

中欧医疗健康混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至2022年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	61
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	61
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	64
§9 开放式基金份额变动.....	64
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	69
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧医疗健康混合型证券投资基金	
基金简称	中欧医疗健康混合	
基金主代码	003095	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2016年09月29日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	25,814,175,416.86份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧医疗健康混合A	中欧医疗健康混合C
下属分级基金的交易代码	003095	003096
报告期末下属分级基金的份额总额	11,711,937,863.19份	14,102,237,553.67份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于医疗健康相关行业股票，在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。
业绩比较基准	65%×中证医药卫生指数收益率+35%×中证综合债券指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-33830351	(010) 66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区 陆家嘴环路479号8层	北京市西城区复兴门内大街5 5号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区 陆家嘴环路479号上海中心大 厦8层	北京市西城区复兴门内大街5 5号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		窦玉明	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴 环路479号8层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	中欧医疗健康混合 A	中欧医疗健康混合 C
本期已实现收益	-1,084,780,940.0 6	-1,508,161,940.2 3
本期利润	-3,401,696,477.8 2	-4,837,846,740.9 3
加权平均基金份额本期利润	-0.2925	-0.3324
本期加权平均净值利润率	-11.40%	-13.17%
本期基金份额净值增长率	-9.73%	-10.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	2,418,002,832.12	2,192,458,610.68
期末可供分配基金份额利润	0.2065	0.1555
期末基金资产净值	32,585,790,120.0 1	38,495,648,289.6 1
期末基金份额净值	2.782	2.730
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	206.08%	200.06%

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

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

3.2 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

中欧医疗健康混合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
过去一个月	13.74%	1.72%	7.71%	0.96%	6.03%	0.76%
过去三个月	4.86%	1.79%	0.09%	1.11%	4.77%	0.68%
过去六个月	-9.73%	1.91%	-8.25%	1.20%	-1.48%	0.71%
过去一年	-31.72%	2.04%	-19.77%	1.14%	-11.95%	0.90%
过去三年	102.84%	1.95%	24.40%	1.08%	78.44%	0.87%
自基金合同 生效起至今	206.08%	1.80%	27.70%	0.99%	178.38%	0.81%

注：本基金业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率*65%+中证综合债券指数收益率*35%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧医疗健康混合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
过去一个月	13.66%	1.72%	7.71%	0.96%	5.95%	0.76%
过去三个月	4.68%	1.79%	0.09%	1.11%	4.59%	0.68%
过去六个月	-10.08%	1.91%	-8.25%	1.20%	-1.83%	0.71%
过去一年	-32.25%	2.04%	-19.77%	1.14%	-12.48%	0.90%
过去三年	98.83%	1.94%	24.40%	1.08%	74.43%	0.86%
自基金合同 生效起至今	200.06%	1.80%	27.70%	0.99%	172.36%	0.81%

注：本基金业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率*65%+中证综合债券指数收益率*35%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧医疗健康混合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
(2016年09月29日-2022年06月30日)



中欧医疗健康混合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
(2016年09月29日-2022年06月30日)



§ 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

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份有限公司、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司以及自然人股东，注册资本为2.20亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。截至2022年6月30日，本基金管理人共管理130只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
葛兰	权益投决会委员/投资总监/基金经理/投资经理	2016-09-29	-	11年	历任国金证券研究所研究员，民生加银基金管理有限公司研究员。2014/10/08加入中欧基金管理有限公司，历任研究员。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

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

4.1.3 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
葛兰	公募基金	5	101,750,898,427.79	2015-01-29
	私募资产管理计划	2	750,532,296.84	2021-05-19
	其他组合	-	-	-
	合计	7	102,501,430,724.63	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有20次，为量化组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2022年上半年，国内疫情的反复对全行业都产生了较大的短期冲击，同时叠加海外经济增长的不确定性、流动性、地缘政治等宏观环境的复杂变化，医药生物板块整体出现了较为明显的震荡。

从基本面角度来看，医药生物板块也受到了疫情的较大影响，但截止至半年末我们认为大部分企业已经出现了较为显著的恢复。政策方面，国家层面的创新药谈判目录规则微调、仿制药方面第七批集采降幅也在历次集采的降幅区间范围内，我们仍然认为政策总体延续了稳健、积极的趋势，引导行业向有真正创新、有临床价值、提供高性价比产品及服务转变的导向没有变化。

在基金操作层面，在板块内部热点快速轮动的情况下，我们仍将坚持以企业的长期投资价值为投资导向。我们仍严格按照我们的投资框架进行个股选择，在长期看好的核

心创新药、创新器械，创新产业链，医疗服务以及消费性医疗等方向进行了着重布局。尤其是疫情短期冲击导致了部分公司出现了较大幅度调整，我们认为其中优秀的公司的长期增长驱动因素并未出现重大变化，也进行了相对积极的布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金A类份额净值增长率为-9.73%，同期业绩比较基准收益率为-8.25%；基金C类份额净值增长率为-10.08%，同期业绩比较基准收益率为-8.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为疫情反复、外围宏观环境动荡等因素难以短期彻底消除，但行业面对相关不确定性扰动的准备也更加充分，预计下半年仍将是震荡恢复的趋势。长期来看，我们认为医药行业的长期增长逻辑没有发生根本性的变化。创新相关的市场还远未触及国内市场的天花板，海外市场也在逐步蓄力中。具体到公司层面，企业转型创新的趋势仍在延续，创新药临床申请数量逐年创出新高。创新质量方面，近几年整体研发管线布局更加理性，资源向差异化方向倾斜，甚至有全球竞争力的创新品种诞生。从早期临床管线来看，一方面跟随海外最新技术的相关分子快速涌现，另一方面品种布局更加的多样化，而这些变化都有望促进创新的长期景气度得到维持。随着海外临床的逐步推进，预计我国创新产品也将在海外逐步进入收获期。此外，在销售层面，国内优秀企业销售合规性持续提升，更加趋向于临床价值导向，也更有利于公司长期稳定成长。与此同时，国内的创新药服务企业也逐步形成了有全球竞争力的产业集群，在部分细分领域达到了全球领先的水平，此外，我们认为相关服务商的竞争力更多的体现在平台的技术和管理能力，龙头企业的市占率大概率仍将持续提升，保持其较高的景气度。此外，伴随我国居民人均收入及认知水平快速提升，医疗服务以及消费性医疗的需求仍在快速增长且未得到充分满足，未来空间依然巨大。

整体而言，我们依然看好医药生物板块的中长期投资机会，但短期市场波动难以避免，本基金将继续努力为持有人创造长期投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、战略规划及业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而

对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以XBRL形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中欧医疗健康混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中欧医疗健康混合型证券投资基金的管理人——中欧基金管理有限公司在中欧医疗健康混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧医疗健康混合型证券投资基金2022年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧医疗健康混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,176,349,489.13	5,339,731,141.76
结算备付金		674,202,782.76	732,599,612.30
存出保证金		4,368,032.66	6,042,156.39
交易性金融资产	6.4.7.2	63,989,468,628.54	65,787,677,038.49
其中：股票投资		63,157,085,466.56	65,028,818,864.62
基金投资		-	-
债券投资		832,383,161.98	758,858,173.87
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	7,742,700,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		3,437,419,452.43	-
应收股利		-	-
应收申购款		247,690,961.51	213,610,924.56

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	1,317,142.76
资产总计		71,529,499,347.03	79,823,678,016.26
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		113,366,935.69	1,996,702,022.25
应付赎回款		212,120,479.13	167,957,417.86
应付管理人报酬		80,500,255.89	92,426,878.47
应付托管费		13,416,709.33	15,404,479.77
应付销售服务费		23,317,637.60	27,023,832.70
应付投资顾问费		-	-
应交税费		854.45	359.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	5,338,065.32	18,730,637.02
负债合计		448,060,937.41	2,318,245,627.08
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	25,814,175,416.86	25,364,358,251.39
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	45,267,262,992.76	52,141,074,137.79
净资产合计		71,081,438,409.62	77,505,432,389.18
负债和净资产总计		71,529,499,347.03	79,823,678,016.26

注：报告截止日2022年06月30日，基金份额总额25,814,175,416.86份。其中A类基金份额净值2.782元，基金份额总额11,711,937,863.19份；C类基金份额净值2.730元，基金份额总额14,102,237,553.67份。

6.2 利润表

会计主体：中欧医疗健康混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-7,514,667,818.5 2	8,852,682,879.11
1. 利息收入		88,014,754.08	9,099,523.75
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,181,134.02	5,544,536.77
债券利息收入		-	720,133.33
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		74,833,620.06	2,834,853.65
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-2,051,623,984.1 0	456,270,727.88
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,233,194,389.6 2	356,355,590.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	10,542,064.87	5,849,356.48
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	171,028,340.65	94,065,780.56
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-

其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-5,646,600,338.46	8,156,145,437.35
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	95,541,749.96	231,167,190.13
减：二、营业总支出		724,875,400.23	487,428,437.30
1. 管理人报酬		495,995,573.07	303,364,359.19
2. 托管费		82,665,928.92	50,560,726.56
3. 销售服务费		146,065,068.30	82,588,133.87
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		523.16	37.33
8. 其他费用	6.4.7.18	148,306.78	50,915,180.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,239,543,218.75	8,365,254,441.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,239,543,218.75	8,365,254,441.81
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,239,543,218.75	8,365,254,441.81

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧医疗健康混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	25,364,358,2 51.39	-	52,141,074,1 37.79	77,505,432,3 89.18
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)	25,364,358,2 51.39	-	52,141,074,1 37.79	77,505,432,3 89.18
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	449,817,165. 47	-	-6,873,811,1 45.03	-6,423,993,9 79.56
(一)、综合收益总额	-	-	-8,239,543,2 18.75	-8,239,543,2 18.75
(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)	449,817,165. 47	-	1,365,732,07 3.72	1,815,549,23 9.19
其中：1. 基金申购款	11,434,970,6 07.19	-	18,313,248,1 07.52	29,748,218,7 14.71
2. 基金赎回款	-10,985,153, 441.72	-	-16,947,516, 033.80	-27,932,669, 475.52
(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	25,814,175,4	-	45,267,262,9	71,081,438,4

(基金净值)	16.86		92.76	09.62
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收 益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	6,775,967,45 9.30	-	16,466,894,0 77.78	23,242,861,5 37.08
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)	6,775,967,45 9.30	-	16,466,894,0 77.78	23,242,861,5 37.08
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	5,277,178,64 9.27	-	21,977,682,4 15.72	27,254,861,0 64.99
(一)、综合收益总 额	-	-	8,365,254,44 1.81	8,365,254,44 1.81
(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)	5,277,178,64 9.27	-	13,894,851,6 61.90	19,172,030,3 11.17
其中：1. 基金申购款	18,692,066,3 82.52	-	49,949,627,0 81.71	68,641,693,4 64.23
2. 基金赎回 款	-13,414,887, 733.25	-	-36,054,775, 419.81	-49,469,663, 153.06
(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)	-	-	-282,423,68 7.99	-282,423,68 7.99
(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)	12,053,146.1 08.57	-	38,444,576.4 93.50	50,497,722.6 02.07
---------------------	-----------------------	---	-----------------------	-----------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧医疗健康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[2016]1031号文《关于准予中欧医疗健康混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中欧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《中欧医疗健康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。经向中国证监会备案,《中欧医疗健康混合型证券投资基金基金合同》于2016年9月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为209,326,535.44份基金份额,其中认购资金利息折合163,277.51基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中欧医疗健康混合型证券投资基金基金合同》和《中欧医疗健康混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,各类别基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2022年8月30日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、

《中欧医疗健康混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2022年06月30日的财务状况以及2022年01月01日至2022年06月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

除下文的会计政策与最近一期年度报告不一致以外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 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，分别采用以下两种方式进行计量：

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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以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衍生金融资产/负债。

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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.2 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；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。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。

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

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或资产支持证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。

6.4.4.3 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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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—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，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，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。

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、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款，金额分别为5,339,731,141.76元、732,599,612.30元、6,042,156.39元、7,742,700,000.00元、1,317,142.76元和213,610,924.56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、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别

为5,340,185,431.30元、732,962,249.08元、6,045,147.29元、7,740,314,133.97元、0.00元和213,610,924.56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65,787,677,038.49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65,790,560,130.06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、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为1,996,702,022.25元、167,957,417.86元、92,426,878.47元、15,404,479.77元、27,023,832.70元、18,354,927.77元和225,709.25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、应付销售服务费、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1,996,702,022.25元、167,957,417.86元、92,426,878.47元、15,404,479.77元、27,023,832.70元、18,354,927.77元和225,709.25元。

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

(b) 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>》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税

[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日	
	活期存款	3,176,349,489.13
等于：本金	3,175,887,463.36	
加：应计利息	462,025.77	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	3,176,349,489.13	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	68,262,854.56 5.28	-	63,157,085.46 6.56	-5,105,769.09 8.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	108,259,482.97	120,789,627.73	12,430,009.80
	银行间市	699,701,100.0	10,473,534.25	711,593,534.2

	场	0		5	
	合计	807,960,582.97	10,573,669.21	832,383,161.98	13,848,909.80
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	69,070,815,148.25	10,573,669.21	63,989,468,628.54	-5,091,920,188.92

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	483,245.00
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,714,221.69
其中：交易所市场	4,714,221.69
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用-审计费	74,383.76
预提费用-信息披露费	59,507.37
应付转出费	4,334.35
应付转出补差费	2,373.15
合计	5,338,065.32

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (中欧医疗健康混合A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	11,049,827,239.93	11,049,827,239.93
本期申购	4,103,023,754.32	4,103,023,754.32
本期赎回(以“-”号填列)	-3,440,913,131.06	-3,440,913,131.06
本期末	11,711,937,863.19	11,711,937,863.19

金额单位：人民币元

项目 (中欧医疗健康混合C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	14,314,531,011.46	14,314,531,011.46
本期申购	7,331,946,852.87	7,331,946,852.87
本期赎回(以“-”号填列)	-7,544,240,310.66	-7,544,240,310.66
本期末	14,102,237,553.67	14,102,237,553.67

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中欧医疗健康混合A

单位：人民币元

项目 (中欧医疗健康混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

本期期初	3,307,128,125.55	19,695,427,125.96	23,002,555,251.51
本期利润	-1,084,780,940.06	-2,316,915,537.76	-3,401,696,477.82
本期基金份额交易产生的变动数	195,655,646.63	1,077,337,836.50	1,272,993,483.13
其中：基金申购款	1,037,473,403.71	5,632,068,886.81	6,669,542,290.52
基金赎回款	-841,817,757.08	-4,554,731,050.31	-5,396,548,807.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,418,002,832.12	18,455,849,424.70	20,873,852,256.82

6.4.7.8.2 中欧医疗健康混合C

单位：人民币元

项目 (中欧医疗健康混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,676,228,731.21	25,462,290,155.07	29,138,518,886.28
本期利润	-1,508,161,940.23	-3,329,684,800.70	-4,837,846,740.93
本期基金份额交易产生的变动数	24,391,819.70	68,346,770.89	92,738,590.59
其中：基金申购款	1,522,612,173.22	10,121,093,643.78	11,643,705,817.00
基金赎回款	-1,498,220,353.52	-10,052,746,872.89	-11,550,967,226.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,192,458,610.68	22,200,952,125.26	24,393,410,735.94

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	6,670,234.95
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	6,463,331.11
其他	47,567.96
合计	13,181,134.02

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	3,707,710,714.08
减：卖出股票成本总额	5,925,768,075.70
减：交易费用	15,137,028.00
买卖股票差价收入	-2,233,194,389.62

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	7,851,476.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,690,588.48
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	10,542,064.87

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,460,939.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,767,000.00
减：应计利息总额	3,339.51
减：交易费用	11.51
买卖债券差价收入	2,690,588.48

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	171,028,340.65
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	171,028,340.65

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-5,646,600,338.46
——股票投资	-5,657,709,657.36

——债券投资	11,109,318.90
——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	-5,646,600,338.46

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	95,232,158.85
转换费收入	309,591.11
合计	95,541,749.96

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	74,383.76
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	5,415.65
账户维护费	9,000.00

合计	148,306.78
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，未发生重大关联方关系变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
自然人股东	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
国都证券	434,441,244.25	3.24%	2,366,852,105.50	6.05%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
国都证券	-	-	1,229,589.32	0.59%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
国都证券	32,500,000,000.00	4.14%	-	-

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
国都证券	317,707.20	3.10%	317,677.57	6.74%

关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	2,204,251.32	6.05%	900,227.11	5.48%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	495,995,573.07	303,364,359.19
其中：支付销售机构的客户维护费	202,536,932.18	125,996,295.45

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	82,665,928.92	50,560,726.56

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧医疗健康混合A	中欧医疗健康混合C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	1,047,418.01	1,047,418.01
国都证券	0.00	4,547.15	4,547.15
中欧基金	0.00	482,377.24	482,377.24
合计	-	1,534,342.40	1,534,342.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧医疗健康混合A	中欧医疗健康混合C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	956,190.52	956,190.52
国都证券	0.00	5,564.58	5,564.58
中欧基金	0.00	563,525.98	563,525.98
合计	0.00	1,525,281.08	1,525,281.08

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.80%，销售服务费按前一日C类基金份额的资产净值0.80%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧医疗健康混合A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	5,114,226.14
报告期间申购/买入总份额	9,707,178.97	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	5,114,226.14
报告期末持有的基金份额	9,707,178.97	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.08%	0.00%

中欧医疗健康混合C

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年06月30日
----	-----------------------------------	--

报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注： 1、申购总份额含红利再投、转换入份额，赎回总份额含转换出份额。
2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧医疗健康混合A

关联方名称	本期末 2022年06月30日		上年度末 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
自然人股东	1,990,028.29	0.02%	1,781,727.91	0.02%

中欧医疗健康混合C

关联方名称	本期末 2022年06月30日		上年度末 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
自然人股东	1,679.26	0.00%	1,679.26	0.00%

注：

- 1、截止本报告期末，本基金除管理人之外的其他关联方持有本基金C类份额的比例为0.000012%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。
- 2、截止上年度末，本基金除管理人之外的其他关联方持有本基金C类份额的比例为

0.000012%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。

3、本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	3,176,349,489.13	6,670,234.95	2,651,348,874.98	4,831,635.83

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688234	天岳先进	2022-01-05	6个月以上	新股流通受限	82.79	65.19	6,759	559,577.61	440,619.21	-

688400	凌云光	2022-06-27	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-
688119	中钢洛耐	2022-05-27	6个月以上	新股流通受限	5.06	7.01	33,327	168,634.62	233,622.27	-
301139	元道通信	2022-06-30	1个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
688282	理工导航	2022-03-10	6个月以上	新股流通受限	65.21	45.37	3,185	207,693.85	144,503.45	-
688259	创耀科技	2022-01-05	6个月以上	新股流通受限	66.60	79.22	1,595	106,227.00	126,355.90	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月以上	新股流通受限	48.59	31.38	2,076	100,865.92	65,144.88	-
688171	纬德信息	2022-01-20	6个月以上	新股流通受限	28.68	22.77	2,821	80,906.28	64,234.17	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月以上	新股流通受限	17.27	14.83	4,284	73,984.68	63,531.72	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月以上	新股流通受限	96.62	87.82	578	55,847.58	50,759.96	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月以上	新股流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-

301206	三元生物	2022-01-26	6个月以上	新股流通受限	72.87	45.69	945	68,859.00	43,177.05	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6个月以上	新股流通受限	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301201	诚达药业	2022-01-12	6个月以上	新股流通受限	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-
301266	宇邦新材	2022-05-30	6个月以上	新股流通受限	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个月以上	新股流通受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月以上	新股流通受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月以上	新股流通受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月以上	新股流通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6个月以上	新股流通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月以上	新股流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6个月以上	新股流通受限	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-

3012 35	华康 医疗	2022 -01- 21	6个月以 上	新股 流通 受限	39.3 0	37.9 3	418	16,4 27.4 0	15,8 54.7 4	-
3011 60	翔楼 新材	2022 -05- 25	6个月以 上	新股 流通 受限	31.5 6	37.6 6	392	12,3 71.5 2	14,7 62.7 2	-
3011 17	佳缘 科技	2022 -01- 07	6个月以 上	新股 流通 受限	46.8 0	54.4 4	262	12,2 61.6 0	14,2 63.2 8	-
3012 98	东利 机械	2022 -05- 27	6个月以 上	新股 流通 受限	12.6 8	20.8 3	634	8,03 9.12	13,2 06.2 2	-
3012 58	富士 莱	2022 -03- 21	6个月以 上	新股 流通 受限	48.3 0	41.6 8	295	14,2 48.5 0	12,2 95.6 0	-
3011 16	益客 食品	2022 -01- 10	6个月以 上	新股 流通 受限	11.4 0	20.4 6	577	6,57 7.80	11,8 05.4 2	-
3012 20	亚香 股份	2022 -06- 15	6个月以 上	新股 流通 受限	35.9 8	39.1 5	285	10,2 54.3 0	11,1 57.7 5	-
3012 37	和顺 科技	2022 -03- 16	6个月以 上	新股 流通 受限	56.6 9	41.8 6	261	14,7 96.0 9	10,9 25.4 6	-
3011 37	哈焊 华通	2022 -03- 14	6个月以 上	新股 流通 受限	15.3 7	15.9 9	644	9,89 8.28	10,2 97.5 6	-
3011 96	唯科 科技	2022 -01- 04	6个月以 上	新股 流通 受限	64.0 8	37.5 2	271	17,3 65.6 8	10,1 67.9 2	-
3012 22	浙江 恒威	2022 -03- 02	6个月以 上	新股 流通 受限	33.9 8	28.9 6	332	11,2 81.3 6	9,61 4.72	-

3011 25	腾亚 精工	2022 -05- 27	6个月以 上	新股 流通 受限	22.4 9	27.4 2	327	7,35 4.23	8,96 6.34	-
3011 10	青木 股份	2022 -03- 04	6个月以 上	新股 流通 受限	63.1 0	39.8 5	202	12,7 46.2 0	8,04 9.70	-
3011 81	标榜 股份	2022 -02- 11	6个月以 上	新股 流通 受限	40.2 5	30.5 9	257	10,3 44.2 5	7,86 1.63	-
3012 33	盛帮 股份	2022 -06- 24	6个月以 上	新股 流通 受限	41.5 2	41.5 2	158	6,56 0.16	6,56 0.16	-

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金无因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。

6.4.12.4 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融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金主要投资于医疗健康相关行业股票，在有效控制投资组合风险的前提下，

通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监

测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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%。本基金的基金管理人管理的所有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%。除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于2022年06月30日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行的上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注6.4.12披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,176,349,489.13	-	-	-	3,176,349,489.13
结算备付金	674,202,782.76	-	-	-	674,202,782.76
存出保证金	4,368,032.66	-	-	-	4,368,032.66
交易性金融资产	711,593,534.25	48,331,442.05	72,458,185.68	63,157,085,466.56	63,989,468,628.54
应收清算款	-	-	-	3,437,419,452.43	3,437,419,452.43
应收申购款	-	-	-	247,690,961.51	247,690,961.51
资产总计	4,566,513,838.80	48,331,442.05	72,458,185.68	66,842,195,880.50	71,529,499,347.03
负债					
应付清算款	-	-	-	113,366,935.69	113,366,935.69
应付赎回款	-	-	-	212,120,479.13	212,120,479.13
应付管理人报酬	-	-	-	80,500,255.89	80,500,255.89
应付托管费	-	-	-	13,416,709.33	13,416,709.33
应付销售服务费	-	-	-	23,317,637.60	23,317,637.60
应交税费	-	-	-	854.45	854.45
其他负债	-	-	-	5,338,065.32	5,338,065.32
负债总计	-	-	-	448,060,937.41	448,060,937.41
利率敏感度缺口	4,566,513,838.80	48,331,442.05	72,458,185.68	66,394,134,943.09	71,081,438,409.62
上年度末 2021年1	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2月31日					
资产					
银行存款	5,339,731,141.76	-	-	-	5,339,731,141.76
结算备付金	732,599,612.30	-	-	-	732,599,612.30
存出保证金	6,042,156.39	-	-	-	6,042,156.39
交易性金融资产	700,280,000.00	-	58,578,173.87	65,028,818,864.62	65,787,677,038.49
买入返售金融资产	7,742,700,000.00	-	-	-	7,742,700,000.00
应收利息	-	-	-	1,317,142.76	1,317,142.76
应收申购款	-	-	-	213,610,924.56	213,610,924.56
资产总计	14,521,352,910.45	-	58,578,173.87	65,243,746,931.94	79,823,678,016.26
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,996,702,022.25	1,996,702,022.25
应付赎回款	-	-	-	167,957,417.86	167,957,417.86
应付管理人报酬	-	-	-	92,426,878.47	92,426,878.47
应付托管费	-	-	-	15,404,479.77	15,404,479.77
应付销售服务费	-	-	-	27,023,832.70	27,023,832.70
应付交易费用	-	-	-	18,354,927.77	18,354,927.77
应交税费	-	-	-	359.01	359.01
其他负债	-	-	-	375,709.25	375,709.25
负债总计	-	-	-	2,318,245,627.08	2,318,245,627.08
利率敏感度缺口	14,521,352,910.45	-	58,578,173.87	62,925,501,304.86	77,505,432,389.18

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年06月30日本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为1.17% (2021年12月31日:0.98%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2021年12月31日: 同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	63,157,085,466.56	88.85	65,028,818,864.62	83.90
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产 — 权证投资		-	-	-
其他		-	-	-
合计	63,157,085,466.56	88.85	65,028,818,864.62	83.90

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	5,236,313,367.20	6,878,373,966.61
	2. 业绩比较基准下降5%	-5,236,313,367.20	-6,878,373,966.61

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	63,275,679,085.93	65,083,796,877.74
第二层次	712,163,831.46	701,533,239.55
第三层次	1,625,711.15	2,346,921.20
合计	63,989,468,628.54	65,787,677,038.49

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	63,157,085,466.56	88.30
	其中：股票	63,157,085,466.56	88.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	832,383,161.98	1.16
	其中：债券	832,383,161.98	1.16
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	3,850,552,271.89	5.38
8	其他各项资产	3,689,478,446.60	5.16
9	合计	71,529,499,347.03	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	30,976,243,699.70	43.58
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	2,141,786,373.28	3.01
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	495,385.39	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	20,097,878,314.61	28.27
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	9,940,661,733.80	13.98
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	63,157,085,466.56	88.85

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300015	爱尔眼科	160,534,595	7,187,133,818.15	10.11
2	603259	药明康德	61,227,924	6,367,091,816.76	8.96
3	300759	康龙化成	48,511,773	4,619,291,025.06	6.50
4	300760	迈瑞医疗	13,740,185	4,303,425,942.00	6.05
5	300347	泰格医药	36,716,074	4,202,154,669.30	5.91
6	002821	凯莱英	11,987,613	3,464,420,157.00	4.87
7	600436	片仔癀	8,215,104	2,930,574,049.92	4.12
8	600085	同仁堂	52,964,533	2,800,764,505.04	3.94
9	600763	通策医疗	15,711,313	2,740,681,439.72	3.86
10	603456	九洲药业	40,737,316	2,106,119,237.20	2.96
11	300363	博腾股份	26,660,397	2,079,244,362.03	2.93
12	300595	欧普康视	31,918,919	1,825,442,977.61	2.57

13	603127	昭衍新药	15,675,143	1,783,831,273.40	2.51
14	000963	华东医药	36,180,052	1,633,891,148.32	2.30
15	300122	智飞生物	14,041,891	1,558,790,319.91	2.19
16	688202	美迪西	4,247,793	1,442,592,980.73	2.03
17	300357	我武生物	25,655,523	1,334,856,861.69	1.88
18	600276	恒瑞医药	30,562,264	1,133,554,371.76	1.59
19	300725	药石科技	9,002,537	891,161,137.63	1.25
20	300630	普利制药	21,409,189	752,532,993.35	1.06
21	600521	华海药业	29,094,282	660,440,201.40	0.93
22	688050	爱博医疗	2,808,428	629,649,557.60	0.89
23	603392	万泰生物	3,146,333	488,625,514.90	0.69
24	600161	天坛生物	20,035,094	486,452,082.32	0.68
25	603939	益丰药房	8,899,047	470,136,653.01	0.66
26	300294	博雅生物	12,999,999	467,349,964.05	0.66
27	605369	拱东医疗	3,413,298	423,931,611.60	0.60
28	301080	百普赛斯	2,407,591	401,802,861.99	0.57
29	000661	长春高新	1,602,240	373,994,860.80	0.53
30	000999	华润三九	7,117,988	320,309,460.00	0.45
31	000538	云南白药	5,210,443	314,658,652.77	0.44
32	688131	皓元医药	1,754,215	249,256,409.35	0.35
33	688179	阿拉丁	4,858,761	248,962,913.64	0.35
34	688690	纳微科技	2,983,013	241,057,280.53	0.34
35	688212	澳华内镜	4,126,102	193,101,573.60	0.27
36	688046	药康生物	6,401,848	187,574,146.40	0.26
37	688265	南模生物	2,742,693	175,614,632.79	0.25

38	688105	诺唯赞	2,001,987	169,968,696.30	0.24
39	688301	奕瑞科技	297,491	140,725,142.64	0.20
40	688315	诺禾致源	4,111,071	105,942,299.67	0.15
41	603301	振德医疗	2,167,622	91,148,505.10	0.13
42	688356	键凯科技	303,427	73,371,682.87	0.10
43	301096	百诚医药	927,950	73,308,050.00	0.10
44	603987	康德莱	3,279,325	65,356,947.25	0.09
45	600587	新华医疗	3,187,252	64,541,853.00	0.09
46	301122	采纳股份	870,870	63,590,927.40	0.09
47	688029	南微医学	722,484	63,000,604.80	0.09
48	688133	泰坦科技	340,519	60,149,276.16	0.08
49	300896	爱美客	94,857	56,915,148.57	0.08
50	300412	迦南科技	7,985,050	54,218,489.50	0.08
51	600566	济川药业	1,956,500	53,138,540.00	0.07
52	002675	东诚药业	3,853,593	52,023,505.50	0.07
53	688235	百济神州	517,947	51,447,675.51	0.07
54	688617	惠泰医疗	209,051	45,798,893.08	0.06
55	688677	海泰新光	467,910	43,043,040.90	0.06
56	603707	健友股份	1,409,682	39,753,032.40	0.06
57	600976	健民集团	738,193	37,758,571.95	0.05
58	300171	东富龙	1,032,151	35,000,240.41	0.05
59	300702	天宇股份	1,023,246	29,070,418.86	0.04
60	601567	三星医疗	2,121,500	28,173,520.00	0.04
61	300298	三诺生物	891,133	25,040,837.30	0.04
62	300633	开立医疗	708,500	21,276,255.00	0.03
63	002603	以岭药业	856,613	20,815,695.90	0.03
64	300685	艾德生物	560,994	17,951,808.00	0.03
65	002007	华兰生物	597,753	13,628,768.40	0.02
66	300832	新产业	298,797	13,478,732.67	0.02
67	000516	国际医学	896,289	9,688,884.09	0.01
68	300482	万孚生物	126,553	5,151,972.63	0.01

69	300957	贝泰妮	23,009	5,005,147.77	0.01
70	688222	成都先导	246,912	3,940,715.52	0.01
71	301047	义翘神州	27,360	3,549,412.80	0.00
72	603520	司太立	121,209	3,408,397.08	0.00
73	603882	金域医学	38,054	3,141,357.70	0.00
74	600079	人福医药	177,878	2,846,048.00	0.00
75	300149	睿智医药	251,000	2,831,280.00	0.00
76	688166	博瑞医药	103,469	2,498,776.35	0.00
77	300601	康泰生物	54,586	2,466,195.48	0.00
78	688314	康拓医疗	49,406	2,398,661.30	0.00
79	688032	禾迈股份	2,534	2,207,114.00	0.00
80	688016	心脉医疗	8,380	1,632,507.80	0.00
81	688185	康希诺	7,857	1,564,171.56	0.00
82	300558	贝达药业	13,300	808,640.00	0.00
83	688075	安旭生物	4,177	731,016.77	0.00
84	688366	昊海生科	6,625	700,792.50	0.00
85	688234	天岳先进	6,759	440,619.21	0.00
86	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.00
87	688119	中钢洛耐	33,327	233,622.27	0.00
88	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.00
89	688282	理工导航	3,185	144,503.45	0.00
90	688259	创耀科技	1,595	126,355.90	0.00
91	688772	珠海冠宇	2,405	73,833.50	0.00
92	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
93	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
94	688171	纬德信息	2,821	64,234.17	0.00
95	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
96	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
97	688167	炬光科技	320	47,600.00	0.00
98	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
99	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00

100	300142	沃森生物	777	37,599.03	0.00
101	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
102	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
103	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
104	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
105	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
106	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
107	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
108	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
109	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
110	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
111	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
112	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
113	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
114	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
115	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
116	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
117	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
118	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
119	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
120	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
121	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
122	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
123	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
124	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
125	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
126	300677	英科医疗	22	557.92	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600085	同仁堂	1,441,291,047.79	1.86
2	000963	华东医药	1,240,663,097.99	1.60
3	300015	爱尔眼科	683,209,921.56	0.88
4	300760	迈瑞医疗	617,968,460.79	0.80
5	603259	药明康德	490,344,596.48	0.63
6	300595	欧普康视	350,543,938.52	0.45
7	600161	天坛生物	344,794,875.52	0.44
8	605369	拱东医疗	328,860,577.25	0.42
9	300294	博雅生物	323,138,139.38	0.42
10	000999	华润三九	296,486,173.27	0.38
11	688050	爱博医疗	266,900,820.51	0.34
12	603392	万泰生物	253,074,210.95	0.33
13	600521	华海药业	250,362,967.93	0.32
14	600276	恒瑞医药	204,930,683.15	0.26
15	300702	天宇股份	175,105,353.15	0.23
16	688046	药康生物	155,857,629.85	0.20
17	688690	纳微科技	132,224,632.38	0.17
18	600976	健民集团	131,287,137.08	0.17
19	688131	皓元医药	129,351,549.79	0.17
20	688301	奕瑞科技	125,958,542.81	0.16

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603259	药明康德	1,029,871,184.91	1.33
2	000661	长春高新	736,021,376.68	0.95
3	600276	恒瑞医药	255,521,725.27	0.33

4	300595	欧普康视	218,904,644.65	0.28
5	600976	健民集团	169,472,154.56	0.22
6	603392	万泰生物	125,385,322.43	0.16
7	300702	天宇股份	117,822,416.81	0.15
8	600587	新华医疗	107,767,849.36	0.14
9	300122	智飞生物	84,383,587.60	0.11
10	688050	爱博医疗	73,289,540.73	0.09
11	300725	药石科技	69,098,670.78	0.09
12	000516	国际医学	68,447,385.75	0.09
13	603301	振德医疗	68,153,757.62	0.09
14	000538	云南白药	61,069,218.10	0.08
15	688029	南微医学	51,077,207.43	0.07
16	002453	华软科技	46,392,365.88	0.06
17	603707	健友股份	42,491,227.84	0.05
18	300412	迦南科技	41,285,797.70	0.05
19	301166	优宁维	40,724,409.88	0.05
20	603351	威尔药业	37,348,340.09	0.05

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,711,744,335.00
卖出股票收入（成交）总额	3,707,710,714.08

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	711,593,534.25	1.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	120,789,627.73	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	832,383,161.98	1.17

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	210016	21付息国债16	7,000,000	711,593,534.25	1.00
2	123145	药石转债	518,420	72,458,185.68	0.10
3	123099	普利转债	404,797	48,331,442.05	0.07

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,368,032.66
2	应收清算款	3,437,419,452.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	247,690,961.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,689,478,446.60

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123099	普利转债	48,331,442.05	0.07

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧医疗健康混合A	2,848,329	4,111.86	75,672,945.05	0.65%	11,636,264,918.14	99.35%
中欧医疗健康混合C	4,417,776	3,192.16	7,468,540.39	0.05%	14,094,769,013.28	99.95%
合计	7,266,105	3,552.68	83,141,485.44	0.32%	25,731,033,931.42	99.68%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧医疗健康混合A	4,566,439.68	0.04%
	中欧医疗健康混合C	240,424.83	0.00%

	合计	4,806,864.51	0.02%
--	----	--------------	-------

注：截至本报告期末，管理人的从业人员持有本基金C份额占总份额实际比例为0.0017%，上表持有份额比例为四舍五入结果。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧医疗健康混合A	>100
	中欧医疗健康混合C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧医疗健康混合A	50~100
	中欧医疗健康混合C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧医疗健康混合A	中欧医疗健康混合C
基金合同生效日(2016年09月29日)基金份额总额	163,142,177.19	46,184,358.25
本报告期期初基金份额总额	11,049,827,239.93	14,314,531,011.46
本报告期基金总申购份额	4,103,023,754.32	7,331,946,852.87
减：本报告期基金总赎回份额	3,440,913,131.06	7,544,240,310.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,711,937,863.19	14,102,237,553.67

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内基金管理人未发生重大的人事变动。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	811,460,702.48	6.05%	593,421.74	5.80%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	1,188,592,285.76	8.87%	869,224.49	8.49%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	60,678,569.41	0.45%	44,374.76	0.43%	-
海通证券	1	886,874,884.73	6.62%	648,571.04	6.34%	-
华创证券	1	1,102,208,048.56	8.22%	806,053.68	7.87%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	2,222,189,569.78	16.58%	1,625,092.88	15.88%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	72,082,104.05	0.54%	52,713.75	0.51%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	2,231,154,818.07	16.65%	1,631,647.89	15.94%	-
中金公司	1	1,036,905,307.03	7.74%	758,317.44	7.41%	-
中信证券	1	2,174,360,407.54	16.22%	2,024,948.80	19.78%	-

德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	2	434,441,244.25	3.24%	317,707.20	3.10%	-
民生证券	2	326,055,220.06	2.43%	238,442.65	2.33%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	553,796,692.45	4.13%	404,985.21	3.96%	-
华泰证券	2	301,481,718.31	2.25%	220,474.35	2.15%	-

注：1. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

2. 本报告期内，本基金减少华泰证券上海和中信证券（华南）深圳交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证	-	-	61,700,000.00	7.85%	-	-	-	-

券			0.00						
国金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	39,400,900.00	5.02%	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	6,913,157,000.00	0.88%	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	176,881,917,000.00	22.52%	-	-	-	-	-
中金公 司	12,460,939.50	100.00%	121,960,000,000.00	15.53%	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	95,943,900,000.00	12.21%	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	32,500,000,000.00	4.14%	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	98,000,000,000.00	12.48%	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	152,217,700,000.00	19.38%	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

2. 本报告期内，本基金减少华泰证券上海和中信证券（华南）深圳交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧医疗健康混合型证券投资基金2021年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2022-01-22
2	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2022-01-22
3	中欧基金管理有限公司及基金经理拟申购旗下医疗主题基金的公告	中国证监会指定媒介	2022-01-26
4	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2022-03-31
5	中欧医疗健康混合型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会指定媒介	2022-03-31
6	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2022年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2022-04-22
7	中欧医疗健康混合型证券投资基金2022年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2022-04-22
8	中欧医疗健康混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2022-05-27

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息**11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中欧医疗健康混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧医疗健康混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧医疗健康混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧医疗健康混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人及基金托管人的住所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话:021-68609700,400-700-9700

中欧基金管理有限公司
二〇二二年八月三十一日