	华康医疗	2023年1月10日	35.77	7,000.00	250,390.00
219	688161	威高骨科	2023年1月3日 -2023年1月5日	52.19	4,500.00	234,855.00
220	002287	奇正藏药	2023年1月12日	22.85	10,000.00	228,500.00
221	688621	阳光诺和	2023年1月3日	102.40	2,100.00	215,040.00
222	688221	前沿生物-U	2023年1月3日 -2023年1月5日	17.26	12,300.00	212,298.00
223	688606	奥泰生物	2023年1月3日	104.4	2,000.00	208,800.00

				0		
224	688026	洁特生物	2023 年 1 月 3 日	24.06	8,600.00	206,916.00
225	600535	天士力	2023 年 1 月 3 日	10.76	18,400.00	197,984.00
226	301111	粤万年青	2023 年 1 月 3 日	19.62	10,000.00	196,200.00
227	688658	悦康药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	19.32	9,900.00	191,268.00
228	688076	诺泰生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	22.94	6,900.00	158,286.00
229	301122	采纳股份	2023 年 1 月 3 日	51.68	3,000.00	155,040.00
230	301207	华兰疫苗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	44.58	3,400.00	151,572.00
231	300966	共同药业	2023 年 1 月 3 日	27.00	5,600.00	151,200.00
232	300937	药易购	2023 年 1 月 3 日	28.86	5,200.00	150,072.00
233	688687	凯因科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	22.75	6,500.00	147,875.00
234	688513	苑东生物	2023 年 1 月 3 日	60.84	2,300.00	139,932.00
235	301126	达嘉维康	2023 年 1 月 3 日	14.89	9,000.00	134,010.00
236	301093	华兰股份	2023 年 1 月 3 日	25.40	5,000.00	127,000.00
237	301263	泰恩康	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	32.50	3,800.00	123,500.00
238	301239	普瑞眼科	2023 年 1 月 3 日	70.60	1,700.00	120,020.00
239	688189	南新制药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	17.26	6,400.00	110,464.00
240	688739	成大生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	30.42	3,600.00	109,512.00
241	688613	奥精医疗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	23.42	4,300.00	100,706.00
242	301065	本立科技	2023 年 1 月 3 日	30.78	3,000.00	92,340.00
243	301096	百诚医药	2023 年 1 月 3 日	68.31	1,200.00	81,972.00
244	301017	漱玉平民	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	17.99	3,300.00	59,367.00
245	688626	翔宇医疗	2023 年 1 月 3 日	31.88	1,800.00	57,384.00
246	301103	何氏眼科	2023 年 1 月 3 日	31.52	1,800.00	56,736.00
247	301201	诚达药业	2023 年 1 月 3 日	50.80	1,100.00	55,880.00
248	300878	维康药业	2023 年 1 月 3 日	24.80	1,600.00	39,680.00
249	301258	富士莱	2023 年 1 月 3 日	39.25	1,000.00	39,250.00
合计	-	-	-	-	23,669,400. 00	480,352,477 .00

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管

理及信息系统持续监控上述各类风险。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；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合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	122,713.72	-
未评级	-	-
合计	122,713.72	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

### 7.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的最大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VaR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	10,441,552.02	-	-	-	10,441,552.02
结算备付金	73,046.75	-	-	-	73,046.75
存出保证金	241,069.72	-	-	-	241,069.72
交易性金融资产	122,713.72	-	-	3,285,647,653.02	3,285,770,366. 74
应收清算款	-	-	-	597,725.40	597,725.40
其他资产	-	-	-	264,895.77	264,895.77
资产总计	10,878,382.21	-	-	3,286,510,274.19	3,297,388,656. 40
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	2,131.23	2,131.23
应付管理人报酬	-	-	-	1,439,805.48	1,439,805.48
应付托管费	-	-	-	287,961.08	287,961.08
应交税费	-	-	-	25,757.18	25,757.18
其他负债	-	-	-	1,464,242.34	1,464,242.34
负债总计	-	-	-	3,219,897.31	3,219,897.31
利率敏感度缺口	10,878,382.21	-	-	3,283,290,376.88	3,294,168,759. 09
上年度末 2021年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	14,123,942.01	-	-	-	14,123,942.01
结算备付金	1,113,723.29	-	-	-	1,113,723.29
存出保证金	41,448.97	-	-	-	41,448.97
交易性金融资产	-	-	-	1,723,812,188.68	1,723,812,188. 68
应收证券清算款	-	-	-	903,079.70	903,079.70
应收利息	-	-	-	41,001.67	41,001.67
应收股利	-	-	-	6,165.60	6,165.60
资产总计	15,279,114.27	-	-	1,724,762,435.65	1,740,041,549.

					92
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	725,924.94	725,924.94
应付管理人报酬	-	-	-	717,040.65	717,040.65
应付托管费	-	-	-	143,408.11	143,408.11
应付交易费用	-	-	-	506,352.08	506,352.08
应交税费	-	-	-	5,029.73	5,029.73
其他负债	-	-	-	672,186.76	672,186.76
负债总计	-	-	-	2,769,942.27	2,769,942.27
利率敏感度缺口	15,279,114.27	-	-	1,721,992,493.38	1,737,271,607.65

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券资产（不含可转债、可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VaR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

##### 7.4.13.4.3.1 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	
	2022 年 12 月 31 日		2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,285,647,653.02	99.74	1,723,812,188.68	99.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	122,713.72	0.00	-	-
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	3,285,770,366.74	99.75	1,723,812,188.68	99.23

#### 7.4.13.4.3.2 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			
	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）		
分析		本期末	上年度末	
		2022年12月31日	2021年12月31日	
上升 5%	163,524,651.26	84,878,612.93		
	下降 5%	-163,524,651.26	-84,878,612.93	

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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	上年度末
	2022年12月31日	2021年12月31日
第一层次	3,285,411,469.92	1,723,031,998.62
第二层次	122,713.72	780,190.06
第三层次	236,183.10	-

合计	3,285,770,366.74	1,723,812,188.68
----	------------------	------------------

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，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金融工具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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期		
	2022年1月1日至2022年12月31日		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	238,206.48	238,206.48
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-2,023.38	-2,023.38
其中：计入损益的利得或损失	-	-2,023.38	-2,023.38
期末余额	-	236,183.10	236,183.10
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动 ——公允价值变动损益	-	-2,023.38	-2,023.38
项目	上年度可比期间		
	2021年1月1日至2021年12月31日		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金	-	-	-

融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动 ——公允价值变动损益			
-------------------------------------	--	--	--

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	236,183.10	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	21.27%-73.86%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
无	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内及上年度可比期间内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

### §8 投资组合报告

#### 8.1 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	3,285,647,653.02	99.64
	其中：普通股	3,285,647,653.02	99.64
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	122,713.72	0.00
	其中：债券	122,713.72	0.00
	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	10,514,598.77	0.32
8	其他各项资产	1,103,690.89	0.03
9	合计	3,297,388,656.40	100.00

注：（1）上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 480,352,477.00 元，占基金资产净值比例 14.58%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末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	2,514,316,922.15	76.33
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	217,203,161.69	6.59
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	102,713.92	0.00
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	334,893,048.10	10.17
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	219,131,807.16	6.65
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,285,647,653.02	99.74

### 8.2.2 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通过港股通投资的股票。

### 8.3 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

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	600276	恒瑞医药	4,427,941	170,608,566.73	5.18
2	603259	药明康德	2,036,197	164,931,957.00	5.01
3	300760	迈瑞医疗	480,672	151,877,931.84	4.61
4	300015	爱尔眼科	3,557,380	110,527,796.60	3.36
5	600436	片仔癀	298,627	86,141,944.42	2.61
6	300122	智飞生物	791,911	69,553,543.13	2.11
7	300142	沃森生物	1,586,513	63,761,957.47	1.94
8	300896	爱美客	105,968	60,014,976.80	1.82
9	300347	泰格医药	520,679	54,567,159.20	1.66
10	000661	长春高新	320,541	53,354,049.45	1.62
11	600196	复星医药	1,258,798	44,360,041.52	1.35
12	000963	华东医药	869,584	40,696,531.20	1.24
13	000538	云南白药	713,784	38,801,298.24	1.18
14	002001	新和成	1,837,297	34,449,318.75	1.05
15	600763	通策医疗	223,629	34,213,000.71	1.04
16	300759	康龙化成	490,892	33,380,656.00	1.01
17	600085	同仁堂	680,325	30,396,921.00	0.92
18	002821	凯莱英	204,486	30,263,928.00	0.92
19	300003	乐普医疗	1,303,934	29,951,363.98	0.91

20	002422	科伦药业	1,122,012	29,856,739.32	0.91
21	002252	上海莱士	4,674,650	29,637,281.00	0.90
22	600079	人福医药	1,132,479	27,054,923.31	0.82
23	002603	以岭药业	828,461	24,820,691.56	0.75
24	002007	华兰生物	1,084,658	24,545,810.54	0.75
25	688180	君实生物-U	379,524	23,758,202.40	0.72
26	603939	益丰药房	358,360	22,877,702.40	0.69
27	603392	万泰生物	180,020	22,808,534.00	0.69
28	603882	金域医学	277,165	21,674,303.00	0.66
29	603456	九洲药业	496,282	21,057,245.26	0.64
30	300601	康泰生物	666,389	21,011,245.17	0.64
31	600332	白云山	698,103	20,796,488.37	0.63
32	300357	我武生物	363,989	20,055,793.90	0.61
33	601607	上海医药	1,101,705	19,643,400.15	0.60
34	002432	九安医疗	383,000	19,575,130.00	0.59
35	600161	天坛生物	817,667	19,403,237.91	0.59
36	600521	华海药业	883,627	19,316,086.22	0.59
37	002223	鱼跃医疗	595,325	18,967,054.50	0.58
38	000423	东阿阿胶	452,663	18,423,384.10	0.56
39	000999	华润三九	393,046	18,398,483.26	0.56
40	002294	信立泰	554,192	18,205,207.20	0.55
41	002317	众生药业	644,654	17,399,211.46	0.53
42	688301	奕瑞科技	36,655	16,783,591.40	0.51
43	002044	美年健康	2,714,120	16,637,555.60	0.51
44	300595	欧普康视	443,234	15,823,453.80	0.48
45	300832	新产业	311,440	15,615,601.60	0.47
46	300363	博腾股份	377,852	15,435,254.20	0.47
47	002030	达安基因	973,243	15,143,661.08	0.46
48	600529	山东药玻	527,400	14,978,160.00	0.45
49	603233	大参林	377,285	14,940,486.00	0.45
50	300529	健帆生物	480,092	14,868,449.24	0.45
51	688050	爱博医疗	63,742	14,705,279.40	0.45
52	002262	恩华药业	597,522	14,669,165.10	0.45
53	603658	安图生物	234,026	14,474,508.10	0.44
54	000623	吉林敖东	920,854	13,803,601.46	0.42
55	600771	广誉远	485,286	13,500,656.52	0.41
56	603127	昭衍新药	224,562	13,116,666.42	0.40
57	600380	健康元	1,147,923	12,960,050.67	0.39
58	600056	中国医药	744,007	12,819,240.61	0.39
59	300676	华大基因	247,611	12,799,012.59	0.39
60	300725	药石科技	158,376	12,749,268.00	0.39
61	600867	通化东宝	1,385,864	12,722,231.52	0.39
62	000739	普洛药业	581,594	12,527,534.76	0.38
63	300244	迪安诊断	497,644	12,505,793.72	0.38

64	300558	贝达药业	248,709	12,253,892.43	0.37
65	600998	九州通	928,200	12,103,728.00	0.37
66	000513	丽珠集团	371,921	12,079,994.08	0.37
67	300026	红日药业	2,087,965	11,859,641.20	0.36
68	688139	海尔生物	186,542	11,808,108.60	0.36
69	603883	老百姓	289,123	11,700,807.81	0.36
70	300633	开立医疗	212,700	11,662,341.00	0.35
71	600129	太极集团	387,301	11,642,268.06	0.35
72	603858	步长制药	549,477	11,544,511.77	0.35
73	300298	三诺生物	335,491	11,316,111.43	0.34
74	300199	翰宇药业	634,600	11,156,268.00	0.34
75	300294	博雅生物	299,211	10,939,154.16	0.33
76	300009	安科生物	1,161,024	10,867,184.64	0.33
77	002675	东诚药业	653,200	10,816,992.00	0.33
78	600511	国药股份	375,347	10,472,181.30	0.32
79	688617	惠泰医疗	33,700	10,343,541.00	0.31
80	688185	康希诺	69,600	10,162,992.00	0.31
81	600566	济川药业	366,394	9,973,244.68	0.30
82	000403	派林生物	432,756	9,849,526.56	0.30
83	600535	天士力	892,912	9,607,733.12	0.29
84	300677	英科医疗	456,672	9,603,812.16	0.29
85	688202	美迪西	43,933	9,396,829.37	0.29
86	002727	一心堂	294,861	9,291,070.11	0.28
87	002019	亿帆医药	728,778	8,927,530.50	0.27
88	002219	新里程	2,263,100	8,916,614.00	0.27
89	002332	仙琚制药	783,705	8,855,866.50	0.27
90	603707	健友股份	481,452	8,685,394.08	0.26
91	300573	兴齐眼药	68,600	8,580,488.00	0.26
92	000915	华特达因	186,210	8,472,555.00	0.26
93	600572	康恩贝	1,781,300	8,425,549.00	0.26
94	300482	万孚生物	263,157	8,386,813.59	0.25
95	688016	心脉医疗	43,639	8,249,516.56	0.25
96	600329	达仁堂	283,455	8,248,540.50	0.25
97	688276	百克生物	118,900	8,217,179.00	0.25
98	600055	万东医疗	417,732	8,162,483.28	0.25
99	688690	纳微科技	157,000	8,127,890.00	0.25
100	002424	贵州百灵	971,178	7,924,812.48	0.24
101	600267	海正药业	715,247	7,882,021.94	0.24
102	002099	海翔药业	1,124,026	7,879,422.26	0.24
103	600216	浙江医药	668,967	7,820,224.23	0.24
104	688520	神州细胞-U	128,717	7,800,250.20	0.24
105	688029	南微医学	94,676	7,775,739.88	0.24
106	688298	东方生物	100,103	7,718,942.33	0.23
107	600422	昆药集团	526,318	7,431,610.16	0.23

108	600062	华润双鹤	415,187	7,427,695.43	0.23
109	300463	迈克生物	423,879	7,333,106.70	0.22
110	603087	甘李药业	224,080	7,300,526.40	0.22
111	300685	艾德生物	275,033	7,274,622.85	0.22
112	002020	京新药业	596,074	7,260,181.32	0.22
113	600252	中恒集团	2,757,623	7,252,548.49	0.22
114	000756	新华制药	235,200	7,079,520.00	0.21
115	300233	金城医药	306,271	6,973,790.67	0.21
116	688677	海泰新光	61,459	6,944,867.00	0.21
117	000650	仁和药业	1,108,951	6,864,406.69	0.21
118	688131	皓元医药	63,000	6,827,940.00	0.21
119	600993	马应龙	298,614	6,748,676.40	0.20
120	002737	葵花药业	289,074	6,700,735.32	0.20
121	002390	信邦制药	1,408,934	6,621,989.80	0.20
122	600557	康缘药业	347,897	6,523,068.75	0.20
123	301047	义翘神州	65,260	6,503,811.60	0.20
124	688289	圣湘生物	291,624	6,401,146.80	0.19
125	300630	普利制药	258,274	6,369,036.84	0.19
126	600645	中源协和	371,506	6,319,317.06	0.19
127	688321	微芯生物	284,136	6,245,309.28	0.19
128	600587	新华医疗	285,238	6,109,797.96	0.19
129	600682	南京新百	667,400	6,093,362.00	0.18
130	300158	振东制药	813,700	6,062,065.00	0.18
131	600976	健民集团	121,200	6,022,428.00	0.18
132	605507	国邦医药	222,255	5,883,089.85	0.18
133	002038	双鹭药业	715,092	5,878,056.24	0.18
134	600285	羚锐制药	449,764	5,864,922.56	0.18
135	300039	上海凯宝	725,509	5,847,602.54	0.18
136	688266	泽璟制药-U	139,635	5,822,779.50	0.18
137	002349	精华制药	480,000	5,798,400.00	0.18
138	688621	阳光诺和	56,500	5,785,600.00	0.18
139	300497	富祥药业	435,869	5,753,470.80	0.17
140	002773	康弘药业	365,336	5,732,121.84	0.17
141	002550	千红制药	888,247	5,560,426.22	0.17
142	300401	花园生物	383,955	5,525,112.45	0.17
143	688575	亚辉龙	280,700	5,515,755.00	0.17
144	300841	康华生物	64,675	5,472,798.50	0.17
145	002382	蓝帆医疗	700,004	5,453,031.16	0.17
146	600812	华北制药	849,855	5,439,072.00	0.17
147	000078	海王生物	1,637,100	5,435,172.00	0.16
148	600200	江苏吴中	708,900	5,423,085.00	0.16
149	600750	江中药业	375,177	5,421,307.65	0.16
150	603368	柳药集团	287,254	5,363,032.18	0.16
151	688198	佰仁医疗	41,174	5,311,446.00	0.16

152	002932	明德生物	91,605	5,246,218.35	0.16
153	300869	康泰医学	159,000	5,178,630.00	0.16
154	002581	未名医药	326,720	5,145,840.00	0.16
155	300181	佐力药业	481,834	5,141,168.78	0.16
156	300326	凯利泰	713,054	5,133,988.80	0.16
157	300049	福瑞股份	209,400	5,115,642.00	0.16
158	300639	凯普生物	303,418	5,112,593.30	0.16
159	600789	鲁抗医药	700,030	5,082,217.80	0.15
160	688091	上海谊众-U	72,800	5,081,440.00	0.15
161	603301	振德医疗	131,300	4,995,965.00	0.15
162	300705	九典制药	205,140	4,984,902.00	0.15
163	002589	瑞康医药	1,190,650	4,905,478.00	0.15
164	000028	国药一致	147,726	4,858,708.14	0.15
165	002399	海普瑞	372,268	4,783,643.80	0.15
166	300406	九强生物	292,035	4,780,612.95	0.15
167	688278	特宝生物	122,500	4,768,925.00	0.14
168	002653	海思科	213,644	4,753,579.00	0.14
169	688356	键凯科技	30,338	4,749,413.90	0.14
170	688166	博瑞医药	207,563	4,684,696.91	0.14
171	600420	国药现代	510,719	4,647,542.90	0.14
172	603896	寿仙谷	116,336	4,613,885.76	0.14
173	300653	正海生物	105,975	4,556,925.00	0.14
174	600664	哈药股份	1,506,560	4,534,745.60	0.14
175	000989	九芝堂	508,467	4,479,594.27	0.14
176	600351	亚宝药业	761,007	4,474,721.16	0.14
177	688317	之江生物	131,700	4,398,780.00	0.13
178	600211	西藏药业	122,005	4,382,419.60	0.13
179	603538	美诺华	169,523	4,365,217.25	0.13
180	300267	尔康制药	1,226,432	4,353,833.60	0.13
181	688578	艾力斯-U	221,082	4,350,893.76	0.13
182	603987	康德莱	305,930	4,215,715.40	0.13
183	000534	万泽股份	296,400	4,179,240.00	0.13
184	300149	睿智医药	395,947	4,121,808.27	0.13
185	688366	昊海生科	41,780	4,075,221.20	0.12
186	603520	司太立	205,120	4,014,198.40	0.12
187	300723	一品红	112,754	3,899,033.32	0.12
188	002437	誉衡药业	1,532,498	3,892,544.92	0.12
189	300143	盈康生命	381,209	3,876,895.53	0.12
190	002950	奥美医疗	314,050	3,847,112.50	0.12
191	688221	前沿生物-U	221,846	3,829,061.96	0.12
192	603229	奥翔药业	159,637	3,799,360.60	0.12
193	603387	基蛋生物	301,730	3,771,625.00	0.11
194	301015	百洋医药	156,700	3,735,728.00	0.11
195	688513	苑东生物	60,800	3,699,072.00	0.11

196	300436	广生堂	93,555	3,663,613.80	0.11
197	300636	同和药业	243,350	3,604,013.50	0.11
198	605369	拱东医疗	34,100	3,601,301.00	0.11
199	000597	东北制药	568,524	3,587,386.44	0.11
200	603567	珍宝岛	279,800	3,567,450.00	0.11
201	000766	通化金马	668,447	3,522,715.69	0.11
202	000950	重药控股	691,800	3,514,344.00	0.11
203	300702	天宇股份	137,636	3,512,470.72	0.11
204	603108	润达医疗	344,445	3,482,338.95	0.11
205	300206	理邦仪器	288,500	3,470,655.00	0.11
206	600594	益佰制药	625,541	3,459,241.73	0.11
207	300194	福安药业	944,109	3,398,792.40	0.10
208	688658	悦康药业	175,520	3,391,046.40	0.10
209	300396	迪瑞医疗	136,300	3,354,343.00	0.10
210	002462	嘉事堂	231,700	3,334,163.00	0.10
211	600713	南京医药	649,400	3,324,928.00	0.10
212	000813	德展健康	885,771	3,286,210.41	0.10
213	000566	海南海药	768,996	3,283,612.92	0.10
214	002082	万邦德	367,200	3,238,704.00	0.10
215	000518	四环生物	1,017,600	3,225,792.00	0.10
216	000931	中关村	523,188	3,217,606.20	0.10
217	300204	舒泰神	235,500	3,202,800.00	0.10
218	301239	普瑞眼科	45,300	3,198,180.00	0.10
219	300147	香雪制药	522,770	3,173,213.90	0.10
220	301060	兰卫医学	159,000	3,117,990.00	0.09
221	688399	硕世生物	35,516	3,115,108.36	0.09
222	000788	北大医药	416,805	3,101,029.20	0.09
223	300239	东宝生物	411,500	3,086,250.00	0.09
224	688315	诺禾致源	115,700	3,053,323.00	0.09
225	688085	三友医疗	108,465	3,009,903.75	0.09
226	300110	华仁药业	700,100	2,968,424.00	0.09
227	002728	特一药业	131,500	2,965,325.00	0.09
228	002118	紫鑫药业	1,271,056	2,961,560.48	0.09
229	688277	天智航-U	248,099	2,949,897.11	0.09
230	002524	光正眼科	411,500	2,938,110.00	0.09
231	688389	普门科技	164,308	2,929,611.64	0.09
232	603309	维力医疗	145,300	2,903,094.00	0.09
233	600222	太龙药业	455,300	2,900,261.00	0.09
234	300485	赛升药业	239,300	2,866,814.00	0.09
235	600479	千金药业	297,371	2,854,761.60	0.09
236	002435	长江健康	610,700	2,851,969.00	0.09
237	688076	诺泰生物	123,800	2,839,972.00	0.09
238	300452	山河药辅	161,900	2,836,488.00	0.09
239	000790	华神科技	623,300	2,836,015.00	0.09

240	000710	贝瑞基因	248,453	2,834,848.73	0.09
241	300006	莱美药业	733,920	2,796,235.20	0.08
242	301089	拓新药业	38,000	2,736,000.00	0.08
243	688161	威高骨科	52,300	2,729,537.00	0.08
244	002551	尚荣医疗	586,223	2,725,936.95	0.08
245	600624	复旦复华	474,407	2,713,608.04	0.08
246	300439	美康生物	229,801	2,688,671.70	0.08
247	002198	嘉应制药	403,400	2,630,168.00	0.08
248	688687	凯因科技	114,200	2,598,050.00	0.08
249	301101	明月镜片	40,500	2,552,310.00	0.08
250	300255	常山药业	461,700	2,530,116.00	0.08
251	000504	南华生物	217,300	2,529,372.00	0.08
252	300683	海特生物	71,445	2,529,153.00	0.08
253	301080	百普赛斯	24,200	2,485,098.00	0.08
254	002365	永安药业	236,200	2,480,100.00	0.08
255	603222	济民医疗	282,880	2,475,200.00	0.08
256	301211	亨迪药业	69,400	2,404,710.00	0.07
257	300453	三鑫医疗	274,850	2,369,207.00	0.07
258	300318	博晖创新	404,400	2,365,740.00	0.07
259	000919	金陵药业	302,900	2,353,533.00	0.07
260	300642	透景生命	113,008	2,349,436.32	0.07
261	002275	桂林三金	173,700	2,296,314.00	0.07
262	301087	可孚医疗	62,800	2,290,944.00	0.07
263	603811	诚意药业	163,300	2,284,567.00	0.07
264	688606	奥泰生物	21,744	2,270,073.60	0.07
265	301263	泰恩康	68,800	2,236,000.00	0.07
266	603439	贵州三力	162,500	2,229,500.00	0.07
267	301096	百诚医药	32,600	2,226,906.00	0.07
268	002940	昂利康	81,800	2,213,508.00	0.07
269	300016	北陆药业	339,125	2,211,095.00	0.07
270	002750	龙津药业	198,500	2,209,305.00	0.07
271	000908	景峰医药	694,285	2,207,826.30	0.07
272	300238	冠昊生物	212,685	2,186,401.80	0.07
273	601089	福元医药	142,600	2,186,058.00	0.07
274	002900	哈三联	157,300	2,147,145.00	0.07
275	603676	卫信康	127,800	2,034,576.00	0.06
276	003020	立方制药	62,260	2,010,998.00	0.06
277	002901	大博医疗	58,744	1,999,058.32	0.06
278	300404	博济医药	255,000	1,994,100.00	0.06
279	688767	博拓生物	43,100	1,991,220.00	0.06
280	605116	奥锐特	78,900	1,948,041.00	0.06
281	688189	南新制药	112,600	1,943,476.00	0.06
282	002393	力生制药	89,100	1,896,939.00	0.06
283	002644	佛慈制药	203,000	1,893,990.00	0.06

284	605199	葫芦娃	117,600	1,883,952.00	0.06
285	688613	奥精医疗	80,300	1,880,626.00	0.06
286	300289	利德曼	321,100	1,849,536.00	0.06
287	301207	华兰疫苗	40,100	1,787,658.00	0.05
288	002107	沃华医药	284,640	1,764,768.00	0.05
289	688136	科兴制药	80,700	1,730,208.00	0.05
290	688026	洁特生物	71,317	1,715,887.02	0.05
291	300981	中红医疗	87,120	1,636,113.60	0.05
292	300501	海顺新材	113,300	1,634,919.00	0.05
293	002923	润都股份	93,090	1,629,075.00	0.05
294	002907	华森制药	78,000	1,588,080.00	0.05
295	300966	共同药业	58,100	1,568,700.00	0.05
296	300584	海辰药业	48,200	1,552,040.00	0.05
297	688626	翔宇医疗	48,493	1,545,956.84	0.05
298	301103	何氏眼科	48,400	1,525,568.00	0.05
299	002287	奇正藏药	66,319	1,515,389.15	0.05
300	301201	诚达药业	29,253	1,486,052.40	0.05
301	301122	采纳股份	28,401	1,467,763.68	0.04
302	300314	戴维医疗	112,200	1,456,356.00	0.04
303	300937	药易购	48,044	1,386,549.84	0.04
304	000411	英特集团	113,200	1,309,724.00	0.04
305	603122	合富中国	116,800	1,308,160.00	0.04
306	688739	成大生物	42,100	1,280,682.00	0.04
307	301166	优宁维	26,300	1,202,699.00	0.04
308	603351	威尔药业	54,500	1,178,835.00	0.04
309	301235	华康医疗	31,918	1,141,706.86	0.03
310	301017	漱玉平民	62,200	1,118,978.00	0.03
311	301258	富士莱	28,000	1,099,000.00	0.03
312	600829	人民同泰	171,400	1,093,532.00	0.03
313	301065	本立科技	35,500	1,092,690.00	0.03
314	300878	维康药业	43,680	1,083,264.00	0.03
315	301093	华兰股份	41,100	1,043,940.00	0.03
316	301097	天益医疗	17,900	1,010,992.00	0.03
317	301111	粤万年青	49,130	963,930.60	0.03
318	603976	正川股份	45,900	943,245.00	0.03
319	301126	达嘉维康	61,900	921,691.00	0.03
320	301257	普蕊斯	18,300	876,936.00	0.03
321	301130	西点药业	24,700	713,089.00	0.02
322	688398	赛特新材	3,246	112,506.36	0.00
323	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.00
324	688455	科捷智能	5,277	69,234.24	0.00
325	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
326	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
327	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00

328	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
-----	--------	-----	-----	----------	------

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	603259	药明康德	156,156,428.38	8.99
2	600276	恒瑞医药	131,664,063.90	7.58
3	600436	片仔癀	84,429,737.75	4.86
4	600196	复星医药	40,906,130.02	2.35
5	600085	同仁堂	24,353,625.00	1.40
6	603392	万泰生物	22,902,815.94	1.32
7	600763	通策医疗	22,312,168.79	1.28
8	688180	君实生物-U	19,729,627.81	1.14
9	688139	海尔生物	19,231,226.74	1.11
10	603456	九洲药业	17,766,282.27	1.02
11	603882	金域医学	16,393,566.00	0.94
12	600332	白云山	15,998,409.71	0.92
13	600079	人福医药	15,792,691.54	0.91
14	601607	上海医药	15,740,245.62	0.91
15	688298	东方生物	14,651,679.28	0.84
16	600521	华海药业	14,376,479.00	0.83
17	600161	天坛生物	13,735,705.11	0.79
18	603939	益丰药房	13,110,601.13	0.75
19	603127	昭衍新药	12,540,134.63	0.72
20	600771	广誉远	12,285,054.34	0.71

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“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（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用，不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

##### 8.4.2 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
----	------	------	----------	--------

				资产净值比例 (%)
1	603259	药明康德	72,613,364.72	4.18
2	600276	恒瑞医药	63,794,546.55	3.67
3	600436	片仔癀	45,051,199.05	2.59
4	300896	爱美客	27,531,618.00	1.58
5	300760	迈瑞医疗	23,211,392.00	1.34
6	600196	复星医药	16,428,587.91	0.95
7	688139	海尔生物	14,361,873.87	0.83
8	603392	万泰生物	13,105,281.65	0.75
9	600085	同仁堂	11,998,678.51	0.69
10	688363	华熙生物	10,981,977.67	0.63
11	688266	泽璟制药-U	9,380,957.66	0.54
12	603456	九洲药业	8,815,367.02	0.51
13	688180	君实生物-U	8,242,368.38	0.47
14	000516	国际医学	8,088,330.50	0.47
15	600763	通策医疗	8,033,001.93	0.46
16	601607	上海医药	7,833,703.00	0.45
17	600332	白云山	7,627,309.00	0.44
18	002821	凯莱英	7,448,573.10	0.43
19	000661	长春高新	7,413,710.00	0.43
20	600521	华海药业	7,388,503.00	0.43

#### 8.4.3 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	1,552,525,324.46
卖出股票收入（成交）总额	857,596,011.28

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	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）	122,713.72	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	122,713.72	0.00

#### 8.6 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	123172	漱玉转债	1,227	122,713.72	0.00

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 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。

**8.12.2** 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。

### 8.12.3 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	241,069.72
2	应收清算款	597,725.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	264,895.77
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,103,690.89

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十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	300015	爱尔眼科	22,929,660.00	0.70	转融通流通受限
2	600436	片仔癀	14,942,228.00	0.45	转融通流通受限
3	300347	泰格医药	13,487,760.00	0.41	转融通流通受限
4	000661	长春高新	11,651,500.00	0.35	转融通流通受限
5	300760	迈瑞医疗	10,806,174.00	0.33	转融通流通受限
6	603259	药明康德	9,639,000.00	0.29	转融通流通受限
7	600276	恒瑞医药	8,522,836.00	0.26	转融通流通受限
8	300142	沃森生物	5,071,978.00	0.15	转融通流通受限

9	300896	爱美客	3,341,465.00	0.10	转融通流通受限
10	300122	智飞生物	3,249,710.00	0.10	转融通流通受限

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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		广发中证全指医药卫 生交易型开放式指数 证券投资基金发起式 联接基金	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份额 比例
64,708	64,591.20	2,260,582,1 58.00	54.09%	1,918,985,0 78.00	45.91%	1,978,096, 676.00	47.33%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

### 9.2 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	方正证券股份有限公司	26,139,494.00	0.63%
2	香港中央结算有限公司	24,427,300.00	0.58%
3	民生人寿保险股份有限公司-传统保险产品	18,230,300.00	0.44%
4	东吴人寿保险股份有限公司-自有资金	17,300,000.00	0.41%
5	安信证券股份有限公司	15,700,000.00	0.38%
6	招商证券股份有限公司	14,913,505.00	0.36%
7	中信建投证券股份有限公司	13,239,274.00	0.32%
8	人保资管-中国银行-人保资产安心盛世 50 号资产管理产品	13,157,800.00	0.31%
9	北京腾辉盛华私募基金管理有限公司-盛华 1 号私募证券投资基金	12,693,300.00	0.30%
10	中国人寿资管-广发银行-国寿资产-创安 FOF 优选 2288 资产管理产品	12,000,000.00	0.29%

11	广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1,978,096,676.00	47.33%
----	---------------------------------	------------------	--------

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年12月1日)基金份额总额	473,283,618.00
本报告期期初基金份额总额	873,283,618.00
本报告期基金总申购份额	2,478,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	799,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	1,627,283,618.00
本报告期期末基金份额总额	4,179,567,236.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。截至本报告期末，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已连续 5 年为本基金提供审计服务，本报告年度的审计费用为 74,000 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
海通证券	2	1,370,376,839.93	57.06%	1,002,149.67	53.88%	-
广发证券	3	518,181,771.38	21.57%	482,591.52	25.94%	-
粤开证券	3	362,448,712.71	15.09%	265,060.90	14.25%	-
安信证券	1	149,320,793.41	6.22%	109,198.70	5.87%	-
银河证券	2	1,481,322.10	0.06%	1,083.29	0.06%	-
万和证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
大同证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	4	-	-	-	-	新增 4 个
国融证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
国盛证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	4	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	新增 2 个

财达证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
长江证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
首创证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
中泰证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
华创证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易单元选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- (2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

### 11.7.2 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		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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				比例		
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	4,861,247.07	58.83%	-	-	-	-
粤开证券	3,270,086.04	39.57%	-	-	-	-
安信证券	131,805.79	1.59%	-	-	-	-
银河证券	642.42	0.01%	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-21
2	关于增加开源证券为旗下部分基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-02-28

3	关于增加华安证券为旗下部分基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-28
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-30
5	关于广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金管理流动性服务商终止的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-18
6	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-21
7	关于广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金管理流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-27
8	关于广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金管理份额拆分并调整最小申购赎回单位的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-05-24
9	关于广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金管理份额拆分结果及恢复申购、赎回的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-05-30
10	关于增加国金证券为旗下部分基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-06-17
11	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-07-20
12	关于增加财达证券为旗下部分 ETF 场内申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-08-19
13	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-08-30
14	广发基金管理有限公司关于调整“特定投资群体(养老金客户)”的客户适用范围的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-09-02
15	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-10-26
16	关于增加东方财富证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-11-07
17	关于增加安信证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-12-08
18	关于广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金管理流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-12-09
19	关于增加金元证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-12-13
20	关于增加华金证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-12-16
21	关于广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金管理流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-12-30

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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
广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20220101-20221231	516,277,438.00	1,726,819,538.00	265,000,300.00	1,978,096,676.00	47.33%
<b>产品特有风险</b>							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>① 当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</li> <li>② 在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；</li> <li>③ 当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</li> <li>④ 在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</li> <li>⑤ 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</li> </ul> <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管理机制，切实保护持有人利益。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，为更好地服务投资者，本基金管理人决定对本基金（基金代码：159938；场内简称：医药卫生 ETF）进行基金份额拆分，拆分比例为 1:2，即每 1 份基金份额拆为 2 份；并自 2022 年 5 月 30 日起将本基金最小申购、赎回单位由 100 万份调整为 250 万份。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分并调整最小申购赎回单位的公告》《关于广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果及恢复申购、赎回的公告》。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2.《广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3.《广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4.法律意见书
- 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

### 13.2 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

### 13.3 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

二〇二三年三月三十日