

万家健康产业混合型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计，立信会计师事务所为本基金出具了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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
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	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	25
§ 8 投资组合报告	58

8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
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	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
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	75
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	75
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	75
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	76
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
8.12 投资组合报告附注	76
§ 9 基金份额持有人信息	77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	77
§ 10 开放式基金份额变动	78
§ 11 重大事件揭示	78
11.1 基金份额持有人大会决议	78
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	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
11.4 基金投资策略的改变	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	79
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	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	79
11.8 其他重大事件	82
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	84
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	84
§ 13 备查文件目录	85
13.1 备查文件目录	85
13.2 存放地点	85
13.3 查阅方式	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家健康产业混合型证券投资基金	
基金简称	万家健康产业混合	
基金主代码	010054	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 9 月 30 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	840,957,036.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	万家健康产业混合 A	万家健康产业混合 C
下属分级基金的交 易代码	010054	010055
报告期末下属分级 基金的份额总额	475,715,861.94 份	365,241,174.58 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于健康产业主题相关的优质上市公司，以分享中国经济增长和健康产业带来的投资机会，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略：（1）健康产业的界定；（2）个股投资策略；（3）存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、股指期货投资策略；8、国债期货投资策略；9、股票期权投资策略；10、融资交易策略；11、信用衍生品投资策略；12、其他。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×10%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 本基金可投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

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		万家基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	王小飞
	联系电话	021-38909626	021-60637103

电子邮箱	lanj@wjasset.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	4008880800	021-60637228
传真	021-38909627	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200122	100033
法定代表人	方一天	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名 义楼层 9 层）基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通 合伙）	上海市南京东路 61 号 4 楼新黄浦金融大厦
注册登记机构	万家基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）

§ 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

3.1. 1 期 间数 据和 指标	2022 年		2021 年		2020 年 9 月 30 日-2020 年 12 月 31 日	
	万家健康产业 混合 A	万家健康产业 混合 C	万家健康产业 混合 A	万家健康产业 混合 C	万家健康产业 混合 A	万家健康产业 混合 C
本期 已实 现收 益	-85,847,836.47	-54,271,696.73	59,189,016.31	4,047,220.62	1,899,358.18	40,564.70
本期 利润	-70,523,968.20	-75,545,557.07	65,705,243.53	3,530,553.94	4,023,907.05	96,285.97
加权 平均 基金 份额 本期 利润	-0.1513	-0.4393	0.3806	0.2878	0.0104	0.0086
本期	-14.25%	-41.49%	34.31%	24.93%	1.04%	0.86%

加权平均净值利润率						
本期基金份额净值增长率	-15.56%	-16.01%	25.13%	24.51%	1.05%	0.92%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	32,135,560.36	20,244,343.74	33,026,032.75	11,954,398.60	1,883,380.14	36,233.91
期末可供分配基金份额利润	0.0676	0.0554	0.2644	0.2566	0.0049	0.0037
期末基金资产净值	507,851,422.30	385,485,518.32	157,945,126.17	58,535,685.72	386,339,090.31	10,010,479.89
期末基金份额净值	1.0676	1.0554	1.2644	1.2566	1.0105	1.0092
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	6.76%	5.54%	26.44%	25.66%	1.05%	0.92%

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

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

3、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

万家健康产业混合 A

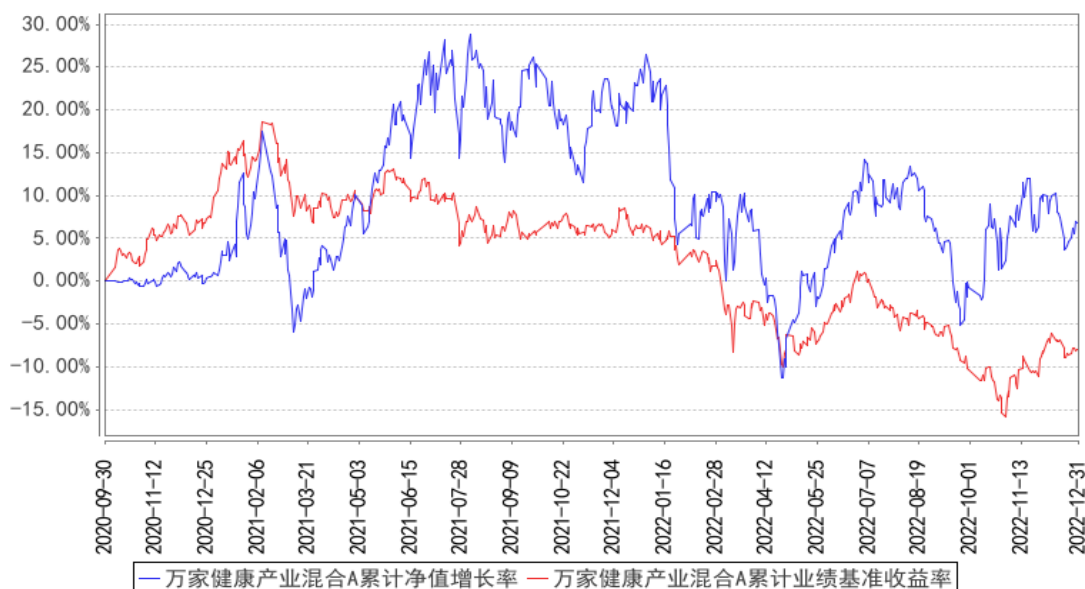
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.53%	1.76%	2.76%	0.98%	4.77%	0.78%
过去六个月	-4.30%	1.57%	-8.69%	0.82%	4.39%	0.75%
过去一年	-15.56%	1.70%	-13.58%	0.93%	-1.98%	0.77%
自基金合同生效起至今	6.76%	1.58%	-7.94%	0.84%	14.70%	0.74%

万家健康产业混合 C

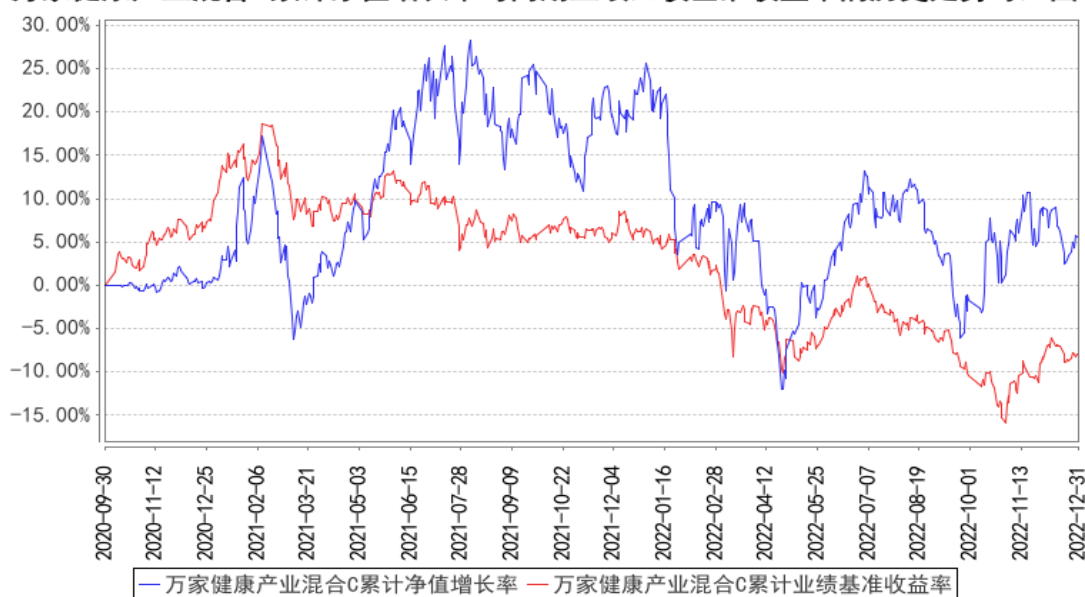
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.41%	1.76%	2.76%	0.98%	4.65%	0.78%
过去六个月	-4.55%	1.57%	-8.69%	0.82%	4.14%	0.75%
过去一年	-16.01%	1.70%	-13.58%	0.93%	-2.43%	0.77%
自基金合同生效起至今	5.54%	1.58%	-7.94%	0.84%	13.48%	0.74%

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

万家健康产业混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



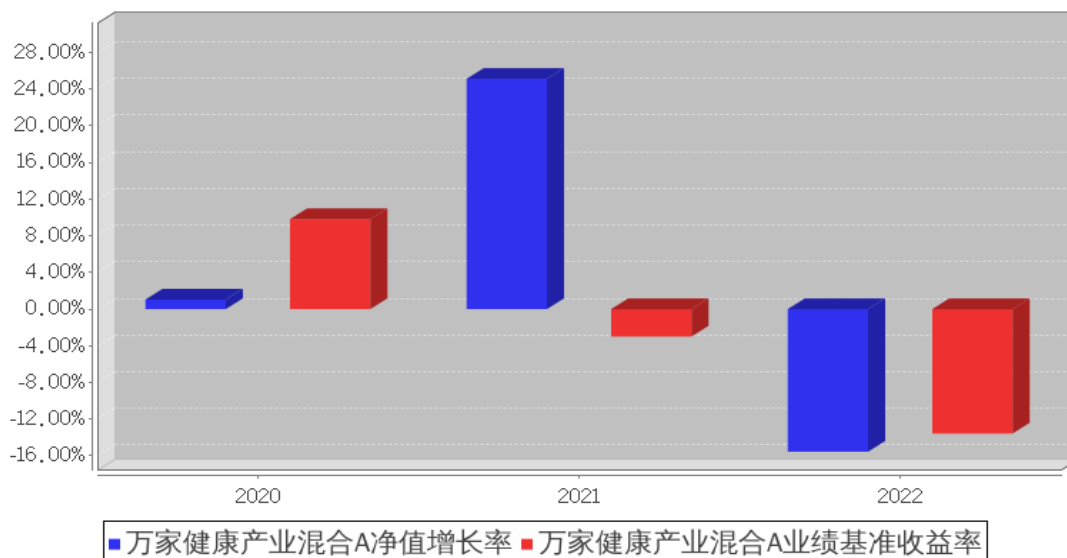
万家健康产业混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



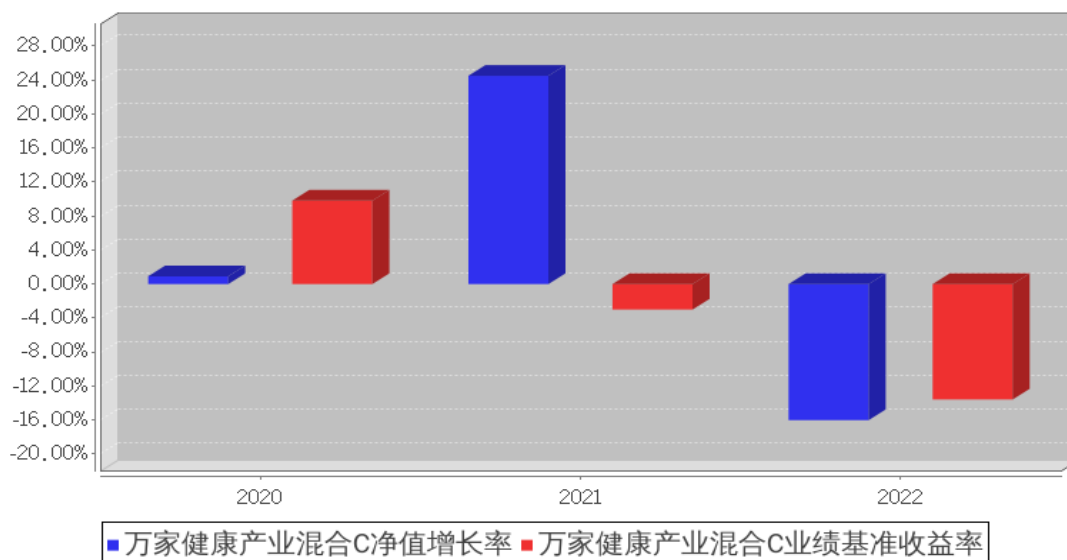
注：本基金于 2020 年 9 月 30 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

3.2.3 自基金合同生效以来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

万家健康产业混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



万家健康产业混合C基金每年净值增长率与同期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

本基金成立（2020年9月30日）以来未分配利润。

§ 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

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。截至报告期末，公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司和齐河众鑫投资有限公司，

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 楼（名义楼层 9 层），办公地点：上海市浦东新区浦电路 360 号 9 楼，注册资本 3 亿元人民币。截至报告期末，公司共管理一百二十只开放式基金，分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金、万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家家年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家中证 500

指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金（QDII）、万家瑞泰混合型证券投资基金、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、万家匠心致远一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投资基金、万家颐远均衡一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家欣远混合型证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家优享平衡混合型发起式证券投资基金、万家洞见进取混合型发起式证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
高源	万家欣远混合型证券投资基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金的基金经理。	2020 年 9 月 30 日	-	17 年	国籍：中国；学历：伦敦政治经济学院会计与金融专业硕士；相关业务资格：证券投资基金从业资格；过往从业经历：2017 年 4 月入职万家基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理。曾任光大证券股份有限公司研究所研究员，安信证券股份有限公司研究部高级研究员，申万菱信基金管理有限公司投资管理部高级研究员、基金经理等职。
王霄音	万家健康产业混合型证券投资基金的基金经理。	2021 年 2 月 8 日	-	8.5 年	国籍：中国；学历：中国科学院上海药物研究所药物化学专业博士；相关业务资格：证券投资基金从业资格；过往从业经历：2015 年 9 月入职万家基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理，历任投资研究部研究员、基金经理助理。曾任上海恒复投资管理有限公司投资研究部研究员等职。

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金

运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋取最大利益,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《万家基金管理有限公司公平交易管理办法》,涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送,确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上:(1)公司投资管理实行分层次决策,投资决策委员会根据公募基金和私募投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。(2)公司研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布,确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施决策方面享有公平的机会。

在交易执行上:(1)公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离,实行集中交易制度;(2)对于交易公开竞价交易,所有指令必须通过系统下达,公司执行交易系统中的公平交易程序;(3)对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,原则上公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;(4)对于银行间交易,交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上,公司定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易,场外交易对手议价的价格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析,基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存记录,并定期编制公平交易分析报告,由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司定期进行同向交易价差分析,即采集公司旗下管理的所有组合,连续四个季度期间内,不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的同向交易样本,对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为0,95%的置信水平下的t检验,并对结论进行跟踪分析,分析结果显示在样本数量大于30的前提下,组合之间在同向交易方面不存在违反公平交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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 13 次，为量化投资组合或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。

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

本基金主要持有医药行业股票。2022 年整个市场呈现出熊市氛围，医药板块也有较大幅度的下跌，全年申万医药生物指数下跌 20.34%，在所有行业里排名 20/31。但值得我们关注的是，医药行业三季度末触底后的反弹亮眼，四季度申万医药生物指数涨幅 10.56%，在所有行业里排名 5/31，且关注度大幅提升。究其原因，我们认为医药板块在经过长达 4 年多的集采和 2 年多的估值消化后，行业的估值和机构持仓比例都已经到历史底部，并且已经走出政策负面影响最大的阶段，当前我们可以明确判断，医药行业将走出熊市，迎来行业基本面底+政策底+估值底+持仓底后的拐点。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家健康产业混合 A 的基金份额净值为 1.0676 元，本报告期基金份额净值增长率为-15.56%，同期业绩比较基准收益率为-13.58%，截至本报告期末万家健康产业混合 C 的基金份额净值为 1.0554 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.01%，同期业绩比较基准收益率为-13.58%。

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 2023，我们认为今年全年乃至未来 2-3 年医药板块都有较大概率获得相对收益，医药行业的持仓也预计会从低配走向标配及以上。在疫情后复苏的大背景下，医药作为需求最为刚性、复苏最为确定的行业，我们认为行业整体估值水位有上行的空间，各个细分子行业可能有多点开花的行情。

从投资的角度来说，我们 2022 年全年秉承稳健的策略，总体持仓较为均衡和分散，以自下而上的个股挖掘思路为主。2023 年我们也将继续坚持稳健均衡的投资策略，从自上而下角度布局景气度初期的小而美的赛道，同时自下而上挖掘估值和基本面匹配的个股进行投资。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，主要做了以下工作：

（一）加强风控文化建设

不断梳理和优化制度流程、防范操作风险、加强对员工的合规培训和加深员工对合规风控工

作的理解，确保公司各项业务合法合规。

（二）制度流程建设

为加强内控管理，保证公司各项制度流程的有效性、及时性、完备性，本年度对投资、销售、专户业务相关的制度流程及后台部门相关制度进行了修订。

（三）定期和临时稽核工作

报告期内，监察稽核部门按计划完成了各项定期稽核和专项稽核，检查内容覆盖公司各业务部门和业务环节，检查完成后出具监察稽核报告和建议书，并对整改情况进行跟踪。

（四）绩效评估和风险管理工作

报告期内，进一步完善了每日风险监控工作；改进基金业绩评价工作，辅助基金经理投资决策，提供风险评估意见等；针对由于市场流动性紧张的情况，加大了对固定收益产品的风险管理，防范资金交收风险。

（五）员工行为管理与防控内幕交易

报告期内，公司进一步完善防控内幕交易制度和从业人员投资申报等制度，强化员工行为管理工作，防范内幕交易和利益输送。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会, 定期评价现行估值政策和程序, 在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由负责估值业务的分管领导、合规稽核部负责人、基金运营部负责人、相关估值业务岗位人员、相关风控人员等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格, 精通各自领域的理论知识, 熟悉政策法规, 并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论, 但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，本基金管理人与中证指数有限公司签署了《中证债券估值数据服务协议》、《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

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

本报告期内，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情况。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2023]第 ZA30338 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	万家健康产业混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了万家健康产业混合型证券投资基金(以下简称“万家健康产业混合”)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、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反

	<p>映了万家健康产业混合 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。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>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，我们独立于万家健康产业混合，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。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>万家健康产业混合的基金管理人万家基金管理有限公司管理层（以下简称管理层）负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估万家健康产业混合的持续经营能力，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。</p> <p>基金管理人治理层负责监督万家健康产业混合的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不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。</p> <p>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：</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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，就可能导致对万家健康产业混合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</p>

	<p>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万家健康产业混合不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>我们与基金管理人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。</p>	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	朱颖	杨利敏
会计师事务所的地址	中国 上海	
审计报告日期	2023 年 03 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家健康产业混合型证券投资基金

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	77,156,198.23	42,785,969.27
结算备付金		4,231,095.41	1,207,700.45
存出保证金		548,133.58	126,995.23
交易性金融资产	7.4.7.2	813,364,583.66	194,675,885.80
其中：股票投资		813,364,583.66	194,675,885.80
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		46,672,549.44	-
应收股利		30,713.11	-
应收申购款		44,978.92	563,484.54

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	2,892.96
资产总计		942,048,252.35	239,362,928.25
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负 债:			
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		39,552,777.43	21,238,548.73
应付赎回款		4,926,839.22	455,785.29
应付管理人报酬		1,128,136.39	189,542.47
应付托管费		188,022.71	31,590.39
应付销售服务费		139,218.23	11,002.01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	2,776,317.75	955,647.47
负债合计		48,711,311.73	22,882,116.36
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	840,957,036.52	171,500,380.54
其他综合收益	7.4.7.8	-	-
未分配利润	7.4.7.9	52,379,904.10	44,980,431.35
净资产合计		893,336,940.62	216,480,811.89
负债和净资产总计		942,048,252.35	239,362,928.25

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 840,957,036.52 份，其中万家健康产业混合 A 基金份额净值 1.0676 元，基金份额总额 475,715,861.94 份；万家健康产业混合 C 基金份额净值 1.0554 元，基金份额总额 365,241,174.58 份。

2、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：万家健康产业混合型证券投资基金

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
一、营业总收入		-133,268,371.08	78,415,758.18
1. 利息收入		415,121.80	167,309.17
其中：存款利息收入	7.4.7.10	415,121.80	151,337.05
债券利息收入		-	12,126.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,845.26
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-128,514,909.74	71,606,750.50
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-132,535,313.60	70,601,629.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-32,089.65	-62,451.86
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	4,052,493.51	1,067,572.72
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-5,949,992.07	5,999,560.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	781,408.93	642,137.97
减：二、营业总支出		12,801,154.19	9,179,960.71
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	10,044,755.16	3,116,301.54
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,674,125.73	519,383.71
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	894,259.43	69,900.75
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	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		1.37	0.19
8. 其他费用	7.4.7.20	188,012.50	5,474,374.52

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-146,069,525.27	69,235,797.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-146,069,525.27	69,235,797.47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-146,069,525.27	69,235,797.47

注：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：万家健康产业混合型证券投资基金

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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	171,500,380.54	-	44,980,431.35	216,480,811.89
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	171,500,380.54	-	44,980,431.35	216,480,811.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	669,456,655.98	-	7,399,472.75	676,856,128.73
(一)、综合收	-	-	-146,069,525.27	-146,069,525.27

益总额				
(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)	669,456,655.98	-	153,468,998.02	822,925,654.00
其中:1. 基金申购款	1,346,663,275.30	-	168,044,861.72	1,514,708,137.02
2 .基金赎回款	-677,206,619.32	-	-14,575,863.70	-691,782,483.02
(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)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	840,957,036.52	-	52,379,904.10	893,336,940.62
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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基	392,252,131.34	-	4,097,438.86	396,349,570.20

金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	392,252,131.34	-	4,097,438.86	396,349,570.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-220,751,750.80	-	40,882,992.49	-179,868,758.31
(一)、综合收益总额	-	-	69,235,797.47	69,235,797.47
(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)	-220,751,750.80	-	-28,352,804.98	-249,104,555.78
其中:1.基金申购款	152,570,486.16	-	30,211,463.43	182,781,949.59
2.基金赎回款	-373,322,236.96	-	-58,564,268.41	-431,886,505.37
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	171,500,380.54	-	44,980,431.35	216,480,811.89

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：

<u>方一天</u>	<u>陈广益</u>	<u>尹超</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家健康产业混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]1707 号文《关于准予万家健康产业混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2020 年 9 月 21 日至 2020 年 9 月 28 日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2020]第 ZA31186 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 9 月 30 日生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 397,052,673.83 元，有效认购资金在募集期间内产生的利息为人民币 28,914.89 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 397,081,588.72 元，折合 397,081,588.72 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板以及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、股指期货、国债期货、股票期权以及债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、

证券公司短期公司债、政府支持机构债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×10%+上证国债指数收益率×30%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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信息披露管理办法》、《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〉》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，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，均以人民币元为单位表示。

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

自 2022 年 1 月 1 日起适用

金融资产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资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的股票投资和债券投资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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的以摊余成本计量的金融资产，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

2022 年 1 月 1 日前适用

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资和债券投资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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债分类

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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和以摊余成本计量的金融负债。本基金现无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

2022 年 1 月 1 日前适用

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和其他金融负债。本基金无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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。

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资的账面价值中。对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金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；或者（3）该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

2022 年 1 月 1 日前适用

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金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；或者（3）该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具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，按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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，采用在当前情况下适用并且有足够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，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，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

其他金融资产在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

2022 年 1 月 1 日前适用

(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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行

企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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按直线法近似计算。

2022 年 1 月 1 日前适用

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.50%的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;
- 2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资,且基金份额持有人可对A类、C类基金份额分别选择不同的分红方式;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;
- 3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;
- 4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;
- 5、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市

场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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》(财会〔2017〕7号)、《企业会计准则第23号——金融资产转移》(财会〔2017〕8号)、《企业会计准则第24号——套期会计》(财会〔2017〕9号)、《企业会计准则第37号——金融工具列报》(财会〔2017〕14号)(以下简称新金融工具相关会计准则)和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22号)，自2022年1月1日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新准则与现行准则的差异追溯调整报告期期初未分配利润。

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：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其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。本基金需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和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

2022年1月1日各项资产和负债按照修订前后金融工具确认计量准则的规定进行分类和计量结果对比如下：

金融资产/ 负债类别	修订前的金融工具确认计量准则		修订后的金融工具确认计量准则	
	计量类别	账面价值	计量类别	账面价值
金融资产				
银行存款	摊余成本(应 收款项)	42,785,969.27	摊余成本	42,787,941.85
结算备付金	摊余成本(应)	1,207,700.45	摊余成本	1,208,311.24

	收款项)			
存出保证金	摊余成本(应 收款项)	126,995.23	摊余成本	127,054.52
交易性金融 资产	以公允价值 计量且其变动计 入当期损益	194,675,885.8 0	以公允价 值计量且其变 动计入当期损 益	194,675,885.8 0
应收利息	摊余成本(应 收款项)	2,892.96	—	—
应收申购款	摊余成本(应 收款项)	563,484.54	摊余成本	563,734.84
金融负债				
应付清算款	摊余成本	21,238,548.73	摊余成本	21,238,548.73
应付赎回款	摊余成本	455,785.29	摊余成本	455,785.29
应付管理人 报酬	摊余成本	189,542.47	摊余成本	189,542.47
应付托管费	摊余成本	31,590.39	摊余成本	31,590.39
应付销售服 务费	摊余成本	11,002.01	摊余成本	11,002.01
应付交易费 用	摊余成本	790,515.92	—	—
其他负债	摊余成本	165,131.55	摊余成本	955,647.47

于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示。

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

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(一) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3%调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(二) 增值税

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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

（三）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对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。

（四）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差

别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 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，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，对基金通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	77,156,198.23	42,785,969.27
等于：本金	77,144,596.23	42,785,969.27
加：应计利息	11,602.00	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	77,156,198.23	42,785,969.27

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		811,134,745.05	-	813,364,583.66	2,229,838.61
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		811,134,745.05	-	813,364,583.66	2,229,838.61
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		186,496,055.12	-	194,675,885.80	8,179,830.68
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		186,496,055.12	-	194,675,885.80	8,179,830.68

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均无衍生金融资产/负债余额。

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未持有各项买入返售金融资产。

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 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	-	-
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
应计利息	-	2,892.96
合计	-	2,892.96

7.4.7.6 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	3,909.14	131.55
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,607,408.61	790,515.92
其中：交易所市场	2,607,408.61	790,515.92
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	165,000.00	165,000.00
合计	2,776,317.75	955,647.47

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家健康产业混合 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	124,919,093.42	124,919,093.42
本期申购	614,541,968.02	614,541,968.02
本期赎回（以“-”号填列）	-263,745,199.50	-263,745,199.50
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	475,715,861.94	475,715,861.94

万家健康产业混合 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,581,287.12	46,581,287.12
本期申购	732,121,307.28	732,121,307.28
本期赎回（以“-”号填列）	-413,461,419.82	-413,461,419.82
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	365,241,174.58	365,241,174.58

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家健康产业混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	48,316,150.00	-15,290,117.25	33,026,032.75
本期利润	-85,847,836.47	15,323,868.27	-70,523,968.20
本期基金份额交易产生的变动数	120,651,305.26	-51,017,809.45	69,633,495.81
其中：基金申购款	167,762,661.28	-75,862,330.97	91,900,330.31
基金赎回款	-47,111,356.02	24,844,521.52	-22,266,834.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	83,119,618.79	-50,984,058.43	32,135,560.36

万家健康产业混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	17,630,586.50	-5,676,187.90	11,954,398.60
本期利润	-54,271,696.73	-21,273,860.34	-75,545,557.07
本期基金份额交易产生的变动数	95,935,834.36	-12,100,332.15	83,835,502.21
其中：基金申购款	155,989,463.50	-79,844,932.09	76,144,531.41
基金赎回款	-60,053,629.14	67,744,599.94	7,690,970.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,294,724.13	-39,050,380.39	20,244,343.74

7.4.7.10 存款利息收入

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
活期存款利息收入	323,078.63	124,918.17
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	72,910.66	23,394.94
其他	19,132.51	3,023.94
合计	415,121.80	151,337.05

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	-132,535,313.60	70,601,629.64
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-132,535,313.60	70,601,629.64

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	5,085,301,407.69	1,724,167,914.26
减：卖出股票成本总额	5,201,261,927.24	1,653,566,284.62
减：交易费用	16,574,794.05	-
买卖股票差价收入	-132,535,313.60	70,601,629.64

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 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	381.67	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-32,471.32	-62,451.86
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	-32,089.65	-62,451.86

7.4.7.12.2 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	5,734,493.60	13,284,878.85
减：卖出债券（债转股及 债券到期兑付）成本总额	5,755,327.52	13,207,166.46
减：应计利息总额	11,626.03	140,164.25
减：交易费用	11.37	-
买卖债券差价收入	-32,471.32	-62,451.86

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利 收益	4,052,493.51	1,067,572.72
其中：证券出借权益补 偿收入	-	-
基金投资产生的股利 收益	-	-
合计	4,052,493.51	1,067,572.72

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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

1. 交易性金融资产	-5,949,992.07	5,999,560.54
股票投资	-5,949,992.07	5,999,560.54
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	-5,949,992.07	5,999,560.54

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	629,215.30	632,329.26
基金转换费收入	152,193.63	9,808.71
合计	781,408.93	642,137.97

7.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	45,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	5,012.50	19,521.87
账户维护费	18,000.00	15,000.00
其他	-	400.00
交易费用	-	5,274,452.65
合计	188,012.50	5,474,374.52

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据中国证券监督管理委员会《关于核准万家基金管理有限公司变更实际控制人的批复》（证监许可[2023]215号），齐河众鑫投资有限公司将其持有的万家基金 11%股权转让给中泰证券股份有限公司，股权变更后，中泰证券股份有限公司持股比例变更为 60%，山东能源集团有限公司为万家基金实际控制人。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人的股东
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人的股东
山东省新动能基金管理有限公司	基金管理人的股东
万家共赢资产管理有限公司（“万家共赢”）	基金管理人的子公司
万家财富基金销售（天津）有限公司（“万家财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构
上海万家朴智投资管理有限公司（“万家朴智”）	基金管理人控制的公司

注：1、2022 年 4 月，中国证监会下发《关于核准万家基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可[2022]795号），核准新疆国际实业股份有限公司将持有的万家基金 40%股权转让给山东省新动能基金管理有限公司。2022 年 6 月，万家基金完成工商变更登记手续，万家基金股东变更为中泰证券、山东省新动能基金管理有限公司、齐河众鑫投资有限公司。

2、2023 年 1 月，中国证监会下发《关于核准万家基金管理有限公司变更实际控制人的批复》（证监许可[2023]215号），核准山东能源集团有限公司成为万家基金实际控制人，对中泰证券股份有限公司依法受让齐河众鑫投资有限公司持有的万家基金 11%股权无异议。2023 年 2 月，万家基金完成工商变更登记手续，万家基金股东变更为中泰证券和山东省新动能基金管理有限公司。

3、下述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	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
中泰证券	2,716,259,155.15	24.92	1,278,249,491.93	37.68

7.4.10.1.2 债券交易

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		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
中泰证券	-	-	2,173,594.04	8.25

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
中泰证券	2,557,815.47	25.16	491,741.78	18.86
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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
中泰证券	1,196,684.26	37.80	13,265.13	1.68

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	10,044,755.16	3,116,301.54
其中：支付销售机构的客户维护费	983,778.39	1,025,971.92

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	1,674,125.73	519,383.71

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家健康产业混合 A	万家健康产业混合 C	合计
中泰证券	-	6,855.02	6,855.02
万家基金	-	497,383.34	497,383.34
合计	-	504,238.36	504,238.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家健康产业混合 A	万家健康产业混合 C	合计

中泰证券	-	1.26	1.26
万家基金	-	2,555.77	2,555.77
合计	-	2,557.03	2,557.03

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%。销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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。

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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
	万家健康产业混合 A	万家健康产业混合 C
基金合同生效日（2020 年 9 月 30 日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	17,894,595.56	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	17,894,595.56	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.7616%	-
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
	万家健康产业混合 A	万家健康产业混合 C
基金合同生效日（2020年9月30日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	77,156,198.23	323,078.63	42,785,969.27	124,918.17

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，活期存款按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

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
301161	唯万密封	2022 年 9 月 6 日	6 个月	新股流通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301176	逸豪新材	2022 年 9 月 21 日	6 个月	新股流通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301230	泓博医药	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股流通受限	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301265	华新环保	2022 年 12 月 8 日	6 个月	新股流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301269	华大九天	2022 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	32.69	87.94	605	19,777.45	53,203.70	-
301296	新巨丰	2022 年 8 月 26 日	6 个月	新股流通受限	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
301297	富乐德	2022 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301300	远翔新材	2022 年 8 月 9 日	6 个月	新股流通受限	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301306	西测测试	2022 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-

301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	138.88	103.52	118	16,387.84	12,215.36	-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	119.88	175.78	139	16,663.32	24,433.42	-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
688031	星环科技	2022年10月11日	6个月	新股流通受限	47.34	78.80	8,149	385,773.66	642,141.20	-
688231	隆达股份	2022年7月13日	6个月	新股流通受限	39.08	35.14	6,137	239,833.96	215,654.18	-
688247	宣泰医药	2022年8月18日	6个月	新股流通受限	9.37	15.06	7,155	67,042.35	107,754.30	-
688375	国博电子	2022年7月13日	6个月	新股流通受限	70.88	94.20	3,478	246,520.64	327,627.60	-
688376	美埃科技	2022年11月10日	6个月	新股流通受限	29.19	28.49	3,713	108,382.47	105,783.37	-
688480	赛恩斯	2022年11月18日	6个月	新股流通受限	19.18	20.19	2,302	44,152.36	46,477.38	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末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, 本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖

出回购金融资产款余额。

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, 本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应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。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了三道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡，形成第二道防线；由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈，形成第三道防线。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。(2021 年 12 月 31 日：同)

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注

7.4.12 中列示的本基金期末持有的流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金资产的流动性风险进行管理，基金管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，在申购赎回确认、投资交易、估值和信息披露等运作过程中专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，维护投资者的合法权益，公平对待投资者。本基金开放期间管理人对组合持仓集中度、短期变现能力、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本基金所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 7.4.12 “期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	77,156,198.23	-	-	-	-	-	77,156,198.23

结算备付金	4,231,095.41	-	-	-	-	-	4,231,095.41
存出保证金	548,133.58	-	-	-	-	-	548,133.58
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-813,364,583.66	813,364,583.66
应收股利	-	-	-	-	-	30,713.11	30,713.11
应收申购款	612.13	-	-	-	-	44,366.79	44,978.92
应收清算款	-	-	-	-	-	46,672,549.44	46,672,549.44
资产总计	81,936,039.35	-	-	-	-	-860,112,213.00	942,048,252.35
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,926,839.22	4,926,839.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,128,136.39	1,128,136.39
应付托管费	-	-	-	-	-	188,022.71	188,022.71
应付清算款	-	-	-	-	-	39,552,777.43	39,552,777.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	139,218.23	139,218.23
其他负债	-	-	-	-	-	2,776,317.75	2,776,317.75
负债总计	-	-	-	-	-	48,711,311.73	48,711,311.73
利率敏感度缺口	81,936,039.35	-	-	-	-	-811,400,901.27	893,336,940.62
上年度末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	42,785,969.27	-	-	-	-	-	42,785,969.27
结算备付金	1,207,700.45	-	-	-	-	-	1,207,700.45
存出保证金	126,995.23	-	-	-	-	-	126,995.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-194,675,885.80	194,675,885.80
应收申购款	-	-	-	-	-	563,484.54	563,484.54
其他资产	-	-	-	-	-	2,892.96	2,892.96
资产总计	44,120,664.95	-	-	-	-	-195,242,263.30	239,362,928.25
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	21,238,548.73	21,238,548.73
应付赎回款	-	-	-	-	-	455,785.29	455,785.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	189,542.47	189,542.47
应付托管费	-	-	-	-	-	31,590.39	31,590.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-	11,002.01	11,002.01
其他负债	-	-	-	-	-	955,647.47	955,647.47
负债总计	-	-	-	-	-	22,882,116.36	22,882,116.36
利率敏感度缺口	44,120,664.95	-	-	-	-	-172,360,146.94	216,480,811.89

注：该表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2021 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资

产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控，并通过外汇远期投资交易对上述外汇风险进行管理。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	13,829,364.95	-	13,829,364.95
资产合计	-	13,829,364.95	-	13,829,364.95
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	13,829,364.95	-	13,829,364.95
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,579,995.65	-	1,579,995.65
资产合计	-	1,579,995.65	-	1,579,995.65
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	1,579,995.65	-	1,579,995.65

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	港币相对于人民币升值 5%	691,468.25	78,999.78
	港币相对于人民币贬值 5%	-691,468.25	-78,999.78

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	813,364,583.66	91.05	194,675,885.80	89.93
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	813,364,583.66	91.05	194,675,885.80	89.93

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票基准指数以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-7,567,112.77	-1,639,846.58
	2. 股票基准指数上升 100 个基点	7,567,112.77	1,639,846.58

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	811,706,933.13	190,793,863.63
第二层次	-	3,882,022.17
第三层次	1,657,650.53	-
合计	813,364,583.66	194,675,885.80

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证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,269,185.75	1,269,185.75
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	-	388,464.78	388,464.78
其中：计入损益的利得或损失	-	388,464.78	388,464.78
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,657,650.53	1,657,650.53
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	-	388,464.78	388,464.78
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		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	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
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——	-	-	-

一公允价值变动损益			
-----------	--	--	--

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
限售股票	1,657,650.53	亚式期权模型	预期波动率	0.2063-2.4756	预期波动率越大公允价值越低
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
-	-	-	-	-	-

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资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产以及其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	813,364,583.66	86.34
	其中：股票	813,364,583.66	86.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	81,387,293.64	8.64
8	其他各项资产	47,296,375.05	5.02
9	合计	942,048,252.35	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 13,829,364.95 元，占净值比例 1.55%。

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

金额单位：人民币元

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	656,065,352.00	73.44
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	69,266,723.19	7.75
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	10,938,893.68	1.22
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	14,902,120.40	1.67
N	水利、环境和公共设施管理业	46,477.38	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	48,315,652.06	5.41
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	799,535,218.71	89.50

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非日常生活消费品	4,061,305.65	0.45
日常消费品	4,452,897.35	0.50
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	5,315,161.95	0.59

工业	-	-
信息技术	-	-
通信服务	-	-
公共事业	-	-
房地产	-	-
合计	13,829,364.95	1.55

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688329	艾隆科技	1,670,972	63,680,742.92	7.13
2	300015	爱尔眼科	1,555,058	48,315,652.06	5.41
3	300595	欧普康视	1,350,530	48,213,921.00	5.40
4	300896	爱美客	63,100	35,736,685.00	4.00
5	603309	维力医疗	1,670,076	33,368,118.48	3.74
6	600329	达仁堂	1,112,459	32,372,556.90	3.62
7	605186	健麾信息	1,024,524	30,838,172.40	3.45
8	002166	莱茵生物	3,139,800	29,828,100.00	3.34
9	300233	金城医药	1,226,930	27,937,196.10	3.13
10	605266	健之佳	348,777	27,926,574.39	3.13
11	002727	一心堂	837,504	26,389,751.04	2.95
12	688358	祥生医疗	741,600	25,511,040.00	2.86
13	688212	澳华内镜	348,578	22,828,373.22	2.56
14	300633	开立医疗	407,900	22,365,157.00	2.50
15	688016	心脉医疗	103,229	19,514,410.16	2.18
16	300653	正海生物	435,900	18,743,700.00	2.10
17	600085	同仁堂	402,300	17,974,764.00	2.01
18	300203	聚光科技	530,191	17,973,474.90	2.01
19	002737	葵花药业	774,200	17,945,956.00	2.01
20	600587	新华医疗	829,500	17,767,890.00	1.99
21	300760	迈瑞医疗	56,000	17,694,320.00	1.98
22	301363	美好医疗	366,800	15,372,588.00	1.72
23	301015	百洋医药	627,114	14,950,397.76	1.67
24	301235	华康医疗	415,576	14,865,153.52	1.66
25	688029	南微医学	179,004	14,701,598.52	1.65
26	300049	福瑞股份	551,700	13,478,031.00	1.51
27	688026	洁特生物	551,158	13,260,861.48	1.48
28	688363	华熙生物	76,543	10,354,737.04	1.16
29	688111	金山办公	38,710	10,238,407.90	1.15
30	603676	卫信康	622,400	9,908,608.00	1.11
31	688319	欧林生物	702,291	9,740,776.17	1.09
32	301367	怡和嘉业	43,188	9,476,702.35	1.06
33	688600	皖仪科技	378,978	9,466,870.44	1.06
34	300957	贝泰妮	59,500	8,879,780.00	0.99

35	600771	广誉远	312,150	8,684,013.00	0.97
36	600420	国药现代	950,600	8,650,460.00	0.97
37	688366	昊海生科	87,586	8,543,138.44	0.96
38	430685	新芝生物	521,301	7,741,319.85	0.87
39	300204	舒泰神	484,800	6,593,280.00	0.74
40	02138	医思健康	741,000	5,315,161.95	0.59
41	01458	周黑鸭	887,000	4,452,897.35	0.50
42	00520	呷哺呷哺	512,000	4,061,305.65	0.45
43	688031	星环科技	8,149	642,141.20	0.07
44	688375	国博电子	3,478	327,627.60	0.04
45	688231	隆达股份	6,137	215,654.18	0.02
46	688247	宣泰医药	7,155	107,754.30	0.01
47	688376	美埃科技	3,713	105,783.37	0.01
48	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
49	301269	华大九天	605	53,203.70	0.01
50	688480	赛恩斯	2,302	46,477.38	0.01
51	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
52	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
53	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
54	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
55	301349	信德新材	118	12,215.36	0.00
56	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
57	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
58	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
59	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
60	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
61	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
62	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
63	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
64	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

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	300595	欧普康视	100,661,763.82	46.50
2	300015	爱尔眼科	86,169,743.32	39.80
3	603259	药明康德	84,476,953.37	39.02
4	603309	维力医疗	79,039,965.15	36.51
5	300026	红日药业	75,301,168.80	34.78
6	301080	百普赛斯	70,013,171.62	32.34

7	300358	楚天科技	65,920,046.45	30.45
8	002821	凯莱英	65,775,512.68	30.38
9	688329	艾隆科技	64,960,894.83	30.01
10	600085	同仁堂	63,800,939.81	29.47
11	002166	莱茵生物	62,747,375.55	28.99
12	301015	百洋医药	61,106,029.82	28.23
13	688298	东方生物	60,927,074.33	28.14
14	603456	九洲药业	60,850,067.00	28.11
15	300482	万孚生物	59,680,636.35	27.57
16	000915	华特达因	58,659,885.25	27.10
17	600329	达仁堂	57,670,496.59	26.64
18	300896	爱美客	56,138,129.02	25.93
19	002873	新天药业	55,789,218.14	25.77
20	300363	博腾股份	54,956,118.49	25.39
21	600587	新华医疗	52,798,466.60	24.39
22	300436	广生堂	51,899,537.00	23.97
23	688133	泰坦科技	51,528,145.78	23.80
24	002728	特一药业	51,021,984.48	23.57
25	300957	贝泰妮	48,385,711.48	22.35
26	300723	一品红	46,750,150.99	21.60
27	002603	以岭药业	46,207,870.81	21.35
28	300122	智飞生物	45,470,457.58	21.00
29	688180	君实生物	38,754,830.04	17.90
29	01877	君实生物	6,674,596.29	3.08
30	688690	纳微科技	42,864,891.31	19.80
31	002317	众生药业	42,479,397.39	19.62
32	688179	阿拉丁	41,348,515.19	19.10
33	600566	济川药业	40,837,806.82	18.86
34	605186	健麾信息	38,579,047.64	17.82
35	600129	太极集团	38,545,008.39	17.81
36	600976	健民集团	38,544,448.35	17.81
37	300233	金城医药	38,347,679.05	17.71
38	000999	华润三九	38,228,090.85	17.66
39	002019	亿帆医药	38,073,797.41	17.59
40	301096	百诚医药	37,903,235.86	17.51
41	301235	华康医疗	37,843,419.36	17.48
42	300171	东富龙	37,678,090.00	17.40
43	300181	佐力药业	37,194,521.00	17.18
44	300760	迈瑞医疗	35,667,132.00	16.48
45	000739	普洛药业	35,515,914.15	16.41
46	688016	心脉医疗	35,402,884.07	16.35
47	002727	一心堂	35,175,024.36	16.25
48	300705	九典制药	34,637,809.60	16.00

49	688639	华恒生物	34,593,716.00	15.98
50	301263	泰恩康	33,535,163.01	15.49
51	600196	复星医药	27,439,897.00	12.68
51	02196	复星医药	6,044,992.97	2.79
52	688185	康希诺	33,024,163.62	15.26
53	000661	长春高新	32,263,071.00	14.90
54	000756	新华制药	31,473,229.28	14.54
55	600272	开开实业	31,103,115.98	14.37
56	301257	普蕊斯	30,104,071.60	13.91
57	688029	南微医学	29,082,334.85	13.43
58	688358	祥生医疗	28,770,092.33	13.29
59	300633	开立医疗	28,379,529.73	13.11
60	605266	健之佳	28,186,945.84	13.02
61	600572	康恩贝	28,047,561.50	12.96
62	600285	羚锐制药	27,880,905.90	12.88
63	603127	昭衍新药	27,782,523.00	12.83
64	603392	万泰生物	27,121,787.40	12.53
65	002223	鱼跃医疗	26,687,345.00	12.33
66	600771	广誉远	26,383,437.38	12.19
67	688068	热景生物	26,213,330.63	12.11
68	300928	华安鑫创	25,938,628.84	11.98
69	301101	明月镜片	25,481,621.00	11.77
70	300039	上海凯宝	24,960,874.36	11.53
71	688617	惠泰医疗	24,935,294.01	11.52
72	688111	金山办公	24,379,359.21	11.26
73	688363	华熙生物	24,256,000.71	11.20
74	300203	聚光科技	24,145,940.10	11.15
75	002192	融捷股份	23,947,201.22	11.06
76	002332	仙琚制药	23,938,812.18	11.06
77	688202	美迪西	23,856,685.43	11.02
78	600557	康缘药业	23,037,474.94	10.64
79	688626	翔宇医疗	23,031,637.87	10.64
80	688026	洁特生物	22,911,245.05	10.58
81	688075	安旭生物	22,092,158.07	10.21
82	00570	中国中药	22,026,542.10	10.17
83	603987	康德莱	21,657,701.59	10.00
84	06606	诺辉健康-B	21,414,036.31	9.89
85	002385	大北农	21,105,744.17	9.75
86	301367	怡和嘉业	20,746,508.99	9.58
87	688212	澳华内镜	20,708,465.55	9.57
88	688105	诺唯赞	20,481,701.10	9.46
89	600763	通策医疗	20,444,634.00	9.44
90	600079	人福医药	20,260,172.00	9.36

91	600479	千金药业	19,595,151.00	9.05
92	300204	舒泰神	19,474,180.00	9.00
93	600062	华润双鹤	18,909,069.04	8.73
94	300813	泰林生物	18,644,889.00	8.61
95	300969	恒帅股份	18,573,412.25	8.58
96	002349	精华制药	18,402,391.00	8.50
97	300759	康龙化成	18,215,170.44	8.41
98	300558	贝达药业	18,162,189.35	8.39
99	301087	可孚医疗	18,146,599.41	8.38
100	601908	京运通	18,015,606.50	8.32
101	600521	华海药业	17,977,166.80	8.30
102	002737	葵花药业	17,792,716.00	8.22
103	603520	司太立	17,628,779.00	8.14
104	000963	华东医药	17,563,075.65	8.11
105	603233	大参林	17,518,305.51	8.09
106	300653	正海生物	17,378,675.00	8.03
107	603883	老百姓	17,301,087.88	7.99
108	688293	奥浦迈	16,834,494.85	7.78
109	01548	金斯瑞生物科技	16,786,389.09	7.75
110	000423	东阿阿胶	16,756,731.00	7.74
111	688600	皖仪科技	16,578,837.13	7.66
112	002644	佛慈制药	16,557,245.00	7.65
113	301239	普瑞眼科	16,215,037.00	7.49
114	002568	百润股份	16,074,067.00	7.43
115	688356	键凯科技	15,889,599.87	7.34
116	300636	同和药业	15,860,629.52	7.33
117	603368	柳药集团	15,812,912.04	7.30
118	688139	海尔生物	15,654,245.13	7.23
119	300601	康泰生物	15,635,453.13	7.22
120	003022	联泓新科	15,547,374.40	7.18
121	300452	山河药辅	15,359,269.00	7.09
122	301363	美好医疗	15,125,976.00	6.99
123	601607	上海医药	14,938,624.15	6.90
124	603896	寿仙谷	14,927,929.20	6.90
125	603858	步长制药	14,255,111.36	6.58
126	600276	恒瑞医药	14,141,261.80	6.53
127	600938	中国海油	14,099,125.63	6.51
128	688276	百克生物	14,095,379.62	6.51
129	600055	万东医疗	14,087,794.00	6.51
130	603676	卫信康	14,026,397.70	6.48
131	300151	昌红科技	14,000,841.80	6.47
132	002612	朗姿股份	13,988,809.96	6.46
133	000998	隆平高科	13,967,063.00	6.45

134	002745	木林森	13,944,743.17	6.44
135	601567	三星医疗	13,930,032.00	6.43
136	002007	华兰生物	13,893,311.00	6.42
137	603538	美诺华	13,724,118.10	6.34
138	002793	罗欣药业	13,686,496.18	6.32
139	601952	苏垦农发	13,614,935.50	6.29
140	301349	信德新材	13,545,190.88	6.26
141	000718	苏宁环球	13,510,129.83	6.24
142	300725	药石科技	13,451,655.04	6.21
143	300049	福瑞股份	13,404,618.86	6.19
144	002345	潮宏基	13,349,059.98	6.17
145	09868	小鹏汽车-W	13,288,584.90	6.14
146	002068	黑猫股份	13,116,610.23	6.06
147	688580	伟思医疗	13,108,743.95	6.06
148	688050	爱博医疗	12,953,518.99	5.98
149	300573	兴齐眼药	12,887,994.90	5.95
150	601868	中国能建	12,840,728.00	5.93
151	301126	达嘉维康	12,801,337.64	5.91
152	000516	国际医学	12,653,232.56	5.84
153	688046	药康生物	12,531,839.13	5.79
154	601618	中国中冶	12,278,186.00	5.67
155	002714	牧原股份	12,224,412.00	5.65
156	603351	威尔药业	12,178,619.60	5.63
157	600313	农发种业	11,913,734.64	5.50
158	688319	欧林生物	11,698,686.22	5.40
159	603566	普莱柯	11,681,922.80	5.40
160	02096	先声药业	11,616,695.35	5.37
161	002041	登海种业	11,559,729.68	5.34
162	301097	天益医疗	11,546,269.94	5.33
163	688131	皓元医药	11,298,068.72	5.22
164	300274	阳光电源	11,289,150.00	5.21
165	01458	周黑鸭	11,199,597.38	5.17
166	06078	海吉亚医疗	10,954,174.27	5.06
167	600993	马应龙	10,935,200.03	5.05
168	600132	重庆啤酒	10,856,062.99	5.01
169	600529	山东药玻	10,793,061.00	4.99
170	00175	吉利汽车	10,787,235.25	4.98
171	600152	维科技术	10,780,541.00	4.98
172	688265	南模生物	10,748,904.99	4.97
173	600211	西藏药业	10,617,276.00	4.90
174	603707	健友股份	10,593,678.03	4.89
175	000705	浙江震元	10,534,018.68	4.87
176	002985	北摩高科	10,367,846.00	4.79

177	600195	中牧股份	10,341,962.73	4.78
178	01093	石药集团	10,158,065.38	4.69
179	300487	蓝晓科技	9,927,925.35	4.59
180	01928	金沙中国有限公司	9,913,769.30	4.58
181	603297	永新光学	9,888,763.00	4.57
182	09995	荣昌生物-B	9,852,269.05	4.55
183	603439	贵州三力	9,847,809.00	4.55
184	300451	创业慧康	9,786,882.11	4.52
185	000810	创维数字	9,644,059.37	4.45
186	688575	亚辉龙	9,582,898.71	4.43
187	002750	龙津药业	9,569,985.39	4.42
188	09926	康方生物-B	9,494,646.94	4.39
189	000615	奥园美谷	9,483,116.98	4.38
190	603260	合盛硅业	9,470,023.00	4.37
191	830946	森萱医药	9,403,401.87	4.34
192	000568	泸州老窖	9,328,446.00	4.31
193	603658	安图生物	9,250,134.80	4.27
194	688357	建龙微纳	9,188,397.95	4.24
195	300427	红相股份	9,027,379.00	4.17
196	600161	天坛生物	9,026,161.26	4.17
197	430685	新芝生物	9,000,436.57	4.16
198	000625	长安汽车	8,966,619.14	4.14
199	600418	江淮汽车	8,965,094.32	4.14
200	688520	神州细胞	8,963,930.74	4.14
201	688366	昊海生科	8,962,490.51	4.14
202	600420	国药现代	8,933,315.00	4.13
203	300871	回盛生物	8,872,013.00	4.10
204	601007	金陵饭店	8,848,649.70	4.09
205	688578	艾力斯	8,744,350.65	4.04
206	600916	中国黄金	8,730,019.00	4.03
207	00520	呷哺呷哺	8,699,536.78	4.02
208	688089	嘉必优	8,662,420.45	4.00
209	002100	天康生物	8,581,541.00	3.96
210	301122	采纳股份	8,566,173.67	3.96
211	603985	恒润股份	8,497,514.00	3.93
212	688205	德科立	8,433,505.24	3.90
213	00388	香港交易所	8,337,815.30	3.85
214	600422	昆药集团	8,288,565.42	3.83
215	002915	中欣氟材	8,258,583.00	3.81
216	01999	敏华控股	8,243,809.91	3.81
217	601155	新城控股	8,171,036.10	3.77
218	002444	巨星科技	8,165,334.00	3.77
219	300335	迪森股份	8,147,421.98	3.76

220	601168	西部矿业	8,140,485.00	3.76
221	600975	新五丰	8,128,794.22	3.75
222	002624	完美世界	8,116,457.00	3.75
223	688680	海优新材	8,052,575.79	3.72
224	688268	华特气体	7,956,338.67	3.68
225	600141	兴发集团	7,865,522.65	3.63
226	688238	和元生物	7,859,576.78	3.63
227	600399	抚顺特钢	7,819,151.00	3.61
228	300529	健帆生物	7,768,113.70	3.59
229	002466	天齐锂业	7,743,398.00	3.58
230	600496	精工钢构	7,714,553.38	3.56
231	000048	京基智农	7,595,236.40	3.51
232	002555	三七互娱	7,585,501.48	3.50
233	601888	中国中免	7,525,339.00	3.48
234	301030	仕净科技	7,510,021.00	3.47
235	002531	天顺风能	7,470,725.05	3.45
236	600126	杭钢股份	7,432,330.50	3.43
237	600267	海正药业	7,379,629.00	3.41
238	688382	益方生物	7,356,193.82	3.40
239	688303	大全能源	7,270,754.54	3.36
240	600536	中国软件	7,227,615.80	3.34
241	688232	新点软件	7,124,824.14	3.29
242	600258	首旅酒店	7,113,125.00	3.29
243	600600	青岛啤酒	7,110,798.73	3.28
244	600977	中国电影	6,966,411.00	3.22
245	301103	何氏眼科	6,954,335.00	3.21
246	603993	洛阳钼业	6,945,357.00	3.21
247	301155	海力风电	6,934,653.00	3.20
248	002550	千红制药	6,900,015.00	3.19
249	300125	聆达股份	6,894,831.61	3.18
250	000059	华锦股份	6,889,344.44	3.18
251	600436	片仔癀	6,873,928.00	3.18
252	001222	源飞宠物	6,850,805.00	3.16
253	688778	厦钨新能	6,832,059.25	3.16
254	603108	润达医疗	6,755,027.90	3.12
255	301258	富士莱	6,718,024.36	3.10
256	300481	濮阳惠成	6,715,355.00	3.10
257	002422	科伦药业	6,712,648.00	3.10
258	601869	长飞光纤	6,712,045.00	3.10
259	600826	兰生股份	6,710,942.00	3.10
260	300740	水羊股份	6,703,547.00	3.10
261	688273	麦澜德	6,673,938.39	3.08
262	600223	鲁商发展	6,645,324.00	3.07

263	002139	拓邦股份	6,644,000.00	3.07
264	000650	仁和药业	6,617,906.00	3.06
265	603229	奥翔药业	6,612,705.00	3.05
266	300390	天华超净	6,595,706.00	3.05
267	002080	中材科技	6,590,025.00	3.04
268	002837	英维克	6,568,280.00	3.03
269	688056	莱伯泰科	6,542,387.75	3.02
270	688368	晶丰明源	6,536,154.17	3.02
271	600123	兰花科创	6,465,143.12	2.99
272	301211	亨迪药业	6,435,719.00	2.97
273	688622	禾信仪器	6,324,213.77	2.92
274	300119	瑞普生物	6,310,136.12	2.91
275	000990	诚志股份	6,268,990.00	2.90
276	603301	振德医疗	6,255,408.00	2.89
277	600056	中国医药	6,130,486.00	2.83
278	600519	贵州茅台	6,066,183.63	2.80
279	603998	方盛制药	6,010,540.00	2.78
280	600222	太龙药业	5,922,734.00	2.74
281	300238	冠昊生物	5,766,392.00	2.66
282	603567	珍宝岛	5,516,416.53	2.55
283	300463	迈克生物	5,447,648.00	2.52
284	601669	中国电建	5,293,834.00	2.45
285	02138	医思健康	5,248,561.65	2.42
286	002258	利尔化学	5,174,486.60	2.39
287	688282	理工导航	5,157,012.97	2.38
288	603329	上海雅仕	4,861,421.00	2.25
289	688315	诺禾致源	4,789,356.54	2.21
290	002304	洋河股份	4,679,995.00	2.16
291	09966	康宁杰瑞制药-B	4,678,600.36	2.16
292	600371	万向德农	4,581,842.40	2.12
293	300761	立华股份	4,571,684.00	2.11
294	000778	新兴铸管	4,493,307.00	2.08
295	601686	友发集团	4,459,124.73	2.06

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

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	占期初基金资产净值比例(%)
1	603259	药明康德	95,030,132.43	43.90
2	300026	红日药业	75,569,798.37	34.91
3	000915	华特达因	73,846,933.44	34.11
4	002821	凯莱英	69,323,185.00	32.02

5	301080	百普赛斯	65,239,276.60	30.14
6	002603	以岭药业	64,904,716.80	29.98
7	603456	九洲药业	62,688,216.48	28.96
8	300482	万孚生物	62,566,540.08	28.90
9	300363	博腾股份	61,336,999.00	28.33
10	300358	楚天科技	59,052,965.56	27.28
11	688298	东方生物	54,071,851.61	24.98
12	603309	维力医疗	53,931,489.20	24.91
13	688133	泰坦科技	53,920,666.93	24.91
14	002873	新天药业	53,615,368.76	24.77
15	300015	爱尔眼科	53,373,706.45	24.66
16	300595	欧普康视	52,716,693.40	24.35
17	301015	百洋医药	50,555,690.59	23.35
18	000999	华润三九	50,205,350.31	23.19
19	002728	特一药业	50,055,717.96	23.12
20	300723	一品红	49,704,967.58	22.96
21	688180	君实生物	42,762,303.34	19.75
21	01877	君实生物	6,160,249.53	2.85
22	300171	东富龙	45,208,530.30	20.88
23	300436	广生堂	45,195,328.00	20.88
24	600085	同仁堂	44,537,348.75	20.57
25	688690	纳微科技	44,494,238.59	20.55
26	688639	华恒生物	44,461,515.84	20.54
27	000739	普洛药业	43,482,309.39	20.09
28	301096	百诚医药	43,481,467.05	20.09
29	688179	阿拉丁	42,671,821.06	19.71
30	300122	智飞生物	41,611,970.00	19.22
31	600566	济川药业	40,101,260.68	18.52
32	600129	太极集团	38,644,373.00	17.85
33	301263	泰恩康	38,609,109.66	17.83
34	002317	众生药业	38,522,130.65	17.79
35	000756	新华制药	37,410,012.06	17.28
36	300181	佐力药业	36,917,014.00	17.05
37	300957	贝泰妮	35,757,104.09	16.52
38	002166	莱茵生物	35,673,713.37	16.48
39	002019	亿帆医药	34,311,675.91	15.85
40	600272	开开实业	34,262,610.80	15.83
41	600196	复星医药	27,843,622.15	12.86
41	02196	复星医药	6,187,979.97	2.86
42	600976	健民集团	33,571,536.08	15.51
43	600587	新华医疗	32,546,856.88	15.03
44	688068	热景生物	31,352,033.76	14.48
45	000661	长春高新	31,033,507.93	14.34

46	600285	羚锐制药	30,603,426.66	14.14
47	300705	九典制药	29,785,685.76	13.76
48	301101	明月镜片	29,312,109.07	13.54
49	688185	康希诺	28,759,913.43	13.29
50	603392	万泰生物	27,585,732.60	12.74
51	600572	康恩贝	27,284,793.00	12.60
52	002223	鱼跃医疗	26,498,730.00	12.24
53	600557	康缘药业	25,623,673.12	11.84
54	300039	上海凯宝	24,900,504.39	11.50
55	300928	华安鑫创	24,591,239.22	11.36
56	301257	普蕊斯	24,004,793.30	11.09
57	300969	恒帅股份	23,793,663.40	10.99
58	603127	昭衍新药	23,790,618.60	10.99
59	002192	融捷股份	23,499,129.64	10.86
60	603987	康德莱	22,885,263.45	10.57
61	600329	达仁堂	22,669,804.00	10.47
62	603233	大参林	22,045,859.80	10.18
63	300896	爱美客	21,265,377.97	9.82
64	301235	华康医疗	21,247,472.57	9.81
65	603883	老百姓	21,162,751.17	9.78
66	300759	康龙化成	20,894,267.88	9.65
67	002332	仙琚制药	20,796,505.00	9.61
68	600771	广誉远	20,739,407.00	9.58
69	600062	华润双鹤	20,705,650.16	9.56
70	600521	华海药业	20,487,581.44	9.46
71	002385	大北农	20,372,766.00	9.41
72	688617	惠泰医疗	20,175,034.38	9.32
73	688202	美迪西	19,838,262.43	9.16
74	600763	通策医疗	19,795,460.84	9.14
75	600079	人福医药	19,468,282.66	8.99
76	688075	安旭生物	19,461,152.79	8.99
77	300452	山河药辅	19,385,417.20	8.95
78	000423	东阿阿胶	19,069,724.00	8.81
79	002349	精华制药	18,869,715.11	8.72
80	688105	诺唯赞	18,615,086.02	8.60
81	300813	泰林生物	18,577,746.00	8.58
82	301087	可孚医疗	18,030,653.44	8.33
83	688626	翔宇医疗	18,030,616.89	8.33
84	603520	司太立	17,638,496.29	8.15
85	300636	同和药业	17,470,511.34	8.07
86	300558	贝达药业	17,350,853.88	8.01
87	300204	舒泰神	17,336,909.00	8.01
88	603896	寿仙谷	17,124,697.00	7.91

89	00570	中国中药	17,117,706.06	7.91
90	688356	键凯科技	16,926,532.37	7.82
91	300760	迈瑞医疗	16,764,237.00	7.74
92	688046	药康生物	16,736,318.81	7.73
93	688276	百克生物	16,400,152.64	7.58
94	002644	佛慈制药	16,367,827.00	7.56
95	600938	中国海油	16,292,009.48	7.53
96	301239	普瑞眼科	16,250,922.80	7.51
97	600479	千金药业	16,028,118.00	7.40
98	000963	华东医药	15,780,519.61	7.29
99	002793	罗欣药业	15,558,095.20	7.19
100	601908	京运通	15,554,315.00	7.19
101	688139	海尔生物	15,447,031.44	7.14
102	600993	马应龙	15,261,935.41	7.05
103	600276	恒瑞医药	15,193,709.31	7.02
104	688265	南模生物	15,177,980.66	7.01
105	002727	一心堂	15,039,576.68	6.95
106	09868	小鹏汽车-W	15,027,748.26	6.94
107	01548	金斯瑞生物科技	14,992,300.72	6.93
108	688293	奥浦迈	14,948,395.68	6.91
109	06606	诺辉健康-B	14,927,141.33	6.90
110	002568	百润股份	14,626,742.58	6.76
111	601952	苏垦农发	14,598,575.33	6.74
112	300151	昌红科技	13,878,484.16	6.41
113	002007	华兰生物	13,853,656.00	6.40
114	688111	金山办公	13,826,216.58	6.39
115	688363	华熙生物	13,655,079.71	6.31
116	688029	南微医学	13,637,323.63	6.30
117	600055	万东医疗	13,545,657.00	6.26
118	688131	皓元医药	13,302,694.97	6.14
119	002612	朗姿股份	13,186,010.00	6.09
120	601607	上海医药	13,177,542.00	6.09
121	000516	国际医学	13,086,725.00	6.05
122	002745	木林森	12,962,330.00	5.99
123	688050	爱博医疗	12,951,186.79	5.98
124	000718	苏宁环球	12,895,036.00	5.96
125	603368	柳药集团	12,862,300.87	5.94
126	603858	步长制药	12,852,554.13	5.94
127	688580	伟思医疗	12,766,718.93	5.90
128	688016	心脉医疗	12,707,969.84	5.87
129	000998	隆平高科	12,650,556.00	5.84
130	300725	药石科技	12,574,634.36	5.81
131	601567	三星医疗	12,555,363.00	5.80

132	002714	牧原股份	12,550,354.56	5.80
133	601868	中国能建	12,501,762.00	5.77
134	003022	联泓新科	12,485,386.00	5.77
135	300601	康泰生物	12,400,232.86	5.73
136	603538	美诺华	12,349,115.12	5.70
137	002041	登海种业	12,138,735.00	5.61
138	002068	黑猫股份	11,816,372.00	5.46
139	600313	农发种业	11,729,729.00	5.42
140	300573	兴齐眼药	11,657,269.40	5.38
141	301097	天益医疗	11,621,102.76	5.37
142	300274	阳光电源	11,355,231.00	5.25
143	601618	中国中冶	11,294,775.00	5.22
144	301126	达嘉维康	11,217,809.00	5.18
145	01928	金沙中国有限公司	11,164,010.23	5.16
146	002345	潮宏基	11,093,421.44	5.12
147	600132	重庆啤酒	11,068,955.00	5.11
148	09995	荣昌生物-B	11,045,225.70	5.10
149	00175	吉利汽车	10,816,047.08	5.00
150	002985	北摩高科	10,778,003.80	4.98
151	603439	贵州三力	10,703,692.00	4.94
152	301349	信德新材	10,695,334.45	4.94
153	300487	蓝晓科技	10,611,826.66	4.90
154	603566	普莱柯	10,402,739.01	4.81
155	603351	威尔药业	10,120,474.52	4.67
156	600211	西藏药业	10,045,699.16	4.64
157	000705	浙江震元	10,018,093.00	4.63
158	600195	中牧股份	9,925,851.00	4.59
159	600529	山东药玻	9,860,241.00	4.55
160	06078	海吉亚医疗	9,797,901.79	4.53
161	300871	回盛生物	9,641,888.14	4.45
162	01093	石药集团	9,638,498.28	4.45
163	000568	泸州老窖	9,557,905.00	4.42
164	603260	合盛硅业	9,523,563.00	4.40
165	830946	森萱医药	9,514,316.41	4.39
166	688329	艾隆科技	9,513,530.45	4.39
167	603297	永新光学	9,435,760.00	4.36
168	601155	新城控股	9,429,694.57	4.36
169	603707	健友股份	9,381,888.70	4.33
170	01458	周黑鸭	9,281,755.55	4.29
171	600152	维科技术	9,232,403.00	4.26
172	00520	呷哺呷哺	9,187,773.78	4.24
173	688575	亚辉龙	9,077,142.18	4.19
174	000615	奥园美谷	9,072,929.00	4.19

175	688026	洁特生物	9,025,959.39	4.17
176	09926	康方生物-B	8,979,252.68	4.15
177	02096	先声药业	8,962,234.88	4.14
178	601007	金陵饭店	8,882,697.00	4.10
179	300451	创业慧康	8,684,378.00	4.01
180	688578	艾力斯	8,683,784.78	4.01
181	00388	香港交易所	8,634,973.09	3.99
182	605186	健麾信息	8,567,768.70	3.96
183	600975	新五丰	8,554,801.84	3.95
184	688315	诺禾致源	8,548,825.98	3.95
185	600399	抚顺特钢	8,493,204.00	3.92
186	600418	江淮汽车	8,425,494.00	3.89
187	002100	天康生物	8,420,967.60	3.89
188	000810	创维数字	8,412,004.00	3.89
189	002444	巨星科技	8,340,791.00	3.85
190	002750	龙津药业	8,337,152.97	3.85
191	603658	安图生物	8,283,665.80	3.83
192	300427	红相股份	8,229,221.22	3.80
193	600536	中国软件	8,218,280.38	3.80
194	600977	中国电影	8,218,239.00	3.80
195	688089	嘉必优	8,140,314.74	3.76
196	000625	长安汽车	8,071,352.48	3.73
197	688238	和元生物	8,071,238.77	3.73
198	688357	建龙微纳	8,059,023.42	3.72
199	600161	天坛生物	8,023,683.90	3.71
200	002624	完美世界	7,954,682.00	3.67
201	002422	科伦药业	7,881,484.00	3.64
202	300390	天华超净	7,878,553.00	3.64
203	301122	采纳股份	7,857,819.62	3.63
204	688520	神州细胞	7,811,418.04	3.61
205	688273	麦澜德	7,794,983.37	3.60
206	301211	亨迪药业	7,793,594.08	3.60
207	301155	海力风电	7,790,431.90	3.60
208	002139	拓邦股份	7,698,060.00	3.56
209	600916	中国黄金	7,541,754.28	3.48
210	002555	三七互娱	7,460,571.52	3.45
211	300633	开立医疗	7,415,233.00	3.43
212	002915	中欣氟材	7,341,444.60	3.39
213	601888	中国中免	7,263,195.20	3.36
214	601168	西部矿业	7,255,397.00	3.35
215	603676	卫信康	7,226,316.00	3.34
216	600422	昆药集团	7,224,014.00	3.34
217	002837	英维克	7,184,688.80	3.32

218	600436	片仔癀	7,160,464.00	3.31
219	688205	德科立	7,142,115.26	3.30
220	603108	润达医疗	7,132,879.36	3.29
221	600141	兴发集团	7,112,143.00	3.29
222	300335	迪森股份	7,043,170.00	3.25
223	000059	华锦股份	7,037,148.00	3.25
224	688382	益方生物	7,004,632.43	3.24
225	300529	健帆生物	7,003,620.00	3.24
226	603993	洛阳钼业	6,952,203.44	3.21
227	600126	杭钢股份	6,941,044.10	3.21
228	000048	京基智农	6,928,414.60	3.20
229	600600	青岛啤酒	6,912,345.00	3.19
230	300481	濮阳惠成	6,906,944.72	3.19
231	601869	长飞光纤	6,849,739.27	3.16
232	600496	精工钢构	6,825,236.00	3.15
233	603998	方盛制药	6,790,763.00	3.14
234	600258	首旅酒店	6,732,205.56	3.11
235	01999	敏华控股	6,728,165.89	3.11
236	002550	千红制药	6,725,391.00	3.11
237	688303	大全能源	6,691,132.58	3.09
238	002466	天齐锂业	6,667,081.00	3.08
239	688232	新点软件	6,651,391.21	3.07
240	301367	怡和嘉业	6,633,374.00	3.06
241	600223	鲁商发展	6,627,605.00	3.06
242	688680	海优新材	6,607,707.02	3.05
243	688268	华特气体	6,579,166.66	3.04
244	301258	富士莱	6,534,140.00	3.02
245	002531	天顺风能	6,531,618.00	3.02
246	300119	瑞普生物	6,521,221.00	3.01
247	000650	仁和药业	6,501,885.81	3.00
248	600826	兰生股份	6,431,663.00	2.97
249	603229	奥翔药业	6,425,744.80	2.97
250	600267	海正药业	6,404,462.00	2.96
251	300125	聆达股份	6,381,465.00	2.95
252	300233	金城医药	6,344,544.00	2.93
253	301103	何氏眼科	6,336,758.43	2.93
254	688778	厦钨新能	6,329,791.23	2.92
255	688056	莱伯泰科	6,298,219.65	2.91
256	300740	水羊股份	6,222,013.00	2.87
257	600519	贵州茅台	6,220,906.00	2.87
258	301030	仕净科技	6,175,660.78	2.85
259	002080	中材科技	6,169,902.00	2.85
260	603985	恒润股份	6,127,097.00	2.83

261	603301	振德医疗	6,096,807.00	2.82
262	600222	太龙药业	5,966,585.00	2.76
263	688622	禾信仪器	5,923,928.45	2.74
264	300203	聚光科技	5,921,130.00	2.74
265	688368	晶丰明源	5,919,903.88	2.73
266	600056	中国医药	5,909,079.80	2.73
267	600123	兰花科创	5,849,430.00	2.70
268	688600	皖仪科技	5,780,053.47	2.67
269	300463	迈克生物	5,753,320.26	2.66
270	001222	源飞宠物	5,722,818.73	2.64
271	000990	诚志股份	5,566,802.00	2.57
272	300238	冠昊生物	5,479,028.00	2.53
273	603329	上海雅仕	5,345,895.00	2.47
274	002258	利尔化学	5,320,645.00	2.46
275	603567	珍宝岛	5,307,536.00	2.45
276	601669	中国电建	5,162,792.00	2.38
277	688282	理工导航	5,095,614.45	2.35
278	002304	洋河股份	4,839,503.00	2.24
279	000778	新兴铸管	4,755,459.00	2.20
280	01801	信达生物	4,594,547.24	2.12
281	601686	友发集团	4,499,130.00	2.08

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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	5,825,900,617.17
卖出股票收入（成交）总额	5,085,301,407.69

注：本项买入金额均按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

本项卖出金额均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金参与股指期货交易以套期保值为目的，利用股指期货剥离部分多头股票资产的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置。

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

本基金可基于谨慎原则，以套期保值为主要目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

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	548,133.58
2	应收清算款	46,672,549.44
3	应收股利	30,713.11
4	应收利息	-
5	应收申购款	44,978.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,296,375.05

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
万家健康产业混合 A	3,230	147,280.45	406,732,633.18	85.50	68,983,228.76	14.50
万家健康产业混合 C	2,769	131,903.64	349,510,748.16	95.69	15,730,426.42	4.31
合计	5,912	142,245.78	756,243,381.34	89.93	84,713,655.18	10.07

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家健康产业混合 A	1,620,152.58	0.3406
	万家健康产业混合 C	405,360.88	0.1110
	合计	2,025,513.46	0.2409

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	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	万家健康产业混合 A	>100

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家健康产业混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	万家健康产业混合 A	0
	万家健康产业混合 C	10~50
	合计	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家健康产业混合 A	万家健康产业混合 C
基金合同生效日 (2020 年 9 月 30 日) 基金份额总额	385,851,087.41	11,230,501.31
本报告期期初基金份额总额	124,919,093.42	46,581,287.12
本报告期基金总申购份额	614,541,968.02	732,121,307.28
减：本报告期基金总赎回份额	263,745,199.50	413,461,419.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	475,715,861.94	365,241,174.58

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

基金管理人：

2022 年 8 月 24 日，公司聘任莫海波先生担任公司副总经理。

基金托管人：

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内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

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

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

报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

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 (%)	
中泰证券	2	2,716,259,155.15	24.92	2,557,815.47	25.16	-
华西证券	2	1,408,575,933.75	12.93	1,311,811.87	12.91	-
西部证券	2	1,304,724,432.57	11.97	1,215,092.12	11.95	-
东方财富证券	2	955,456,530.19	8.77	889,817.28	8.75	-
天风证券	2	689,237,547.55	6.32	641,888.77	6.32	-
国金证券	1	634,627,520.92	5.82	591,033.50	5.81	-
海通证券	1	598,970,851.69	5.50	557,823.89	5.49	-
国泰君安	1	516,242,504.53	4.74	480,777.19	4.73	-
民生证券	1	475,115,865.57	4.36	442,474.63	4.35	-
安信证券	1	466,306,792.92	4.28	434,272.07	4.27	-
东北证券	2	410,450,985.54	3.77	382,253.65	3.76	-

东方证券	2	366,649,492.61	3.36	341,461.42	3.36	-
国盛证券	1	161,340,554.62	1.48	150,256.72	1.48	-
中银国际证券	3	83,340,359.66	0.76	77,613.65	0.76	-
申万宏源证券	1	51,895,281.26	0.48	48,330.30	0.48	-
兴业证券	3	30,253,332.88	0.28	15,127.13	0.15	-
方正证券	1	28,538,484.15	0.26	26,578.26	0.26	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范, 内控制度健全, 在业内有良好的声誉;
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施满足基金进行证券交易的需要;
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平, 包括但不限于: 有较好的研究能力和行业分析能力, 能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务; 能根据公司所管理基金的特定要求, 提供专门研究报告, 具有开发量化投资组合模型的能力; 能积极为公司投资业务的开展, 投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、基金专用交易席位的变更情况：

本报告期内，本基金新增兴业证券交易单元 1 个。

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比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	11,501,054.00	100.00	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-

兴业证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
高华证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
广州证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 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	万家健康产业混合型证券投资基金基金第 4 季度报告	指定媒介	2022-01-21
2	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在泰信财富开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-07
3	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金调整最低申购金额的公告	指定媒介	2022-03-22
4	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宜信普泽为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-24
5	万家健康产业混合型证券投资基金 2021 年年度报告	指定媒介	2022-03-30
6	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增攀赢基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-12
7	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-18
8	万家健康产业混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	指定媒介	2022-04-21
9	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中欧财富为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-05-26
10	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增苏宁基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-07-12
11	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万得基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-07-15
12	万家健康产业混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	指定媒介	2022-07-20
13	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在九州证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-08-02
14	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江南银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2022-08-04
15	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行为销售机构并开通	指定媒介	2022-08-29

	转换、基金定投业务的公告		
16	万家健康产业混合型证券投资基金 2022 年中期报告	指定媒介	2022-08-30
17	万家基金管理有限公司关于旗下部分 基金新增凯石财富为销售机构并开通 转换、基金定投业务及参与其费率优 惠活动的公告	指定媒介	2022-09-06
18	万家健康产业混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	指定媒介	2022-10-25
19	万家基金管理有限公司关于旗下部分 基金新增浙江绍兴瑞丰农村商业银行 股份有限公司为销售机构并开通基金 定投业务的公告	指定媒介	2022-10-31
20	万家健康产业混合型证券投资基金基 金产品资料概要（更新）	指定媒介	2022-11-09
21	万家健康产业混合型证券投资基金更 新招募说明书（2022 年第 1 号）	指定媒介	2022-11-09
22	万家基金管理有限公司关于旗下部分 基金在海通证券开通申购、转换、定 投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-11-11
23	万家基金管理有限公司关于旗下部分 基金新增新浪仓石为销售机构并开通 转换、基金定投业务及参与其费率优 惠活动的公告	指定媒介	2022-12-03
24	万家基金管理有限公司关于旗下部分 基金新增贵州银行为销售机构并开通 转换、基金定投业务及参加费率优惠 活动的公告	指定媒介	2022-12-06

§ 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 (%)
机构	1	20220106 - 2022010 9、20220117 - 20220117、 20220224 - 20220424	16,295,66 6.26	245,321, 971.86	261,617,6 38.12	-	-
	2	20220104	23,960,86	104,183,	23,960,86	104,183,408.2	12.39

		- 20220105、20220107	2.62	408.29	2.62	9	
		- 20220120、20220429					
		- 20220508、20220512					
		- 20220515					
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，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。</p>							

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家健康产业混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 4、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。
- 5、万家健康产业混合型证券投资基金 2022 年年度报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、《万家健康产业混合型证券投资基金托管协议》。

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站：www.wjasset.com。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日