

# 富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 30 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2022年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示及目录                              | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| §2 基金简介                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 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、基金净值表现及利润分配情况                 | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 8  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 11 |
| §4 管理人报告                                | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 14 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 14 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 15 |
| §5 托管人报告                                | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 16 |
| 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 | 16 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 16 |
| §6 审计报告                                 | 16 |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 16 |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 16 |
| §7 年度财务报表                               | 19 |
| 7.1 资产负债表                               | 19 |
| 7.2 利润表                                 | 21 |
| 7.3 净资产（基金净值）变动表                        | 22 |
| 7.4 报表附注                                | 25 |
| §8 投资组合报告                               | 54 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 54 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 54 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 55 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 57 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 60 |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 61 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 61 |
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细   | 61 |
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细      | 61 |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 61 |

|   |    |
|---|----|
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....                    | 61 |
| 8.12 投资组合报告附注.....                                | 61 |
| §9 基金份额持有人信息.....                                 | 62 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                        | 62 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....                     | 63 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....             | 63 |
| 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况..... | 63 |
| §10 开放式基金份额变动.....                                | 64 |
| §11 重大事件揭示.....                                   | 64 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                             | 64 |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....             | 64 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....                  | 64 |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                               | 64 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                        | 65 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....                | 65 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                       | 65 |
| 11.8 其他重大事件.....                                  | 70 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息.....                           | 74 |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....           | 74 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                          | 74 |
| §13 备查文件目录.....                                   | 75 |
| 13.1 备查文件目录.....                                  | 75 |
| 13.2 存放地点.....                                    | 75 |
| 13.3 查阅方式.....                                    | 75 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                      |                |
|-----------------|----------------------|----------------|
| 基金名称            | 富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金 |                |
| 基金简称            | 富安达健康人生混合            |                |
| 基金主代码           | 001861               |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式               |                |
| 基金合同生效日         | 2015年11月25日          |                |
| 基金管理人           | 富安达基金管理有限公司          |                |
| 基金托管人           | 交通银行股份有限公司           |                |
| 报告期末基金份额总额      | 30,077,176.70份       |                |
| 基金合同存续期         | 不定期                  |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 富安达健康人生混合<br>A       | 富安达健康人生混合<br>C |
| 下属分级基金的交易代码     | 001861               | 014470         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 30,056,106.14份       | 21,070.56份     |

注：本基金自2021年12月17日起新增C类份额。

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金通过资产的灵活配置,重点投资于能够满足人们对优质健康生活需求的上市公司,在有效控制风险的前提下,力争为投资者带来长期稳定的超额收益。   |
| 投资策略 | 本基金采用自上而下的富安达多维经济模型,通过对全球经济发展形势,国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析,结合FED模型,对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势做出预测,并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。同时结合富安达择时量化模型,辅助判断大类资产配置及权益类资产仓位。一般情况下,本基金将大部分基金资产投资于健康人生主题下的上市公司证券,当证券市 |

|        |   |
|--------|---|
|        | 场系统性风险加大时，本基金将对相关证券资产的配置比例做出适时调整。                   |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%                         |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型证券投资基金，一般情况，其风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 |

### 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      | 富安达基金管理有限公司        | 交通银行股份有限公司            |
| 信息披露负责人 | 姓名                 | 李理想                   |
|         | 联系电话               | 021-61870999          |
|         | 电子邮箱               | service@fadfunds.com  |
| 客户服务电话  | 400-630-6999       | 95559                 |
| 传真      | 021-61870888       | 021-62701216          |
| 注册地址    | 上海市浦东新区世纪大道156号29楼 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号 |
| 办公地址    | 上海市浦东新区世纪大道156号29楼 | 中国（上海）长宁区仙霞路18号       |
| 邮政编码    | 200122             | 200336                |
| 法定代表人   | 张睿                 | 任德奇                   |

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                       | 办公地址                        |
|--------|--------------------------|-----------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所<br>(特殊普通合伙) | 上海浦东新区东育路588号前滩中心<br>42楼    |
| 注册登记机构 | 富安达基金管理有限公司              | 上海市浦东新区世纪大道1568号中<br>建大厦29楼 |

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2022年          |            | 2021年         |            | 2020年         |            |
|---------------|----------------|------------|---------------|------------|---------------|------------|
|               | 富安达健康人生混合A     | 富安达健康人生混合C | 富安达健康人生混合A    | 富安达健康人生混合C | 富安达健康人生混合A    | 富安达健康人生混合C |
| 本期已实现收益       | -12,351,305.29 | -687.96    | 3,262,824.64  | 0.14       | 32,937,941.39 | -          |
| 本期利润          | -12,864,357.67 | -2,555.22  | -1,583,419.92 | 2.42       | 40,712,609.36 | -          |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.3993        | -0.1517    | -0.0472       | 0.0634     | 0.9006        | -          |
| 本期加权平均净值利润率   | -22.11%        | -8.37%     | -2.02%        | 2.93%      | 46.60%        | -          |
| 本期基金份额净值增长率   | -16.59%        | -16.90%    | -2.56%        | 0.90%      | 67.75%        | -          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022年末         |            | 2021年末        |            | 2020年末        |            |
| 期末可供分配利润      | 25,243,740.18  | 17,305.16  | 40,838,964.72 | 71.76      | 48,710,882.76 | -          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.8399         | 0.8213     | 1.2059        | 1.1958     | 1.2000        | -          |
| 期末基金资产净值      | 55,299,846.32  | 38,636.92  | 74,703,796.76 | 132.42     | 91,897,083.10 | -          |
| 期末基金份额净值      | 1.8399         | 1.8337     | 2.2059        | 2.2066     | 2.2638        | -          |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2022年末         |            | 2021年末        |            | 2020年末        |            |

|             |        |         |         |       |         |   |
|-------------|--------|---------|---------|-------|---------|---|
| 基金份额累计净值增长率 | 83.99% | -16.15% | 120.59% | 0.90% | 126.38% | - |
|-------------|--------|---------|---------|-------|---------|---|

注：

1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，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. 期末可供分配利润为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。
4. 本基金自2021年12月17日起新增C类份额。

### 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

富安达健康人生混合A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 11.75%   | 1.78%       | 1.28%      | 0.76%         | 10.47% | 1.02% |
| 过去六个月      | -2.87%   | 1.59%       | -7.61%     | 0.66%         | 4.74%  | 0.93% |
| 过去一年       | -16.59%  | 1.58%       | -12.02%    | 0.77%         | -4.57% | 0.81% |
| 过去三年       | 36.34%   | 1.73%       | 2.96%      | 0.77%         | 33.38% | 0.96% |
| 过去五年       | 60.73%   | 1.61%       | 10.86%     | 0.77%         | 49.87% | 0.84% |
| 自基金合同生效起至今 | 83.99%   | 1.41%       | 17.66%     | 0.75%         | 66.33% | 0.66% |

富安达健康人生混合C

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 11.63%   | 1.78%       | 1.28%      | 0.76%         | 10.35% | 1.02% |
| 过去六个月 | -3.07%   | 1.59%       | -7.61%     | 0.66%         | 4.54%  | 0.93% |
| 过去一年  | -16.90%  | 1.58%       | -12.02%    | 0.77%         | -4.88% | 0.81% |



|            |         |       |         |       |        |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | -16.15% | 1.56% | -11.99% | 0.76% | -4.16% | 0.80% |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|

注：

1. 本基金业绩比较基准为：60%×沪深300指数+40%×中债总财富总指数，
2. 本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：  

$$\text{Return } t = 60\% \times [\text{沪深300指数}_t \div \text{沪深300指数}(t-1) - 1] + 40\% \times [\text{中债总财富总指数}_t \div \text{中债总财富总指数}(t-1) - 1]$$

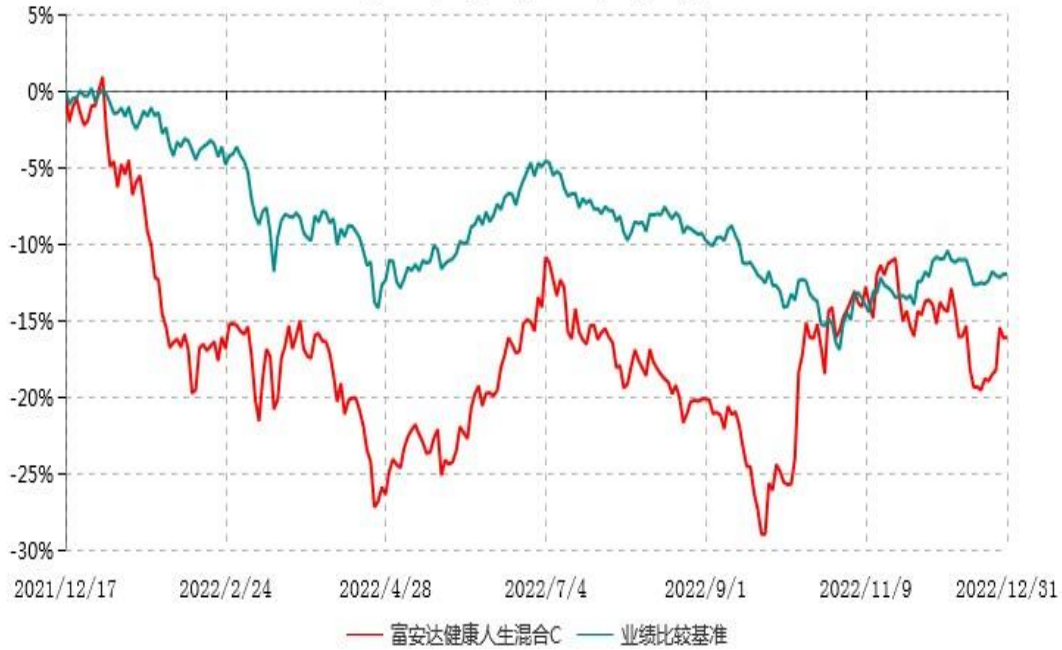
$$\text{Benchmark } t = (1 + \text{Return } t) \times \text{Benchmark}(t-1)$$
 其中，t=1, 2, 3, ...T, T表示时间截至日。
3. 本基金自2021年12月17日起新增C类份额。

### 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

富安达健康人生混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年11月25日-2022年12月31日)

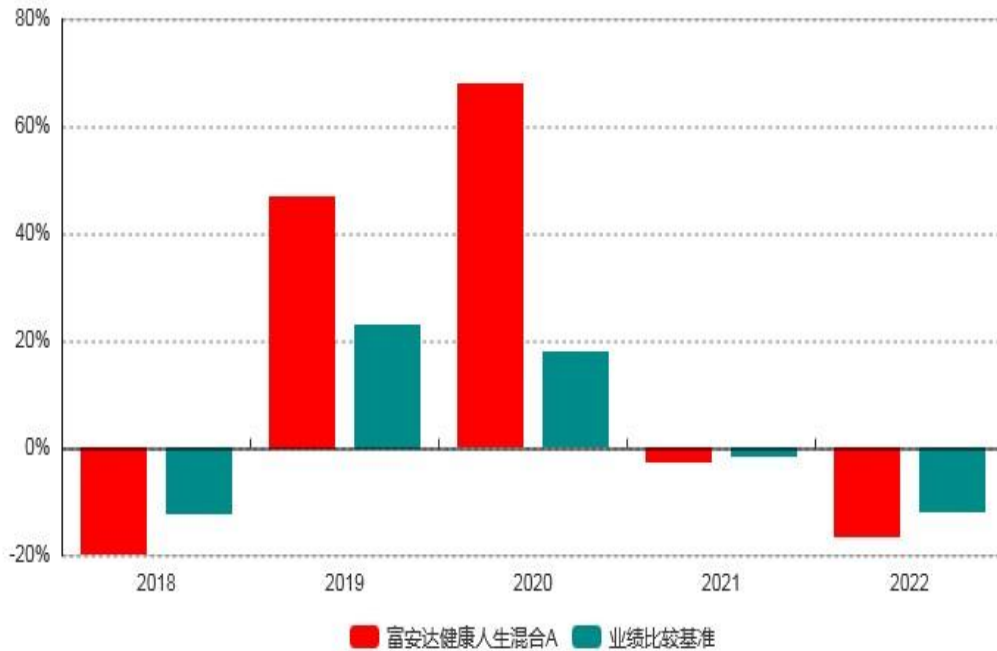


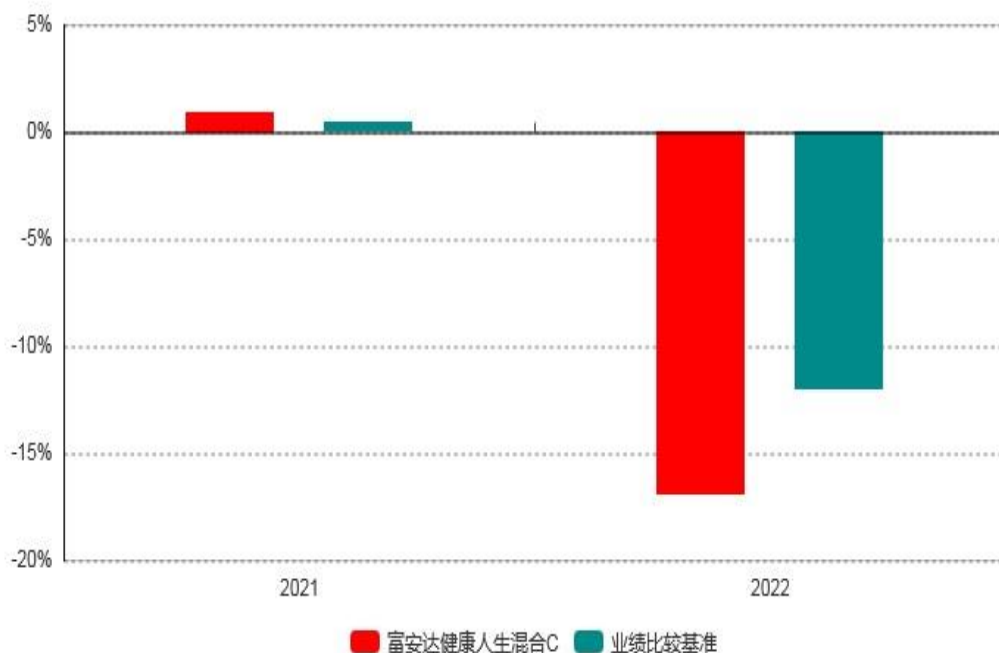
富安达健康人生混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年12月17日-2022年12月31日)



注：本基金自2021年12月17日起新增C类份额。

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





注:本基金自2021年12月17日起新增C类份额,份额新增当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股(集团)有限责任公司三家单位共同发起设立。2021年6月29日,经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2276号文批准,江苏交通控股有限公司将其持有的本公司股权转让给江苏云杉资本管理有限公司。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦,注册资本8.18亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念,以基金持有人利益最大化为首要经营目标,为客户提供卓越的理财服务。

截至2022年12月31日,公司共管理二十只开放式基金:富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达现金货币市场证券投资基金、富安达新兴成长灵活配置混合型证券

投资基金、富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达科技领航混合型证券投资基金、富安达科技创新混合型发起式证券投资基金、富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金、富安达医药创新混合型证券投资基金、富安达中小盘六个月持有期混合型发起式证券投资基金、富安达成长价值一年持有期混合型证券投资基金、富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金、富安达先进制造混合型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务               | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|------------------|-----------------|------|--------|---|
|     |                  | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 李守峰 | 本基金的基金经理、行业研究部经理 | 2015-12-25      | -    | 12年    | 博士。历任万联证券研究所医药研究员。2013年3月加入富安达基金管理有限公司任行业研究员。2015年12月起担任富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金(2018年11月30日至2021年8月11日期间)、富安达医药创新混合型证券投资基金、富安达中小盘六个月持有期混合型发起式证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021年6月28日至今兼任投资经理。 |

注：

- 1.任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，任职日期为基金合同生效日。
- 2.证券从业年限计算标准遵从中国证监会《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》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

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

| 姓名  | 产品类型     | 产品数量（只） | 资产净值(元)        | 任职时间       |
|-----|----------|---------|----------------|------------|
| 李守峰 | 公募基金     | 4       | 432,435,758.93 | 2015-12-25 |
|     | 私募资产管理计划 | 2       | 48,972,909.27  | 2021-06-28 |
|     | 其他组合     | -       | -              | -          |
|     | 合计       | 6       | 481,408,668.20 | -          |

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

兼任基金经理所管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩不直接与兼任基金经理薪酬激励挂钩，公司会根据实际情况对兼任基金经理所管理的公募产品及私募资产管理计划分别进行考核，并依据考核结果对薪酬激励进行评定和调整。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》，并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系，涵盖了所有投资组合，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节，确保公平对待旗下的每一个投资组合。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日，公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析，按照特定计算周期，分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异，未发现公平交易异常情形。

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

本报告期内，本基金管理人针对同一基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理的多个投资组合，加强了对投资指令、交易行为的管理，加强了事后报告机制。同时，本基金管理人按照不同时间窗（包括日内、3日内、5日内、10日内），进一步加强基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理的多个投资组合反向交易和同向交易的交易价差监控分析，未发现公平交易异常情形。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金不存在异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年A股受到整体盈利下行以及俄乌冲突、美联储加息、疫情超预期扩散等因素导致的估值下行影响大幅下跌，全年上证指数下跌15.13%，深证成指下跌25.85%，创业板指数下跌29.37%。本基金主要配置在健康最相关的医药行业，申万医药指数全年下跌20.34%，连续两年下跌；我们在2022下半年配置方向上有所调整，主要配置了两条主线，一个是我们观察到2018年受集采影响最大的仿制药板块盈利已经触底，同时部分公司第二增长曲线已经有了一定的体量，所以我们在配置中增加了仿制药相关公司的配置，另一个主线是政策面比较友好的医疗设备相关公司。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达健康人生混合A基金份额净值为1.8399元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-16.59%，同期业绩比较基准收益率为-12.02%；截至报告期末富安达健康人生混合C基金份额净值为1.8337元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-16.90%，同期业绩比较基准收益率为-12.02%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为经过近两年的调整，医药行业的估值已经处于历史低位，部分细分行业如仿制药集采政策的影响已经出清，我们看好医药行业2023年的表现，新的一年我们将努力寻找健康人生主题里面的结构性机会，力争为投资者贡献长期稳健回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人持续推进内控体系和机制建设，强化内部管理，不断提升自身合规风控能力。报告期内，公司进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，强化内控基础建设；牵头开展了多形式的合规培训，强化员工职业道德教育和合规意识培育，从源头上防范合规风险；建立健全防控内幕交易机制，确保基金投资的独立性、公平性和合规性；加强业务日常合规审核和合规监测，并加大对重要业务和关键业务环节的监督检查，确保各项法规和管理制度有效落实，使业务在可稽可控的范围内有序开展。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，建立健全全面风险管理体系，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保护基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。

本基金管理人设有估值委员会，公司总经理担任估值委员会主席，估值委员会成员由公司总经理、督察长、首席信息官、基金经理、以及投资研究部、固定收益部、多资产投资部、监察稽核部和基金事务部负责人组成，公司其他高级管理人员可列席参会。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议；可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，参与估值程度和估值技术的讨论，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

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，基金托管人在富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《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，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，富安达基金管理有限公司在富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金投资运作、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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                       |
|------------|-----------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                     |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见               |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2023)第24264号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|         |   |
|---------|---|
| 审计报告标题  | 审计报告  |
| 审计报告收件人 | 富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：  |
| 审计意见    | (一) 我们审计的内容 我们审计了富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“富安达健康人生基金”)的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表, 2022年度的利润表和净资产 |



|                 |  |
|-----------------|--|
|                 | (基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了富安达健康人生基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况。   |
| 形成审计意见的基础       | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于富安达健康人生基金,并履行了职业道德方面的其他责任。   |
| 强调事项            | 无  |
| 其他事项            | 无  |
| 其他信息            | 无  |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 富安达健康人生基金的基金管理人富安达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估富安达健康人生基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算富安达健康人生基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督富安达健康人生基金的财务报告过程。 |

## 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对富安达健康人生基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富安达健康人生基金不能持续经营。(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计

|           |                                      |    |
|-----------|--------------------------------------|----|
|           | 发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |    |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)                 |    |
| 注册会计师的姓名  | 张振波                                  | 罗佳 |
| 会计师事务所的地址 | 上海浦东新区东育路588号前滩中心42楼                 |    |
| 审计报告日期    | 2023-03-27                           |    |

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 5,447,315.18       | 12,516,851.53       |
| 结算备付金      |         | 131,066.57         | 139,152.18          |
| 存出保证金      |         | 29,388.60          | 38,194.09           |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 50,837,795.32      | 63,841,067.87       |
| 其中：股票投资    |         | 50,837,795.32      | 63,841,067.87       |
| 基金投资       |         | -                  | -                   |
| 债券投资       |         | -                  | -                   |
| 资产支持证券投资   |         | -                  | -                   |
| 贵金属投资      |         | -                  | -                   |
| 其他投资       |         | -                  | -                   |
| 衍生金融资产     | 7.4.7.3 | -                  | -                   |
| 买入返售金融资产   | 7.4.7.4 | -                  | -                   |
| 债权投资       |         | -                  | -                   |
| 其中：债券投资    |         | -                  | -                   |
| 资产支持证券投资   |         | -                  | -                   |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资             |            |                            |                             |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 其他债权投资        |            | -                          | -                           |
| 其他权益工具投资      |            | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 5,295.21                   | 218,540.21                  |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 7.4.7.5    | -                          | 3,047.23                    |
| 资产总计          |            | 56,450,860.88              | 76,756,853.11               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2021年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                            |                             |
| 短期借款          |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债        | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | 894,577.41                 | 1,751,724.76                |
| 应付赎回款         |            | 8,901.85                   | 52,134.90                   |
| 应付管理人报酬       |            | 71,653.25                  | 93,768.69                   |
| 应付托管费         |            | 11,942.24                  | 15,628.12                   |
| 应付销售服务费       |            | 24.53                      | -                           |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | -                          | -                           |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 7.4.7.6    | 125,278.36                 | 139,667.46                  |
| 负债合计          |            | 1,112,377.64               | 2,052,923.93                |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 7.4.7.7    | 30,077,176.70              | 33,864,892.05               |
| 其他综合收益        |            | -                          | -                           |

|          |         |               |               |
|----------|---------|---------------|---------------|
| 未分配利润    | 7.4.7.8 | 25,261,306.54 | 40,839,037.13 |
| 净资产合计    |         | 55,338,483.24 | 74,703,929.18 |
| 负债和净资产总计 |         | 56,450,860.88 | 76,756,853.11 |

注：报告截止日2022年12月31日，基金份额总额30,077,176.70份，其中富安达健康人生混合A类基金份额净值1.8399元，基金份额30,056,106.14份；富安达健康人生混合C类基金份额净值1.8337元，基金份额21,070.56份。

## 7.2 利润表

会计主体：富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2022年01月01日至2<br>022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2<br>021年12月31日 |
|------------------|----------|-----------------------------------|--|
| <b>一、营业总收入</b>   |          | -11,680,983.57                    | 790,452.98                             |
| 1.利息收入           |          | 68,240.71                         | 70,244.05                              |
| 其中：存款利息收入        | 7.4.7.9  | 67,716.87                         | 66,595.51                              |
| 债券利息收入           |          | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券利息收<br>入   |          | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产收<br>入   |          | 523.84                            | 3,648.54                               |
| 证券出借利息收入         |          | -                                 | -                                      |
| 其他利息收入           |          | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | -11,260,117.46                    | 5,307,419.11                           |
| 其中：股票投资收益        | 7.4.7.10 | -11,686,904.01                    | 5,127,724.01                           |
| 基金投资收益           |          | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益           | 7.4.7.11 | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券投资收<br>益   | 7.4.7.12 | -                                 | -                                      |
| 贵金属投资收益          | 7.4.7.13 | -                                 | -                                      |
| 衍生工具收益           | 7.4.7.14 | -                                 | -                                      |

|                            |            |                |               |
|----------------------------|------------|----------------|---------------|
| 股利收益                       | 7.4.7.15   | 426,786.55     | 179,695.10    |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益      |            | -              | -             |
| 其他投资收益                     |            | -              | -             |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 7.4.7.16   | -514,919.64    | -4,846,242.28 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -              | -             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.17   | 25,812.82      | 259,032.10    |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 1,185,929.32   | 2,373,870.48  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 873,757.97     | 1,177,070.06  |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 145,626.45     | 196,178.42    |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 119.90         | -             |
| 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                   |            | -              | -             |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.18   | 166,425.00     | 1,000,622.00  |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -12,866,912.89 | -1,583,417.50 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -12,866,912.89 | -1,583,417.50 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -              | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -12,866,912.89 | -1,583,417.50 |

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |        |                |                |
|-------------------------------------|-------------------------------|--------|----------------|----------------|
|                                     | 实收基金                          | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                     | 33,864,892.05                 | -      | 40,839,037.13  | 74,703,929.18  |
| 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）                     | 33,864,892.05                 | -      | 40,839,037.13  | 74,703,929.18  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | -3,787,715.35                 | -      | -15,577,730.59 | -19,365,445.94 |
| （一）、综合收益总额                          | -                             | -      | -12,866,912.89 | -12,866,912.89 |
| （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) | -3,787,715.35                 | -      | -2,710,817.70  | -6,498,533.05  |
| 其中：1.基金申购款                          | 5,163,512.77                  | -      | 4,420,497.57   | 9,584,010.34   |
| 2.基金赎回款                             | -8,951,228.12                 | -      | -7,131,315.27  | -16,082,543.39 |
| （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)                     | 30,077,176.70                      | -      | 25,261,306.54  | 55,338,483.24  |
| 项目                                  | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |        |                |                |
|                                     | 实收基金                               | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                     | 40,593,444.68                      | -      | 51,303,638.42  | 91,897,083.10  |
| 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)                     | 40,593,444.68                      | -      | 51,303,638.42  | 91,897,083.10  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | -6,728,552.63                      | -      | -10,464,601.29 | -17,193,153.92 |
| (一)、综合收益总额                          | -                                  | -      | -1,583,417.50  | -1,583,417.50  |
| (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) | -6,728,552.63                      | -      | -8,881,183.79  | -15,609,736.42 |



|  |                |   |                |                |
|--|----------------|---|----------------|----------------|
| 其中：1.基金申购款                               | 29,327,300.67  | - | 41,505,821.19  | 70,833,121.86  |
| 2.基金赎回款                                  | -36,055,853.30 | - | -50,387,004.98 | -86,442,858.28 |
| (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)                          | 33,864,892.05  | - | 40,839,037.13  | 74,703,929.18  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

张睿

孙爱民

王雪

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")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]2041号《关于准予富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册，由富安达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《富安达健康人生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359,240,820.11元，业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(2015)第1324号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年11月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为359,287,506.07份基金份额，其中认购资金利息折合

46,685.96份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《富安达基金管理有限公司关于富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金增设C类基金份额并修订基金合同和托管协议的公告》，本基金自2021年12月17日(含)起增加C类份额，原份额变更为A类基金份额。本基金根据申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为C类基金份额。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达健康人生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、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、资产支持证券、中小企业私募债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(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：股票资产占基金资产的比例为0%-95%，其中投资于健康人生主题相关的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于2023年3月27日批准报出。

#### 7.4.2 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》及其他相关规定(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》、《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年度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2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，采用以下方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

## (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括其他各类应付款项等。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,相关交易费用计入当期损益。对于其他类别的金融资产和金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和

报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

##### 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明



财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号一套期会计》及《企业会计准则第37号--金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号),中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表时,对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定,本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日,本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于2022年1月1日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款,金额分别为12,516,851.53元、139,152.18元、38,194.09元、3,047.23元和218,540.21元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款,金额分别为12,519,810.79元、139,221.04元、38,213.01元、0.00元和218,540.40元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为63,841,067.87元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为63,841,067.87元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款,金额分别为1,751,724.76元、52,134.90元、93,768.69元、15,628.12元、89,559.30元和108.16元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款,金额分别为1,751,724.76元、52,134.90元、93,768.69元、15,628.12元、89,559.30元和108.16元。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》,本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露,这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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的转让收入免征增值税。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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目               | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|------------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款             | 5,447,315.18       | 12,516,851.53       |
| 等于：本金            | 5,446,057.24       | 12,516,851.53       |
| 加：应计利息           | 1,257.94           | -                   |
| 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<br>内 | -                  | -                   |
| 存款期限1-3个<br>月    | -                  | -                   |
| 存款期限3个月<br>以上    | -                  | -                   |
| 其他存款             | -                  | -                   |
| 等于：本金            | -                  | -                   |
| 加：应计利息           | -                  | -                   |
| 减：坏账准备           | -                  | -                   |
| 合计               | 5,447,315.18       | 12,516,851.53       |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022年12月31日 |      |               |              |
|----|--------------------|------|---------------|--------------|
|    | 成本                 | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票 | 46,325,109.64      | -    | 50,837,795.32 | 4,512,685.68 |

|               |       |                     |      |               |              |
|---------------|-------|---------------------|------|---------------|--------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                   | -    | -             | -            |
| 债券            | 交易所市场 | -                   | -    | -             | -            |
|               | 银行间市场 | -                   | -    | -             | -            |
|               | 合计    | -                   | -    | -             | -            |
| 资产支持证券        |       | -                   | -    | -             | -            |
| 基金            |       | -                   | -    | -             | -            |
| 其他            |       | -                   | -    | -             | -            |
| 合计            |       | 46,325,109.64       | -    | 50,837,795.32 | 4,512,685.68 |
| 项目            |       | 上年度末<br>2021年12月31日 |      |               |              |
|               |       | 成本                  | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            |       | 58,813,462.55       | -    | 63,841,067.87 | 5,027,605.32 |
| 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            |       | 58,813,462.55       | -    | 63,841,067.87 | 5,027,605.32 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

## 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|-------|--------------------|---------------------|
| 应收利息  | -                  | 3,047.23            |
| 其他应收款 | -                  | -                   |
| 待摊费用  | -                  | -                   |
| 合计    | -                  | 3,047.23            |

## 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 11.83              | 108.16              |
| 应付证券出借违约金   | -                  | -                   |
| 应付交易费用      | 75,266.53          | 89,559.30           |
| 其中：交易所市场    | 75,266.53          | 89,559.30           |
| 银行间市场       | -                  | -                   |
| 应付利息        | -                  | -                   |
| 预提费用        | 50,000.00          | 50,000.00           |
| 合计          | 125,278.36         | 139,667.46          |

## 7.4.7.7 实收基金

## 7.4.7.7.1 富安达健康人生混合A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(富安达健康人生混合A) | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |               |
|--------------------|-------------------------------|---------------|
|                    | 基金份额(份)                       | 账面金额          |
| 上年度末               | 33,864,832.04                 | 33,864,832.04 |
| 本期申购               | 5,075,488.55                  | 5,075,488.55  |

|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -8,884,214.45 | -8,884,214.45 |
| 本期末           | 30,056,106.14 | 30,056,106.14 |

#### 7.4.7.7.2 富安达健康人生混合C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(富安达健康人生混合C) | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |            |
|--------------------|-------------------------------|------------|
|                    | 基金份额（份）                       | 账面金额       |
| 上年度末               | 60.01                         | 60.01      |
| 本期申购               | 88,024.22                     | 88,024.22  |
| 本期赎回（以“-”号填列）      | -67,013.67                    | -67,013.67 |
| 本期末                | 21,070.56                     | 21,070.56  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 富安达健康人生混合A

单位：人民币元

| 项目<br>(富安达健康人生混合A) | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|--------------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期期初               | 44,237,024.50  | -3,398,059.78 | 40,838,964.72  |
| 本期利润               | -12,351,305.29 | -513,052.38   | -12,864,357.67 |
| 本期基金份额交易产生的变动数     | -3,682,682.83  | 951,815.96    | -2,730,866.87  |
| 其中：基金申购款           | 5,364,294.43   | -1,018,125.18 | 4,346,169.25   |
| 基金赎回款              | -9,046,977.26  | 1,969,941.14  | -7,077,036.12  |
| 本期已分配利润            | -              | -             | -              |
| 本期末                | 28,203,036.38  | -2,959,296.20 | 25,243,740.18  |

##### 7.4.7.8.2 富安达健康人生混合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 |
|----|-------|-------|---------|
|----|-------|-------|---------|

|                |            |           |            |
|----------------|------------|-----------|------------|
| (富安达健康人生混合 C)  |            |           |            |
| 本期期初           | 71.76      | 0.65      | 72.41      |
| 本期利润           | -687.96    | -1,867.26 | -2,555.22  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 17,921.36  | 2,127.81  | 20,049.17  |
| 其中：基金申购款       | 74,104.23  | 224.09    | 74,328.32  |
| 基金赎回款          | -56,182.87 | 1,903.72  | -54,279.15 |
| 本期已分配利润        | -          | -         | -          |
| 本期末            | 17,305.16  | 261.20    | 17,566.36  |

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|--|
| 活期存款利息收入  | 65,220.71                         | 61,894.27                              |
| 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 | 2,035.89                          | 3,700.13                               |
| 其他        | 460.27                            | 1,001.11                               |
| 合计        | 67,716.87                         | 66,595.51                              |

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|------------|-----------------------------------|--|
| 卖出股票成交总额   | 176,809,821.28                    | 298,926,973.73                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 188,020,685.86                    | 293,799,249.72                         |
| 减：交易费用     | 476,039.43                        | -                                      |
| 买卖股票差价收入   | -11,686,904.01                    | 5,127,724.01                           |

**7.4.7.11 债券投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

**7.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

**7.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年01月01日至2022<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021<br>年12月31日 |
|---------------|-----------------------------------|--|
| 股票投资产生的股利收益   | 426,786.55                        | 179,695.10                             |
| 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            | 426,786.55                        | 179,695.10                             |

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2022年01月01日至2022年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12<br>月31日 |
|------------|-----------------------------------|--|
| 1.交易性金融资产  | -514,919.64                       | -4,846,242.28                          |
| ——股票投资     | -514,919.64                       | -4,846,242.28                          |
| ——债券投资     | -                                 | -                                      |
| ——资产支持证券投资 | -                                 | -                                      |
| ——贵金属投资    | -                                 | -                                      |



|                        |             |               |
|------------------------|-------------|---------------|
| ——其他                   | -           | -             |
| 2.衍生工具                 | -           | -             |
| ——权证投资                 | -           | -             |
| 3.其他                   | -           | -             |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -           | -             |
| 合计                     | -514,919.64 | -4,846,242.28 |

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|---------|-----------------------------------|--|
| 基金赎回费收入 | 24,954.64                         | 254,968.36                             |
| 转换费收入   | 858.18                            | 4,063.74                               |
| 合计      | 25,812.82                         | 259,032.10                             |

注：

1.本基金的赎回费率按持有期间递减，其中，A类份额不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类份额将赎回费收入全额归入基金资产。

2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|---------|-----------------------------------|--|
| 审计费用    | 50,000.00                         | 50,000.00                              |
| 信息披露费   | 80,000.00                         | 80,000.00                              |
| 证券出借违约金 | -                                 | -                                      |
| 汇划手续费   | 425.00                            | 425.00                                 |

|       |            |              |
|-------|------------|--------------|
| 账户维护费 | 36,000.00  | 36,000.00    |
| 交易费用  | -          | 834,197.00   |
| 合计    | 166,425.00 | 1,000,622.00 |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                             | 与本基金的关系               |
|-----------------------------------|-----------------------|
| 富安达基金管理有限公司("富安达基金")              | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司("交通银行")                | 基金托管人、基金销售机构          |
| 南京证券股份有限公司("南京证券")                | 基金管理人的股东、基金销售机构       |
| 江苏云杉资本管理有限公司("江苏云杉")              | 基金管理人的股东              |
| 南京市河西新城国有资产经营控股(集团)有限责任公司("南京河西") | 基金管理人的股东              |
| 富安达资产管理(上海)有限公司("富安达资管")          | 基金管理人的全资子公司           |

注：

1. 本报告期内，关联方关系未发生变化。
2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |            |
|-------|-------------------------------|------------|------------------------------------|------------|
|       | 成交金额                          | 占当期<br>股票成 | 成交金额                               | 占当期<br>股票成 |
|       |                               |            |                                    |            |

|                    |               | 交总额<br>的比例 |   | 交总额<br>的比例 |
|--------------------|---------------|------------|---|------------|
| 南京证券<br>股份有限<br>公司 | 33,570,862.79 | 9.56%      | - | -          |

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称              | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日      |                        |           |                      |
|--------------------|------------------------------------|------------------------|-----------|----------------------|
|                    | 当期佣金                               | 占当期<br>佣金总<br>量的比<br>例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应<br>付佣金总<br>额的比例 |
| 南京证券<br>股份有限<br>公司 | 31,264.17                          | 11.57%                 | 12,662.01 | 16.82%               |
| 关联方名称              | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |                        |           |                      |
|                    | 当期佣金                               | 占当期<br>佣金总<br>量的比<br>例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应<br>付佣金总<br>额的比例 |
| 南京证券<br>股份有限       | -                                  | -                      | -         | -                    |

|    |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|
| 公司 |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 873,757.97                    | 1,177,070.06                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 280,237.89                    | 342,827.95                         |

注：

1. 支付基金管理人富安达基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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×1.50%/当年天数。
2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 145,626.45                    | 196,178.42                         |

- 注：支付基金托管人交通银行的基金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×0.25%/当年天数。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

本基金本报告期内及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

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

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

富安达健康人生混合A

| 关联方名称 | 本期末<br>2022年12月31日 |                  | 上年度末<br>2021年12月31日 |                  |
|-------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|       | 持有的基金份额            | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 富安达资管 | 8,803,320.89       | 29.27%           | 8,803,320.89        | 26.00%           |

注：1.报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资"富安达健康人生混合C"。

2.基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的费率按照招募说明书的规定执行。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |           |
|------------|-------------------------------|-----------|------------------------------------|-----------|
|            | 期末余额                          | 当期利息收入    | 期末余额                               | 当期利息收入    |
| 交通银行股份有限公司 | 5,447,315.18                  | 65,220.71 | 12,516,851.53                      | 61,894.27 |

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型证券投资基金，其风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金通过资产的灵活配置，重点投资于能够满足人们对优质健康生活需求的上市公司，在有效控制风险的前提下，力争为投资者带来长期稳定的超额收益。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。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，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

本基金的基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系，贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。本基金的基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金的基金管理人在公司层面建立的风险控制委员会以及在董事会层面建立的合规与风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金的基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金的基金管理人设立了独立于各业务部门的监察稽核部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期出具监察稽核报告，报公司督察长、董事。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2022年12月31日，本基金无债券投资(2021年12月31日：同)。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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2022年12月31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(净资产)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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金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上市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7.4.12。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2022年12月31日，本基金无流动性受限资产。

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2022年12月31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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、存出保证金和应收申购款等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022年1<br>2月31<br>日 | 1年以内         | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计           |
|----------------------------|--------------|------|------|-----|--------------|
| 资产                         |              |      |      |     |              |
| 银行存款                       | 5,447,315.18 | -    | -    | -   | 5,447,315.18 |
| 结算备付金                      | 131,066.57   | -    | -    | -   | 131,066.57   |
| 存出保证金                      | 29,388.60    | -    | -    | -   | 29,388.60    |

|                     |               |      |      |               |               |
|---------------------|---------------|------|------|---------------|---------------|
| 交易性金融资产             | -             | -    | -    | 50,837,795.32 | 50,837,795.32 |
| 应收申购款               | -             | -    | -    | 5,295.21      | 5,295.21      |
| 资产总计                | 5,607,770.35  | -    | -    | 50,843,090.53 | 56,450,860.88 |
| 负债                  |               |      |      |               |               |
| 应付清算款               | -             | -    | -    | 894,577.41    | 894,577.41    |
| 应付赎回款               | -             | -    | -    | 8,901.85      | 8,901.85      |
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -    | 71,653.25     | 71,653.25     |
| 应付托管费               | -             | -    | -    | 11,942.24     | 11,942.24     |
| 应付销售服务费             | -             | -    | -    | 24.53         | 24.53         |
| 其他负债                | -             | -    | -    | 125,278.36    | 125,278.36    |
| 负债总计                | -             | -    | -    | 1,112,377.64  | 1,112,377.64  |
| 利率敏感度缺口             | 5,607,770.35  | -    | -    | 49,730,712.89 | 55,338,483.24 |
| 上年度末<br>2021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                | 12,516,851.53 | -    | -    | -             | 12,516,851.53 |
| 结算备付金               | 139,152.18    | -    | -    | -             | 139,152.18    |
| 存出保证金               | 38,194.09     | -    | -    | -             | 38,194.09     |
| 交易性金融资产             | -             | -    | -    | 63,841,067.87 | 63,841,067.87 |
| 应收申购款               | -             | -    | -    | 218,540.21    | 218,540.21    |
| 其他资                 | -             | -    | -    | 3,047.23      | 3,047.23      |

|         |               |   |   |               |               |
|---------|---------------|---|---|---------------|---------------|
| 产       |               |   |   |               |               |
| 资产总计    | 12,694,197.80 | - | - | 64,062,655.31 | 76,756,853.11 |
| 负债      |               |   |   |               |               |
| 应付证券清算款 | -             | - | - | 1,751,724.76  | 1,751,724.76  |
| 应付赎回款   | -             | - | - | 52,134.90     | 52,134.90     |
| 应付管理人报酬 | -             | - | - | 93,768.69     | 93,768.69     |
| 应付托管费   | -             | - | - | 15,628.12     | 15,628.12     |
| 其他负债    | -             | - | - | 139,667.46    | 139,667.46    |
| 负债总计    | -             | - | - | 2,052,923.93  | 2,052,923.93  |
| 利率敏感度缺口 | 12,694,197.80 | - | - | 62,009,731.38 | 74,703,929.18 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2021年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2021年12月31日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的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，采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合FED模型，对未来一定时期各大类资产的收益风

险变化趋势作出预测，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。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，包括VaR(Value at Risk)指标等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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022年12月31日 |                          | 上年度末<br>2021年12月31日 |                          |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 50,837,795.32      | 91.87                    | 63,841,067.87       | 85.46                    |
| 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            | 50,837,795.32      | 91.87                    | 63,841,067.87       | 85.46                    |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深300指数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<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|  | 1.沪深300指数上升5% | 1,887,353.15       | 3,513,493.17        |
|  | 2.沪深300指数下降5% | -1,887,353.15      | -3,513,493.17       |

注：本基金本期末其他价格风险的敏感性计算中所使用的 $\beta$ 系数为股票组合的 $\beta$ 系数，即资产负债表日投资组合内各个股票的 $\beta$ 加权平均。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 50,837,795.32      | 63,837,100.67       |
| 第二层次          | -                  | 3,967.20            |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 50,837,795.32      | 63,841,067.87       |

###### 7.4.14.2.2 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。

###### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021年12月31日：同)。

**7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括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。

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

**§8 投资组合报告****8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 50,837,795.32 | 90.06        |
|    | 其中：股票             | 50,837,795.32 | 90.06        |
| 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      | 5,578,381.75  | 9.88         |
| 8  | 其他各项资产            | 34,683.81     | 0.06         |
| 9  | 合计                | 56,450,860.88 | 100.00       |

**8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合****8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

|   |                  |               |       |
|---|------------------|---------------|-------|
| A | 农、林、牧、渔业         | -             | -     |
| B | 采矿业              | 851,245.60    | 1.54  |
| C | 制造业              | 42,218,273.87 | 76.29 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -     |
| E | 建筑业              | -             | -     |
| F | 批发和零售业           | 4,988,781.00  | 9.02  |
| 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       | 2,779,494.85  | 5.02  |
| 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               | 50,837,795.32 | 91.87 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资股票投资组合。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)      | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|----------------------|
| 1  | 688198 | 佰仁医疗 | 29,936  | 3,861,744.00 | 6.98                 |
| 2  | 002675 | 东诚药业 | 230,900 | 3,823,704.00 | 6.91                 |
| 3  | 600079 | 人福医药 | 130,400 | 3,115,256.00 | 5.63                 |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 4  | 300294 | 博雅生物 | 74,000  | 2,705,440.00 | 4.89 |
| 5  | 688016 | 心脉医疗 | 13,550  | 2,561,492.00 | 4.63 |
| 6  | 600566 | 济川药业 | 92,900  | 2,528,738.00 | 4.57 |
| 7  | 300760 | 迈瑞医疗 | 6,800   | 2,148,596.00 | 3.88 |
| 8  | 603233 | 大参林  | 53,400  | 2,114,640.00 | 3.82 |
| 9  | 002262 | 恩华药业 | 85,300  | 2,094,115.00 | 3.78 |
| 10 | 002250 | 联化科技 | 130,200 | 2,018,100.00 | 3.65 |
| 11 | 002727 | 一心堂  | 63,600  | 2,004,036.00 | 3.62 |
| 12 | 603259 | 药明康德 | 23,200  | 1,879,200.00 | 3.40 |
| 13 | 688271 | 联影医疗 | 10,396  | 1,839,884.08 | 3.32 |
| 14 | 300452 | 山河药辅 | 94,700  | 1,659,144.00 | 3.00 |
| 15 | 688029 | 南微医学 | 18,800  | 1,544,044.00 | 2.79 |
| 16 | 688488 | 艾迪药业 | 143,723 | 1,514,840.42 | 2.74 |
| 17 | 300957 | 贝泰妮  | 9,800   | 1,462,552.00 | 2.64 |
| 18 | 000403 | 派林生物 | 62,200  | 1,415,672.00 | 2.56 |
| 19 | 600276 | 恒瑞医药 | 35,500  | 1,367,815.00 | 2.47 |
| 20 | 002020 | 京新药业 | 100,000 | 1,218,000.00 | 2.20 |
| 21 | 603858 | 步长制药 | 51,500  | 1,082,015.00 | 1.96 |
| 22 | 688315 | 诺禾致源 | 34,115  | 900,294.85   | 1.63 |
| 23 | 603883 | 老百姓  | 21,500  | 870,105.00   | 1.57 |
| 24 | 600938 | 中国海油 | 56,003  | 851,245.60   | 1.54 |
| 25 | 688677 | 海泰新光 | 5,945   | 671,785.00   | 1.21 |
| 26 | 688050 | 爱博医疗 | 2,896   | 668,107.20   | 1.21 |
| 27 | 301367 | 怡和嘉业 | 2,900   | 636,753.00   | 1.15 |
| 28 | 600161 | 天坛生物 | 25,100  | 595,623.00   | 1.08 |
| 29 | 688076 | 诺泰生物 | 23,050  | 528,767.00   | 0.96 |
| 30 | 300896 | 爱美客  | 800     | 453,080.00   | 0.82 |
| 31 | 603309 | 维力医疗 | 10,900  | 217,782.00   | 0.39 |
| 32 | 688085 | 三友医疗 | 6,573   | 182,400.75   | 0.33 |
| 33 | 688276 | 百克生物 | 2,000   | 138,220.00   | 0.25 |
| 34 | 688017 | 绿的谐波 | 1,275   | 123,394.50   | 0.22 |



|    |        |      |     |           |      |
|----|--------|------|-----|-----------|------|
| 35 | 001301 | 尚太科技 | 698 | 41,209.92 | 0.07 |
|----|--------|------|-----|-----------|------|

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------------|
| 1  | 688133 | 泰坦科技 | 5,466,116.09 | 7.32               |
| 2  | 600566 | 济川药业 | 5,071,990.00 | 6.79               |
| 3  | 688016 | 心脉医疗 | 4,802,109.54 | 6.43               |
| 4  | 600079 | 人福医药 | 4,447,195.00 | 5.95               |
| 5  | 300015 | 爱尔眼科 | 4,085,889.00 | 5.47               |
| 6  | 300294 | 博雅生物 | 4,075,695.00 | 5.46               |
| 7  | 600129 | 太极集团 | 4,055,102.00 | 5.43               |
| 8  | 300595 | 欧普康视 | 3,859,312.00 | 5.17               |
| 9  | 300026 | 红日药业 | 3,824,082.00 | 5.12               |
| 10 | 600529 | 山东药玻 | 3,771,056.00 | 5.05               |
| 11 | 000999 | 华润三九 | 3,722,289.00 | 4.98               |
| 12 | 002020 | 京新药业 | 3,403,397.00 | 4.56               |
| 13 | 688105 | 诺唯赞  | 3,321,995.01 | 4.45               |
| 14 | 002001 | 新和成  | 3,244,507.00 | 4.34               |
| 15 | 603392 | 万泰生物 | 3,206,759.00 | 4.29               |
| 16 | 603520 | 司太立  | 2,994,299.00 | 4.01               |
| 17 | 603456 | 九洲药业 | 2,861,107.00 | 3.83               |
| 18 | 603087 | 甘李药业 | 2,804,191.00 | 3.75               |
| 19 | 002675 | 东诚药业 | 2,787,891.00 | 3.73               |
| 20 | 688621 | 阳光诺和 | 2,739,863.22 | 3.67               |
| 21 | 600276 | 恒瑞医药 | 2,715,758.03 | 3.64               |
| 22 | 300760 | 迈瑞医疗 | 2,576,132.00 | 3.45               |
| 23 | 603896 | 寿仙谷  | 2,557,717.00 | 3.42               |
| 24 | 300759 | 康龙化成 | 2,524,791.00 | 3.38               |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 25 | 002603 | 以岭药业 | 2,482,350.00 | 3.32 |
| 26 | 301080 | 百普赛斯 | 2,455,191.00 | 3.29 |
| 27 | 300452 | 山河药辅 | 2,425,481.00 | 3.25 |
| 28 | 600521 | 华海药业 | 2,356,900.00 | 3.15 |
| 29 | 688131 | 皓元医药 | 2,313,296.05 | 3.10 |
| 30 | 603127 | 昭衍新药 | 2,279,386.00 | 3.05 |
| 31 | 000963 | 华东医药 | 2,279,210.00 | 3.05 |
| 32 | 002250 | 联化科技 | 2,269,903.00 | 3.04 |
| 33 | 600380 | 健康元  | 2,267,821.00 | 3.04 |
| 34 | 002262 | 恩华药业 | 2,213,325.00 | 2.96 |
| 35 | 300363 | 博腾股份 | 2,087,158.00 | 2.79 |
| 36 | 603233 | 大参林  | 2,043,765.00 | 2.74 |
| 37 | 688315 | 诺禾致源 | 2,038,558.44 | 2.73 |
| 38 | 300298 | 三诺生物 | 1,996,857.00 | 2.67 |
| 39 | 688271 | 联影医疗 | 1,991,611.63 | 2.67 |
| 40 | 002727 | 一心堂  | 1,986,116.00 | 2.66 |
| 41 | 600557 | 康缘药业 | 1,961,444.00 | 2.63 |
| 42 | 600332 | 白云山  | 1,902,870.00 | 2.55 |
| 43 | 688065 | 凯赛生物 | 1,777,030.71 | 2.38 |
| 44 | 002294 | 信立泰  | 1,764,201.00 | 2.36 |
| 45 | 600161 | 天坛生物 | 1,760,632.56 | 2.36 |
| 46 | 688488 | 艾迪药业 | 1,759,059.70 | 2.35 |
| 47 | 300841 | 康华生物 | 1,755,870.00 | 2.35 |
| 48 | 603811 | 诚意药业 | 1,703,019.00 | 2.28 |
| 49 | 300633 | 开立医疗 | 1,693,590.00 | 2.27 |
| 50 | 688029 | 南微医学 | 1,681,506.98 | 2.25 |
| 51 | 688658 | 悦康药业 | 1,661,847.27 | 2.22 |
| 52 | 000423 | 东阿阿胶 | 1,641,060.00 | 2.20 |
| 53 | 300957 | 贝泰妮  | 1,628,641.00 | 2.18 |

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

## 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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<br>(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------------|
| 1  | 688133 | 泰坦科技 | 6,002,570.70 | 8.04               |
| 2  | 688677 | 海泰新光 | 5,372,698.69 | 7.19               |
| 3  | 300026 | 红日药业 | 4,852,123.00 | 6.50               |
| 4  | 600129 | 太极集团 | 4,546,639.92 | 6.09               |
| 5  | 000999 | 华润三九 | 4,480,824.14 | 6.00               |
| 6  | 300760 | 迈瑞医疗 | 4,174,687.00 | 5.59               |
| 7  | 300015 | 爱尔眼科 | 3,897,721.31 | 5.22               |
| 8  | 603392 | 万泰生物 | 3,811,254.50 | 5.10               |
| 9  | 688105 | 诺唯赞  | 3,766,801.83 | 5.04               |
| 10 | 300595 | 欧普康视 | 3,634,808.00 | 4.87               |
| 11 | 300759 | 康龙化成 | 3,567,739.60 | 4.78               |
| 12 | 603520 | 司太立  | 3,493,860.00 | 4.68               |
| 13 | 603456 | 九洲药业 | 3,481,608.00 | 4.66               |
| 14 | 300633 | 开立医疗 | 3,432,492.24 | 4.59               |
| 15 | 002020 | 京新药业 | 3,318,288.00 | 4.44               |
| 16 | 002001 | 新和成  | 3,290,967.00 | 4.41               |
| 17 | 002603 | 以岭药业 | 3,211,924.72 | 4.30               |
| 18 | 600529 | 山东药玻 | 3,075,468.24 | 4.12               |
| 19 | 600566 | 济川药业 | 2,907,985.44 | 3.89               |
| 20 | 600557 | 康缘药业 | 2,859,862.00 | 3.83               |
| 21 | 300294 | 博雅生物 | 2,823,687.00 | 3.78               |
| 22 | 603987 | 康德莱  | 2,789,863.00 | 3.73               |
| 23 | 600521 | 华海药业 | 2,584,483.00 | 3.46               |
| 24 | 300298 | 三诺生物 | 2,579,380.00 | 3.45               |
| 25 | 603087 | 甘李药业 | 2,567,393.00 | 3.44               |
| 26 | 603896 | 寿仙谷  | 2,543,907.00 | 3.41               |
| 27 | 603259 | 药明康德 | 2,472,526.59 | 3.31               |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 28 | 688621 | 阳光诺和 | 2,465,137.42 | 3.30 |
| 29 | 600380 | 健康元  | 2,419,599.00 | 3.24 |
| 30 | 300813 | 泰林生物 | 2,365,404.00 | 3.17 |
| 31 | 002294 | 信立泰  | 2,301,832.40 | 3.08 |
| 32 | 301080 | 百普赛斯 | 2,230,590.00 | 2.99 |
| 33 | 600332 | 白云山  | 2,202,265.00 | 2.95 |
| 34 | 300725 | 药石科技 | 2,171,707.00 | 2.91 |
| 35 | 688016 | 心脉医疗 | 2,137,779.52 | 2.86 |
| 36 | 300685 | 艾德生物 | 2,113,899.00 | 2.83 |
| 37 | 603127 | 昭衍新药 | 2,111,184.60 | 2.83 |
| 38 | 688131 | 皓元医药 | 2,021,000.82 | 2.71 |
| 39 | 603811 | 诚意药业 | 1,866,222.00 | 2.50 |
| 40 | 300244 | 迪安诊断 | 1,824,043.00 | 2.44 |
| 41 | 300363 | 博腾股份 | 1,807,024.00 | 2.42 |
| 42 | 688301 | 奕瑞科技 | 1,792,149.09 | 2.40 |
| 43 | 300896 | 爱美客  | 1,744,681.20 | 2.34 |
| 44 | 603882 | 金域医学 | 1,723,000.00 | 2.31 |
| 45 | 000963 | 华东医药 | 1,712,967.00 | 2.29 |
| 46 | 605266 | 健之佳  | 1,710,494.40 | 2.29 |
| 47 | 688166 | 博瑞医药 | 1,634,488.16 | 2.19 |
| 48 | 300347 | 泰格医药 | 1,496,594.00 | 2.00 |

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 175,532,332.95 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 176,809,821.28 |

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1** 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

**8.12.2** 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额        |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | 29,388.60 |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 5,295.21  |

|   |       |           |
|---|-------|-----------|
| 6 | 其他应收款 | -         |
| 7 | 待摊费用  | -         |
| 8 | 其他    | -         |
| 9 | 合计    | 34,683.81 |

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级别                   | 持<br>有<br>人<br>户<br>数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构        |                |               |             |
|----------------------------|------------------------------|---------------|--------------|----------------|---------------|-------------|
|                            |                              |               | 机构投资者        |                | 个人投资者         |             |
|                            |                              |               | 持有份额         | 占总<br>份额<br>比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例  |
| 富安<br>达健<br>康人<br>生混<br>合A | 3,7<br>47                    | 8,021.38      | 8,818,186.89 | 29.3<br>4%     | 21,237,919.25 | 70.66%      |
| 富安<br>达健<br>康人<br>生混<br>合C | 44                           | 478.88        | 0.00         | 0.00%          | 21,070.56     | 100.0<br>0% |

|    |       |          |              |        |               |        |
|----|-------|----------|--------------|--------|---------------|--------|
| 合计 | 3,791 | 7,933.84 | 8,818,186.89 | 29.32% | 21,258,989.81 | 70.68% |
|----|-------|----------|--------------|--------|---------------|--------|

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别       | 持有份额总数<br>(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 | 富安达健康人生混合A | 310,840.05    | 1.03%    |
|                  | 富安达健康人生混合C | 0.00          | 0.00%    |
|                  | 合计         | 310,840.05    | 1.03%    |

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别       | 持有基金份额总量的数量区间<br>(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 | 富安达健康人生混合A | 10~50                 |
|                                | 富安达健康人生混合C | 0                     |
|                                | 合计         | 10~50                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 富安达健康人生混合A | 0~10                  |
|                                | 富安达健康人生混合C | 0                     |
|                                | 合计         | 0~10                  |

注：

1. 基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为10~50万份（含）。
2. 本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0~10万份（含）。

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

| 基金经理姓名 | 产品类型 | 持有本人管理的产<br>品份额总量的数量区间（万 |
|--------|------|--------------------------|
|--------|------|--------------------------|

|     |          | 份)   |
|-----|----------|------|
| 李守峰 | 公募基金     | 0~10 |
|     | 私募资产管理计划 | 0    |
|     | 合计       | 0~10 |

注：本基金的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品份额总量数量区间为0~10万份（含）。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 富安达健康人生混合A     | 富安达健康人生混合C |
|----------------------------|----------------|------------|
| 基金合同生效日(2015年11月25日)基金份额总额 | 359,287,506.07 | -          |
| 本报告期期初基金份额总额               | 33,864,832.04  | 60.01      |
| 本报告期基金总申购份额                | 5,075,488.55   | 88,024.22  |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 8,884,214.45   | 67,013.67  |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -              | -          |
| 本报告期期末基金份额总额               | 30,056,106.14  | 21,070.56  |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。



### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为50,000元人民币。

截至本报告期末，该事务所已向本基金提供8年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

| 措施1                   | 内容   |
|-----------------------|--|
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 管理人及高级管理人员                                   |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2022-11-30                                   |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 中国证券监督管理委员会上海监管局                             |
| 受到的具体措施类型             | 公司：责令改正并暂停办理新增私募资产管理计划备案6个月；高级管理人员：警示函       |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 开展私募资产管理业务过程中存在违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》规定的情形 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 公司按照法律法规及监管要求，已及时完成相关私募资产管理计划的清算工作并提交整改报告。   |
| 其他                    | 此事项不影响公司公募基金业务的正常开展。                         |

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 安信证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|       |   |               |        |           |        |   |
|-------|---|---------------|--------|-----------|--------|---|
| 大同证券  | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 东海证券  | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 方正证券  | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 国泰君安  | 1 | 13,477,693.74 | 3.84%  | 12,551.76 | 4.64%  | - |
| 国元证券  | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 海通证券  | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 华创证券  | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 山西证券  | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 申港证券  | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 西南证券  | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 新时代证券 | 1 | 4,397,153.00  | 1.25%  | 3,215.72  | 1.19%  | - |
| 信达证券  | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 银河证券  | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 浙商证券  | 1 | 39,216,777.62 | 11.17% | 28,679.30 | 10.61% | - |
| 中金公司  | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 中泰证券  | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 财通证券  | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 长江证券  | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 东北证券  | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 东方财富  | 2 | -             | -      | -         | -      | - |

|        |   |                |        |           |        |   |
|--------|---|----------------|--------|-----------|--------|---|
| 东方证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 东吴证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 东兴证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 东亚前海证券 | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 光大证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 国金证券   | 2 | 3,649,242.60   | 1.04%  | 3,398.42  | 1.26%  | - |
| 国联证券   | 2 | 22,453,174.45  | 6.40%  | 16,420.24 | 6.07%  | - |
| 国盛证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 国信证券   | 2 | 110,096,342.46 | 31.36% | 80,513.07 | 29.79% | - |
| 华安证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 华宝证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 华金证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 华龙证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 华泰证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 华西证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 开源证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 民生证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 南京证券   | 2 | 33,570,862.79  | 9.56%  | 31,264.17 | 11.57% | - |
| 上海证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 申万宏源   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |

|        |   |                |        |           |        |   |
|--------|---|----------------|--------|-----------|--------|---|
| 首创证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 太平洋证券  | 2 | 107,096,691.40 | 30.51% | 78,319.78 | 28.98% | - |
| 天风证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 西部证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 兴业证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 招商证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 中信建投   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 中信证券   | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 中银国际证券 | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 广发证券   | 3 | 17,109,016.24  | 4.87%  | 15,933.67 | 5.89%  | - |

注：

1、交易单元的选择标准和程序：

我公司制定了选择券商的标准，即：

(1) 财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与公司具有互补性、最近一年内无重大违法违规行为发生；

(2) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(3) 能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及其他信息咨询服务；

(4) 能根据公司特定要求，提供专门研究报告；

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需，能为基金提供全面的信息服；能够提供很好的交易执行。

投资研究部对潜在签约券商进行必要的尽职调查，将相应的交易单元租用协议、证券综合服务协议作为附件，发起相应OA审批流程，经审批后用印。

2、

在上述租用的券商交易单元中，(33086)财通证券、(011366)财通证券、(55327)大同证券、(014894)广发证券、(55557)国联证券、(006085)国联证券、(56599)民生证券、(015987)

民生证券、(016284)山西证券、(56756)首创证券、(016016)首创证券、(56794)西部证券、(015662)西部证券为本基金本期新增的交易单元。本基金本期剔除交易单元：(014894)广发证券、(348500)华泰证券、(005995)华泰证券。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易 |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|--------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|        | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 安信证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 大同证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东海证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 方正证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 国泰君安   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 国元证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 海通证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华创证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 山西证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 申港证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 西南证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 新时代证券  | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 信达证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 银河证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 浙商证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中金公司   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中泰证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 财通证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 长江证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东北证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东方财富   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东方证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东吴证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东兴证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东亚前海证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 光大证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 国金证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 国联证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 国盛证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 国信证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华安证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华宝证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华金证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华龙证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华泰证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华西证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 开源证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |

|        |   |   |              |         |   |   |   |   |   |
|--------|---|---|--------------|---------|---|---|---|---|---|
| 民生证券   | - | - | -            | -       | - | - | - | - | - |
| 南京证券   | - | - | -            | -       | - | - | - | - | - |
| 上海证券   | - | - | -            | -       | - | - | - | - | - |
| 申万宏源   | - | - | -            | -       | - | - | - | - | - |
| 首创证券   | - | - | -            | -       | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券  | - | - | 8,000,000.00 | 100.00% | - | - | - | - | - |
| 天风证券   | - | - | -            | -       | - | - | - | - | - |
| 西部证券   | - | - | -            | -       | - | - | - | - | - |
| 兴业证券   | - | - | -            | -       | - | - | - | - | - |
| 招商证券   | - | - | -            | -       | - | - | - | - | - |
| 中信建投   | - | - | -            | -       | - | - | - | - | - |
| 中信证券   | - | - | -            | -       | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 | - | - | -            | -       | - | - | - | - | - |
| 广发证券   | - | - | -            | -       | - | - | - | - | - |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式 | 法定披露日期     |
|----|---|--------|------------|
| 1  | 富安达基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告                 | 规定媒介   | 2022-01-04 |
| 2  | 富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持有国际医学(000516)估值调整的公告               | 规定媒介   | 2022-01-17 |
| 3  | 富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告                            | 规定媒介   | 2022-01-21 |
| 4  | 富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2021年第4季度报告                       | 规定媒介   | 2022-01-21 |
| 5  | 富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售(深圳)有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告 | 规定媒介   | 2022-01-26 |
| 6  | 富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告                              | 规定媒介   | 2022-01-28 |

|    |   |      |            |
|----|---|------|------------|
| 7  | 富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加济安财富(北京)基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告     | 规定媒介 | 2022-02-07 |
| 8  | 富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告 | 规定媒介 | 2022-02-17 |
| 9  | 富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京中植基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告         | 规定媒介 | 2022-03-23 |
| 10 | 富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京创金启富基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告     | 规定媒介 | 2022-03-23 |
| 11 | 富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2021年年度报告                             | 规定媒介 | 2022-03-29 |
| 12 | 富安达基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告                                | 规定媒介 | 2022-03-29 |
| 13 | 富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告         | 规定媒介 | 2022-03-31 |
| 14 | 富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告                                | 规定媒介 | 2022-04-21 |

|    |  |      |            |
|----|--|------|------------|
| 15 | 富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2022年第1季度报告            | 规定媒介 | 2022-04-21 |
| 16 | 富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持股票“神火股份”(000933)估值调整的公告 | 规定媒介 | 2022-04-30 |
| 17 | 富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告                   | 规定媒介 | 2022-06-08 |
| 18 | 富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告                   | 规定媒介 | 2022-06-17 |
| 19 | 富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告                   | 规定媒介 | 2022-06-22 |
| 20 | 富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新             | 规定媒介 | 2022-06-29 |
| 21 | 富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二二年第一号）    | 规定媒介 | 2022-06-29 |
| 22 | 富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新提示性公告           | 规定媒介 | 2022-06-29 |
| 23 | 富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告                   | 规定媒介 | 2022-07-01 |
| 24 | 富安达基金管理有限公司关于参加光大证券股份有限公司费率优惠活动的公告         | 规定媒介 | 2022-07-08 |
| 25 | 富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2022年第2季度报告            | 规定媒介 | 2022-07-20 |
| 26 | 富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性                   | 规定媒介 | 2022-07-20 |



|    |   |      |            |
|----|---|------|------------|
|    | 公告  |      |            |
| 27 | 富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2022年中期报告                     | 规定媒介 | 2022-08-29 |
| 28 | 富安达基金管理有限公司旗下全部基金中期报告提示性公告                        | 规定媒介 | 2022-08-29 |
| 29 | 富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告 | 规定媒介 | 2022-08-31 |
| 30 | 富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告                          | 规定媒介 | 2022-09-14 |
| 31 | 富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加泰信财富基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告 | 规定媒介 | 2022-09-21 |
| 32 | 富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加九州证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告   | 规定媒介 | 2022-10-25 |
| 33 | 富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告                        | 规定媒介 | 2022-10-25 |
| 34 | 富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2022年第3季度报告                   | 规定媒介 | 2022-10-25 |
| 35 | 富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告                          | 规定媒介 | 2022-11-17 |
| 36 | 富安达基金管理有限公司关于开通交通银行借记卡“交                          | 规定媒介 | 2022-11-18 |

|    |   |      |            |
|----|---|------|------------|
|    | 行快捷”微信交易业务的公告                                       |      |            |
| 37 | 富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加兴业银行股份有限公司银银平台为销售机构并参与其费率优惠活动的公告 | 规定媒介 | 2022-11-25 |
| 38 | 富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告 | 规定媒介 | 2022-12-14 |
| 39 | 富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加五矿证券有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告       | 规定媒介 | 2022-12-23 |
| 40 | 富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告                            | 规定媒介 | 2022-12-27 |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |              |      | 报告期末持有基金情况 |              |        |
|-------|----------------|------------------------|--------------|------|------------|--------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额         | 申购份额 | 赎回份额       | 持有份额         | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 20220101-20221231      | 8,803,320.89 | 0.00 | 0.00       | 8,803,320.89 | 29.27% |

#### 产品特有风险

当持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大的冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。

注：

- ① "申购份额"包含份额申购、转换转入、红利再投等导致份额增加的情况；
- ② "赎回份额"包含份额赎回、转换转出等导致份额减少的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金设立的文件：  
《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；  
《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；  
《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 3、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 4、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

### 13.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.fadfunds.com](http://www.fadfunds.com)）查阅。

富安达基金管理有限公司  
二〇二三年三月三十日