

# 同泰大健康主题混合型证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：同泰基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 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。

本报告期自 2021 年 4 月 8 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 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>         | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 其他指标                                | 10        |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况                       | 11        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 12        |
| 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                 | 13        |
| 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             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 14        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 16        |
| 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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明        | 17        |
| 4.10 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        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>18</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 18        |
| 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 | 18        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 18        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>19</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 19        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 19        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>22</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 22        |
| 7.2 利润表                                 | 23        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 24        |
| 7.4 报表附注                                | 25        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>51</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 51        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 51        |
| 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       | 52        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 53        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 58        |

|                                                    |           |
|----------------------------------------------------|-----------|
| 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 .....           | 59        |
| 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 .....        | 59        |
| 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 .....        | 59        |
| 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 .....           | 59        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....                    | 59        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....                    | 59        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                                | 60        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                         | <b>61</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                        | 61        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                     | 61        |
| 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的情况 .....            | 61        |
| 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 ..... | 62        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                        | <b>63</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                           | <b>64</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                             | 64        |
| 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 .....             | 64        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....                  | 64        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                               | 64        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                        | 64        |
| 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 .....                | 64        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                       | 64        |
| 11.8 其他重大事件 .....                                  | 65        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>                   | <b>67</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 .....           | 67        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                          | 67        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                           | <b>68</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                                  | 68        |
| 13.2 存放地点 .....                                    | 68        |
| 13.3 查阅方式 .....                                    | 68        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 同泰大健康主题混合型证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 同泰大健康主题混合        |                 |
| 场内简称            | -                |                 |
| 基金主代码           | 011002           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2021 年 4 月 8 日   |                 |
| 基金管理人           | 同泰基金管理有限公司       |                 |
| 基金托管人           | 兴业银行股份有限公司       |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 63,459,318.09 份  |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 基金份额上市的证券交易所    | -                |                 |
| 上市日期            | -                |                 |
| 下属分级基金的基金简称:    | 同泰大健康主题混合 A      | 同泰大健康主题混合 C     |
| 下属分级基金的场内简称:    | -                | -               |
| 下属分级基金的交易代码:    | 011002           | 011003          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 18,749,309.59 份  | 44,710,008.50 份 |

### 2.2 基金产品说明

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |             |
|---------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|
| 投资目标          | 本基金主要投资于与大健康主题相关的资产，在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求超越基金业绩比较基准的资本增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                    |             |
| 投资策略          | <p>1、大健康主题资产界定：大健康主题是指经济系统中提供预防、诊断、治疗、康复、保健等与人体健康相关的商品和服务的总称。主要围绕生物医药、生活健康、身心健康、环境健康对相关产业和公司进行范围界定，包括以下方面：<br/>1) 生物医药相关产业；2) 生活健康相关产业；3) 身心健康相关产业；4) 环境健康相关产业。</p> <p>2、大类资产配置策略：本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过自上而下的分析，形成对不同大类资产市场的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定固定收益类资产、权益类资产和现金等的配置比例，并随着市场运行状况以及各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例，力争有效控制基金资产运作风险，提高基金资产风险调整后收益。</p> |             |
| 业绩比较基准        | 中证健康产业指数收益率×80%+一年期人民币定期存款利率（税后）×20%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |             |
| 风险收益特征        | 本基金为混合型基金，长期平均风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |             |
|               | 同泰大健康主题混合 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 同泰大健康主题混合 C |
| 下属分级基金的风险收益特征 | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | -           |

## 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      |      | 同泰基金管理有限公司                                  | 兴业银行股份有限公司                 |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 滕大江                                         | 陈玮                         |
|         | 联系电话 | 0755-23537892                               | 021-52629999               |
|         | 电子邮箱 | tengdj@tongtaiamc.com                       | chenw823@cib.com.cn        |
| 客户服务电话  |      | 400-830-1666                                | 95561                      |
| 传真      |      | 0755-23537801                               | 021-62535823               |
| 注册地址    |      | 深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城（南区）T2 栋 41 层 | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 办公地址    |      | 深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城（南区）T2 栋 41 层 | 上海市银城路 167 号               |
| 邮政编码    |      | 518033                                      | 200041                     |
| 法定代表人   |      | 马俊生                                         | 吕家进                        |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                    |
|---------------------|--------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报              |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.tongtaiamc.com |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的住所     |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址                                        |
|--------|------------------|---------------------------------------------|
| 会计师事务所 | 上会会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼                  |
| 注册登记机构 | 同泰基金管理有限公司       | 深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城(南区)T2 栋 41 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 | 2021 年 4 月 8 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日 |               | 2020 年      |             | 2019 年      |             |
|---------------|------------------------------------------|---------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
|               | 同泰大健康主题混合 A                              | 同泰大健康主题混合 C   | 同泰大健康主题混合 A | 同泰大健康主题混合 C | 同泰大健康主题混合 A | 同泰大健康主题混合 C |
| 本期已实现收益       | -2,583,837.16                            | -6,053,158.71 | -           | -           | -           | -           |
| 本期利润          | -2,555,660.58                            | -6,526,914.47 | -           | -           | -           | -           |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1215                                  | -0.1113       | -           | -           | -           | -           |
| 本期加权平均净值利润率   | -12.58%                                  | -11.48%       | -           | -           | -           | -           |
| 本期基金份额净值增长率   | -17.62%                                  | -17.85%       | -           | -           | -           | -           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末                                  |               | 2020 年末     |             | 2019 年末     |             |
| 期末可供分配利润      | -3,303,603.12                            | -7,981,751.01 | -           | -           | -           | -           |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.1762                                  | -0.1785       | -           | -           | -           | -           |
| 期末基金资产净值      | 15,445,706.47                            | 36,728,257.49 | -           | -           | -           | -           |
| 期末基金份额净值      | 0.8238                                   | 0.8215        | -           | -           | -           | -           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2021 年末                                  |               | 2020 年末     |             | 2019 年末     |             |
| 基金份额累计净值增长率   | -17.62%                                  | -17.85%       | -           | -           | -           | -           |

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、对期末可供分配利润，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、以上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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

同泰大健康主题混合 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      | -12.19%  | 1.66%       | 1.72%      | 0.64%         | -13.91% | 1.02% |
| 过去六个月      | -25.36%  | 2.10%       | -2.47%     | 0.83%         | -22.89% | 1.27% |
| 自基金合同生效起至今 | -17.62%  | 1.92%       | -1.02%     | 0.80%         | -16.60% | 1.12% |

同泰大健康主题混合 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      | -12.28%  | 1.66%       | 1.72%      | 0.64%         | -14.00% | 1.02% |
| 过去六个月      | -25.51%  | 2.10%       | -2.47%     | 0.83%         | -23.04% | 1.27% |
| 自基金合同生效起至今 | -17.85%  | 1.92%       | -1.02%     | 0.80%         | -16.83% | 1.12% |

注：本基金的业绩比较基准为中证健康产业指数收益率×80%+一年期人民币定期存款利率（税后）×20%，每日进行再平衡过程。

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

同泰大健康主题混合A基金份额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



同泰大健康主题混合C基金份额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

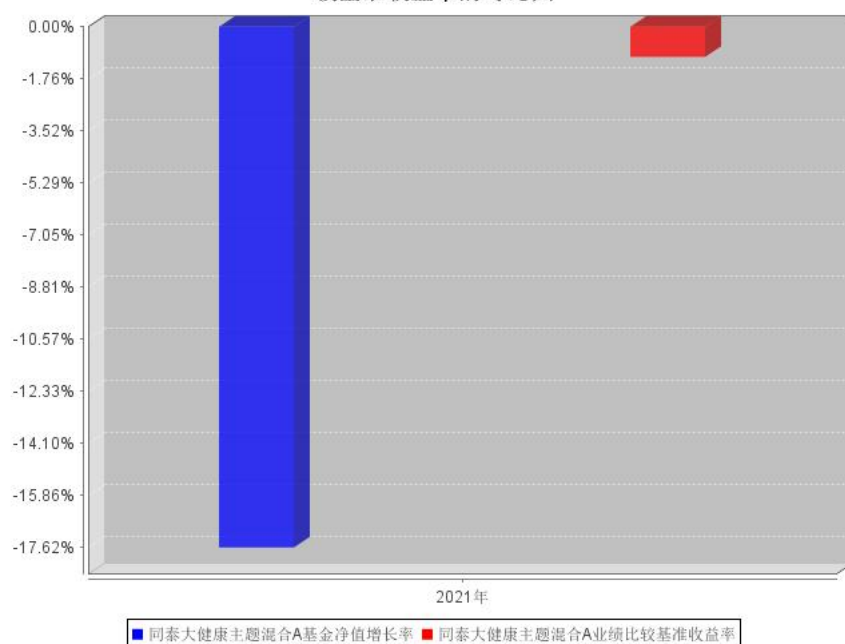


注：1、本基金合同生效日为 2021 年 4 月 8 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未滿 1 年。

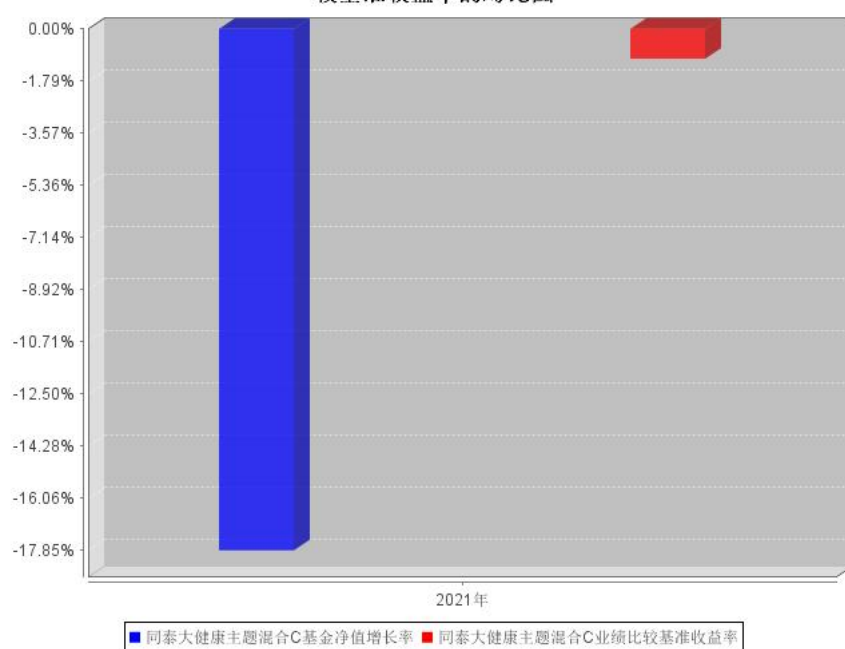
2、本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

### 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

同泰大健康主题混合A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对比图



同泰大健康主题混合C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对比图



注：本基金合同生效日为 2021 年 4 月 8 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未进行利润分配。

## § 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

本基金基金管理人为同泰基金管理有限公司，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[2018]1497号文批准设立，于2018年10月11日在深圳注册成立，注册资本1亿元人民币，并于2019年3月15日取得中国证监会核发的《经营证券期货业务许可证》。目前，公司股东及其出资比例为：刘文灿先生38.2%，刘韞芬女士32%，上海蓝尚投资管理中心（有限合伙）20%，马俊生先生4.9%，王雪梅女士4.9%。截至本报告期末，本基金管理人共管理了17只开放式基金。

#### 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                      |
| 卞亚军 | 本基金的基金经理、投资决策委员会联席主席 | 2021年4月8日       | -    | 18     | 卞亚军先生，中国国籍，硕士。曾任红塔证券股份有限公司研究员、投资经理助理，华泰柏瑞基金管理有限公司研究员、基金经理，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司基金经理、基金投资部总监，上海濠河投资管理有限公司总经理等职。2020年8月加入同泰基金管理有限公司，现任投资决策委员会联席主席兼基金经理。2020年9月23日起担任同泰竞争优势混合型证券投资基金基金经理，2020年12月31日起担任同泰远见灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021年4月8日起担任同泰大健 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                      |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 康主题混合型证券投资基金基金经理，2021 年 7 月 26 日起担任同泰数字经济主题股票型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月 30 日起担任同泰行业优选股票型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月 27 日起担任同泰同欣混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

2、基金的非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期无此情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，不存在本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 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，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规。

### 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

基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，针对股票市场、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节，制定了《同泰基金管理有限公司公平交易管理办法》等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资

者合法权益。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，不存在本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 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

在封闭期，本基金的仓位极低，打开封闭后的两周时间，本基金的仓位也相对较低。而在同一时间，整个板块的表现却很出色，这是本基金超额收益的主要来源之一。

本季度，医药行业内部的分化也比较明显，以 CRO/CDMO 为代表的高成长、高估值股票表现很弱。虽然本基金持有的医药标的基本上都是各细分领域的优秀公司，但我们在大部分时间里重点关注 CRO/CDMO 板块。而在四季度，CRO/CDMO 行业受 CDE 自查传闻、投融资数据、知名投资机构减持、美国将中国生物企业列入实体名单等因素扰动，发生较大回调；但本质上是估值相对高位情况下，板块跷跷板效应、部分绝对收益资金套现离场等因素导致。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末同泰大健康主题混合 A 基金份额净值为 0.8238 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.62%；截至本报告期末同泰大健康主题混合 C 基金份额净值为 0.8215 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.85%；同期业绩比较基准收益率为-1.02%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

疫情期间全球货币宽松对通货膨胀的远期影响不容忽视，再加上地缘政治的不确定性，我们将通货膨胀以及与此相关的货币紧缩预期作为 2022 年投资思考的一个关键变量（DCF 模型的分母端）。在这个关键变量产生稳定预期之前，我们认为短久期资产具有相对优势；而在产生稳定预期之后，长久期资产（我们通常所说的成长股）具有比较优势。

我们认为，全球新药研发景气度仍在、中国企业比较优势仍在，目前的估值已经相对合理，

CXO 仍是医药板块内相对有吸引力的赛道，具有长期配置价值。同时，我们亦看好生物制药/科研上游、原料药和制剂。此外，以中药、连锁药房、集采影响即将消除的制药企业为代表的低估值板块亦有估值修复的机会。

生物制药/科研上游是指生命科学研究和生物制药所用的仪器、试剂、耗材和装备等，应用领域非常广泛，整体需求呈现高景气态势。全球几大龙头公司长期垄断市场，产品齐全度、销售规模、品牌影响力和一站式服务体系等方面都具有明显优势；国内市场格局也类似，进口品牌占据绝大部分市场份额，大量国产企业分割其余较小份额，国产替代和行业集中度提升空间巨大。国产企业规模普遍较小，且多专注于特定环节或产品领域，还未出现能提供一站式产品和服务的公司；但可喜的是，在上游各细分领域已经出现了一批“小而美”的头部公司。新冠疫情给国产企业创造了巨大的发展机遇。一方面，新冠病原检测、疫苗和治疗性药物的研发和生产，带来巨大需求增量；另一方面，进口产品供应出现巨大挑战，国内客户纷纷寻求本土供应商；国产头部企业凭借产品性能优良、供货及时性和稳定性、可提供定制化服务等优势脱颖而出，部分企业还实现了海外市场的突破和重大进展。这些企业快速积累了资金、项目经验和品牌口碑之后，未来发展有望提速。短中期维度，受益于下游需求高景气、进口替代和行业集中度提升以及海外市场突破，各细分领域头部企业将继续保持快速发展态势。长期维度，中国具有产业链配套完善和工程师红利等比较优势，必将涌现出一批具备全球影响力的生物制药/科研上游公司。

原料药和制剂市场空间巨大，2020 年全球市场规模超过 5000 亿美元，其中欧美市场保持平稳态势，新兴国家用药潜力逐渐释放；以中国为代表的新兴国家推行仿制药一致性评价等政策，监管体系和质量标准快速接轨欧美规范市场，高品质原料药和制剂存在巨大结构性替代机遇。GDUDA 法案出台以来，仿制药审批速度大幅加快；行业核心竞争要素也从过去的产品申报速度、注册能力逐渐转变为上游产业链配套、综合制造能力和综合成本优势，而底层是先进技术、先进装备、先进制造方式的竞争，原料药制剂一体化的重要性凸显。行业竞争格局也会随之发生变化，中国和印度新一代原料药企业快速崛起，将成为行业下一阶段竞争的主要赢家。国内安全生产和环保要求趋严、限电限产和上游原材料上涨大背景下，供给端逐步出清，行业竞争门槛和集中度会逐渐提高。多部委联合发布《关于推动原料药产业高质量发展实施方案的通知》，明确了原料药产业的战略高度，也从绿色技术、先进装备、产业集群等方面为产业高质量发展提供指导；后续各地可能相继有配套政策落地，总体利好头部企业。原料药企业可依托其工艺开发能力、制造能力和成本优势，往 CDMO 和制剂等业务延伸，贡献业绩弹性的同时，进一步打开成长和估值天花板。头部原料药企业经过多年国际大客户、规范市场业务积累，已形成较好的工艺能力和质量体系，在全球医药制造产业转移、国产创新药开始商业化、国内合规产能稀缺的大背景下，CDMO 业务渐

成规模。另外，我们可喜地看到这两年中国原料药企业在海外制剂出口方面取得一些突破，国内借助仿制药集采快速放量，未来在制剂这个巨大的蓝海市场也将大有作为。

就 CRO/CDMO 行业的需求端来看，全球生物医药产业蓬勃发展，生命科学研究不断突破、生物技术加速涌现并成功产业化，本质上是技术突破瓶颈之后的指数级增长效应，未来每一个方向都将催生巨大的市场，CRO/CDMO 需求快速增长，行业天花板持续突破。而中国三医改革逐渐深化，适合创新药发展的大环境逐渐理顺；中国药审制度改革、MAH 政策和加入 ICH 相继推出，新药研发热情高涨，行业处于爆发式增长初期阶段，未来发展空间和潜力巨大；大量海归人才回国创业，头部 CRO 公司快速崛起，带动整个行业技术外溢，中国与全球新药研发/生物技术的差距在逐步缩小。海外大型药企纷纷剥离生产设施，更加聚焦于高附加值的药物创新研发，有巨大的生产外包需求；生物医药研发模式发生变化，biotech 公司占比逐步提高，这些公司的外包需求更加刚性，外包服务内容更加丰富，对一站式服务的需求更加强烈。就供给端来看，中国 CRO/CDMO 企业具有低成本、高效率、完善的上游供应链等诸多比较优势，且技术能力和质量体系逐步提升，已经走过了低水平的成本红利/环保红利、产能外包阶段；短期看，CRO/CDMO 行业还处在一起做大蛋糕、分蛋糕的阶段；中期看，企业纷纷寻求横向扩张和纵向突破，以期打造全流程一体化的服务能力，弱化单一业务竞争风险，逐步全产业链覆盖；长期看，龙头 CRO/CDMO 企业将引领新药研发科技创新，进一步解放人力和产能的束缚，商业模式不断升级；未来还可以依托行业趋势和竞争格局的深入了解，对合作创新企业进行全方位的赋能，打造以自身平台为中心的创融生态圈。

#### 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，本基金管理人依据法律法规、监管政策的变化，并结合公司业务发展情况，遵照公司内部控制的整体要求，不断完善内控建设，积极践行合规风控管理，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规政策和公司管理制度的落实，确保基金合同得到严格履行。

报告期内，本基金管理人积极贯彻落实新的监管要求，及时进行公司制度、流程的制定和修订，进一步完善公司的内控体系，确保各项业务的合规开展；实行入职合规宣导机制并组织开展合规培训，不断提高从业人员的合规素质；实时监控投资组合交易，监督投资运作的合规性；定期开展专项稽核工作，保障业务开展的合规有效性。

本基金管理人将继续坚持审慎勤勉的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，加强防范各种风险，切实保护基金资产的安全及基金份额持有人的权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括估值委员会、运营部及相关部门。

本基金的日常估值程序通常由运营部估值核算岗执行并由业务复核岗复核估值结果，最终由估值核算岗与基金托管人的估值结果核对一致。

本基金的特别估值程序由估值委员会秘书部门运营部在收到启动特殊估值程序的请求后，通过估值核算人员及时与基金托管人沟通协商，必要时征求会计师事务所的专业意见，并将有关信息及材料一并报送全体估值委员会成员；估值委员会应综合考虑投资研究部和运营部等各方面的意见和建议，并按照有关议事规则讨论审议，决定批准或不批准使用特殊估值调整；运营部应当根据经估值委员会审议通过的特别估值调整意见执行估值程序，准备特殊估值调整事项的临时公告，并发起信息披露审批流程；监察稽核部应当对特殊估值调整事项的相关信息披露进行合规审核。

截止报告期末，本基金管理人已与中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金收益分配原则：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；基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类别的每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

本报告期内，会计师事务所对当期财务会计报告出具的是标准审计报告。

#### **4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内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的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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     | 上会师报字(2022)第 2577 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   | 同泰大健康主题混合型证券投资基金全体份额持有人                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 审计意见      | <p>我们审计了同泰大健康主题混合型证券投资基金(以下简称“同泰大健康混合基金”)财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 4 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、基金净值变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附同泰大健康混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《同泰大健康主题混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了同泰大健康混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 4 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p> |
| 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,我们独立于同泰大健康混合基金,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。                                                                                                                                                                                                                            |
| 强调事项      | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 其他事项      | 我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系同泰大健康混合基金管理人同泰基金管理有限公司(以下简称“管理人”)管理层根据《同泰大健康主题混合型证券投资基金基金合同》的规定为其基金份额持有人编制的,因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人管理层提供同泰大健康混合基金份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用(如需),不得用于其他目的。                                                                                                                                                                              |
| 其他信息      | <p>管理人管理层对其他信息负责。其他信息包括同泰大健康混合基金 2021 年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。</p> <p>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</p>                                                                                                                                                                                                                                                                      |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | <p>信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>                                                                                                                             |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>管理人管理层负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《同泰大健康主题混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，管理人管理层负责评估同泰大健康混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，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>管理人治理层负责监督同泰大健康混合基金的财务报告过程。</p>      |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <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，</p> |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |     |
|-----------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|           | <p>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、评价管理人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、对管理人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，就可能导致对同泰大健康混合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同泰大健康混合基金不能持续经营。</p> <p>5、评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管理人治理层就同泰大健康混合基金的审计范围、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 | 上会会计师事务所（特殊普通合伙）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |     |
| 注册会计师的姓名  | 杨小磊                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 杨桂丽 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 层                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |     |
| 审计报告日期    | 2022 年 3 月 26 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |     |

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：同泰大健康主题混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 3,406,172.67                    | -                                |
| 结算备付金           |            | 0.04                            | -                                |
| 存出保证金           |            | -                               | -                                |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 49,147,526.64                   | -                                |
| 其中：股票投资         |            | 49,086,927.30                   | -                                |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 60,599.34                       | -                                |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 416.74                          | -                                |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 84,082.00                       | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 52,638,198.09                   | -                                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 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       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款           |            | 250,231.85                      | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 63,753.61                       | -                                |
| 应付托管费           |            | 8,500.50                        | -                                |
| 应付销售服务费         |            | 11,744.63                       | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | -                               | -                                |
| 应交税费            |            | 0.06                            | -                                |
| 应付利息            |            | -                               | -                                |

|               |          |                |   |
|---------------|----------|----------------|---|
| 应付利润          |          | -              | - |
| 递延所得税负债       |          | -              | - |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 130,003.48     | - |
| 负债合计          |          | 464,234.13     | - |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |   |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 63,459,318.09  | - |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -11,285,354.13 | - |
| 所有者权益合计       |          | 52,173,963.96  | - |
| 负债和所有者权益总计    |          | 52,638,198.09  | - |

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 63,459,318.09 份，其中同泰大健康主题混合 A 基金份额净值 0.8238 元，基金份额总额 18,749,309.59 份；同泰大健康主题混合 C 基金份额净值 0.8215 元，基金份额总额 44,710,008.50 份。

## 7.2 利润表

会计主体：同泰大健康主题混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 4 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2021 年 4 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|------------|-------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | -6,938,115.69                                   | -                                              |
| 1.利息收入                |            | 479,026.27                                      | -                                              |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11   | 222,311.01                                      | -                                              |
| 债券利息收入                |            | 56,494.25                                       | -                                              |
| 资产支持证券利息收入            |            | -                                               | -                                              |
| 买入返售金融资产收入            |            | 200,221.01                                      | -                                              |
| 证券出借利息收入              |            | -                                               | -                                              |
| 其他利息收入                |            | -                                               | -                                              |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | -7,215,677.36                                   | -                                              |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12   | -7,306,224.86                                   | -                                              |
| 基金投资收益                |            | -                                               | -                                              |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13   | 4,940.00                                        | -                                              |
| 资产支持证券投资收益            | 7.4.7.13.5 | -                                               | -                                              |
| 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   | 85,607.50                                       | -                                              |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | -445,579.18                                     | -                                              |
| 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   | 244,114.58    | - |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 2,144,459.36  | - |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 853,340.57    | - |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 113,778.72    | - |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 168,047.55    | - |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | 871,036.56    | - |
| 5. 利息支出                    |            | -             | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -             | - |
| 6. 税金及附加                   |            | -             | - |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 138,255.96    | - |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -9,082,575.05 | - |
| 减：所得税费用                    |            | -             | - |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -9,082,575.05 | - |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：同泰大健康主题混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |               |                 |
|----------------------------------------|-------------------------------------------------|---------------|-----------------|
|                                        | 实收基金                                            | 未分配利润         | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 223,220,579.43                                  | -             | 223,220,579.43  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                               | -9,082,575.05 | -9,082,575.05   |
| 三、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）      | -159,761,261.34                                 | -2,202,779.08 | -161,964,040.42 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 76,038,425.44                                   | -2,462,750.06 | 73,575,675.38   |
| 2. 基金赎回款                               | -235,799,686.78                                 | 259,970.98    | -235,539,715.80 |
| 四、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） | -                                               | -             | -               |

|                                        |                                             |                |               |
|----------------------------------------|---------------------------------------------|----------------|---------------|
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 63,459,318.09                               | -11,285,354.13 | 52,173,963.96 |
|                                        | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |                |               |
| 项目                                     | 实收基金                                        | 未分配利润          | 所有者权益合计       |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | -                                           | -              | -             |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                           | -              | -             |
| 三、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）      | -                                           | -              | -             |
| 其中：1. 基金申购款                            | -                                           | -              | -             |
| 2. 基金赎回款                               | -                                           | -              | -             |
| 四、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） | -                                           | -              | -             |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | -                                           | -              | -             |

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>马俊生</u> | <u>杨伍</u> | <u>刘蕴芬</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

同泰大健康主题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]3169号《关于准予同泰大健康主题混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人同泰基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2021年4月8日正式生效，首次设立募集规模为223,220,579.43份基金份额。

本基金为契约型开放式混合型基金。基金存续期限为不定期。本基金的基金管理人为同泰基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金主要投资于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(包括中小板、

创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国家债券、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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)。

股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，投资于大健康主题相关资产的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：中证健康产业指数收益率 $\times$ 80 %+一年期人民币定期存款利率（税后） $\times$ 20 %。

#### 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、解释以及其他相关规定（以下统称“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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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信息披露管理办法》、《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<年度和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

本基金会计年度为公历 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为人民币。

#### 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分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

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主要为股票、债券和衍生工具等投资。

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、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归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。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 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

##### 初始确认

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，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。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取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

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。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融

负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

#### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 金融资产转移

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。

### 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。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资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估值原则仍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，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(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

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；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。

#### 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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。

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；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，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。

应收款项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则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的相关交易费用在发生时按照确定的金额计入交易费用。

其他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。

其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额计入当期费用。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 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；

(2) 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类别的每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 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

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组

成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

无。

### **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**

无。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

无。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

无。

### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府

债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 1,763,111.84            | -                        |
| 定期存款           | -                       | -                        |
| 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           | 1,643,060.83            | -                        |
| 合计：            | 3,406,172.71            | -                        |

注：本基金持有的其他存款为存放在证券经纪商资金账户的证券交易结算资金。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|----|-------------------------|
|----|-------------------------|

|               |       | 成本                       | 公允价值          | 公允价值变动      |
|---------------|-------|--------------------------|---------------|-------------|
| 股票            |       | 49,532,506.48            | 49,086,927.30 | -445,579.18 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -             | -           |
| 债券            | 交易所市场 | 60,599.34                | 60,599.34     | -           |
|               | 银行间市场 | -                        | -             | -           |
|               | 合计    | 60,599.34                | 60,599.34     | -           |
| 资产支持证券        |       | -                        | -             | -           |
| 基金            |       | -                        | -             | -           |
| 其他            |       | -                        | -             | -           |
| 合计            |       | 49,593,105.82            | 49,147,526.64 | -445,579.18 |
| 项目            |       | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |               |             |
|               |       | 成本                       | 公允价值          | 公允价值变动      |
| 股票            |       | -                        | -             | -           |
| 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            |       | -                        | -             | -           |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 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

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|----------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息 | 139.33                  | -                        |

|            |        |   |
|------------|--------|---|
| 应收定期存款利息   | -      | - |
| 应收其他存款利息   | -      | - |
| 应收结算备付金利息  | -      | - |
| 应收债券利息     | 2.66   | - |
| 应收资产支持证券利息 | -      | - |
| 应收买入返售证券利息 | -      | - |
| 应收申购款利息    | 40.74  | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -      | - |
| 应收出借证券利息   | -      | - |
| 其他         | 234.01 | - |
| 合计         | 416.74 | - |

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

无。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | 3.48                    | -                        |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 预提费用        | 130,000.00              | -                        |
| 合计          | 130,003.48              | -                        |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 同泰大健康主题混合 A   |                                                 |                |
|---------------|-------------------------------------------------|----------------|
| 项目            | 本期<br>2021 年 4 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |                |
|               | 基金份额(份)                                         | 账面金额           |
| 基金合同生效日       | 33,270,650.61                                   | 33,270,650.61  |
| 本期申购          | 14,466,380.52                                   | 14,466,380.52  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -28,987,721.54                                  | -28,987,721.54 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                               | -              |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                               | -              |

|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 本期申购          | -             | -             |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -             | -             |
| 本期末           | 18,749,309.59 | 18,749,309.59 |

金额单位：人民币元

| 同泰大健康主题混合 C   |                                                 |                 |
|---------------|-------------------------------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>2021 年 4 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                                         | 账面金额            |
| 基金合同生效日       | 189,949,928.82                                  | 189,949,928.82  |
| 本期申购          | 61,572,044.92                                   | 61,572,044.92   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -206,811,965.24                                 | -206,811,965.24 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                               | -               |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                               | -               |
| 本期申购          | -                                               | -               |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                               | -               |
| 本期末           | 44,710,008.50                                   | 44,710,008.50   |

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 同泰大健康主题混合 A    |               |             |               |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分       | 未分配利润合计       |
| 基金合同生效日        | -             | -           | -             |
| 本期利润           | -2,583,837.16 | 28,176.58   | -2,555,660.58 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -23,343.70    | -724,598.84 | -747,942.54   |
| 其中：基金申购款       | -369,537.31   | 139,957.75  | -229,579.56   |
| 基金赎回款          | 346,193.61    | -864,556.59 | -518,362.98   |
| 本期已分配利润        | -             | -           | -             |
| 本期末            | -2,607,180.86 | -696,422.26 | -3,303,603.12 |

单位：人民币元

| 同泰大健康主题混合 C    |               |               |               |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 基金合同生效日        | -             | -             | -             |
| 本期利润           | -6,053,158.71 | -473,755.76   | -6,526,914.47 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -272,679.12   | -1,182,157.42 | -1,454,836.54 |
| 其中：基金申购款       | -1,956,162.00 | -277,008.50   | -2,233,170.50 |
| 基金赎回款          | 1,683,482.88  | -905,148.92   | 778,333.96    |

|         |               |               |               |
|---------|---------------|---------------|---------------|
| 本期已分配利润 | -             | -             | -             |
| 本期末     | -6,325,837.83 | -1,655,913.18 | -7,981,751.01 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 4 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------|-------------------------------------------------|---------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 4,756.89                                        | -                                           |
| 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 | 198,104.06                                      | -                                           |
| 其他        | 19,450.06                                       | -                                           |
| 合计        | 222,311.01                                      | -                                           |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2021 年 4 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|------------------|-------------------------------------------------|---------------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -7,306,224.86                                   | -                                           |
| 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               | -7,306,224.86                                   | -                                           |

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021 年 4 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------------------------------|---------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 314,813,905.07                                  | -                                           |
| 减：卖出股票成本总额 | 322,120,129.93                                  | -                                           |
| 买卖股票差价收入   | -7,306,224.86                                   | -                                           |

**7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入**

无。

**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<br>2021年4月8日(基金合<br>同生效日)至2021年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年<br>12月31日 |
|-------------------------------|----------------------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 4,940.00                                     | -                                    |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                                            | -                                    |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                                            | -                                    |
| 合计                            | 4,940.00                                     | -                                    |

**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<br>2021年4月8日(基金合<br>同生效日)至2021年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年<br>12月31日 |
|-------------------------|----------------------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 59,784,971.43                                | -                                    |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 59,714,460.00                                | -                                    |
| 减：应收利息总额                | 65,571.43                                    | -                                    |
| 买卖债券差价收入                | 4,940.00                                     | -                                    |

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

无。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

无。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 4 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------------------------------|---------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 85,607.50                                       | -                                           |
| 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            | 85,607.50                                       | -                                           |

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2021 年 4 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------------------------------|---------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -445,579.18                                     | -                                           |

|                        |             |   |
|------------------------|-------------|---|
| ——股票投资                 | -445,579.18 | - |
| ——债券投资                 | -           | - |
| ——资产支持证券投资             | -           | - |
| ——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                     | -445,579.18 | - |

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目           | 本期<br>2021 年 4 月 8 日(基金合同<br>生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12<br>月 31 日 |
|--------------|-----------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 基金赎回费收入      | 243,196.69                                          | -                                              |
| 转换费收入 011002 | 497.99                                              | -                                              |
| 转换费收入 011003 | 419.90                                              | -                                              |
| 合计           | 244,114.58                                          | -                                              |

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 4 月 8 日(基金合同<br>生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12<br>月 31 日 |
|-----------|-----------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 870,286.56                                          | -                                              |
| 银行间市场交易费用 | 750.00                                              | -                                              |
| 交易基金产生的费用 | -                                                   | -                                              |
| 其中：申购费    | -                                                   | -                                              |
| 赎回费       | -                                                   | -                                              |
| 合计        | 871,036.56                                          | -                                              |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 4 月 8 日(基金合 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 |
|----|--------------------------|-----------------------------------|
|----|--------------------------|-----------------------------------|

|              | 同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 12 月 31 日 |
|--------------|-------------------------|-----------|
| 审计费用         | 30,000.00               | —         |
| 信息披露费        | 100,000.00              | —         |
| 证券出借违约金      | —                       | —         |
| 银行汇划费        | 2,468.54                | —         |
| 中债登债券充抵保证金费用 | 1,012.33                |           |
| 中金所债券充抵保证金费用 | 575.09                  |           |
| 开户费          | 1,200.00                |           |
| 中债登账户维护费     | 3,000.00                |           |
| 合计           | 138,255.96              | —         |

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 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

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称              | 与本基金的关系               |
|--------------------|-----------------------|
| 同泰基金管理有限公司         | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 基金托管人、基金销售机构          |
| 上海蓝尚投资管理中心（有限合伙）   | 基金管理人的股东              |
| 刘文灿                | 基金管理人的股东              |
| 马俊生                | 基金管理人的股东              |
| 刘韞芬                | 基金管理人的股东              |
| 王雪梅                | 基金管理人的股东              |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**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**

无。

**7.4.10.1.2 债券交易**

无。

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**7.4.10.1.4 权证交易**

无。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**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<br>2021年4月8日(基金合同生效<br>日)至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31<br>日 |
|-----------------|------------------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 853,340.57                               | —                                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 329,514.08                               | —                                    |

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

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年4月8日(基金合同生效<br>日)至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31<br>日 |
|----|------------------------------------------|--------------------------------------|
|----|------------------------------------------|--------------------------------------|

|                | 日)至 2021 年 12 月 31 日 | 日 |
|----------------|----------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 113,778.72           | - |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

### 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<br>2021 年 4 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |             |           |
|----------------|-------------------------------------------------|-------------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                |             |           |
|                | 同泰大健康主题混合 A                                     | 同泰大健康主题混合 C | 合计        |
| 同泰基金管理有限公司     | -                                               | 34,982.69   | 34,982.69 |
| 兴业银行           | -                                               | 2.15        | 2.15      |
| 合计             | -                                               | 34,984.84   | 34,984.84 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日     |             |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                |             |           |
|                | 同泰大健康主题混合 A                                     | 同泰大健康主题混合 C | 合计        |
| 合计             | -                                               | -           | -         |

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 0.40%，按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

### 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

无。

**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**

无。

**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**

无。

**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**

无。

**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

| 同泰大健康主题混合 C |                         |                          |                          |                          |
|-------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 关联方名称       | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                          |
|             | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 自然人股东       | 924.81                  | 0.00%                    | —                        | —                        |

**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<br>名称      | 本期<br>2021 年 4 月 8 日 (基金合同生效日) 至 2021<br>年 12 月 31 日 |          | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 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 |
| 兴业银行股份有<br>限公司 | 1,763,111.84                                         | 4,756.89 | —                                           | —      |

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**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（2021 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            | 可流通日            | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量<br>(单位:股) | 期末成本总额   | 期末估值总额   | 备注 |
| 001234               | 泰慕士  | 2021 年 12 月 31 日 | 2022 年 1 月 11 日 | 新股流通受限 | 16.53 | 16.53  | 268          | 4,430.04 | 4,430.04 | -  |

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**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**

无。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

**7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

无。

**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**

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、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。

本基金管理人的风险管理架构由董事会下的风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、监察稽核部、以及各个业务部门组成。

#### **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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本公司管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.12%。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期不适用。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期不适用。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期不适用。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期不适用。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期不适用。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期不适用。

**7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金的基金管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

**7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无。

**7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金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，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制（如有）外，本基金所持的证券均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。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。

本报告期内，未发生重大流动性风险事件。

#### 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。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年 12 月 31<br>日  | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计            |
|-----------------------------|--------------|-------|-------|----------------|---------------|
| 资产                          |              |       |       |                |               |
| 银行存款                        | 3,406,172.67 | -     | -     | -              | 3,406,172.67  |
| 结算备付金                       | 0.04         | -     | -     | -              | 0.04          |
| 交易性金融资产                     | 60,599.34    | -     | -     | -49,086,927.30 | 49,147,526.64 |
| 应收利息                        | -            | -     | -     | 416.74         | 416.74        |
| 应收申购款                       | -            | -     | -     | 84,082.00      | 84,082.00     |
| 资产总计                        | 3,466,772.05 | -     | -     | -49,171,426.04 | 52,638,198.09 |
| 负债                          |              |       |       |                |               |
| 应付赎回款                       | -            | -     | -     | 250,231.85     | 250,231.85    |
| 应付管理人报酬                     | -            | -     | -     | 63,753.61      | 63,753.61     |
| 应付托管费                       | -            | -     | -     | 8,500.50       | 8,500.50      |
| 应付销售服务费                     | -            | -     | -     | 11,744.63      | 11,744.63     |
| 应交税费                        | -            | -     | -     | 0.06           | 0.06          |
| 其他负债                        | -            | -     | -     | 130,003.48     | 130,003.48    |
| 负债总计                        | -            | -     | -     | 464,234.13     | 464,234.13    |
| 利率敏感度缺口                     | 3,466,772.05 | -     | -     | -48,707,191.91 | 52,173,963.96 |
| 上年度末<br>2020 年 12 月 31<br>日 | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计            |
| 资产                          |              |       |       |                |               |
| 资产总计                        | -            | -     | -     | -              | -             |

|         |   |   |   |   |   |
|---------|---|---|---|---|---|
| 负债      |   |   |   |   |   |
| 负债总计    | - | - | - | - | - |
| 利率敏感度缺口 | - | - | - | - | - |

注：各期限分类的标准为按金融资产或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

于本报告期末，本基金未持有债券或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对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，无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

##### 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<br>2021 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 49,086,927.30           | 94.08                    | -                        | -                     |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 交易性金融资产—债券投资  | 60,599.34               | 0.12                     | -                        | -                     |
| 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            | 49,147,526.64           | 94.20                    | -                        | -                     |

**7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

| 假设 | 除沪深 300 指数收益率以外的其他市场价格变量保持不变 |                             |                        |
|----|------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动                    | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                              | 本期末（2021 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|    | 沪深 300 指数收益率上升 5%            | 2,500,075.58                | -                      |
|    | 沪深 300 指数收益率下降 5%            | -2,500,075.58               |                        |

**7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

本基金本报告期不适用。

**7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****7.4.14.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

**7.4.14.2 其他事项****（1）公允价值**

基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

**各层次金融工具公允价值**

于本报告期末，本基金持有的持续以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 49,082,497.26 元，划分为第二层次的余额为人民币 65,029.38 元，无划分为第三层次的余额。

**公允价值所属层次间重大变动**

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

**第三层次公允价值期初金额和本期变动金额**

本基金本期未发生第三层次公允价值转入（转出）的情况。

（2）除公允价值外，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              | 49,086,927.30 | 93.25         |
|    | 其中：股票             | 49,086,927.30 | 93.25         |
| 2  | 基金投资              | —             | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 60,599.34     | 0.12          |
|    | 其中：债券             | 60,599.34     | 0.12          |
|    | 资产支持证券            | —             | —             |
| 4  | 贵金属投资             | —             | —             |
| 5  | 金融衍生品投资           | —             | —             |
| 6  | 买入返售金融资产          | —             | —             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —             | —             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 3,406,172.71  | 6.47          |
| 8  | 其他各项资产            | 84,498.74     | 0.16          |
| 9  | 合计                | 52,638,198.09 | 100.00        |

### 8.2 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          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —             | —             |
| B  | 采矿业              | —             | —             |
| C  | 制造业              | 34,131,701.92 | 65.42         |
| 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           | 4,127,084.00  | 7.91          |
| 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  | 1,106,160.00  | 2.12          |
| J  | 金融业              | 61,007.52     | 0.12          |
| 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       | 7,102,511.19  | 13.61         |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| 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       | 2,541,880.00  | 4.87  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 16,582.67     | 0.03  |
| S | 综合            | —             | —     |
|   | 合计            | 49,086,927.30 | 94.08 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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  | 000963 | 华东医药 | 64,200 | 2,580,840.00 | 4.95         |
| 2  | 300363 | 博腾股份 | 28,500 | 2,549,325.00 | 4.89         |
| 3  | 603707 | 健友股份 | 52,500 | 2,205,000.00 | 4.23         |
| 4  | 300347 | 泰格医药 | 15,800 | 2,019,240.00 | 3.87         |
| 5  | 300015 | 爱尔眼科 | 46,000 | 1,944,880.00 | 3.73         |
| 6  | 688202 | 美迪西  | 3,841  | 1,865,151.19 | 3.57         |
| 7  | 688363 | 华熙生物 | 11,200 | 1,739,360.00 | 3.33         |
| 8  | 300630 | 普利制药 | 29,800 | 1,640,192.00 | 3.14         |
| 9  | 002821 | 凯莱英  | 3,600  | 1,566,000.00 | 3.00         |
| 10 | 600976 | 健民集团 | 19,600 | 1,546,244.00 | 2.96         |
| 11 | 300813 | 泰林生物 | 15,000 | 1,500,000.00 | 2.87         |
| 12 | 603456 | 九洲药业 | 26,000 | 1,462,760.00 | 2.80         |
| 13 | 000739 | 普洛药业 | 41,180 | 1,445,006.20 | 2.77         |
| 14 | 603127 | 昭衍新药 | 12,000 | 1,385,160.00 | 2.65         |
| 15 | 300171 | 东富龙  | 27,000 | 1,364,580.00 | 2.62         |
| 16 | 600587 | 新华医疗 | 42,000 | 1,352,400.00 | 2.59         |
| 17 | 603520 | 司太立  | 20,800 | 1,352,000.00 | 2.59         |
| 18 | 688105 | 诺唯赞  | 12,600 | 1,335,600.00 | 2.56         |
| 19 | 300636 | 同和药业 | 50,000 | 1,318,000.00 | 2.53         |
| 20 | 300358 | 楚天科技 | 50,000 | 1,303,500.00 | 2.50         |
| 21 | 688626 | 翔宇医疗 | 22,800 | 1,297,776.00 | 2.49         |
| 22 | 688301 | 奕瑞科技 | 2,600  | 1,291,940.00 | 2.48         |
| 23 | 688056 | 莱伯泰科 | 20,000 | 1,287,600.00 | 2.47         |
| 24 | 688357 | 建龙微纳 | 6,600  | 1,266,804.00 | 2.43         |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 25 | 600129 | 太极集团 | 56,000 | 1,257,760.00 | 2.41 |
| 26 | 603351 | 威尔药业 | 32,000 | 1,253,440.00 | 2.40 |
| 27 | 002045 | 国光电器 | 80,000 | 1,200,000.00 | 2.30 |
| 28 | 300253 | 卫宁健康 | 66,000 | 1,106,160.00 | 2.12 |
| 29 | 688298 | 东方生物 | 4,300  | 991,150.00   | 1.90 |
| 30 | 605369 | 拱东医疗 | 5,000  | 716,450.00   | 1.37 |
| 31 | 300497 | 富祥药业 | 42,000 | 685,860.00   | 1.31 |
| 32 | 600763 | 通策医疗 | 3,000  | 597,000.00   | 1.14 |
| 33 | 688366 | 昊海生科 | 4,400  | 553,916.00   | 1.06 |
| 34 | 300702 | 天宇股份 | 10,800 | 522,180.00   | 1.00 |
| 35 | 688166 | 博瑞医药 | 13,800 | 506,598.00   | 0.97 |
| 36 | 688131 | 皓元医药 | 2,000  | 497,360.00   | 0.95 |
| 37 | 300896 | 爱美客  | 900    | 482,499.00   | 0.92 |
| 38 | 600927 | 永安期货 | 1,626  | 61,007.52    | 0.12 |
| 39 | 603230 | 内蒙新华 | 641    | 16,582.67    | 0.03 |
| 40 | 001296 | 长江材料 | 256    | 15,175.68    | 0.03 |
| 41 | 001234 | 泰慕士  | 268    | 4,430.04     | 0.01 |

## 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末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 000963 | 华东医药 | 15,486,808.00 | 29.68          |
| 2  | 600111 | 北方稀土 | 13,059,694.75 | 25.03          |
| 3  | 600763 | 通策医疗 | 11,911,985.20 | 22.83          |
| 4  | 000661 | 长春高新 | 11,552,308.00 | 22.14          |
| 5  | 300015 | 爱尔眼科 | 10,304,432.77 | 19.75          |
| 6  | 603259 | 药明康德 | 9,716,418.60  | 18.62          |
| 7  | 600392 | 盛和资源 | 9,533,456.00  | 18.27          |
| 8  | 300896 | 爱美客  | 9,163,477.60  | 17.56          |
| 9  | 600276 | 恒瑞医药 | 8,718,260.60  | 16.71          |
| 10 | 688050 | 爱博医疗 | 8,687,369.13  | 16.65          |
| 11 | 688363 | 华熙生物 | 8,057,416.44  | 15.44          |
| 12 | 300759 | 康龙化成 | 8,014,307.00  | 15.36          |
| 13 | 688202 | 美迪西  | 7,810,776.29  | 14.97          |
| 14 | 688356 | 键凯科技 | 7,414,420.94  | 14.21          |

|    |        |      |              |       |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 15 | 002821 | 凯莱英  | 7,205,794.00 | 13.81 |
| 16 | 603456 | 九洲药业 | 7,201,834.05 | 13.80 |
| 17 | 300390 | 天华超净 | 7,079,320.00 | 13.57 |
| 18 | 603127 | 昭衍新药 | 6,766,468.80 | 12.97 |
| 19 | 300347 | 泰格医药 | 6,432,930.00 | 12.33 |
| 20 | 300725 | 药石科技 | 6,370,929.40 | 12.21 |
| 21 | 688366 | 昊海生科 | 6,187,042.63 | 11.86 |
| 22 | 000422 | 湖北宜化 | 5,992,083.00 | 11.48 |
| 23 | 600096 | 云天化  | 5,944,313.00 | 11.39 |
| 24 | 600141 | 兴发集团 | 5,158,453.00 | 9.89  |
| 25 | 000739 | 普洛药业 | 4,859,177.00 | 9.31  |
| 26 | 000792 | 盐湖股份 | 4,640,732.04 | 8.89  |
| 27 | 300363 | 博腾股份 | 4,400,334.00 | 8.43  |
| 28 | 300497 | 富祥药业 | 4,207,227.00 | 8.06  |
| 29 | 300122 | 智飞生物 | 3,909,677.00 | 7.49  |
| 30 | 688301 | 奕瑞科技 | 3,837,590.75 | 7.36  |
| 31 | 600010 | 宝钢股份 | 3,466,400.00 | 6.64  |
| 32 | 002539 | 云图控股 | 3,324,283.00 | 6.37  |
| 33 | 300358 | 楚天科技 | 3,241,531.00 | 6.21  |
| 34 | 688056 | 莱伯泰科 | 3,125,598.91 | 5.99  |
| 35 | 002176 | 江特电机 | 3,123,797.00 | 5.99  |
| 36 | 688357 | 建龙微纳 | 3,024,629.07 | 5.80  |
| 37 | 600338 | 西藏珠峰 | 2,997,327.00 | 5.74  |
| 38 | 688016 | 心脉医疗 | 2,982,740.43 | 5.72  |
| 39 | 688617 | 惠泰医疗 | 2,956,124.06 | 5.67  |
| 40 | 300171 | 东富龙  | 2,901,002.00 | 5.56  |
| 41 | 300748 | 金力永磁 | 2,887,791.00 | 5.53  |
| 42 | 002612 | 朗姿股份 | 2,871,516.00 | 5.50  |
| 43 | 000615 | 奥园美谷 | 2,829,407.00 | 5.42  |
| 44 | 688139 | 海尔生物 | 2,731,560.62 | 5.24  |
| 45 | 300224 | 正海磁材 | 2,553,409.00 | 4.89  |
| 46 | 688185 | 康希诺  | 2,460,693.88 | 4.72  |
| 47 | 301089 | 拓新药业 | 2,260,677.00 | 4.33  |
| 48 | 600519 | 贵州茅台 | 2,251,856.00 | 4.32  |
| 49 | 688029 | 南微医学 | 2,215,264.33 | 4.25  |
| 50 | 603707 | 健友股份 | 2,128,552.26 | 4.08  |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 51 | 300529 | 健帆生物 | 2,110,760.00 | 4.05 |
| 52 | 600259 | 广晟有色 | 2,037,684.00 | 3.91 |
| 53 | 002312 | 川发龙蟒 | 2,033,037.00 | 3.90 |
| 54 | 300653 | 正海生物 | 1,884,945.00 | 3.61 |
| 55 | 000762 | 西藏矿业 | 1,883,417.05 | 3.61 |
| 56 | 301080 | 百普赛斯 | 1,870,368.00 | 3.58 |
| 57 | 300573 | 兴齐眼药 | 1,836,526.00 | 3.52 |
| 58 | 000516 | 国际医学 | 1,781,631.00 | 3.41 |
| 59 | 688621 | 阳光诺和 | 1,776,897.52 | 3.41 |
| 60 | 000822 | 山东海化 | 1,714,660.00 | 3.29 |
| 61 | 002004 | 华邦健康 | 1,664,000.00 | 3.19 |
| 62 | 688277 | 天智航  | 1,663,899.08 | 3.19 |
| 63 | 002597 | 金禾实业 | 1,663,557.00 | 3.19 |
| 64 | 688166 | 博瑞医药 | 1,656,045.05 | 3.17 |
| 65 | 600673 | 东阳光  | 1,645,660.00 | 3.15 |
| 66 | 002192 | 融捷股份 | 1,635,753.00 | 3.14 |
| 67 | 300285 | 国瓷材料 | 1,590,645.00 | 3.05 |
| 68 | 000960 | 锡业股份 | 1,578,152.00 | 3.02 |
| 69 | 600773 | 西藏城投 | 1,531,971.00 | 2.94 |
| 70 | 300630 | 普利制药 | 1,515,693.00 | 2.91 |
| 71 | 688076 | 诺泰生物 | 1,515,031.09 | 2.90 |
| 72 | 688690 | 纳微科技 | 1,488,360.13 | 2.85 |
| 73 | 688105 | 诺唯赞  | 1,453,822.74 | 2.79 |
| 74 | 688626 | 翔宇医疗 | 1,453,821.35 | 2.79 |
| 75 | 300127 | 银河磁体 | 1,451,417.00 | 2.78 |
| 76 | 600976 | 健民集团 | 1,411,910.04 | 2.71 |
| 77 | 300813 | 泰林生物 | 1,379,426.00 | 2.64 |
| 78 | 300203 | 聚光科技 | 1,366,421.00 | 2.62 |
| 79 | 603520 | 司太立  | 1,344,280.00 | 2.58 |
| 80 | 300149 | 睿智医药 | 1,334,532.00 | 2.56 |
| 81 | 300685 | 艾德生物 | 1,333,844.00 | 2.56 |
| 82 | 603986 | 兆易创新 | 1,324,058.00 | 2.54 |
| 83 | 300636 | 同和药业 | 1,315,310.00 | 2.52 |
| 84 | 002466 | 天齐锂业 | 1,315,077.00 | 2.52 |
| 85 | 000568 | 泸州老窖 | 1,306,867.00 | 2.50 |
| 86 | 300782 | 卓胜微  | 1,299,569.00 | 2.49 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 87 | 603351 | 威尔药业 | 1,291,552.00 | 2.48 |
| 88 | 300412 | 迦南科技 | 1,289,672.00 | 2.47 |
| 89 | 002045 | 国光电器 | 1,250,134.00 | 2.40 |
| 90 | 300595 | 欧普康视 | 1,229,941.00 | 2.36 |
| 91 | 600587 | 新华医疗 | 1,189,418.00 | 2.28 |
| 92 | 300648 | 星云股份 | 1,153,800.00 | 2.21 |
| 93 | 600129 | 太极集团 | 1,125,820.00 | 2.16 |
| 94 | 000969 | 安泰科技 | 1,114,160.00 | 2.14 |
| 95 | 300693 | 盛弘股份 | 1,111,272.00 | 2.13 |
| 96 | 688389 | 普门科技 | 1,095,231.06 | 2.10 |

注：本项的“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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600111 | 北方稀土 | 14,139,625.90 | 27.10          |
| 2  | 000963 | 华东医药 | 12,251,601.00 | 23.48          |
| 3  | 600763 | 通策医疗 | 10,691,995.24 | 20.49          |
| 4  | 603259 | 药明康德 | 9,888,488.00  | 18.95          |
| 5  | 600392 | 盛和资源 | 9,840,700.00  | 18.86          |
| 6  | 000661 | 长春高新 | 9,432,718.00  | 18.08          |
| 7  | 600276 | 恒瑞医药 | 8,471,100.00  | 16.24          |
| 8  | 688050 | 爱博医疗 | 8,302,266.59  | 15.91          |
| 9  | 300896 | 爱美客  | 8,294,717.60  | 15.90          |
| 10 | 688356 | 键凯科技 | 8,286,714.93  | 15.88          |
| 11 | 300759 | 康龙化成 | 7,941,668.00  | 15.22          |
| 12 | 300015 | 爱尔眼科 | 7,597,243.31  | 14.56          |
| 13 | 300390 | 天华超净 | 6,696,270.00  | 12.83          |
| 14 | 000422 | 湖北宜化 | 6,489,536.00  | 12.44          |
| 15 | 002821 | 凯莱英  | 5,948,455.00  | 11.40          |
| 16 | 600096 | 云天化  | 5,862,370.00  | 11.24          |
| 17 | 688202 | 美迪西  | 5,749,412.82  | 11.02          |
| 18 | 603456 | 九洲药业 | 5,694,573.77  | 10.91          |
| 19 | 300725 | 药石科技 | 5,603,782.90  | 10.74          |
| 20 | 688363 | 华熙生物 | 5,602,841.37  | 10.74          |
| 21 | 688366 | 昊海生科 | 5,487,996.47  | 10.52          |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 22 | 600141 | 兴发集团 | 5,013,541.00 | 9.61 |
| 23 | 603127 | 昭衍新药 | 4,749,946.00 | 9.10 |
| 24 | 000792 | 盐湖股份 | 4,112,822.00 | 7.88 |
| 25 | 600338 | 西藏珠峰 | 3,874,521.00 | 7.43 |
| 26 | 300347 | 泰格医药 | 3,748,272.00 | 7.18 |
| 27 | 600010 | 宝钢股份 | 3,392,400.00 | 6.50 |
| 28 | 300122 | 智飞生物 | 3,388,435.00 | 6.49 |
| 29 | 688617 | 惠泰医疗 | 3,270,223.13 | 6.27 |
| 30 | 000739 | 普洛药业 | 3,261,096.00 | 6.25 |
| 31 | 300497 | 富祥药业 | 3,219,587.00 | 6.17 |
| 32 | 300363 | 博腾股份 | 3,185,348.00 | 6.11 |
| 33 | 002539 | 云图控股 | 3,113,665.00 | 5.97 |
| 34 | 002612 | 朗姿股份 | 2,981,061.00 | 5.71 |
| 35 | 688185 | 康希诺  | 2,912,352.07 | 5.58 |
| 36 | 300748 | 金力永磁 | 2,807,585.00 | 5.38 |
| 37 | 002176 | 江特电机 | 2,798,197.00 | 5.36 |
| 38 | 000615 | 奥园美谷 | 2,648,392.00 | 5.08 |
| 39 | 688139 | 海尔生物 | 2,373,533.23 | 4.55 |
| 40 | 301089 | 拓新药业 | 2,356,564.66 | 4.52 |
| 41 | 688301 | 奕瑞科技 | 2,333,671.94 | 4.47 |
| 42 | 300224 | 正海磁材 | 2,324,799.00 | 4.46 |
| 43 | 688056 | 莱伯泰科 | 2,317,466.81 | 4.44 |
| 44 | 600519 | 贵州茅台 | 2,316,647.00 | 4.44 |
| 45 | 688016 | 心脉医疗 | 2,297,516.29 | 4.40 |
| 46 | 600259 | 广晟有色 | 2,051,878.00 | 3.93 |
| 47 | 002312 | 川发龙蟒 | 2,046,782.00 | 3.92 |
| 48 | 300358 | 楚天科技 | 2,043,021.00 | 3.92 |
| 49 | 000762 | 西藏矿业 | 2,016,771.00 | 3.87 |
| 50 | 688029 | 南微医学 | 1,986,278.19 | 3.81 |
| 51 | 301080 | 百普赛斯 | 1,870,158.00 | 3.58 |
| 52 | 300529 | 健帆生物 | 1,850,461.00 | 3.55 |
| 53 | 300653 | 正海生物 | 1,777,815.00 | 3.41 |
| 54 | 600673 | 东阳光  | 1,701,291.11 | 3.26 |
| 55 | 300573 | 兴齐眼药 | 1,683,282.00 | 3.23 |
| 56 | 688621 | 阳光诺和 | 1,652,933.59 | 3.17 |
| 57 | 000822 | 山东海化 | 1,648,427.00 | 3.16 |
| 58 | 000516 | 国际医学 | 1,639,410.00 | 3.14 |
| 59 | 688277 | 天智航  | 1,615,865.65 | 3.10 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 60 | 002597 | 金禾实业 | 1,575,765.00 | 3.02 |
| 61 | 688357 | 建龙微纳 | 1,568,714.71 | 3.01 |
| 62 | 000960 | 锡业股份 | 1,564,880.00 | 3.00 |
| 63 | 600773 | 西藏城投 | 1,559,670.00 | 2.99 |
| 64 | 002192 | 融捷股份 | 1,514,910.00 | 2.90 |
| 65 | 300149 | 睿智医药 | 1,493,185.00 | 2.86 |
| 66 | 300127 | 银河磁体 | 1,455,250.00 | 2.79 |
| 67 | 002466 | 天齐锂业 | 1,443,215.00 | 2.77 |
| 68 | 300285 | 国瓷材料 | 1,397,047.00 | 2.68 |
| 69 | 300171 | 东富龙  | 1,378,006.00 | 2.64 |
| 70 | 000568 | 泸州老窖 | 1,333,017.00 | 2.55 |
| 71 | 688076 | 诺泰生物 | 1,330,756.81 | 2.55 |
| 72 | 688690 | 纳微科技 | 1,330,136.35 | 2.55 |
| 73 | 603986 | 兆易创新 | 1,306,164.20 | 2.50 |
| 74 | 300412 | 迦南科技 | 1,292,596.00 | 2.48 |
| 75 | 300782 | 卓胜微  | 1,279,865.00 | 2.45 |
| 76 | 002004 | 华邦健康 | 1,256,831.74 | 2.41 |
| 77 | 300203 | 聚光科技 | 1,228,690.00 | 2.35 |
| 78 | 300693 | 盛弘股份 | 1,151,714.00 | 2.21 |
| 79 | 300648 | 星云股份 | 1,123,084.00 | 2.15 |
| 80 | 688166 | 博瑞医药 | 1,112,153.94 | 2.13 |
| 81 | 300685 | 艾德生物 | 1,078,362.00 | 2.07 |
| 82 | 002460 | 赣锋锂业 | 1,075,120.00 | 2.06 |

注：本项的“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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 | 371,652,636.41 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 314,813,905.07 |

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

### 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） | 60,599.34 | 0.12 |
| 8  | 同业存单      | -         | -    |
| 9  | 其他        | -         | -    |
| 10 | 合计        | 60,599.34 | 0.12 |

## 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  | 123135 | 泰林转债 | 606   | 60,599.34 | 0.12         |

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，届时将根据风险管理原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

## 8.11 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

在法律法规允许的范围内，本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，投资于国债期

货合约，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 8.11.3 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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   | —         |
| 2  | 应收证券清算款 | —         |
| 3  | 应收股利    | —         |
| 4  | 应收利息    | 416.74    |
| 5  | 应收申购款   | 84,082.00 |
| 6  | 其他应收款   | —         |
| 7  | 待摊费用    | —         |
| 8  | 其他      | —         |
| 9  | 合计      | 84,498.74 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 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<br>级别    | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的<br>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  |
| 同泰大健康主题混合 A | 1,274            | 14,716.88     | —     | 0.00%  | 18,749,309.59 | 100.00% |
| 同泰大健康主题混合 C | 8,240            | 5,425.97      | —     | 0.00%  | 44,710,008.50 | 100.00% |
| 合计          | 9,514            | 6,670.10      | —     | 0.00%  | 63,459,318.09 | 100.00% |

### 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 | 同泰大健康主题混合 A | 59,505.81 | 0.32%    |
|                  | 同泰大健康主题混合 C | 6,383.89  | 0.01%    |
|                  | 合计          | 65,889.70 | 0.10%    |

### 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的情况

| 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 同泰大健康主题混合 A | 0~10              |
|                                | 同泰大健康主题混合 C | 0~10              |
|                                | 合计          | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 同泰大健康主题混合 A | 0                 |

|  |                |   |
|--|----------------|---|
|  | 同泰大健康主题混合<br>C | 0 |
|  | 合计             | 0 |

#### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

本报告期无此情况。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 同泰大健康主题混<br>合 A | 同泰大健康主题混<br>合 C |
|----------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日（2021 年 4 月 8 日）基金<br>份额总额      | 33,270,650.61   | 189,949,928.82  |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申<br>购份额              | 14,466,380.52   | 61,572,044.92   |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总<br>赎回份额            | 28,987,721.54   | 206,811,965.24  |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分<br>变动份额（份额减少以“-”填列） | -               | -               |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 18,749,309.59   | 44,710,008.50   |

## § 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

基金管理人重大人事变动：

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

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，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

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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内合同生效，初次聘请上会会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务。报告期内应支付给该事务所的报酬为 30,000 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

本报告期内，基金管理人、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 |    |
| 华福证券 | 2      | 671,029,587.50 | 97.82%       | 486,266.56 | 97.86%     | -  |
| 万联证券 | 2      | 14,921,049.07  | 2.18%        | 10,616.10  | 2.14%      | -  |

注：1、本基金使用券商结算模式。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准主要包括：公司基本面评价（财务状况、资信状况、经营状况）；公司信息服务评价（全面

性、及时性和高效性）等方面。

### 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 |
| 华福证券 | -    | -            | 176,400,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 万联证券 | -    | -            | -              | -              | -    | -            |

### 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  | 同泰大健康主题混合型证券投资基金基金合同生效公告                 | 中国证监会指定的媒介 | 2021 年 4 月 9 日   |
| 2  | 同泰大健康主题混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2021 年 5 月 12 日  |
| 3  | 同泰大健康主题混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告          | 中国证监会指定的媒介 | 2021 年 7 月 21 日  |
| 4  | 同泰大健康主题混合型证券投资基金 2021 年中期报告              | 中国证监会指定的媒介 | 2021 年 8 月 27 日  |
| 5  | 同泰大健康主题混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告          | 中国证监会指定的媒介 | 2021 年 10 月 25 日 |
| 6  | 同泰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告    | 中国证监会指定的媒介 | 2021 年 4 月 21 日  |
| 7  | 同泰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告    | 中国证监会指定的媒介 | 2021 年 5 月 21 日  |
| 8  | 同泰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告    | 中国证监会指定的媒介 | 2021 年 7 月 19 日  |
| 9  | 同泰基金管理有限公司关于                             | 中国证监会指定的   | 2021 年 9 月 14 日  |

|    |                                              |            |                  |
|----|----------------------------------------------|------------|------------------|
|    | 旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告                      | 媒介         |                  |
| 10 | 同泰基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北交所上市股票的风险提示性公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2021 年 11 月 25 日 |
| 11 | 同泰基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告          | 中国证监会指定的媒介 | 2021 年 12 月 10 日 |
| 12 | 同泰基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告          | 中国证监会指定的媒介 | 2021 年 12 月 17 日 |

## § 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              | 20210408-20210512       | -    | 50,004,722.22 | 50,004,722.22 | 0.00       | 0.00% |
| 个人                                                                                                        | -              | -                       | -    | -             | -             | -          | -     |
| 产品特有风险                                                                                                    |                |                         |      |               |               |            |       |
| 本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动等风险。 |                |                         |      |               |               |            |       |

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、《同泰大健康主题混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《同泰大健康主题混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、报告期内同泰大健康主题混合型证券投资基金公告的各项原稿。

### 13.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的住所或办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可登录中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>) 或者基金管理人网站 ([www.tongtaiamc.com](http://www.tongtaiamc.com)) 查阅, 或在营业时间内至基金管理人住所免费查阅。

同泰基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日