

华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金
金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	44

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
§ 8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	45
§ 9 开放式基金份额变动.....	45
§ 10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§ 12 备查文件目录.....	48
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华富健康文娱灵活配置混合
基金主代码	001563
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 4 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	213,036,404.98 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入研究并积极投资于健康文娱主题相关的优质上市公司，精选个股，分享其发展和成长的机会，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济、证券市场以及健康文娱相关行业的发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

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	华富基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	满志弘
	联系电话	021-68886996
	电子邮箱	manzh@hffund.com
客户服务电话	400-700-8001	95528
传真	021-68887997	021-63602540
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	上海市中山东一路 12 号
办公地址	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码	200120	200126
法定代表人	赵万利	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路 18 号 陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-18,498,484.83
本期利润	-22,238,413.57
加权平均基金份额本期利润	-0.2370
本期加权平均净值利润率	-20.56%
本期基金份额净值增长率	-1.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	7,084,605.44
期末可供分配基金份额利润	0.0333
期末基金资产净值	220,121,010.42
期末基金份额净值	1.033
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	18.11%

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) 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，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

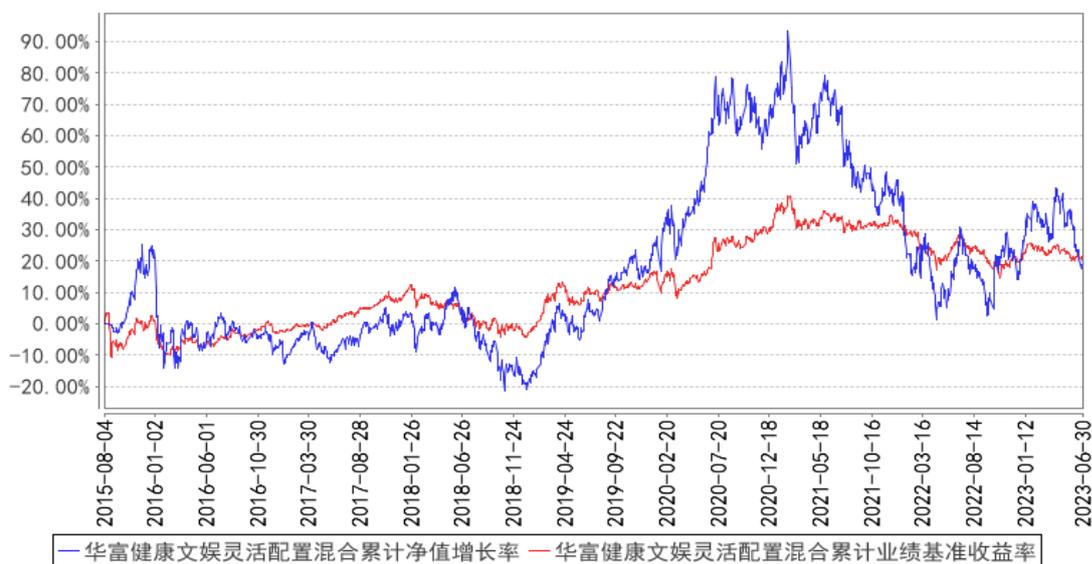
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-10.72%	1.17%	0.81%	0.43%	-11.53%	0.74%

过去三个月	-8.26%	1.54%	-1.87%	0.41%	-6.39%	1.13%
过去六个月	-1.53%	1.52%	0.79%	0.42%	-2.32%	1.10%
过去一年	-6.52%	1.71%	-5.44%	0.49%	-1.08%	1.22%
过去三年	-28.76%	1.73%	2.62%	0.60%	-	31.38%
自基金合同生效起至今	18.11%	1.58%	21.27%	0.65%	-3.16%	0.93%

注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

华富健康文娱灵活配置混合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：根据《华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票投资比例为基金资产的 0%-95%，投资于本基金合同界定的健康文娱主题相关证券不低于非现金基金资产的 80%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为 2015 年 8 月 4 日到 2016 年 2 月 4 日。建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富国潮优选混合型发起式证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定期开放债券型发起

式证券投资基金、华富安业一年持有期债券型证券投资基金、华富消费成长股票型证券投资基金、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富时代锐选混合型证券投资基金、华富匠心领航 18 个月持有期混合型证券投资基金、华富数字经济混合型证券投资基金共六十只基金。

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		
廖庆阳	本基金基金经理	2021 年 11 月 10 日	-	十一年	复旦大学金融学专业硕士，硕士研究生学历。曾任中泰证券股份有限公司投资顾问、海通证券股份有限公司分析师、天风证券股份有限公司高级分析师、凯盛融英（科技）股份有限公司医药行业负责人。2020 年 9 月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部基金经理助理、研究发展部总监助理，自 2021 年 11 月 10 日起任华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

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

回顾 2023 年上半年，医药板块整体呈现先扬后抑的格局。其中 4 月上旬随着第一次预期加息周期见顶叠加 ASCO 等会议积极数据催化，创新药板块累积了大量涨幅，但随后板块阶段性见顶，4 月中旬开始到 6 月下旬随着人民币对美元汇率进一步贬值、美联储加息周期预期延续以及创新药板块个股风险带来的负 beta 效应导致整个板块经历了接近 3 个月的深度回调；中药板块在一波政策集中释放以及对上半年业绩改善的充分预期后指数整体也在 5 月份见顶，后续中药集采的落地、去年下半年业绩的高基数影响等也致使中药板块经历了近 2 个月的回调；器械板块整体波澜不惊，个股有所分化，但仍然缺乏大的机会；CXO 板块在博弈中美关系后仍震荡向下，行业竞争加剧下游需求萎靡仍对板块整体估值有所压制，6 月以来板块逐步企稳；消费医疗持续回调，在 Q1 同比低基数高增长后逐步开始反应整体消费信心的疲软；仿制药板块估值较低整体表现较为坚挺但也有所分化，原料药板块底部震荡，药店板块在 4 月初的大幅下跌后跌幅趋缓慢。回顾本产品上半年交易情况，4 月中旬前本产品超配创新药，获得了较多的超额收益和绝对收益，4 月开始进一步加配中药板块，但从 4 月下旬开始，虽然本产品对于创新药个股风险有所规避，但忽略了行业整体阶段性受宏观预期波动以及行业阶段性负面事件影响带来的负板块效应，净值回撤较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，本基金份额净值为 1.033 元，累计基金份额净值为 1.193 元。报告期，本基金份额净值增长率为-1.53%，同期业绩比较基准收益率为 0.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入 2023 年下半年，7 月 21 日 10 部委会议联合进行的医疗反腐以及 7 月 28 日中纪委正式发文介入医疗反腐，标志着本轮医疗领域反腐正式进入深水区。我们认为本轮反腐虽然从短期来看将会对院内板块整体估值及部分院内企业阶段性业绩产生影响，并且也将对医疗行业的阶段性利益格局产生影响，7 月份以来，我们判断经过三个月的调整创新药板块已经见底，后续宏观以及行业因素支持板块有中期向上行情，因此重新加仓创新药板块，产品净值阶段性有一定表现，但随着医药反腐加速对行业情绪的影响，8 月以来净值亦有较大幅度调整。但从中长期维度来

看，我们认为本轮医疗反腐有利于医疗行业更健康和长远的发展，这体现在本轮反腐有望对疗效不够清晰临床利益品种进一步出清，而对真正有能力真正满足临床实际需求、不断解决临床痛点的产品和创新型公司来说将迎来更好的发展环境和机遇。因此，我们在下半年将择机进一步对创新型医疗企业进行加仓布局，着眼中线利益格局调整后创新产品类企业更为广阔的发展空间。

展望 2023 年三四季度，我们认为当前美联储年内加息两次预期已充分反应，医保续约谈判细则发布实质性利好创新药板块，我们认为 Q3 创新药板块有望在医疗反腐短期情绪影响见底后震荡向上，真正具有高临床价值的创新药产品将迎来新一轮投资机会；中药预计在充分调整后，部分去年未受益于疫情的个股有望在 Q3-Q4 迎来政策催化和估值切换行情，优先关注 OTC 板块投资机会；当前我们仍然关注底部细分方向和个股的边际变化节奏，当前时点中报有较好增长的方向我们认为股价几乎已充分反应，上市公司院内相关产品业绩存在阶段性下调可能，因此我们仍考虑尽量规避中报业绩反应较为充分、Q3Q4 环比改善不明显或边际有可能恶化且 2024 年可能持续承压的细分方向；而 Q4 至明年有望逐步边际改善，无论是业绩层面还是产品催化层面有积极变化的板块和个股，将是我们重点关注和配置的方向。

长期维度来看，我们仍然着重配置于以下方向：受益于国产替代、技术创新以及提升患者生存质量的创新药、创新医疗器械和设备；受益于消费升级的品质医疗服务和消费医疗；受益于工程师红利、承接全球需求的医药制造和研发服务；受益于政策支持和消费升级的传统中药和院内中药，以及受益于工程师红利、国产替代大潮的生命科学上游产业链；同时未来我们会继续跟踪新兴医疗技术、AI+医疗/新药研发、医疗大数据、细胞与基因治疗、合成生物学、脑机接口等技术进步孕育的新的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、督察长、副总经理、基金运营部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富健康文娱灵活配置混合型证券

投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为-22,238,413.57 元，期末可供分配利润为 7,084,605.44 元。本报告期内未进行利润分配，滚存至下一期进行分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

从 2017 年 12 月 07 日起至 2023 年 02 月 14 日，本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于 5000 万元的情形，从 2023 年 02 月 15 日至本报告期末（2023 年 06 月 30 日），本基金基金资产净值已不存在低于 5000 万元的情形。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	71,607,795.66	3,310,898.09

结算备付金		475,892.35	138,717.56
存出保证金		57,484.21	8,025.23
交易性金融资产	6.4.7.2	159,679,067.50	29,936,676.36
其中：股票投资		159,679,067.50	29,936,676.36
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		100,052.14	260,810.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		231,920,291.86	33,655,127.27
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		9,907,313.67	143,311.28
应付赎回款		920,004.67	358,852.91
应付管理人报酬		209,389.78	31,975.59
应付托管费		34,898.29	5,329.26
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		27.76	5.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	727,647.27	118,088.17
负债合计		11,799,281.44	657,562.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	213,036,404.98	31,451,010.80
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	7,084,605.44	1,546,554.11
净资产合计		220,121,010.42	32,997,564.91
负债和净资产总计		231,920,291.86	33,655,127.27

注： 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.033 元，基金份额总额 213,036,404.98 份。

6.2 利润表

会计主体：华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-21,289,268.65	-1,415,838.03
1. 利息收入		25,538.74	1,781.84
其中：存款利息收入	6.4.7.9	25,538.74	1,781.84
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-18,597,972.52	-2,263,213.50
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-19,575,441.15	-2,309,976.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	67,415.57	15,274.41
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	910,053.06	31,488.90
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-3,739,928.74	830,059.50
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,023,093.87	15,534.13
减：二、营业总支出		949,144.92	102,337.79
1. 管理人报酬		796,712.86	66,763.19
2. 托管费		132,785.51	11,127.21
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		2.44	-
8. 其他费用	6.4.7.19	19,644.11	24,447.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-22,238,413.57	-1,518,175.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-22,238,413.57	-1,518,175.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-22,238,413.57	-1,518,175.82

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	31,451,010.80	-	1,546,554.11	32,997,564.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	31,451,010.80	-	1,546,554.11	32,997,564.91
三、本期增减变动额（减少以“-”	181,585,394.18	-	5,538,051.33	187,123,445.51

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-22,238,413.57	-22,238,413.57
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	181,585,394.18	-	27,776,464.90	209,361,859.08
其中:				
1. 基金申购款	337,934,080.16	-	52,901,045.80	390,835,125.96
2. 基金赎回款	-156,348,685.98	-	-25,124,580.90	-181,473,266.88
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	213,036,404.98	-	7,084,605.44	220,121,010.42

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	8,376,343.57	-	2,305,261.46	10,681,605.03
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	8,376,343.57	-	2,305,261.46	10,681,605.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-121,506.06	-	-1,436,852.55	-1,558,358.61
（一）、综合收益总额	-	-	-1,518,175.82	-1,518,175.82
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-121,506.06	-	81,323.27	-40,182.79
其中： 1. 基金申购款	2,879,957.28	-	197,833.85	3,077,791.13

2 . 基金赎回款	-3,001,463.34	-	-116,510.58	-3,117,973.92
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	8,254,837.51	-	868,408.91	9,123,246.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵万里

曹华玮

邵恒

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（证监许可[2015]1288号）核准，基金合同于2015年08月04日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具《验资报告》（天健验（2015）6-132号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金

托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、资产支持证券、货币市场工具、中小企业私募债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规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净资产变动等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无重大变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无重大变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1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〔2012〕85号）、《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税〔2014〕81号）、《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税〔2016〕127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〔2015〕101号）、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36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〕46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〔2016〕140号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号）、《关于金融机

构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(一) 自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征税率缴纳增值税。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

(三) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(四) 对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利,H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册,H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利,由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(五) 主要税种及税率列示如下:

税种	计税依据	税率
增值税	以按税法规定计算的金融服务销售额	3%
城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加	实际缴纳的流转税税额	2%

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	71,607,795.66
等于: 本金	71,604,559.51
加: 应计利息	3,236.15
减: 坏账准备	-
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-

减：坏账准备	
其中：存款期限 1 个月以内	
存款期限 1-3 个月	
存款期限 3 个月以上	
其他存款	
等于：本金	
加：应计利息	
减：坏账准备	
合计	71,607,795.66

注：“其他存款”所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	163,076,899.66	-	159,679,067.50	-3,397,832.16
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	163,076,899.66	-	159,679,067.50	-3,397,832.16

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,299.43
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	711,471.45
其中：交易所市场	711,471.45
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	14,876.39
合计	727,647.27

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,451,010.80	31,451,010.80
本期申购	337,934,080.16	337,934,080.16
本期赎回（以“-”号填列）	-156,348,685.98	-156,348,685.98
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	213,036,404.98	213,036,404.98

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,957,133.25	-22,410,579.14	1,546,554.11
本期利润	-18,498,484.83	-3,739,928.74	-22,238,413.57
本期基金份额交易产生的变动数	132,943,892.31	-105,167,427.41	27,776,464.90
其中：基金申购款	250,445,690.37	-197,544,644.57	52,901,045.80
基金赎回款	-117,501,798.06	92,377,217.16	-25,124,580.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	138,402,540.73	-131,317,935.29	7,084,605.44

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

活期存款利息收入	21,340.57
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	3,958.50
其他	239.67
合计	25,538.74

注：“其他存款利息收入”所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-19,575,441.15
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	-19,575,441.15

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	417,396,722.27
减：卖出股票成本总额	435,561,850.75
减：交易费用	1,410,312.67
买卖股票差价收入	-19,575,441.15

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	674.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	66,741.28
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	67,415.57
----	-----------

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,605,881.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,528,674.49
减：应计利息总额	10,019.94
减：交易费用	445.89
买卖债券差价收入	66,741.28

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	910,053.06
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	910,053.06

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,739,928.74
股票投资	-3,739,928.74
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-3,739,928.74

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,015,316.00
基金转换费收入	7,777.87
合计	1,023,093.87

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-

证券出借违约金	-
银行费用	1,767.72
账户维护费	3,000.00
合计	19,644.11

6.4.7.20 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
华安证券	302,908,563.42	30.71	12,282,523.00	18.89

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华安证券	281,778.05	30.79	128,703.38	18.09
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华安证券	11,193.17	18.68	-	-

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	796,712.86	66,763.19
其中：支付销售机构的客户维护 费	212,226.61	26,743.40

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	132,785.51	11,127.21

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期和上年度可比期间基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	71,607,795.66	21,340.57	378,928.37	1,018.57

注：本表仅列示活期存款余额及产生的利息收入。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，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。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	71,607,795.66	-	-	-	-	-	71,607,795.66
结算备付金	475,892.35	-	-	-	-	-	475,892.35
存出保证金	57,484.21	-	-	-	-	-	57,484.21
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-159,679,067.50	159,679,067.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	100,052.14	100,052.14
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	72,141,172.22	-	-	-	-	-159,779,119.64	231,920,291.86
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	920,004.67	920,004.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	209,389.78	209,389.78
应付托管费	-	-	-	-	-	34,898.29	34,898.29
应付清算款	-	-	-	-	-	9,907,313.67	9,907,313.67
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	27.76	27.76
其他负债	-	-	-	-	-	727,647.27	727,647.27
负债总计	-	-	-	-	-	11,799,281.44	11,799,281.44
利率敏感度缺口	72,141,172.22	-	-	-	-	-147,979,838.20	220,121,010.42
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,310,898.09	-	-	-	-	-	3,310,898.09
结算备付金	138,717.56	-	-	-	-	-	138,717.56
存出保证金	8,025.23	-	-	-	-	-	8,025.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-	29,936,676.36	29,936,676.36
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	260,810.03	260,810.03
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,457,640.88	-	-	-	-	30,197,486.39	33,655,127.27
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	358,852.91	358,852.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	31,975.59	31,975.59
应付托管费	-	-	-	-	-	5,329.26	5,329.26
应付清算款	-	-	-	-	-	143,311.28	143,311.28
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	5.15	5.15
其他负债	-	-	-	-	-	118,088.17	118,088.17
负债总计	-	-	-	-	-	657,562.36	657,562.36
利率敏感度缺口	3,457,640.88	-	-	-	-	29,539,924.03	32,997,564.91

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 除利率外其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	市场利率上升 25 基点	-	-
	市场利率下降 25 基点	-	-

注：未持有债券类资产，因此若除利率外其他市场变量保持不变，则本基金资产净值不会发生重大变动。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	159,679,067.50	72.54	29,936,676.36	90.72
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	159,679,067.50	72.54	29,936,676.36	90.72

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末 (2023年6月30日)	上年度末 (2022年12月31日)	
分析	沪深 300 指数上升百分之五	3,597,801.27	1,065,566.34
	沪深 300 指数下降百分之五	-3,597,801.27	-1,065,566.34

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

1. 置信区间(95%)

假设	2. 观察期(1 年)		
	-		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	合计	32, 280, 732. 13	13, 352, 053. 60

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	159, 679, 067. 50	29, 936, 676. 36
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	159, 679, 067. 50	29, 936, 676. 36

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6. 4. 14. 3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6. 4. 14. 4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与

公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	159,679,067.50	68.85
	其中：股票	159,679,067.50	68.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	72,083,688.01	31.08
8	其他各项资产	157,536.35	0.07
9	合计	231,920,291.86	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	141,113,627.50	64.11
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	13,151,570.00	5.97
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,413,870.00	2.46
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	159,679,067.50	72.54

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688062	迈威生物	680,000	14,640,400.00	6.65
2	688197	首药控股	280,000	13,344,800.00	6.06
3	300573	兴齐眼药	60,000	12,828,000.00	5.83
4	605186	健麾信息	180,000	8,910,000.00	4.05
5	600572	康恩贝	1,200,000	8,220,000.00	3.73
6	688566	吉贝尔	168,000	6,553,680.00	2.98
7	002755	奥赛康	700,000	6,153,000.00	2.80
8	688177	百奥泰	220,000	5,876,200.00	2.67
9	003020	立方制药	155,000	5,736,550.00	2.61
10	688575	亚辉龙	300,000	5,535,000.00	2.51
11	300119	瑞普生物	300,000	5,340,000.00	2.43
12	688315	诺禾致源	200,000	5,310,000.00	2.41
13	688488	艾迪药业	420,000	5,174,400.00	2.35
14	688076	诺泰生物	140,000	4,981,200.00	2.26
15	002262	恩华药业	160,000	4,932,800.00	2.24
16	688336	三生国健	280,000	4,785,200.00	2.17
17	688117	圣诺生物	160,000	4,624,000.00	2.10
18	605266	健之佳	50,000	4,191,500.00	1.90
19	300181	佐力药业	300,000	3,663,000.00	1.66
20	002653	海思科	140,000	3,304,000.00	1.50
21	300705	九典制药	120,000	3,171,600.00	1.44
22	002727	一心堂	120,000	3,168,000.00	1.44
23	688351	微电生理	120,000	2,336,400.00	1.06
24	688617	惠泰医疗	5,990	2,238,762.50	1.02

25	603707	健友股份	150,000	2,025,000.00	0.92
26	300633	开立医疗	30,000	1,635,000.00	0.74
27	688578	艾力斯	60,000	1,617,000.00	0.73
28	688410	山外山	30,000	1,575,000.00	0.72
29	000423	东阿阿胶	20,000	1,069,000.00	0.49
30	600422	昆药集团	50,000	1,036,000.00	0.47
31	688016	心脉医疗	5,000	899,400.00	0.41
32	600329	达仁堂	20,000	897,800.00	0.41
33	688687	凯因科技	30,000	885,000.00	0.40
34	002294	信立泰	20,000	623,800.00	0.28
35	002020	京新药业	30,000	384,600.00	0.17
36	688091	上海谊众	5,000	368,150.00	0.17
37	688319	欧林生物	10,000	216,300.00	0.10
38	300639	凯普生物	20,000	200,400.00	0.09
39	688212	澳华内镜	2,000	135,800.00	0.06
40	002873	新天药业	10,000	135,200.00	0.06
41	600079	人福医药	5,000	134,700.00	0.06
42	605369	拱东医疗	2,000	112,080.00	0.05
43	300558	贝达药业	2,000	96,060.00	0.04
44	301257	普蕊斯	1,000	56,200.00	0.03
45	301015	百洋医药	2,000	55,520.00	0.03
46	688358	祥生医疗	1,000	51,000.00	0.02
47	688236	春立医疗	2,000	49,000.00	0.02
48	600276	恒瑞医药	1,000	47,900.00	0.02
49	688293	奥浦迈	1,000	47,670.00	0.02
50	688266	泽璟制药	1,000	46,550.00	0.02
51	600867	通化东宝	4,000	41,760.00	0.02
52	603087	甘李药业	1,000	38,500.00	0.02
53	603998	方盛制药	3,000	37,830.00	0.02
54	300841	康华生物	500	32,945.00	0.01
55	300723	一品红	1,000	29,300.00	0.01
56	688302	海创药业	500	26,560.00	0.01
57	300630	普利制药	1,000	19,550.00	0.01
58	000739	普洛药业	1,000	17,740.00	0.01
59	300026	红日药业	3,000	16,260.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688235	百济神州	16,888,847.01	51.18
2	688062	迈威生物	15,908,578.22	48.21
3	688076	诺泰生物	15,019,251.99	45.52

4	688197	首药控股	14,729,938.20	44.64
5	300759	康龙化成	13,215,396.54	40.05
6	688117	圣诺生物	13,018,864.51	39.45
7	688302	海创药业	11,944,674.65	36.20
8	300573	兴齐眼药	11,709,489.00	35.49
9	605186	健麾信息	11,632,969.00	35.25
10	603259	药明康德	10,853,458.56	32.89
11	002755	奥赛康	10,259,687.80	31.09
12	600422	昆药集团	9,542,213.00	28.92
13	688266	泽璟制药	9,404,973.52	28.50
14	688382	益方生物	9,134,834.90	27.68
15	600276	恒瑞医药	8,893,497.41	26.95
16	600572	康恩贝	8,182,559.00	24.80
17	688506	百利天恒	7,976,645.95	24.17
18	688073	毕得医药	7,771,632.40	23.55
19	688176	亚虹医药	7,572,581.33	22.95
20	600329	达仁堂	7,567,494.92	22.93
21	002821	凯莱英	7,462,323.62	22.61
22	000423	东阿阿胶	7,386,646.36	22.39
23	002262	恩华药业	7,122,085.32	21.58
24	003020	立方制药	7,086,516.52	21.48
25	688315	诺禾致源	7,043,382.21	21.35
26	000989	九芝堂	6,962,134.85	21.10
27	600750	江中药业	6,923,984.00	20.98
28	688566	吉贝尔	6,791,343.62	20.58
29	688687	凯因科技	6,666,424.87	20.20
30	688177	百奥泰	6,469,163.93	19.60
31	300181	佐力药业	6,303,021.00	19.10
32	688578	艾力斯	6,114,590.27	18.53
33	300558	贝达药业	6,016,621.00	18.23
34	688428	诺诚健华	5,884,354.65	17.83
35	688575	亚辉龙	5,764,370.02	17.47
36	688336	三生国健	5,763,309.91	17.47
37	688488	艾迪药业	5,756,343.33	17.44
38	688366	昊海生科	5,638,117.09	17.09
39	000028	国药一致	5,553,143.79	16.83
40	600129	太极集团	5,539,450.00	16.79
41	300119	瑞普生物	5,325,344.00	16.14
42	688321	微芯生物	4,718,730.69	14.30
43	002653	海思科	4,640,042.00	14.06
44	603896	寿仙谷	4,610,942.00	13.97
45	688576	西山科技	4,471,559.43	13.55
46	688222	成都先导	4,316,141.22	13.08

47	301333	诺思格	4,249,148.00	12.88
48	605266	健之佳	4,230,781.00	12.82
49	002332	仙琚制药	4,189,094.00	12.70
50	688410	山外山	3,986,054.39	12.08
51	002020	京新药业	3,895,018.00	11.80
52	002777	久远银海	3,825,630.00	11.59
53	002727	一心堂	3,801,770.63	11.52
54	002873	新天药业	3,665,408.28	11.11
55	603439	贵州三力	3,507,775.00	10.63
56	688091	上海谊众	3,459,978.22	10.49
57	301239	普瑞眼科	3,455,445.00	10.47
58	300357	我武生物	3,435,884.00	10.41
59	300705	九典制药	3,366,317.18	10.20
60	600535	天士力	3,087,712.00	9.36
61	688358	祥生医疗	3,079,282.21	9.33
62	688319	欧林生物	3,050,280.17	9.24
63	300049	福瑞股份	3,049,412.00	9.24
64	600557	康缘药业	2,975,378.00	9.02
65	300298	三诺生物	2,868,612.00	8.69
66	688617	惠泰医疗	2,843,840.59	8.62
67	688389	普门科技	2,667,628.84	8.08
68	301126	达嘉维康	2,661,040.00	8.06
69	301230	泓博医药	2,628,849.00	7.97
70	688246	嘉和美康	2,597,319.35	7.87
71	600267	海正药业	2,538,873.00	7.69
72	688351	微电生理	2,464,900.92	7.47
73	301015	百洋医药	2,405,471.00	7.29
74	002880	卫光生物	2,361,294.00	7.16
75	688331	荣昌生物	2,139,316.20	6.48
76	600976	健民集团	2,130,867.00	6.46
77	301103	何氏眼科	2,126,943.00	6.45
78	688338	赛科希德	2,100,430.37	6.37
79	688108	赛诺医疗	2,080,159.28	6.30
80	600511	国药股份	2,061,881.00	6.25
81	301293	三博脑科	2,054,504.45	6.23
82	603087	甘李药业	2,048,372.00	6.21
83	300878	维康药业	2,014,414.00	6.10
84	603707	健友股份	2,011,983.84	6.10
85	688581	安杰思	2,003,556.34	6.07
86	603567	珍宝岛	1,997,137.95	6.05
87	301257	普蕊斯	1,969,467.00	5.97
88	300841	康华生物	1,794,072.00	5.44
89	002644	佛慈制药	1,703,486.00	5.16

90	603368	柳药集团	1,698,832.00	5.15
91	300765	新诺威	1,667,425.80	5.05
92	300633	开立医疗	1,660,922.00	5.03
93	600211	西藏药业	1,631,972.00	4.95
94	603998	方盛制药	1,582,884.00	4.80
95	300158	振东制药	1,568,468.00	4.75
96	688383	新益昌	1,523,094.12	4.62
97	300347	泰格医药	1,521,678.75	4.61
98	301060	兰卫医学	1,417,078.00	4.29
99	603127	昭衍新药	1,369,362.80	4.15
100	301267	华夏眼科	1,360,378.00	4.12
101	600479	千金药业	1,359,772.00	4.12
102	300725	药石科技	1,317,000.00	3.99
103	688373	盟科药业	1,302,042.70	3.95
104	300396	迪瑞医疗	1,299,283.00	3.94
105	301097	天益医疗	1,275,983.00	3.87
106	600812	华北制药	1,247,632.00	3.78
107	688212	澳华内镜	1,192,998.90	3.62
108	603990	麦迪科技	1,180,786.00	3.58
109	688253	英诺特	1,152,881.03	3.49
110	600771	广誉远	1,132,500.00	3.43
111	688426	康为世纪	1,114,366.08	3.38
112	300255	常山药业	1,087,300.00	3.30
113	300451	创业慧康	1,070,954.00	3.25
114	600062	华润双鹤	1,037,821.90	3.15
115	301122	采纳股份	1,024,387.20	3.10
116	688236	春立医疗	1,019,238.52	3.09
117	300723	一品红	1,014,560.00	3.07
118	688639	华恒生物	1,004,661.33	3.04
119	002424	贵州百灵	993,223.00	3.01
120	603533	掌阅科技	986,000.00	2.99
121	000919	金陵药业	958,060.00	2.90
122	688013	天臣医疗	955,151.10	2.89
123	688016	心脉医疗	904,395.84	2.74
124	688278	特宝生物	881,352.11	2.67
125	002422	科伦药业	880,705.00	2.67
126	301363	美好医疗	877,593.60	2.66
127	688050	爱博医疗	867,838.00	2.63
128	688329	艾隆科技	847,517.74	2.57
129	688314	康拓医疗	832,534.36	2.52
130	600833	第一医药	799,550.00	2.42
131	000503	国新健康	761,117.00	2.31
132	300363	博腾股份	742,702.00	2.25

133	000950	重药控股	729,649.98	2.21
134	688621	阳光诺和	707,703.31	2.14
135	600587	新华医疗	665,084.00	2.02

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688235	百济神州	16,779,958.66	50.85
2	300759	康龙化成	14,145,546.62	42.87
3	688302	海创药业	11,679,212.47	35.39
4	688076	诺泰生物	10,388,590.35	31.48
5	603259	药明康德	10,083,056.46	30.56
6	688266	泽璟制药	8,769,955.92	26.58
7	688117	圣诺生物	8,716,535.62	26.42
8	600276	恒瑞医药	8,394,817.40	25.44
9	688382	益方生物	7,815,111.18	23.68
10	600422	昆药集团	7,667,425.80	23.24
11	688506	百利天恒	7,373,307.46	22.35
12	688176	亚虹医药	7,221,091.48	21.88
13	688073	毕得医药	7,111,675.65	21.55
14	002821	凯莱英	7,100,227.00	21.52
15	600329	达仁堂	7,042,522.00	21.34
16	688428	诺诚健华	6,820,570.87	20.67
17	600129	太极集团	6,553,366.00	19.86
18	600750	江中药业	6,410,752.00	19.43
19	000989	九芝堂	6,113,080.00	18.53
20	000423	东阿阿胶	5,924,738.00	17.96
21	300558	贝达药业	5,898,849.24	17.88
22	688366	昊海生科	5,794,834.50	17.56
23	000028	国药一致	5,460,515.00	16.55
24	688687	凯因科技	5,059,541.04	15.33
25	603896	寿仙谷	4,532,242.00	13.74
26	688358	祥生医疗	4,464,673.27	13.53
27	688321	微芯生物	4,403,449.11	13.34
28	688578	艾力斯	4,397,409.01	13.33
29	002332	仙琚制药	4,183,959.00	12.68
30	688222	成都先导	4,108,176.18	12.45
31	688576	西山科技	4,091,370.16	12.40
32	301333	诺思格	4,049,163.00	12.27
33	605186	健麾信息	3,920,459.22	11.88

34	301239	普瑞眼科	3,914,401.00	11.86
35	603439	贵州三力	3,776,645.00	11.45
36	002777	久远银海	3,425,474.00	10.38
37	002873	新天药业	3,344,579.80	10.14
38	688091	上海谊众	3,338,889.11	10.12
39	600557	康缘药业	3,331,313.00	10.10
40	300357	我武生物	3,304,437.00	10.01
41	688331	荣昌生物	3,300,495.79	10.00
42	600535	天士力	3,121,206.00	9.46
43	002020	京新药业	3,100,857.35	9.40
44	300049	福瑞股份	2,873,481.00	8.71
45	300298	三诺生物	2,797,262.00	8.48
46	688212	澳华内镜	2,733,803.33	8.28
47	301103	何氏眼科	2,717,224.86	8.23
48	002755	奥赛康	2,648,169.00	8.03
49	688389	普门科技	2,626,512.79	7.96
50	600267	海正药业	2,592,387.00	7.86
51	301230	泓博医药	2,582,476.64	7.83
52	688319	欧林生物	2,568,130.86	7.78
53	301126	达嘉维康	2,504,510.00	7.59
54	300396	迪瑞医疗	2,448,165.00	7.42
55	688246	嘉和美康	2,442,004.56	7.40
56	002880	卫光生物	2,407,713.00	7.30
57	002262	恩华药业	2,359,523.00	7.15
58	300181	佐力药业	2,342,714.00	7.10
59	301015	百洋医药	2,290,775.00	6.94
60	688410	山外山	2,247,588.65	6.81
61	688108	赛诺医疗	2,234,542.89	6.77
62	301267	华夏眼科	2,122,064.00	6.43
63	300725	药石科技	2,110,321.00	6.40
64	688338	赛科希德	2,110,265.77	6.40
65	300878	维康药业	2,049,541.00	6.21
66	600976	健民集团	2,040,000.00	6.18
67	603567	珍宝岛	1,972,840.00	5.98
68	600511	国药股份	1,956,666.00	5.93
69	301257	普蕊斯	1,909,949.00	5.79
70	688581	安杰思	1,899,788.30	5.76
71	688373	盟科药业	1,887,770.04	5.72
72	603087	甘李药业	1,868,524.80	5.66
73	300723	一品红	1,829,086.00	5.54
74	688315	诺禾致源	1,763,219.73	5.34
75	301122	采纳股份	1,713,203.40	5.19
76	301293	三博脑科	1,712,151.50	5.19

77	600211	西藏药业	1,682,595.00	5.10
78	300841	康华生物	1,633,639.00	4.95
79	603368	柳药集团	1,625,588.00	4.93
80	603998	方盛制药	1,533,146.00	4.65
81	300347	泰格医药	1,527,887.00	4.63
82	002644	佛慈制药	1,520,069.00	4.61
83	688351	微电生理	1,516,928.82	4.60
84	300765	新诺威	1,506,117.00	4.56
85	300158	振东制药	1,471,000.00	4.46
86	301060	兰卫医学	1,429,088.60	4.33
87	688329	艾隆科技	1,397,549.45	4.24
88	603127	昭衍新药	1,355,962.00	4.11
89	688383	新益昌	1,337,748.10	4.05
90	688393	安必平	1,322,194.76	4.01
91	603676	卫信康	1,300,757.00	3.94
92	600479	千金药业	1,276,408.00	3.87
93	600812	华北制药	1,180,800.00	3.58
94	002653	海思科	1,176,556.00	3.57
95	603990	麦迪科技	1,165,535.50	3.53
96	600771	广誉远	1,143,611.00	3.47
97	301097	天益医疗	1,115,141.00	3.38
98	600587	新华医疗	1,106,571.00	3.35
99	688253	英诺特	1,076,282.73	3.26
100	002727	一心堂	1,072,926.00	3.25
101	300451	创业慧康	1,071,727.00	3.25
102	603533	掌阅科技	1,069,500.00	3.24
103	688062	迈威生物	1,039,548.63	3.15
104	300633	开立医疗	1,028,853.00	3.12
105	300255	常山药业	1,016,000.00	3.08
106	003020	立方制药	1,002,293.20	3.04
107	600062	华润双鹤	973,765.60	2.95
108	688197	首药控股	973,570.18	2.95
109	000919	金陵药业	972,700.00	2.95
110	688192	迪哲医药	941,131.97	2.85
111	688013	天臣医疗	934,525.11	2.83
112	688426	康为世纪	921,558.84	2.79
113	002424	贵州百灵	902,076.00	2.73
114	688278	特宝生物	887,240.00	2.69
115	688639	华恒生物	881,158.53	2.67
116	301363	美好医疗	879,281.64	2.66
117	688236	春立医疗	859,851.24	2.61
118	002422	科伦药业	809,800.00	2.45
119	600833	第一医药	806,082.00	2.44

120	688050	爱博医疗	797,936.91	2.42
121	000950	重药控股	756,520.00	2.29
122	300363	博腾股份	735,913.00	2.23
123	688314	康拓医疗	726,911.60	2.20
124	688273	麦澜德	722,995.14	2.19
125	300957	贝泰妮	720,532.00	2.18
126	688621	阳光诺和	713,497.07	2.16
127	688617	惠泰医疗	711,600.00	2.16
128	000503	国新健康	711,100.00	2.16
129	603309	维力医疗	684,819.00	2.08

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	569,044,170.63
卖出股票收入（成交）总额	417,396,722.27

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末无债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，百奥泰生物制药股份有限公司、北京奥赛康药业股份有限公司曾出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	57,484.21
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	100,052.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	157,536.35

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
13,912	15,313.14	153,178,693.28	71.90	59,857,711.70	28.10

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	60,857.55	0.0286

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015 年 8 月 4 日) 基金份额总额	276,009,114.26
本报告期期初基金份额总额	31,451,010.80
本报告期基金总申购份额	337,934,080.16
减：本报告期基金总赎回份额	156,348,685.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	213,036,404.98

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 本基金本报告期内基金管理人无重大人事变动。
2. 本基金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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，管理人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
首创证券	1	372,994,230.57	37.81	347,373.99	37.95	-
浙商证券	1	308,673,801.41	31.29	284,379.87	31.07	-
华安证券	2	302,908,563.42	30.71	281,778.05	30.79	-
海通证券	1	1,864,297.50	0.19	1,736.19	0.19	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1)根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的券商租用了基金专用交易单元。

2) 此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

3) 本报告期本基金交易单元没有发生变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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(%)
首创证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	11,144,881.57	100.00	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 1 月 20 日
2	华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金 2022 年度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
3	华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅, 相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日