# 新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金
# 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:新疆前海联合基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2023 年 08 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月25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6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 ..... 6
2.4 信息披露方式 ..... 6
2.5 其他相关资料 ..... 6
**§3 主要财务指标和基金净值表现 ..... 6**
3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 6
3.2 基金净值表现 ..... 7
3.3 其他指标 ..... 9
**§4 管理人报告 ..... 9**
4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 10
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 ..... 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 ..... 12
**§5 托管人报告 ..... 13**
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 13
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 ..... 13
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 ..... 13
**§6 半年度财务会计报告(未经审计) ..... 13**
6.1 资产负债表 ..... 13
6.2 利润表 ..... 15
6.3 净资产（基金净值）变动表 ..... 16
6.4 报表附注 ..... 17
**§7 投资组合报告 ..... 41**
7.1 期末基金资产组合情况 ..... 41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 42
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 ..... 43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 46
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 ..... 47
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 ..... 47
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 ..... 47
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 ..... 47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 47

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 47
7.12 投资组合报告附注 47
**§8 基金份额持有人信息 48**
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 49
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 49
**§9 开放式基金份额变动 49**
**§10 重大事件揭示 49**
10.1 基金份额持有人大会决议 49
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 50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 50
10.4 基金投资策略的改变 50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 50
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 50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 50
10.8 其他重大事件 52
**§11 影响投资者决策的其他重要信息 52**
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 52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 52
**§12 备查文件目录 52**
12.1 备查文件目录 53
12.2 存放地点 53
12.3 查阅方式 53

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 前海联合国民健康混合 | |
| 基金主代码 | 003581 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 12 月 29 日 | |
| 基金管理人 | 新疆前海联合基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 105,761,783.26 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 前海联合国民健康混合 A | 前海联合国民健康混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003581 | 007111 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 92,907,391.12 份 | 12,854,392.14 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金主要投资于医疗健康行业证券，通过深入分析医疗健康行业的成长驱动力，把握以创新为主的核心竞争力，在合理控制风险的前提下，力争实现超越业绩基准的超额收益。 |
| 投资策略 | 当前医药行业政策频出，但医药产业发展的路径已经日渐清晰。随着支付能力的提升以及保险来源的多样化，患者的真实需求越来越多地影响着产业变革，这也对产业的创新提出了更高的要求，无论是产品端还是服务端，满足患者需求的创新是核心竞争力。在医保控费的大背景下，考虑目前医保资金压力不可逆转，医药正在进行结构优化，但各项政策的支持和变化都有利于实力强的龙头企业，创新药、医疗服务、疫苗等龙头公司基本面持续向好。本基金投资策略以配置优质医药龙头为主，考虑到政策不确定性的存在，同时在新政策下，行业的发展环境并未明显改善，我们在配置上偏重创新药，生物药等受政策影响较小的子行业，注重布局具备核心竞争力、业绩具有稳定性的行业龙头公司，买入持有，以期获取长期投资回报。 |
| 业绩比较基准 | 中证医药卫生指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 |

## 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 | | 新疆前海联合基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 邹文庆（代履职） | 郭明 |
| | 联系电话 | 0755-82780666 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | service@qhlhfund.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-640-0099 | 95588 |
| 传真 | | 0755-82780000 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 新疆乌鲁木齐经济技术开发区维泰南路 1 号维泰大厦 1506 室 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | | 深圳市南山区桂湾四路 197 号前海华润金融中心 T1 栋第 28 和 29 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 518057 | 100140 |
| 法定代表人 | | 邹文庆（代履职） | 陈四清 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.qhlhfund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人、托管人的办公地址 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 新疆前海联合基金管理有限公司 | 深圳市南山区桂湾四路 197 号前海华润金融中心 T1 栋第 28 和 29 层 |

# §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 01 月 01 日-2023 年 06 月 30 日） | |
|---|---|---|
| | 前海联合国民健康混合 A | 前海联合国民健康混合 C |
| 本期已实现收益 | -16,519,737.48 | -2,290,520.84 |
| 本期利润 | -15,789,786.68 | -2,018,746.51 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1386 | -0.1630 |

| | | |
|---|---|---|
| 本期加权平均净值利润率 | -9.04% | -10.96% |
| 本期基金份额净值增长率 | -11.37% | -11.54% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | 报告期末（2023年06月30日） | |
| 期末可供分配利润 | 21,041,772.85 | 2,863,592.92 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2265 | 0.2228 |
| 期末基金资产净值 | 126,655,313.20 | 17,149,202.26 |
| 期末基金份额净值 | 1.3632 | 1.3341 |
| **3.1.3 累计期末指标** | 报告期末（2023年06月30日） | |
| 基金份额累计净值增长率 | 42.99% | 42.93% |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或者交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的"期末"均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

## 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

**前海联合国民健康混合A净值表现**

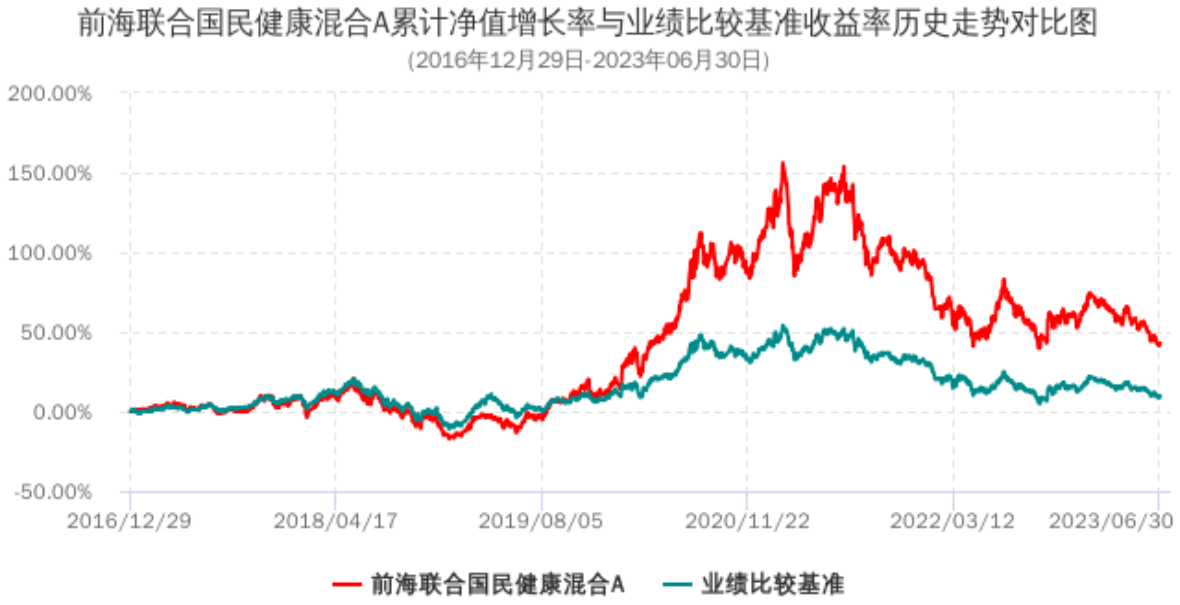
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -4.94% | 0.83% | -2.34% | 0.58% | -2.60% | 0.25% |
| 过去三个月 | -8.60% | 1.03% | -4.97% | 0.62% | -3.63% | 0.41% |
| 过去六个月 | -11.37% | 1.04% | -4.64% | 0.64% | -6.73% | 0.40% |
| 过去一年 | -18.85% | 1.38% | -10.01% | 0.86% | -8.84% | 0.52% |
| 过去三年 | -18.89% | 1.73% | -17.93% | 1.01% | -0.96% | 0.72% |
| 自基金合同生效起至今 | 42.99% | 1.50% | 9.76% | 0.92% | 33.23% | 0.58% |

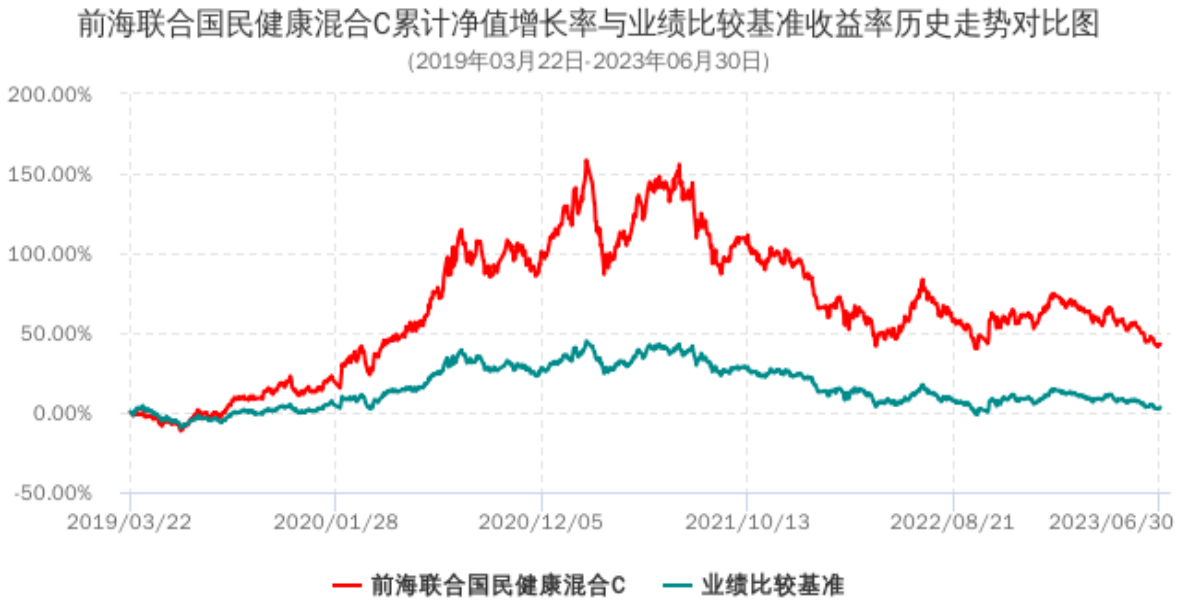
**前海联合国民健康混合C净值表现**

| 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 | -4.97% | 0.83% | -2.34% | 0.58% | -2.63% | 0.25% |
| 过去三个月 | -8.69% | 1.03% | -4.97% | 0.62% | -3.72% | 0.41% |
| 过去六个月 | -11.54% | 1.04% | -4.64% | 0.64% | -6.90% | 0.40% |
| 过去一年 | -19.13% | 1.38% | -10.01% | 0.86% | -9.12% | 0.52% |
| 过去三年 | -19.91% | 1.73% | -17.93% | 1.01% | -1.98% | 0.72% |
| 自基金合同生效起至今 | 42.93% | 1.65% | 3.17% | 0.97% | 39.76% | 0.68% |

注：1、本基金业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%。
2、本基金自 2019 年 3 月 22 日起，增加 C 类基金份额并设置对应基金代码。

### 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




注：本基金自 2019 年 3 月 22 日起，增加 C 类基金份额并设置对应基金代码。前海联合国民健康混合 C 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起始日为 2019 年 3 月 22 日。

## 3.3 其他指标

无。

# §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

新疆前海联合基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监许可【2015】1842 号文批准，于 2015 年 8 月 7 日成立。公司注册资本 2 亿元人民币，股东结构为：深圳市钜盛华股份有限公司（30%）、深圳粤商物流有限公司（25%）、深圳市深粤控股股份有限公司（25%）、凯信恒有限公司（20%）。本公司总部位于广东省深圳市，已设立上海分公司、北京分公司、深圳分公司。本公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，本公司旗下共管理 28 只开放式基金，包括 2 只货币市场基金、12 只债券型基金、13 只混合型基金和 1 只基金中基金（FOF），另管理 2 只专户理财产品，管理资产总规模超过 146 亿元人民币。

### 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 | | |
| 林材 | 本基金的基金经理 | 2016-12-29 | - | 15 年 | 林材先生，硕士，15 年证券基金投资研究经验。曾任上海医药工业研究院医药行业研究员、德邦证券医药行业研究员、民生加银基金管理有限公司研究员、金元顺安基金管理有限公司基金经理、新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2016 年 11 月 11 日至 2020 年 7 月 6 日）、新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金基金经理（自 2016 年 11 月 17 日至 2021 年 5 月 6 日）、新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金基 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 金经理（自 2016 年 11 月 30 日至 2019 年 9 月 17 日）、新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金经理（自 2016 年 11 月 30 日至 2020 年 7 月 6 日）、新疆前海联合研究优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2018 年 7 月 25 日至 2019 年 9 月 26 日）、新疆前海联合泳隆灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2020 年 2 月 18 日至 2021 年 3 月 4 日）、新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金基金经理（自 2020 年 2 月 18 日至 2021 年 7 月 16 日）和新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金基金经理（自 2021 年 4 月 20 日至 2022 年 8 月 4 日）。现任新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2016 年 12 月 29 日起任职）和新疆前海联合产业趋势混合型证券投资基金基金经理（自 2021 年 8 月 17 日起任职）。 |

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”根据公司对外公告的解聘日期填写；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别根据公司对外公告的聘任日期和解聘日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 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

无。

### 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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善了相应的制度和流程，通过系统和人工等各种方式在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个业务环节保证公平交易制度的严格执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，保护投资者合法权益。

本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占优比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现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%的情况。

## 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

2023年 上半年A股市场依然体现为结构行情，科技股表现较好，其它多数行业机会不大，我们在配置上更加注重以业绩增速确定性较高的医疗健康行业个股为核心持仓。

2023年上半年乌克兰危机、美联储快速加息等因素，致使全球经济增速预期下修。国内4月和5月制造业景气度下滑幅度较大，6月份则显现了供需两端回落幅度趋缓的信号，经济复苏势头出现边际向好的迹象，而在央行6月份调降LPR报价、推动贷款利率平稳回落的加持下，改善的信号或在三季度末逐步显现。政策更关注通胀与就业压力，强调支持中小微，稳定就业，目前流动性已十分充裕，后续重心更多在于疏通信用扩张机制、宽信用。

在投资策略方面，我们保持适当的谨慎，坚持自下而上精选优质个股，关注创新周期带来的优质龙头公司估值提升，如生物医药、创新药、医疗服务等，看好优质医药股的长期投资价值。坚持从公司的基本面、估值出发，重点选取基本面坚实、具备核心竞争力、资产负债表健康、业绩具有稳定性的行业龙头公司，买入持有，以获取长期的投资回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合国民健康混合A基金份额净值为1.3632元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.37%，同期业绩比较基准收益率为-4.64%；截至报告期末前海联合国民健康混合C基金份额净值为1.3341元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.54%，同期业绩比较基准收益率为-4.64%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，俄乌战争仍未结束，市场对于未来美国经济下行的担忧依然存在，欧元区经济受到能源价格上涨的影响，延缓经济复苏势头。在此背景下，外需回落将对新兴经济体造成冲击，“内循环”对于新兴经济体的重要性将更加凸显。

国内经济 2023 年二季度走弱超出市场预期，引发了市场对经济前景甚至长期预期的巨大担忧。虽然目前市场情绪十分悲观，但一些经济数据却有触底迹象。6 月以来大宗商品价格出现了明显反弹，PPI 可能已经触底，PPI 触底回升将推动名义经济增速上行。工业企业利润降幅逐步收窄，企业的盈利状况在改善。6 月制造业 PMI 小幅反弹，预示经济下行最快的阶段可能已经过去。

我们认为下半年股市结构性机会仍存，重点关注中特估、高科技等明显受益政策支持的方向。从中长期维度来看，基本面才是定价的核心，预计未来仍将以业绩为主线，企业基本面和盈利增长将成为影响股价的关键因素。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人的基金估值由基金会计负责，基金会计以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管人双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管人进行核对；每日估值结果必须与托管人核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。配备的基金会计具备基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了较为丰富的知识和经验,熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策的估值小组，由运营分管高管、投研分管高管、基金运营部负责人、研究发展部负责人、信用研究部负责人、监察稽核部负责人、风险管理部负责人及其他指定人员组成，分别具有投资研究、风险管理、估值核算等方面的专业经验。基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。

本报告期内，参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

## 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

无。

# §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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，本基金的管理人——新疆前海联合基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对新疆前海联合基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# §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：新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2023 年 06 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 12,535,786.20 | 15,411,116.95 |
| 结算备付金 | | 23,364.77 | - |
| 存出保证金 | | 55,522.57 | 29,811.94 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 131,607,618.30 | 232,543,239.74 |
| 其中：股票投资 | | 131,607,618.30 | 232,543,239.74 |
| 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 | - | - |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | 3,084,456.43 | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 47,267.41 | 11,475.38 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 147,354,015.68 | 247,995,644.01 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末 2023 年 06 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 | | 3,086,736.31 | - |
| 应付赎回款 | | 59,236.65 | 213,824.86 |
| 应付管理人报酬 | | 180,729.42 | 311,334.38 |
| 应付托管费 | | 30,121.59 | 51,889.05 |
| 应付销售服务费 | | 5,725.95 | 7,327.68 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 186,950.30 | 256,195.45 |
| 负债合计 | | 3,549,500.22 | 840,571.42 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 105,761,783.26 | 160,956,636.49 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 38,042,732.20 | 86,198,436.10 |
| 净资产合计 | | 143,804,515.46 | 247,155,072.59 |
| 负债和净资产总计 | | 147,354,015.68 | 247,995,644.01 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 105,761,783.26 份。其中前海联合国民健康混合 A 基金份额净值 1.3632 元，基金份额总额 92,907,391.12 份；前海联合国民健康混合 C 基金份额净值 1.3341 元，基金份额总额 12,854,392.14 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | -15,994,945.39 | -30,292,587.09 |
| 1.利息收入 | | 34,246.43 | 39,492.80 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 34,246.43 | 39,492.80 |
| 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） | | -17,109,906.14 | -10,331,811.03 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -17,828,539.96 | -11,472,863.28 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 718,633.82 | 1,141,052.25 |
| 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 | 1,001,725.13 | -20,065,344.57 |
| 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 | 78,989.19 | 65,075.71 |
| **减：二、营业总支出** | | 1,813,587.80 | 2,394,479.57 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,447,221.03 | 1,927,085.40 |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 241,203.50 | 321,180.93 |
| 3.销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 36,636.11 | 57,700.08 |
| 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 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7.税金及附加 | | - | - |
| 8.其他费用 | 6.4.7.19 | 88,527.16 | 88,513.16 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | -17,808,533.19 | -32,687,066.66 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | -17,808,533.19 | -32,687,066.66 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | -17,808,533.19 | -32,687,066.66 |

## 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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） | 160,956,636.49 | - | 86,198,436.10 | 247,155,072.59 |
| 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） | 160,956,636.49 | - | 86,198,436.10 | 247,155,072.59 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -55,194,853.23 | - | -48,155,703.90 | -103,350,557.13 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -17,808,533.19 | -17,808,533.19 |
| （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） | -55,194,853.23 | - | -30,347,170.71 | -85,542,023.94 |
| 其中：1.基金申购款 | 7,567,834.84 | - | 3,807,605.26 | 11,375,440.10 |
| 2.基金赎回款 | -62,762,688.07 | - | -34,154,775.97 | -96,917,464.04 |
| （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） | 105,761,783.26 | - | 38,042,732.20 | 143,804,515.46 |
| **项 目** | **上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 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 | 163,936,695.96 | - | 155,054,847.35 | 318,991,543.31 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 净值） | | | | |
| 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） | 163,936,695.96 | - | 155,054,847.35 | 318,991,543.31 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -9,119,952.20 | - | -37,541,061.43 | -46,661,013.63 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -32,687,066.66 | -32,687,066.66 |
| （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） | -9,119,952.20 | - | -4,853,994.77 | -13,973,946.97 |
| 其中：1.基金申购款 | 14,543,085.54 | - | 9,310,173.58 | 23,853,259.12 |
| 2.基金赎回款 | -23,663,037.74 | - | -14,164,168.35 | -37,827,206.09 |
| （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） | 154,816,743.76 | - | 117,513,785.92 | 272,330,529.68 |

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:

| 邹文庆 | 党刚 | 陈艳 |
|---|---|---|
| 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

新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]19号《关于准予新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》进行募集，由新疆前海联合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币209,388,372.38元，经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1705号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为209,400,994.15份基金份额，其中认购资金利息折合12,621.77份基金份额。本基金的基金管

理人为新疆前海联合基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《关于新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同的公告》和《新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，自 2019 年 3 月 22 日起，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费并根据持有期限收取赎回费，但不收取销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人申购时不收取申购费，但收取销售服务费并根据持有期限收取赎回费，称为 C 类基金份额。本基金增加 C 类基金份额后，分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。原有的基金份额在增加收取销售服务费的 C 类基金份额后，全部自动转换为本基金 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括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上市的股票、存托凭证)、债券(包括中小企业私募债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的投资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、存出保证金和应收申购款等。本基金以医疗健康行业的上市公司股票为主要投资对象，投资于医疗健康行业上市公司证券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。本基金的业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率 X60%+中债综合指数收益率 X40%。

本财务报表由本基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司于 2023 年 8 月 28 日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 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

基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。

(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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适

用比例计算缴纳。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 12,535,786.20 |
| 等于：本金 | 12,534,744.22 |
| 加：应计利息 | 1,041.98 |
| 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 | 12,535,786.20 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2023 年 06 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 151,593,848.26 | - | 131,607,618.30 | -19,986,229.96 |
| 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 | | 151,593,848.26 | - | 131,607,618.30 | -19,986,229.96 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

### 6.4.7.5 其他资产

无余额。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末2023年06月30日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 23.80 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 101,083.34 |
| 其中：交易所市场 | 101,083.34 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 85,843.16 |
| 合计 | 186,950.30 |

### 6.4.7.7 实收基金

**前海联合国民健康混合A**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期2023年01月01日至2023年06月30日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 147,020,323.41 | 147,020,323.41 |
| 本期申购 | 3,307,377.20 | 3,307,377.20 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -57,420,309.49 | -57,420,309.49 |
| 本期末 | 92,907,391.12 | 92,907,391.12 |

**前海联合国民健康混合C**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期2023年01月01日至2023年06月30日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 13,936,313.08 | 13,936,313.08 |
| 本期申购 | 4,260,457.64 | 4,260,457.64 |

| | | |
|---|---|---|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5,342,378.58 | -5,342,378.58 |
| 本期末 | 12,854,392.14 | 12,854,392.14 |

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

### 6.4.7.8 未分配利润

**前海联合国民健康混合A**

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 | 59,607,908.74 | 19,507,524.25 | 79,115,432.99 |
| 本期利润 | -16,519,737.48 | 729,950.80 | -15,789,786.68 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -22,046,398.41 | -7,531,325.82 | -29,577,724.23 |
| 其中：基金申购款 | 1,243,317.05 | 491,816.37 | 1,735,133.42 |
| 基金赎回款 | -23,289,715.46 | -8,023,142.19 | -31,312,857.65 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 21,041,772.85 | 12,706,149.23 | 33,747,922.08 |

**前海联合国民健康混合C**

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 | 5,587,361.81 | 1,495,641.30 | 7,083,003.11 |
| 本期利润 | -2,290,520.84 | 271,774.33 | -2,018,746.51 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -433,248.05 | -336,198.43 | -769,446.48 |
| 其中：基金申购款 | 1,574,987.34 | 497,484.50 | 2,072,471.84 |
| 基金赎回款 | -2,008,235.39 | -833,682.93 | -2,841,918.32 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,863,592.92 | 1,431,217.20 | 4,294,810.12 |

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期2023年01月01日至2023年06月30日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 32,583.86 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 1,246.59 |
| 其他 | 415.98 |
| 合计 | 34,246.43 |

### 6.4.7.10 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01月01日至2023年06月30日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 208,295,173.50 |

| | |
|---|---|
| 减：卖出股票成本总额 | 225,610,597.25 |
| 减：交易费用 | 513,116.21 |
| 买卖股票差价收入 | -17,828,539.96 |

**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**

无。

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

无。

**6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入**

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**

无。

**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**

无。

**6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

**6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**6.4.7.13.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入**

无。

**6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**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**

无。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 718,633.82 |
| 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 | 718,633.82 |

**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 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 1,001,725.13 |
| ——股票投资 | 1,001,725.13 |
| ——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 | 1,001,725.13 |

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期2023年01月01日至2023年06月30日 |
| --- | --- |
| 基金赎回费收入 | 78,989.19 |
| 合计 | 78,989.19 |

**6.4.7.18 信用减值损失**

无。

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期2023年01月01日至2023年06月30日 |
| --- | --- |
| 审计费用 | 19,835.79 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 其他费用 | 184.00 |
| 账户维护费 | 9,000.00 |
| 合计 | 88,527.16 |

**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**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报告批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

**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未发生变化。

**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 |
| --- | --- |
| 新疆前海联合基金管理有限公司 | 基金管理人、登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.10.1.1 股票交易**

无。

**6.4.10.1.2 权证交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券交易**

无。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬**

**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期2023年01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间2022年01月01日至2022年06月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,447,221.03 | 1,927,085.40 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 154,198.08 | 186,806.58 |

注：支付基金管理人新疆前海联合基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期2023年01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间2022年01月01日至2022年06月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 241,203.50 | 321,180.93 |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期2023年01月01日至2023年06月30日 |
|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |

| | 前海联合国民健康混合A | 前海联合国民健康混合C | 合计 |
|---|---|---|---|
| 新疆前海联合基金管理有限公司 | - | 2.28 | 2.28 |
| 合计 | - | 2.28 | 2.28 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间2022年01月01日至2022年06月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 前海联合国民健康混合A | 前海联合国民健康混合C | 合计 |
| 新疆前海联合基金管理有限公司 | - | 10,914.7 | 10,914.7 |
| 合计 | - | 10,914.7 | 10,914.7 |

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给新疆前海联合，再由新疆前海联合计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费＝前一日C类基金份额的基金资产净值×0.40%/当年天数。

2、本基金自2019年3月22日起，增加C类基金份额并设置对应基金代码。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**

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

无。

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

无。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

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

无。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期2023年01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间2022年01月01日至2022年06月30日 |
|---|---|---|

| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
|---|---|---|---|---|
| 中国工商银行股份有限公司 | 12,535,786.20 | 32,583.86 | 14,862,327.31 | 38,593.52 |

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

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

无。

**6.4.12 期末（2023 年 06 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**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 688485 | 九州一轨 | 2023 年 01 月 11 日 | 6 个月 | 科创板新股锁定 | 17.47 | 15.17 | 3,254 | 56,847.38 | 49,363.18 | - |
| 301486 | 致尚科技 | 2023 年 06 月 30 日 | 6 个交易日 | 新股流通受限 | 57.66 | 57.66 | 788 | 45,436.08 | 45,436.08 | - |
| 301292 | 海科新源 | 2023 年 06 月 29 日 | 7 个交易日 | 新股流通受限 | 19.99 | 19.99 | 2,166 | 43,298.34 | 43,298.34 | - |
| 001286 | 陕西能源 | 2023 年 03 月 31 日 | 6 个月 | 股票流通受限 | 9.60 | 9.41 | 3,767 | 36,163.20 | 35,447.47 | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023 年 06 月 29 日 | 8 个交易日 | 新股流通受限 | 36.90 | 36.90 | 837 | 30,885.30 | 30,885.30 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 301202 | 朗威股份 | 2023年06月28日 | 6个交易日 | 新股流通受限 | 25.82 | 25.82 | 1,029 | 26,568.78 | 26,568.78 | - |
| 301419 | 阿莱德 | 2023年02月02日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 24.80 | 43.85 | 326 | 8,084.80 | 14,295.10 | - |
| 301317 | 鑫磊股份 | 2023年01月12日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 20.67 | 26.17 | 529 | 10,934.43 | 13,843.93 | - |
| 301293 | 三博脑科 | 2023年04月25日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 29.60 | 71.42 | 147 | 4,351.20 | 10,498.74 | - |
| 301303 | 真兰仪表 | 2023年02月13日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 26.80 | 22.32 | 418 | 11,202.40 | 9,329.76 | - |
| 688361 | 中科飞测 | 2023年05月12日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 23.60 | 64.67 | 133 | 3,138.80 | 8,601.11 | - |
| 688469 | 中芯集成 | 2023年04月28日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 5.69 | 5.41 | 1,525 | 8,677.25 | 8,250.25 | - |
| 301408 | 华人健康 | 2023年02月22日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 16.24 | 16.95 | 470 | 7,632.80 | 7,966.50 | - |
| 688531 | 日联科技 | 2023年03月24日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 152.38 | 135.97 | 58 | 8,838.04 | 7,886.26 | - |
| 301325 | 曼恩斯特 | 2023年05月04日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 76.80 | 107.95 | 73 | 5,606.40 | 7,880.35 | - |
| 301310 | 鑫宏业 | 2023年05月26日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 67.28 | 65.43 | 115 | 7,737.20 | 7,524.45 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 688629 | 华丰科技 | 2023年06月16日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 9.26 | 18.59 | 362 | 3,352.12 | 6,729.58 | - |
| 301141 | 中科磁业 | 2023年03月27日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 41.20 | 42.69 | 157 | 6,468.40 | 6,702.33 | - |
| 301373 | 凌玮科技 | 2023年01月20日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 33.73 | 31.85 | 208 | 7,015.84 | 6,624.80 | - |
| 688562 | 航天软件 | 2023年05月15日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 12.68 | 22.31 | 296 | 3,753.28 | 6,603.76 | - |
| 688484 | 南芯科技 | 2023年03月28日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 39.99 | 36.71 | 170 | 6,798.30 | 6,240.70 | - |
| 301315 | 威士顿 | 2023年06月13日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 32.29 | 51.12 | 115 | 3,713.35 | 5,878.80 | - |
| 301157 | 华塑科技 | 2023年03月01日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 56.50 | 52.93 | 111 | 6,271.50 | 5,875.23 | - |
| 301399 | 英特科技 | 2023年05月16日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 43.99 | 51.57 | 113 | 4,970.87 | 5,827.41 | - |
| 301322 | 绿通科技 | 2023年02月27日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 131.11 | 53.24 | 108 | 9,439.92 | 5,749.92 | - |
| 301382 | 蜂助手 | 2023年05月09日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 23.80 | 32.84 | 167 | 3,974.60 | 5,484.28 | - |
| 301360 | 荣旗科技 | 2023年04月17日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 71.88 | 92.60 | 57 | 4,097.16 | 5,278.20 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 688535 | 华海诚科 | 2023年03月28日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 35.00 | 51.23 | 102 | 3,570.00 | 5,225.46 | - |
| 301439 | 泓淋电力 | 2023年03月10日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 19.99 | 16.90 | 307 | 6,136.93 | 5,188.30 | - |
| 688146 | 中船特气 | 2023年04月13日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 36.15 | 38.13 | 136 | 4,916.40 | 5,185.68 | - |
| 688458 | 美芯晟 | 2023年05月15日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 75.00 | 90.76 | 57 | 4,275.00 | 5,173.32 | - |
| 688593 | 新相微 | 2023年05月25日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 11.18 | 14.59 | 349 | 3,901.82 | 5,091.91 | - |
| 301486 | 致尚科技 | 2023年06月30日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 57.66 | 57.66 | 88 | 5,074.08 | 5,074.08 | - |
| 301386 | 未来电器 | 2023年03月21日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 29.99 | 23.79 | 210 | 6,297.90 | 4,995.90 | - |
| 001287 | 中电港 | 2023年03月30日 | 6个月 | 股票流通受限 | 11.88 | 21.02 | 237 | 2,815.56 | 4,981.74 | - |
| 688620 | 安凯微 | 2023年06月15日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 10.68 | 12.34 | 400 | 4,272.00 | 4,936.00 | - |
| 301292 | 海科新源 | 2023年06月29日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 19.99 | 19.99 | 241 | 4,817.59 | 4,817.59 | - |
| 688334 | 西高院 | 2023年06月09日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 14.16 | 16.21 | 294 | 4,163.04 | 4,765.74 | - |
| 688352 | 颀 | 2023年 | 6个月 | 科创 | 12.10 | 12.07 | 394 | 4,767.40 | 4,755.58 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 中科技 | 04月11日 | | 板新股锁定 | | | | | | |
| 301262 | 海看股份 | 2023年06月13日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 30.22 | 25.50 | 185 | 5,590.70 | 4,717.50 | - |
| 688552 | 航天南湖 | 2023年05月08日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 21.17 | 23.50 | 198 | 4,191.66 | 4,653.00 | - |
| 301210 | 金杨股份 | 2023年06月21日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 57.88 | 49.17 | 94 | 5,440.72 | 4,621.98 | - |
| 688523 | 航天环宇 | 2023年05月26日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 21.86 | 23.85 | 193 | 4,218.98 | 4,603.05 | - |
| 301225 | 恒勃股份 | 2023年06月08日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 35.66 | 33.26 | 133 | 4,742.78 | 4,423.58 | - |
| 301332 | 德尔玛 | 2023年05月09日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 14.81 | 13.73 | 319 | 4,724.39 | 4,379.87 | - |
| 301281 | 科源制药 | 2023年03月28日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 44.18 | 25.10 | 174 | 5,478.32 | 4,367.40 | - |
| 688433 | 华曙高科 | 2023年04月07日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 26.66 | 31.50 | 137 | 3,652.42 | 4,315.50 | - |
| 688581 | 安杰思 | 2023年05月12日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 125.80 | 118.03 | 36 | 4,528.80 | 4,249.08 | - |
| 301345 | 涛涛车业 | 2023年03月10日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 73.45 | 46.64 | 90 | 6,610.50 | 4,197.60 | - |
| 301397 | 溯 | 2023年 | 6个月 | 创业 | 53.27 | 40.20 | 101 | 5,380.27 | 4,060.20 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 联股份 | 06月15日 | | 板新股锁定 | | | | | | |
| 301428 | 世纪恒通 | 2023年05月10日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 26.35 | 30.60 | 132 | 3,478.20 | 4,039.20 | - |
| 301305 | 朗坤环境 | 2023年05月15日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 25.25 | 19.69 | 205 | 5,176.25 | 4,036.45 | - |
| 688570 | 天玛智控 | 2023年05月29日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 30.26 | 25.33 | 154 | 4,660.04 | 3,900.82 | - |
| 301376 | 致欧科技 | 2023年06月14日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 24.66 | 22.51 | 165 | 4,068.90 | 3,714.15 | - |
| 301170 | 锡南科技 | 2023年06月16日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 34.00 | 34.93 | 100 | 3,400.00 | 3,493.00 | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023年06月29日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 36.90 | 36.90 | 93 | 3,431.70 | 3,431.70 | - |
| 301337 | 亚华电子 | 2023年05月16日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 32.60 | 30.37 | 111 | 3,618.60 | 3,371.07 | - |
| 301323 | 新莱福 | 2023年05月29日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 39.06 | 39.36 | 83 | 3,241.98 | 3,266.88 | - |
| 603135 | 中重科技 | 2023年03月29日 | 6个月 | 股票流通受限 | 17.80 | 17.89 | 174 | 3,097.20 | 3,112.86 | - |
| 688631 | 莱斯信息 | 2023年06月19日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 25.28 | 29.87 | 101 | 2,553.28 | 3,016.87 | - |
| 301202 | 朗 | 2023年 | 6个月 | 创业 | 25.82 | 25.82 | 115 | 2,969.30 | 2,969.30 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 威股份 | 06月28日 | | 板新股锁定 | | | | | | |
| 688479 | 友车科技 | 2023年05月04日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 33.99 | 29.49 | 97 | 3,297.03 | 2,860.53 | - |
| 001380 | 华纬科技 | 2023年05月09日 | 6个月 | 股票流通受限 | 28.84 | 30.78 | 83 | 2,393.72 | 2,554.74 | - |
| 301232 | 飞沃科技 | 2023年06月08日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 72.50 | 58.42 | 41 | 2,972.50 | 2,395.22 | - |
| 601065 | 江盐集团 | 2023年03月31日 | 6个月 | 股票流通受限 | 10.36 | 11.84 | 168 | 1,740.48 | 1,989.12 | - |
| 603137 | 恒尚节能 | 2023年04月10日 | 6个月 | 股票流通受限 | 15.90 | 17.09 | 116 | 1,844.40 | 1,982.44 | - |
| 601133 | 柏诚股份 | 2023年03月31日 | 6个月 | 股票流通受限 | 11.66 | 12.26 | 161 | 1,877.26 | 1,973.86 | - |
| 001328 | 登康口腔 | 2023年03月29日 | 6个月 | 股票流通受限 | 20.68 | 25.49 | 70 | 1,447.60 | 1,784.30 | - |
| 001282 | 三联锻造 | 2023年05月15日 | 6个月 | 股票流通受限 | 27.93 | 33.03 | 48 | 1,340.64 | 1,585.44 | - |
| 001360 | 南矿集团 | 2023年03月31日 | 6个月 | 股票流通受限 | 15.38 | 14.87 | 95 | 1,461.10 | 1,412.65 | - |
| 603172 | 万丰股份 | 2023年04月28日 | 6个月 | 股票流通受限 | 14.58 | 16.13 | 87 | 1,268.46 | 1,403.31 | - |
| 001324 | 长 | 2023年 | 6个月 | 股票 | 18.88 | 19.60 | 71 | 1,340.48 | 1,391.60 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 青科技 | 05月12日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 001367 | 海森药业 | 2023年03月30日 | 6个月 | 股票流通受限 | 44.48 | 39.48 | 33 | 1,467.84 | 1,302.84 | - |

注：实际可流通日以该证券公告为准。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

无。

**6.4.13 金融工具风险及管理**

**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为混合型证券投资基金，预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券（包括中小企业私募债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层投资风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层层面设立投资风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部和风险管理部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及

进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

**6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行。对于定期银行存款，本基金通过选择具备适当信用水平的银行作为交易对手、平衡信用风险与投资收益率、综合参考内外部信用评级信息评价及调整投资限额，管理相关信用风险并定期评估减值损失。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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 06 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的市值未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动

性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

**6.4.13.4 市场风险**

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

**6.4.13.4.1 利率风险**

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

**6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

| 本期末 2023 年 06 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 12,535,786.20 | - | - | - | 12,535,786.20 |
| 结算备付金 | 23,364.77 | - | - | - | 23,364.77 |
| 存出保证金 | 55,522.57 | - | - | - | 55,522.57 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 131,607,618.30 | 131,607,618.30 |
| 应收清算款 | - | - | - | 3,084,456.43 | 3,084,456.43 |
| 应收申购款 | - | - | - | 47,267.41 | 47,267.41 |
| 资产总计 | 12,614,673.54 | - | - | 134,739,342.14 | 147,354,015.68 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 3,086,736.31 | 3,086,736.31 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 59,236.65 | 59,236.65 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 180,729.42 | 180,729.42 |
| 应付托管费 | - | - | - | 30,121.59 | 30,121.59 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 5,725.95 | 5,725.95 |
| 其他负债 | - | - | - | 186,950.30 | 186,950.30 |
| 负债总计 | - | - | - | 3,549,500.22 | 3,549,500.22 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 利率敏感度缺口 | 12,614,673.54 | - | - | 131,189,841.92 | 143,804,515.46 |
| 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 15,411,116.95 | - | - | - | 15,411,116.95 |
| 存出保证金 | 29,811.94 | - | - | - | 29,811.94 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 232,543,239.74 | 232,543,239.74 |
| 应收申购款 | - | - | - | 11,475.38 | 11,475.38 |
| 资产总计 | 15,440,928.89 | - | - | 232,554,715.12 | 247,995,644.01 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 213,824.86 | 213,824.86 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 311,334.38 | 311,334.38 |
| 应付托管费 | - | - | - | 51,889.05 | 51,889.05 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 7,327.68 | 7,327.68 |
| 其他负债 | - | - | - | 256,195.45 | 256,195.45 |
| 负债总计 | - | - | - | 840,571.42 | 840,571.42 |
| 利率敏感度缺口 | 15,440,928.89 | - | - | 231,714,143.70 | 247,155,072.59 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

**6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

**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市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于医疗健康行业证券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观

经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金以医疗健康行业的上市公司股票为主要投资对象，投资于医疗健康行业上市公司证券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

**6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 06 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 | 131,607,618.30 | 91.52 | 232,543,239.74 | 94.09 |
| 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 | 131,607,618.30 | 91.52 | 232,543,239.74 | 94.09 |

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

| 假设 | 除中证医药卫生指数以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元 ） | |
| | | 本期末 2023 年 06 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
| | 中证医药卫生指数上升 5% | 6,463,829.83 | 11,193,155.82 |
| | 中证医药卫生指数下降 5% | -6,463,829.83 | -11,193,155.82 |

**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06月30日 | 上年度末2022年12月31日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 131,043,779.28 | 231,974,063.78 |
| 第二层次 | 162,481.17 | 190,165.30 |
| 第三层次 | 401,357.85 | 379,010.66 |
| 合计 | 131,607,618.30 | 232,543,239.74 |

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、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、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

无。

**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 | 131,607,618.30 | 89.31 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 其中：股票 | 131,607,618.30 | 89.31 |
| 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 | 12,559,150.97 | 8.52 |
| 8 | 其他各项资产 | 3,187,246.41 | 2.16 |
| 9 | 合计 | 147,354,015.68 | 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

| 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 | 109,993,020.34 | 76.49 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 35,447.47 | 0.02 |
| E | 建筑业 | 3,956.30 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 12,008,790.29 | 8.35 |
| 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 | 172,954.03 | 0.12 |
| 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 | 3,634,508.76 | 2.53 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 53,399.63 | 0.04 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 5,705,541.48 | 3.97 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 131,607,618.30 | 91.52 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

## 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 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600276 | 恒瑞医药 | 289,939 | 13,888,078.10 | 9.66 |
| 2 | 600161 | 天坛生物 | 503,192 | 13,661,662.80 | 9.50 |
| 3 | 002007 | 华兰生物 | 453,900 | 10,171,899.00 | 7.07 |
| 4 | 300357 | 我武生物 | 207,900 | 6,991,677.00 | 4.86 |
| 5 | 300122 | 智飞生物 | 155,900 | 6,890,780.00 | 4.79 |
| 6 | 000999 | 华润三九 | 110,000 | 6,672,600.00 | 4.64 |
| 7 | 600422 | 昆药集团 | 300,000 | 6,216,000.00 | 4.32 |
| 8 | 603392 | 万泰生物 | 89,940 | 6,005,293.80 | 4.18 |
| 9 | 000963 | 华东医药 | 125,900 | 5,460,283.00 | 3.80 |
| 10 | 300294 | 博雅生物 | 150,000 | 5,442,000.00 | 3.78 |
| 11 | 688076 | 诺泰生物 | 130,000 | 4,625,400.00 | 3.22 |
| 12 | 688180 | 君实生物 | 120,000 | 4,624,800.00 | 3.22 |
| 13 | 603939 | 益丰药房 | 112,000 | 4,144,000.00 | 2.88 |
| 14 | 000661 | 长春高新 | 30,000 | 4,089,000.00 | 2.84 |
| 15 | 300347 | 泰格医药 | 56,100 | 3,620,694.00 | 2.52 |
| 16 | 688506 | 百利天恒 | 40,000 | 2,894,400.00 | 2.01 |
| 17 | 603658 | 安图生物 | 49,982 | 2,585,568.86 | 1.80 |
| 18 | 002020 | 京新药业 | 200,000 | 2,564,000.00 | 1.78 |
| 19 | 300015 | 爱尔眼科 | 130,067 | 2,412,742.85 | 1.68 |
| 20 | 603233 | 大参林 | 84,000 | 2,352,840.00 | 1.64 |
| 21 | 000513 | 丽珠集团 | 60,000 | 2,334,600.00 | 1.62 |
| 22 | 300406 | 九强生物 | 100,000 | 2,333,000.00 | 1.62 |
| 23 | 300595 | 欧普康视 | 70,000 | 2,113,300.00 | 1.47 |
| 24 | 600763 | 通策医疗 | 20,049 | 1,941,946.14 | 1.35 |
| 25 | 300119 | 瑞普生物 | 100,000 | 1,780,000.00 | 1.24 |
| 26 | 688276 | 百克生物 | 19,936 | 1,247,993.60 | 0.87 |
| 27 | 301267 | 华厦眼科 | 20,155 | 1,228,447.25 | 0.85 |
| 28 | 002821 | 凯莱英 | 10,000 | 1,178,600.00 | 0.82 |
| 29 | 600085 | 同仁堂 | 20,000 | 1,151,200.00 | 0.80 |
| 30 | 301293 | 三博脑科 | 1,462 | 122,405.24 | 0.09 |
| 31 | 301315 | 威士顿 | 1,142 | 67,324.21 | 0.05 |
| 32 | 301262 | 海看股份 | 1,844 | 50,754.75 | 0.04 |
| 33 | 301486 | 致尚科技 | 876 | 50,510.16 | 0.04 |
| 34 | 688485 | 九州一轨 | 3,254 | 49,363.18 | 0.03 |
| 35 | 301292 | 海科新源 | 2,407 | 48,115.93 | 0.03 |
| 36 | 301225 | 恒勃股份 | 1,329 | 47,348.02 | 0.03 |
| 37 | 301397 | 溯联股份 | 1,002 | 42,262.60 | 0.03 |
| 38 | 688570 | 天玛智控 | 1,536 | 40,717.30 | 0.03 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 39 | 301376 | 致欧科技 | 1,642 | 38,719.05 | 0.03 |
| 40 | 001286 | 陕西能源 | 3,767 | 35,447.47 | 0.02 |
| 41 | 301261 | 恒工精密 | 930 | 34,317.00 | 0.02 |
| 42 | 688631 | 莱斯信息 | 1,007 | 32,516.23 | 0.02 |
| 43 | 301202 | 朗威股份 | 1,144 | 29,538.08 | 0.02 |
| 44 | 301419 | 阿莱德 | 326 | 14,295.10 | 0.01 |
| 45 | 301317 | 鑫磊股份 | 529 | 13,843.93 | 0.01 |
| 46 | 301367 | 怡和嘉业 | 68 | 10,087.12 | 0.01 |
| 47 | 301303 | 真兰仪表 | 418 | 9,329.76 | 0.01 |
| 48 | 301297 | 富乐德 | 402 | 9,049.02 | 0.01 |
| 49 | 688361 | 中科飞测 | 133 | 8,601.11 | 0.01 |
| 50 | 688469 | 中芯集成 | 1,525 | 8,250.25 | 0.01 |
| 51 | 301408 | 华人健康 | 470 | 7,966.50 | 0.01 |
| 52 | 688531 | 日联科技 | 58 | 7,886.26 | 0.01 |
| 53 | 301325 | 曼恩斯特 | 73 | 7,880.35 | 0.01 |
| 54 | 301310 | 鑫宏业 | 115 | 7,524.45 | 0.01 |
| 55 | 688629 | 华丰科技 | 362 | 6,729.58 | 0.00 |
| 56 | 301141 | 中科磁业 | 157 | 6,702.33 | 0.00 |
| 57 | 301373 | 凌玮科技 | 208 | 6,624.80 | 0.00 |
| 58 | 688562 | 航天软件 | 296 | 6,603.76 | 0.00 |
| 59 | 688484 | 南芯科技 | 170 | 6,240.70 | 0.00 |
| 60 | 301157 | 华塑科技 | 111 | 5,875.23 | 0.00 |
| 61 | 301399 | 英特科技 | 113 | 5,827.41 | 0.00 |
| 62 | 301322 | 绿通科技 | 108 | 5,749.92 | 0.00 |
| 63 | 301382 | 蜂助手 | 167 | 5,484.28 | 0.00 |
| 64 | 301360 | 荣旗科技 | 57 | 5,278.20 | 0.00 |
| 65 | 688535 | 华海诚科 | 102 | 5,225.46 | 0.00 |
| 66 | 301439 | 泓淋电力 | 307 | 5,188.30 | 0.00 |
| 67 | 688146 | 中船特气 | 136 | 5,185.68 | 0.00 |
| 68 | 688458 | 美芯晟 | 57 | 5,173.32 | 0.00 |
| 69 | 688593 | 新相微 | 349 | 5,091.91 | 0.00 |
| 70 | 301386 | 未来电器 | 210 | 4,995.90 | 0.00 |
| 71 | 001287 | 中电港 | 237 | 4,981.74 | 0.00 |
| 72 | 688620 | 安凯微 | 400 | 4,936.00 | 0.00 |
| 73 | 688334 | 西高院 | 294 | 4,765.74 | 0.00 |
| 74 | 688352 | 颀中科技 | 394 | 4,755.58 | 0.00 |
| 75 | 688552 | 航天南湖 | 198 | 4,653.00 | 0.00 |
| 76 | 301210 | 金杨股份 | 94 | 4,621.98 | 0.00 |
| 77 | 688523 | 航天环宇 | 193 | 4,603.05 | 0.00 |
| 78 | 301332 | 德尔玛 | 319 | 4,379.87 | 0.00 |
| 79 | 301281 | 科源制药 | 174 | 4,367.40 | 0.00 |
| 80 | 688433 | 华曙高科 | 137 | 4,315.50 | 0.00 |
| 81 | 688581 | 安杰思 | 36 | 4,249.08 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 82 | 301345 | 涛涛车业 | 90 | 4,197.60 | 0.00 |
| 83 | 301428 | 世纪恒通 | 132 | 4,039.20 | 0.00 |
| 84 | 301305 | 朗坤环境 | 205 | 4,036.45 | 0.00 |
| 85 | 301170 | 锡南科技 | 100 | 3,493.00 | 0.00 |
| 86 | 301337 | 亚华电子 | 111 | 3,371.07 | 0.00 |
| 87 | 301323 | 新莱福 | 83 | 3,266.88 | 0.00 |
| 88 | 603135 | 中重科技 | 174 | 3,112.86 | 0.00 |
| 89 | 688479 | 友车科技 | 97 | 2,860.53 | 0.00 |
| 90 | 001380 | 华纬科技 | 83 | 2,554.74 | 0.00 |
| 91 | 301232 | 飞沃科技 | 41 | 2,395.22 | 0.00 |
| 92 | 601065 | 江盐集团 | 168 | 1,989.12 | 0.00 |
| 93 | 603137 | 恒尚节能 | 116 | 1,982.44 | 0.00 |
| 94 | 601133 | 柏诚股份 | 161 | 1,973.86 | 0.00 |
| 95 | 001328 | 登康口腔 | 70 | 1,784.30 | 0.00 |
| 96 | 001282 | 三联锻造 | 48 | 1,585.44 | 0.00 |
| 97 | 001360 | 南矿集团 | 95 | 1,412.65 | 0.00 |
| 98 | 603172 | 万丰股份 | 87 | 1,403.31 | 0.00 |
| 99 | 001324 | 长青科技 | 71 | 1,391.60 | 0.00 |
| 100 | 001367 | 海森药业 | 33 | 1,302.84 | 0.00 |

## 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 | 603259 | 药明康德 | 11,430,721.75 | 4.62 |
| 2 | 000999 | 华润三九 | 10,858,000.00 | 4.39 |
| 3 | 300122 | 智飞生物 | 8,599,499.30 | 3.48 |
| 4 | 600763 | 通策医疗 | 8,337,119.00 | 3.37 |
| 5 | 002821 | 凯莱英 | 7,778,070.60 | 3.15 |
| 6 | 000963 | 华东医药 | 6,421,180.00 | 2.60 |
| 7 | 600422 | 昆药集团 | 6,373,397.00 | 2.58 |
| 8 | 603392 | 万泰生物 | 6,015,846.20 | 2.43 |
| 9 | 688180 | 君实生物 | 4,771,898.32 | 1.93 |
| 10 | 603939 | 益丰药房 | 4,577,707.00 | 1.85 |
| 11 | 603127 | 昭衍新药 | 4,333,081.00 | 1.75 |
| 12 | 688076 | 诺泰生物 | 3,927,765.77 | 1.59 |
| 13 | 688639 | 华恒生物 | 3,406,665.10 | 1.38 |
| 14 | 002007 | 华兰生物 | 3,360,993.00 | 1.36 |
| 15 | 688506 | 百利天恒 | 3,233,132.26 | 1.31 |
| 16 | 603658 | 安图生物 | 2,919,414.64 | 1.18 |
| 17 | 002020 | 京新药业 | 2,763,967.00 | 1.12 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 18 | 603233 | 大参林 | 2,635,132.00 | 1.07 |
| 19 | 002294 | 信立泰 | 2,520,505.00 | 1.02 |
| 20 | 000513 | 丽珠集团 | 2,339,558.00 | 0.95 |

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 000999 | 华润三九 | 18,387,448.00 | 7.44 |
| 2 | 000963 | 华东医药 | 18,168,622.68 | 7.35 |
| 3 | 300015 | 爱尔眼科 | 14,975,308.00 | 6.06 |
| 4 | 600085 | 同仁堂 | 14,137,027.00 | 5.72 |
| 5 | 300760 | 迈瑞医疗 | 12,647,285.00 | 5.12 |
| 6 | 600436 | 片仔癀 | 11,248,102.00 | 4.55 |
| 7 | 600276 | 恒瑞医药 | 8,745,149.80 | 3.54 |
| 8 | 300003 | 乐普医疗 | 8,575,752.00 | 3.47 |
| 9 | 603259 | 药明康德 | 7,619,159.80 | 3.08 |
| 10 | 002727 | 一心堂 | 7,203,359.00 | 2.91 |
| 11 | 600763 | 通策医疗 | 7,189,525.40 | 2.91 |
| 12 | 600557 | 康缘药业 | 6,917,693.32 | 2.80 |
| 13 | 000661 | 长春高新 | 6,605,809.00 | 2.67 |
| 14 | 600161 | 天坛生物 | 5,953,286.40 | 2.41 |
| 15 | 000538 | 云南白药 | 5,620,852.00 | 2.27 |
| 16 | 600079 | 人福医药 | 5,125,772.00 | 2.07 |
| 17 | 002262 | 恩华药业 | 5,055,166.96 | 2.05 |
| 18 | 000423 | 东阿阿胶 | 4,848,350.05 | 1.96 |
| 19 | 002821 | 凯莱英 | 4,608,274.00 | 1.86 |
| 20 | 002223 | 鱼跃医疗 | 4,589,810.00 | 1.86 |

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 123,673,250.68 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 208,295,173.50 |

注：买入股票成本（成交）总额、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，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

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

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

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

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 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

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有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。

### 7.12.2 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中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 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 | 55,522.57 |
| 2 | 应收清算款 | 3,084,456.43 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 47,267.41 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,187,246.41 |

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

# §8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 前海联合国民健康混合 A | 10,838 | 8,572.37 | 72,919,740.54 | 78.49% | 19,987,650.58 | 21.51% |
| 前海联合国民健康混合 C | 5,988 | 2,146.69 | - | - | 12,854,392.14 | 100% |
| 合计 | 15,908 | 6,648.34 | 72,919,740.54 | 68.95% | 32,842,042.72 | 31.05% |

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 前海联合国民健康混合 A | 16,682.66 | 0.0180% |
| | 前海联合国民健康混合 C | 5,558.42 | 0.0432% |
| | 合计 | 22,241.08 | 0.0210% |

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 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 | 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 | 前海联合国民健康混合 A | 0 |
| | 前海联合国民健康混合 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 前海联合国民健康混合 A | 0 |
| | 前海联合国民健康混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

# §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 前海联合国民健康混合 A | 前海联合国民健康混合 C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2016 年 12 月 29 日）基金份额总额 | 209,400,994.15 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 147,020,323.41 | 13,936,313.08 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,307,377.20 | 4,260,457.64 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 57,420,309.49 | 5,342,378.58 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 92,907,391.12 | 12,854,392.14 |

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

无。

## 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、本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未有重大改变。

## 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改聘会计师事务所。

## 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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无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 | |
| 华创证券有限责任公司 | 2 | 156,304,223.90 | 47.68% | 145,566.74 | 52.57% | - |
| 国盛证券有限责任公司 | 1 | 109,535,542.87 | 33.41% | 80,104.45 | 28.93% | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1 | 32,290,541.80 | 9.85% | 23,614.37 | 8.53% | - |
| 广发证券股份有限 | 1 | 18,229,023.25 | 5.56% | 16,976.70 | 6.13% | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 公司 | | | | | | |
| 兴业证券股份有限公司 | 1 | 11,449,971.96 | 3.49% | 10,663.44 | 3.85% | - |
| 东兴证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 五矿证券有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华金证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |

注：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）的有关规定，我公司制定了《交易单元及券商研究服务评价管理办法》：

（1）券商选择标准：

1）实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；

2）研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；

3）券商利用其他专业研究咨询机构为公司提供研究与支持服务的，对该券商研究方面的要求按照上述第 2 点规定执行；

（2）券商选择程序：

1）券商研究质量与研究服务评价；

2）拟定租用对象。由研究发展部根据券商选择标准拟定备选的券商；

3）上报批准。研究发展部将拟定租用对象上报分管领导批准；

4）签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

2、本报告期内新增交易单元：民生证券股份有限公司，退租交易单元：无。

### 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

本基金本报告期内租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

### 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 | 新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第四季度报告及提示性公告 | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023-01-28 |
| 2 | 新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告及提示性公告 | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023-03-30 |
| 3 | 新疆前海联合基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息的公告 | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023-04-18 |
| 4 | 新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第一季度报告及提示性公告 | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023-04-22 |

## §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 | 1 | 20230101-20230315 | 52,118,192.89 | - | 52,118,192.89 | - | - |
| | 2 | 20230101-20230630 | 72,919,740.54 | - | - | 72,919,740.54 | 68.95% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。 | | | | | | | |

注：报告期内申购份额包含红利再投份额。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

1、中国证监会核准新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；

2、《新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、本报告期内公开披露的基金净值信息及其他临时公告。

## 12.2 存放地点

除上述第 6 项文件存放于基金托管人处外，其他备查文件等文本存放于基金管理人处。

## 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

**新疆前海联合基金管理有限公司**

二〇二三年八月三十日