

# 创金合信全球医药生物股票型发起式 证券投资基金（QDII）2024 年中期报 告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

### 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	3
2.1 基金基本情况.....	3
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§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.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	41
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	41
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	41
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	53

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	53
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 ..	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	53
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	54
7.12 投资组合报告附注 .....	54
§8 基金份额持有人信息 .....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
8.4 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况 .....	56
§9 开放式基金份额变动 .....	56
§10 重大事件揭示 .....	57
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4 基金投资策略的改变 .....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
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 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
§12 备查文件目录 .....	60
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金（QDII）
基金简称	创金合信全球医药生物股票发起（QDII）
基金主代码	018155
交易代码	018155
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 17 日
基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	宁波银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	12,509,110.92 份

基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信全球医药生物股票发起（QDII）A	创金合信全球医药生物股票发起（QDII）C
下属分级基金的交易代码	018155	018156
报告期末下属分级基金的份额总额	6,200,098.26 份	6,309,012.66 份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要精选全球医药生物相关证券，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过"自上而下"与"自下而上"相结合的主动投资管理策略，综合考虑宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，评估股票、债券、货币市场工具及金融衍生品等大类资产的估值水平和投资价值，形成对大类资产预期收益及风险的判断，持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。</p> <p>2、国别/地区配置策略</p> <p>在进行国别/地区配置时，本基金可参考以下因素：（1）基金管理人对相关国家或地区医疗行业投资价值的判断；（2）相关国家或地区政治经济因素，包括政治局势、经济状况、货币政策、财政政策、贸易差额、贸易结构、产业结构、利率走势、汇率走势、金融市场风险预期及大宗商品价格趋势和国际经济周期对经济的影响等。（3）基金管理人对相关国家或地区的相对估值水平的判断。</p>
业绩比较基准	MSCI 全球医疗保健指数收益率（经估值汇率调整）*60%+申万医药生物行业指数收益率*25%+中债总指数收益率*15%
风险收益特征	<p>本基金为股票型证券投资基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。</p> <p>本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p> <p>本基金可通过港股通机制投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

## 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	创金合信基金管理有限公司	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田
	联系电话	0755-82820166
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com
客户服务电话	400-868-0666	0574-83895886

传真	0755-25832571	0574-89103213
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
办公地址	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
邮政编码	518052	315100
法定代表人	钱龙海	陆华裕

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问	境外资产托管人
名称	中文	- 北美信托银行
	英文	- The NorthernTrust Company
注册地址	-	美国伊利诺伊州芝加哥南拉萨尔街 50 号
办公地址	-	美国伊利诺伊州芝加哥南拉萨尔街 50 号
邮政编码	-	60603

## 2.5 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.cjhxfund.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

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

##### 1、创金合信全球医药生物股票发起（QDII）A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-136,743.19
本期利润	-40,727.92
加权平均基金份额本期利润	-0.0068
本期加权平均净值利润率	-0.68%
本期基金份额净值增长率	-0.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-187,031.44
期末可供分配基金份额利润	-0.0302
期末基金资产净值	6,226,617.30
期末基金份额净值	1.0043
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.43%

##### 2、创金合信全球医药生物股票发起（QDII）C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-165,851.21
本期利润	-67,234.39
加权平均基金份额本期利润	-0.0108
本期加权平均净值利润率	-1.07%
本期基金份额净值增长率	-0.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-209,448.45
期末可供分配基金份额利润	-0.0332
期末基金资产净值	6,316,513.89
期末基金份额净值	1.0012
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.12%

注：1. 上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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3. 期末可供分配利润是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。

4. 本基金合同生效日为 2023 年 11 月 17 日, 无上年度可比期间。

### 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

创金合信全球医药生物股票发起（QDII）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	0.59%	0.42%	-0.88%	0.28%	1.47%	0.14%
过去三个月	-2.04%	0.70%	-2.16%	0.49%	0.12%	0.21%
过去六个月	-0.57%	0.59%	-1.07%	0.52%	0.50%	0.07%
自基金合同生效起至今	0.43%	0.53%	1.60%	0.50%	-1.17%	0.03%

创金合信全球医药生物股票发起（QDII）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	0.55%	0.42%	-0.88%	0.28%	1.43%	0.14%
过去三个月	-2.16%	0.70%	-2.16%	0.49%	0.00%	0.21%
过去六个月	-0.82%	0.59%	-1.07%	0.52%	0.25%	0.07%
自基金合同生效起至今	0.12%	0.54%	1.60%	0.50%	-1.48%	0.04%

#### 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

创金合信全球医药生物股票发起（QDII）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

(2023年11月17日-2024年06月30日)



创金合信全球医药生物股票发起（QDII）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

(2023年11月17日-2024年06月30日)



注：1、本基金合同于 2023 年 11 月 17 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于 2014 年 7 月 2 日获得中国证监会核准设立的批复，2014 年 7 月 9 日成立，注册地为深圳市。目前创金合信基金注册资本为 26,096 万元人民币，第一创业证券股份有限公司出资比例为 51.072961%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 23.287094%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.47195%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.160791%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 3.490956%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 3.969957%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.910331%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.63596%。

创金合信基金始终坚持“客户利益至上”，做客户投资理财的亲密伙伴。

#### 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		
毛丁丁	本基金基金经理	2023 年 11 月 24 日	-	8	毛丁丁先生，中国国籍，北京大学硕士。2015 年 7 月加入广发证券资产管理（广东）有限公司，任权益产品部行业研究员，2020 年 12 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任行业投资研究部研究员、基金经理助理，现任基金经理。
皮劲松	本基金基金经理	2023 年 11 月 17 日	-	12	皮劲松先生，中国国籍，中国药科大学硕士。2009 年 9 月至 2012 年 4 月先后任职于中药固体制剂国家工程中心、上海药明康德新药开发有限公司从事技术开发工作，2012 年 4 月加入东莞证券有限责任公司，任研究所研究员，2014 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任研究员、投资经理，现任基金经理、兼任投资经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任日期、后任基金经理的任职日期指公司作出决定的日期；

2、证券从业年限的含义遵从《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
皮劲松	公募基金	5	821,703,085.75	2018-10-31
	私募资产管理计划	1	1,001,084,805.29	2024-02-06

	其他组合	-	-	-
	合计	6	1,822,787,891.04	-

## 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

## 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

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。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，美股、A 股和港股医疗板块走势明显分化，申万医药生物指数下跌 21.09%，恒生医疗保健指数下跌 27.60%，纳斯达克生物技术指数上涨 4.00%。AH 医疗板块下跌幅度较大，主要与国内医药行业深化改革阵痛期、美国生物安全法案等因素有关；美股医疗板块整体平稳略有上涨，主要与公司基本面相关，阶段性受到市场降息预期波动的影响。

2024 年上半年本基金按照合同要求逐步完成建仓。结构上，美股主要配置了具备全球领先优势的制药和医疗器械龙头公司，同时适当参与了部分有重要研发进展的 biotech 公

司；A 股和港股市场主要配置了创新药、医疗器械等细分领域中悲观因素消化相对充分、公司未来成长性空间较大的部分个股。后续投资思路方面，美股我们继续关注有新产品驱动业绩预期的公司，同时关注市场的降息预期交易，适时调整美股仓位；A 股我们继续从个股角度出发，综合赔率和胜率进行个股的筛选和配置。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信全球医药生物股票发起（QDII）A 基金份额净值为 1.0043 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.57%，同期业绩比较基准收益率为-1.07%；截至本报告期末创金合信全球医药生物股票发起（QDII）C 基金份额净值为 1.0012 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.82%，同期业绩比较基准收益率为-1.07%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年及以后，在美股，宏观方面关注美联储的降息节奏及市场预期的演绎，但更多还是关注行业及公司的基本面运行情况，关注新兴的靶点、技术和疗法；在 A 股和港股市场，基于医保基金中长期的强约束机制，更多关注当前政策鼓励或者与政策关联度不高的创新药、器械、医疗设备、出海等方向。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

#### 4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

## § 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，本托管人在创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金(QDII)(以下称“本基金”)的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、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：创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金（QDII）

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,170,150.97	10,181,193.70
结算备付金		47,673.18	4,388.59
存出保证金		13,706.88	2,856.13
交易性金融资产	6.4.7.2	10,802,041.09	3,409,976.94
其中：股票投资		10,802,041.09	3,409,976.94
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		2,271.95	-
应收申购款		14,477.86	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		13,050,321.93	13,598,415.36
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		344,992.05	1,118,507.72
应付赎回款		107,383.73	-
应付管理人报酬		15,599.24	15,709.85
应付托管费		2,599.87	2,618.31
应付销售服务费		2,618.11	2,967.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	33,997.74	3,153.10
负债合计		507,190.74	1,142,956.91
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	12,509,110.92	12,334,606.77
其他综合收益		-	-
未分配利润		34,020.27	120,851.68
净资产合计		12,543,131.19	12,455,458.45
负债和净资产总计		13,050,321.93	13,598,415.36

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，创金合信全球医药生物股票发起（QDII）A 份额净值 1.0043 元，基金份额总额 6,200,098.26 份；创金合信全球医药生物股票发起（QDII）C 份额净值 1.0012 元，基金份额总额 6,309,012.66 份；总份额合计 12,509,110.92 份。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金（QDII）

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2024年1月1日至 2024年6月30日
一、营业总收入		24,059.18
1.利息收入		23,940.73
其中：存款利息收入	6.4.7.9	23,940.73
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-117,467.31
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-152,401.91
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	34,934.60
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）	6.4.7.17	194,632.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-79,115.16
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,068.83
减：二、营业总支出		132,021.49
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	91,017.58
其中：暂估管理人报酬		-
2.托管费	6.4.10.2.2	15,169.64
3.销售服务费	6.4.10.2.3	15,491.74
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	6.4.7.19	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.20	10,342.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-107,962.31
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-107,962.31
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-107,962.31

注：本基金合同生效日为 2023 年 11 月 17 日，无上年度可比期间。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金（QDII）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	12,334,606.77	-	120,851.68	12,455,458.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	12,334,606.77	-	120,851.68	12,455,458.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	174,504.15	-	-86,831.41	87,672.74
（一）、综合收益总额	-	-	-107,962.31	-107,962.31
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	174,504.15	-	21,130.90	195,635.05
其中：1.基金申购款	2,090,695.96	-	21,907.36	2,112,603.32
2.基金赎回	-1,916,191.81	-	-776.46	-1,916,968.27

回款				
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	12,509,110.92	-	34,020.27	12,543,131.19

注：本基金合同生效日为 2023 年 11 月 17 日，无上年度可比期间。

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：

\_\_\_\_苏彦祝\_\_\_\_                      \_\_\_\_奚胜田\_\_\_\_                      \_\_\_\_吉祥\_\_\_\_  
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

创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金(QDII)(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[2023]510号《关于准予创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金(QDII)注册的批复》核准,由创金合信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《创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金(QDII)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 12,334,015.47 元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2300409 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金(QDII)基金合同》于 2023 年 11 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 12,334,606.77 份基金份额,其中认购资金利息折合 591.30 份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司,基金托管人为宁波银行股份有限公司(以下简称“宁波银行”)。境外资产托管人为北美信托银行(The Northern Trust Company)(以下简称“北美信托银行”)。

根据《创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金(QDII)招募说明书》,本基金根据认购/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。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用但不计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C

类基金份额将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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括境内市场和境外市场依法发行的金融工具，境内市场投资工具包括于国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。境外市场投资工具包括在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(含交易型开放式指数基金 ETF); 已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证; 港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”); 政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券; 银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具; 远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品; 与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品。本基金为对冲外币的汇率风险，可以投资于外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易、境内融资交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%。其中投资于本基金界定的全球医药生物相关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全部需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金可投资全球市场，包括境内市场和境外不同国家或地区市场，其中主要境外市场有：美国、香港、台湾、新加坡、欧洲和日本等国家或地区。香港市场可通过合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度与港股通机制进行投资，通过港股通机制投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%。本基金投资于境内市场的股票及存托凭证资产占基金资产的比例不低于 20%，投资于境外市场的股票及存托凭证资产占基金资产的比例不低于 20%，投资各个市场股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例上限均为 95%。

本基金的业绩比较基准为：MSCI 全球医疗保健指数收益率（经估值汇率调整）\*60%+申万医药生物行业指数收益率\*25%+中债总指数收益率\*15%。

## 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》、《创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金（QDII）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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 重要会计政策和会计估计

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日和 2023 年 11 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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业务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、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。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

#### **6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。

#### **6.4.4.6 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。

#### **6.4.4.7 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

#### **6.4.4.8 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)。

#### **6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量**

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

价值变动产生的预估增值税后的净额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及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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。暂估业绩报酬/附加管理费的估计方法为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值（计提业绩报酬/附加管理费前）清算，根据基金份额持有人持有的基金份额（包括未到期份额）至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬/附加管理费。

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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；3、同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后，可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 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债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，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》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期末未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号文《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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 目前税收政策法规未对合格境内机构投资者（“QDII”）产品的税收处理给予特别的说明。在法规未有明确说明的情况下，参考现有的针对证券投资基金的税收法规进行处理。

(b) 目前基金取得的源自境外的差价收入和股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(c) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(d) 对证券投资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，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,170,150.97
等于：本金	2,170,031.33
加：应计利息	119.64
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	2,170,150.97

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	10,398,668.90	-	10,802,041.09	403,372.19
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		10,398,668.90	-	10,802,041.09	403,372.19

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	98.25
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	24,682.21
其中：交易所市场	24,682.21
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	9,217.28
合计	33,997.74

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信全球医药生物股票发起（QDII）A		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,342,620.77	5,342,620.77
本期申购	1,124,418.64	1,124,418.64

本期赎回（以“-”号填列）	-266,941.15	-266,941.15
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	6,200,098.26	6,200,098.26

创金合信全球医药生物股票发起（QDII）C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,991,986.00	6,991,986.00
本期申购	966,277.32	966,277.32
本期赎回（以“-”号填列）	-1,649,250.66	-1,649,250.66
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	6,309,012.66	6,309,012.66

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.7.8 未分配利润——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

创金合信全球医药生物股票发起（QDII）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-36,250.58	90,439.32	54,188.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-36,250.58	90,439.32	54,188.74
本期利润	-136,743.19	96,015.27	-40,727.92
本期基金份额交易产生的变动数	-14,037.67	27,095.89	13,058.22
其中：基金申购款	-21,438.85	35,480.02	14,041.17
基金赎回款	7,401.18	-8,384.13	-982.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-187,031.44	213,550.48	26,519.04

创金合信全球医药生物股票发起（QDII）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-51,637.84	118,300.78	66,662.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-51,637.84	118,300.78	66,662.94
本期利润	-165,851.21	98,616.82	-67,234.39

本期基金份额交易产生的变动数	8,040.60	32.08	8,072.68
其中：基金申购款	-16,828.05	24,694.24	7,866.19
基金赎回款	24,868.65	-24,662.16	206.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-209,448.45	216,949.68	7,501.23

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	23,152.75
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	787.98
其他	-
合计	23,940.73

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-152,401.91
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-152,401.91

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	43,693,923.51
减：卖出股票成本总额	43,737,872.48
减：交易费用	108,452.94
买卖股票差价收入	-152,401.91

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.13 资产支持证券投资收益****6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	34,934.60
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	34,934.60

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	194,632.09
——股票投资	194,632.09
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	194,632.09

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,068.83
合计	2,068.83

#### 6.4.7.19 信用减值损失

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	9,217.28
信息披露费	-
证券出借违约金	-
境外其他费用	1,125.25
合计	10,342.53

### 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

本报告期不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。

#### 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
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销

	售机构
宁波银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
美国北美信托银行有限公司	境外资产托管人
第一创业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	69,809,355.36	100.00%

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	52,103.60	68.78%	-	-

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	91,017.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	29,166.85
应支付基金管理人的净管理费	61,850.73

注：支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	15,169.64

注：支付基金托管人宁波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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信全球医药生物股票发起（QDII）A	创金合信全球医药生物股票发起（QDII）C	合计
宁波银行	-	14,672.09	14,672.09
合计	-	14,672.09	14,672.09

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日 C 类基金份额销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.5\% / \text{当年天数}。$$

### 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

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期无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。

**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**

本基金本报告期无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

**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**

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	创金合信全球医药生物股票发起（QDII）A	创金合信全球医药生物股票发起（QDII）C
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	80.64%	79.25%

**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**

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
宁波银行股份有限公司	1,186,746.34	5,659.19
北美信托银行	983,404.63	17,493.56

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波银行股份有限公司保管，按银行同业存款利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 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。

#### 6.4.12 期末（2024 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 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

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 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证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的金融工具风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、合规与风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行宁波银行股份有限公司及本基金的境外托管行美国北美信托银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内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，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

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

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基

金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节。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%。

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。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,170,150.97	-	-	-	2,170,150.97
结算备付金	47,673.18	-	-	-	47,673.18
存出保证金	13,706.88	-	-	-	13,706.88
交易性金融资产	-	-	-	10,802,041.09	10,802,041.09
应收股利	-	-	-	2,271.95	2,271.95
应收申购款	-	-	-	14,477.86	14,477.86
资产总计	2,231,531.03	-	-	10,818,790.90	13,050,321.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	107,383.73	107,383.73
应付管理人报酬	-	-	-	15,599.24	15,599.24
应付托管费	-	-	-	2,599.87	2,599.87
应付销售服务费	-	-	-	2,618.11	2,618.11
应付清算款	-	-	-	344,992.05	344,992.05
其他负债	-	-	-	33,997.74	33,997.74

负债总计	-	-	-	507,190.74	507,190.74
利率敏感度缺口	2,231,531.03	-	-	10,311,600.16	12,543,131.19
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,181,193.70	-	-	-	10,181,193.70
结算备付金	4,388.59	-	-	-	4,388.59
存出保证金	2,856.13	-	-	-	2,856.13
交易性金融资产	-	-	-	3,409,976.94	3,409,976.94
资产总计	10,188,438.42	-	-	3,409,976.94	13,598,415.36
负债					
应付清算款	-	-	-	1,118,507.72	1,118,507.72
应付管理人报酬	-	-	-	15,709.85	15,709.85
应付托管费	-	-	-	2,618.31	2,618.31
应付销售服务费	-	-	-	2,967.93	2,967.93
其他负债	-	-	-	3,153.10	3,153.10
负债总计	-	-	-	1,142,956.91	1,142,956.91
利率敏感度缺口	10,188,438.42	-	-	2,267,020.03	12,455,458.45

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

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产						
货币资金	686,665.75	296,738.88	-	-	-	983,404.63
交易性金融资产	6,965,737.38	1,020,193.71	-	-	-	7,985,931.09
应收股利	2,271.95	-	-	-	-	2,271.95
资产合计	7,654,675.08	1,316,932.59	-	-	-	8,971,607.67
以外币计						

价的负债						
应付清算款	225,347.28	-	-	-	-	225,347.28
负债合计	225,347.28	-	-	-	-	225,347.28
资产负债表外汇风险敞口净额	7,429,327.80	1,316,932.59	-	-	-	8,746,260.39

项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产						
货币资金	1,083,296.34	311,943.46	-	-	-	1,395,239.80
交易性金融资产	1,470,001.78	1,014,785.16	-	-	-	2,484,786.94
资产合计	2,553,298.12	1,326,728.62	-	-	-	3,880,026.74
以外币计价的负债						
应付清算款	314,051.02	78,431.13	-	-	-	392,482.15
负债合计	314,051.02	78,431.13	-	-	-	392,482.15
资产负债表外汇风险敞口净额	2,239,247.10	1,248,297.49	-	-	-	3,487,544.59

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	437,313.02	174,377.23
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-437,313.02	-174,377.23	

#### 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。本基金的投资范围包括境内市场和境外市场依法发行的金融工具，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

#### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	10,802,041.09	86.12	3,409,976.94	27.38
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	10,802,041.09	86.12	3,409,976.94	27.38

#### 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准上升 5%	399,621.51	44,363.80
2.业绩比较基准下降 5%	-399,621.51	-44,363.80	

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

**6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	10,802,041.09
第二层次	-
第三层次	-
合计	10,802,041.09

**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的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**

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

**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工具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之间无重大差异。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

**§ 7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	10,802,041.09	82.77
	其中：普通股	8,442,564.22	64.69
	存托凭证	2,359,476.87	18.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,217,824.15	16.99
8	其他资产	30,456.69	0.23
9	合计	13,050,321.93	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 263,581.99 元，占净值比为 2.10%。

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	6,965,737.38	55.53
中国	2,816,110.00	22.45
中国香港	1,020,193.71	8.13
合计	10,802,041.09	86.12

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
医疗保健	10,802,041.09	86.12
合计	10,802,041.09	86.12

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Eli Lilly And Compa	礼来公司	LLY	纽约证券交易所	美国	194	1,251,777.66	9.98

	ny							
2	Novo Nordisk A/S	诺和诺德	NVO	纽约证券交易所	美国	1,172	1,192,251.49	9.51
3	AstraZeneca Plc	阿斯利康股份有限公司	AZN	纳斯达克证券交易所	美国	1,827	1,015,481.55	8.10
4	Sonoscape Medical Corp.	深圳开立生物医疗科技股份有限公司	300633	深圳证券交易所	中国内地	24,000	949,920.00	7.57
5	Sichuan Kelun-Biotech Biopharmaceutical Co., Ltd.	四川科伦博泰生物医药股份有限公司	6990	香港证券交易所	中国香港	5,000	756,611.72	6.03
6	Beijing Balance Medical Technology Co., Ltd.	北京佰仁医疗科技股份有限公司	688198	上海证券交易所	中国内地	7,000	710,430.00	5.66
7	Intuitive Surgical, Inc.	直觉外科公司	ISRG	纳斯达克证券交易所	美国	202	640,412.11	5.11
8	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd.	深圳迈瑞生物医疗电子股份有限公司	300760	深圳证券交易所	中国内地	2,000	581,820.00	4.64
9	Boston Scientific Corporation	波士顿科学国际有限公司	BSX	纽约证券交易所	美国	800	439,067.89	3.50

	tion							
10	Stryker Corporation	史赛克公司	SYK	纽约证券交易所	美国	180	436,480.87	3.48
11	EDWARDS LIFESCIENCE SCORP	爱德华生命科学公司	EW	纽约证券交易所	美国	600	394,981.51	3.15
12	Shanghai Junshi Biosciences Co.,Ltd.	上海君实生物医药科技股份有限公司	688180	上海证券交易所	中国内地	9,000	261,450.00	2.08
13	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX	纳斯达克证券交易所	美国	70	233,833.16	1.86
14	Merck & Co.Inc.	默克公司	MRK	纽约证券交易所	美国	264	232,926.63	1.86
15	Suzhou Zelgen Biopharmaceuticals Co., Ltd.	苏州泽璟生物制药股份有限公司	688266	上海证券交易所	中国内地	4,000	216,880.00	1.73
16	Johnson & Johnson	强生制药公司	JNJ	纽约证券交易所	美国	200	208,330.62	1.66
17	HCA Healthcare Inc.	HCA 医疗保健有限公司	HCA	纽约证券交易所	美国	80	183,175.86	1.46
18	United Health Group Inc.	联合健康集团	UNH	纽约证券交易所	美国	50	181,469.71	1.45
19	Akero Therapeutics	AKERON 公司	AKRO	纳斯达克证券交易所	美国	1,000	167,194.73	1.33

	Inc.							
20	Novartis AG	诺华制药有限公司	NVS	纽约证券交易所	美国	200	151,743.83	1.21
21	Rainmed Medical Limited	润迈德医疗有限公司	RMD	纽约证券交易所	美国	100	136,421.21	1.09
22	Innovent Biologics, Inc.	信达生物制药	1801	香港证券交易所	中国香港	4,000	134,346.50	1.07
23	Lepu Biopharma Co., Ltd.	乐普生物科技股份有限公司	2157	香港证券交易所	中国香港	40,000	129,235.49	1.03
24	Shanghai Allist Pharmaceuticals Co., Ltd	上海艾力斯医药科技股份有限公司	688578	上海证券交易所	中国内地	1,500	95,610.00	0.76
25	89BIO Inc.	89BIO 公司	ETNB	纳斯达克证券交易所	美国	1,500	85,628.50	0.68
26	Terns Pharmaceuticals Inc.	拓臻生物科技股份有限公司	TERN	纳斯达克证券交易所	美国	300	14,560.05	0.12

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Eyebright Medical Technology (Beijing) Co., Ltd.	688050.SH	2,941,803.83	23.62
2	SICHUAN KELUN-BI	6990.HK	2,444,298.18	19.62
3	Yifeng	603939.SH	2,034,231.00	16.33

	Pharmacy Chain Co., Ltd.			
4	Sonoscape Medical Corp.	300633.SZ	1,934,181.00	15.53
5	Beijing Balance Medical Technology Co.,Ltd.	688198.SH	1,607,822.02	12.91
6	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd.	300760.SZ	1,525,622.00	12.25
7	Suzhou Zelgen Biopharmaceuticals Co., Ltd.	688266.SH	1,139,299.81	9.15
8	ELI LILLY and CO	LLY.US	1,082,740.28	8.69
9	Hangzhou Tigermed Consulting Co., Ltd	300347.SZ	1,045,680.00	8.40
10	NOVO-NORDISK-ADR	NVO.US	1,043,656.68	8.38
11	ASTRAZENECA-ADR	AZN.US	1,020,508.04	8.19
12	Jiangsu Sinopep-Allsino Biopharmaceutical Co., Ltd.	688076.SH	984,272.22	7.90
13	Beijing Kawin Technology Share-Holding Co., Ltd.	688687.SH	913,010.93	7.33
14	Shanghai United Imaging Healthcare Co., Ltd.	688271.SH	878,041.88	7.05
15	Muyuan Foods Co., Ltd.	002714.SZ	837,532.00	6.72
16	Topchoice Medical Co.,Inc.	600763.SH	810,766.00	6.51
17	Guangzhou	603882.SH	716,740.00	5.75

	Kingmed Diagnostics Group Co.,Ltd.			
18	Akeso,Inc.	H09926.HK	673,740.61	5.41
19	Dong-E-E-Jiao Co.,Ltd.	000423.SZ	647,458.00	5.20
20	Innovita Biological Technology Co., Ltd.	688253.SH	645,396.38	5.18
21	Zhejiang Wolwo Bio- Pharmaceutical Co., Ltd.	300357.SZ	636,145.00	5.11
22	AMGEN INC	AMGN.US	622,775.64	5.00
23	RESMED INC	RMD.US	618,638.35	4.97
24	Shouyao Holdings Co.,Ltd	688197.SH	584,566.90	4.69
25	Hubei Jumpcan Pharmaceutical Co., Ltd.	600566.SH	543,661.00	4.36
26	Hangzhou Changchuan Technology Co.,Ltd	300604.SZ	511,587.00	4.11
27	Nanjing King- Friend Biochemical Pharmaceutical Co., Ltd	603707.SH	510,007.00	4.09
28	ALIGN TECHNOLOGY	ALGN.US	504,157.25	4.05
29	Gushengtang Holdings Limited	H02273.HK	495,766.57	3.98
30	WUXI XDC CAYMAN	2268.HK	483,205.83	3.88
31	Sansure Biotech Inc.	688289.SH	477,545.83	3.83
32	Intuitive Surgical Inc	ISRG.US	471,385.58	3.78
33	Shanghai Aohua Photoelectricity	688212.SH	464,809.31	3.73

	Endoscope Co., Ltd.			
34	VERTEX PHARM	VRTX.US	452,435.81	3.63
35	CHARLES RIVER LA	CRL.US	451,794.65	3.63
36	AKERO THERAPEUTI	AKRO.US	439,330.15	3.53
37	STRYKER CORP	SYK.US	436,797.70	3.51
38	Beijing Aosaikang Pharmaceutical Co.,Ltd.	002755.SZ	435,812.00	3.50
39	Beijing Tiantan Biological Products Corporation Limited	600161.SH	425,014.00	3.41
40	BOSTON SCIENTIFC	BSX.US	419,229.70	3.37
41	Smo Clinplus Co.,Ltd.	301257.SZ	414,785.00	3.33
42	Shanghai Allist Pharmaceuticals Co., Ltd	688578.SH	400,308.78	3.21
43	Hunan Jiudian Pharmaceutical Co., Ltd	300705.SZ	380,080.40	3.05
44	NOVARTIS AG-ADR	NVS.US	370,599.71	2.98
45	Inner Mongolia Furui Medical Science Co., Ltd.	300049.SZ	360,616.00	2.90
46	Sunflower Pharmaceutical Group Co.,Ltd	002737.SZ	356,694.00	2.86
47	UNITEDHEAL TH GRP	UNH.US	353,582.28	2.84
48	Jafron Biomedical Co.,Ltd.	300529.SZ	342,419.00	2.75
49	Zhejiang	002840.SZ	330,549.00	2.65

	Huatong Meat Products Co., Ltd			
50	JOHNSONAND JOHNSON	JNJ.US	330,215.88	2.65
51	Qingdao Baheal Medical Inc.	301015.SZ	328,687.00	2.64
52	Joinn Laboratories (China) Co.,Ltd.	603127.SH	317,787.60	2.55
53	CSPC Innovation Pharmaceutical Co.,Ltd.	300765.SZ	317,677.00	2.55
54	Tecon Biology Co.Ltd	002100.SZ	312,214.00	2.51
55	Luoxin Pharmaceuticals Group Stock Co., Ltd.	002793.SZ	300,500.00	2.41
56	THERMO FISHER	TMO.US	300,219.82	2.41
57	Guangxi Liuyao Group Co., Ltd	603368.SH	293,976.00	2.36
58	Acrobiosystems Co., Ltd	301080.SZ	285,521.00	2.29
59	Jiangsu Nhwa Pharmaceutical Co., Ltd.	002262.SZ	282,754.00	2.27
60	Zhejiang Starry Pharmaceutical Co., Ltd.	603520.SH	275,865.00	2.21
61	Chengdu Easton Bio Pharmaceuticals Co.,Ltd	688513.SH	272,163.84	2.19
62	Shanghai Junshi Biosciences Co.,Ltd.	688180.SH	270,786.98	2.17
63	Shenzhen Yhlo Biotech Co., Ltd.	688575.SH	259,588.65	2.08
64	Shenzhen Mason Technologies	002654.SZ	255,993.00	2.06

	Co.,Ltd			
65	EDWARDS LIFE	EW.US	253,802.95	2.04
66	MERCK AND CO	MRK.US	252,420.24	2.03
67	LEGEND BIOT- ADR	LEGN.US	251,725.98	2.02

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Eyebright Medical Technology (Beijing) Co., Ltd.	688050.SH	2,913,254.72	23.39
2	Yifeng Pharmacy Chain Co., Ltd.	603939.SH	2,139,528.00	17.18
3	SICHUAN KELUN-BI	6990.HK	1,985,751.39	15.94
4	Hangzhou Tigermed Consulting Co., Ltd	300347.SZ	1,008,256.00	8.09
5	Jiangsu Sinopep- Allsino Biopharmaceutic al Co., Ltd.	688076.SH	997,968.26	8.01
6	Beijing Kawin Technology Share-Holding Co., Ltd.	688687.SH	984,228.65	7.90
7	Beijing Balance Medical Technology Co.,Ltd.	688198.SH	960,808.56	7.71
8	Sonoscape Medical Corp.	300633.SZ	959,276.00	7.70
9	Innovita Biological	688253.SH	887,556.33	7.13

	Technology Co., Ltd.			
10	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd.	300760.SZ	885,546.00	7.11
11	Topchoice Medical Co.,Inc.	600763.SH	858,022.00	6.89
12	Suzhou Zelgen Biopharmaceuticals Co., Ltd.	688266.SH	854,857.39	6.86
13	Muyuan Foods Co., Ltd.	002714.SZ	841,978.00	6.76
14	Shanghai United Imaging Healthcare Co., Ltd.	688271.SH	841,044.82	6.75
15	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co.,Ltd.	603882.SH	731,827.00	5.88
16	Akeso,Inc.	H09926.HK	706,150.04	5.67
17	Dong-E-E-Jiao Co.,Ltd.	000423.SZ	692,128.00	5.56
18	Hubei Jumpcan Pharmaceutical Co., Ltd.	600566.SH	678,895.00	5.45
19	Zhejiang Wolwo Bio-Pharmaceutical Co., Ltd.	300357.SZ	675,356.00	5.42
20	AMGEN INC	AMGN.US	638,298.78	5.12
21	Nanjing King-Friend Biochemical Pharmaceutical Co., Ltd	603707.SH	544,387.00	4.37
22	ALIGN TECHNOLOGY	ALGN.US	538,972.55	4.33
23	Hunan Jiudian Pharmaceutical Co., Ltd	300705.SZ	512,087.00	4.11
24	Shouyao	688197.SH	507,866.92	4.08

	Holdings Co.,Ltd			
25	ILLUMINA INC	ILMN.US	506,255.12	4.06
26	RESMED INC	RMD.US	504,282.91	4.05
27	Gushengtang Holdings Limited	H02273.HK	495,900.58	3.98
28	Hangzhou Changchuan Technology Co.,Ltd	300604.SZ	485,569.00	3.90
29	Sansure Biotech Inc.	688289.SH	481,687.40	3.87
30	Shanghai Aohua Photoelectricity Endoscope Co., Ltd.	688212.SH	438,256.95	3.52
31	CHARLES RIVER LA	CRL.US	437,648.20	3.51
32	Qingdao Baheal Medical Inc.	301015.SZ	418,307.00	3.36
33	Beijing Tiantan Biological Products Corporation Limited	600161.SH	415,319.00	3.33
34	Smo Clinplus Co.,Ltd.	301257.SZ	413,553.00	3.32
35	WuXi XDC Cayman Inc.	2268.HK	407,543.27	3.27
36	Beijing Aosaikang Pharmaceutical Co.,Ltd.	002755.SZ	383,630.00	3.08
37	AKERO THERAPEUTI	AKRO.US	374,597.23	3.01
38	HBM HOLDINGS LTD	2142.HK	368,633.34	2.96
39	Sunflower Pharmaceutical Group Co.,Ltd	002737.SZ	358,335.00	2.88
40	Sino Biopharmaceutic	H01177.HK	344,672.89	2.77

	al Limited			
41	Inner Mongolia Furui Medical Science Co., Ltd.	300049.SZ	341,957.00	2.75
42	NOVARTIS AG-ADR	NVS.US	339,458.40	2.73
43	Jafron Biomedical Co.,Ltd.	300529.SZ	334,951.50	2.69
44	Jiangsu Nhwa Pharmaceutical Co., Ltd.	002262.SZ	325,733.00	2.62
45	Zhejiang Huatong Meat Products Co., Ltd	002840.SZ	324,020.00	2.60
46	CSPC Innovation Pharmaceutical Co.,Ltd.	300765.SZ	318,497.00	2.56
47	Guangxi Liuyao Group Co., Ltd	603368.SH	306,000.00	2.46
48	Tecon Biology Co.Ltd	002100.SZ	300,400.00	2.41
49	THERMO FISHER	TMO.US	298,241.85	2.39
50	Joinn Laboratories (China) Co.,Ltd.	603127.SH	298,175.00	2.39
51	Luoxin Pharmaceuticals Group Stock Co., Ltd.	002793.SZ	296,796.00	2.38
52	Shanghai Allist Pharmaceuticals Co., Ltd	688578.SH	292,098.63	2.35
53	SUMMIT THERAPEUT	SMMT.US	287,103.81	2.31
54	Zhejiang Starry Pharmaceutical Co., Ltd.	603520.SH	283,060.00	2.27
55	Hutchmed (China) Limited	H00013.HK	280,513.86	2.25

56	Chengdu Easton Bio Pharmaceuticals Co.,Ltd	688513.SH	280,348.80	2.25
57	Acrobiosystems Co., Ltd	301080.SZ	273,746.00	2.20
58	STAAR SURGICAL	STAA.US	269,982.55	2.17
59	Shenzhen Yhlo Biotech Co., Ltd.	688575.SH	255,076.53	2.05
60	LEGEND BIOT-ADR	LEGN.US	252,446.07	2.03

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

买入成本（成交）总额	50,935,304.54
卖出收入（成交）总额	43,693,923.51

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 7.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1

本报告期内，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

#### 7.12.2

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	13,706.88
2	应收清算款	-
3	应收股利	2,271.95
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,477.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,456.69

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信全球医药生物股票发起(QDII) A	128	48,438.27	5,000,000.00	80.64%	1,200,098.26	19.36%
创金合信全球医药生物股票发起(QDII) C	165	38,236.44	5,000,000.00	79.25%	1,309,012.66	20.75%
合计	274	45,653.69	10,000,000.00	79.94%	2,509,110.92	20.06%

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

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	创金合信全球医药生物股票发起(QDII) A	148,023.92	2.39%
	创金合信全球医药生物股票发起(QDII) C	11.03	0.00%
	合计	148,034.95	1.18%

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

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金	创金合信全球医药生物股票	0~10

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	发起（QDII）A	
	创金合信全球医药生物股票发起（QDII）C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信全球医药生物股票发起（QDII）A	0~10
	创金合信全球医药生物股票发起（QDII）C	0
	合计	0~10

#### 8.4 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	79.94	10,000,000.00	79.94	36 个月
基金管理人高级管理人员	32,893.81	0.26	31,064.57	0.25	36 个月
基金经理等人员	9,903.81	0.08	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,042,797.62	80.28	10,031,064.57	80.19	36 个月

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信全球医药生物股票发起（QDII）A	创金合信全球医药生物股票发起（QDII）C
基金合同生效日(2023 年 11 月 17 日)基金份额总额	5,342,620.77	6,991,986.00
本报告期期初基金份额总额	5,342,620.77	6,991,986.00
本报告期基金总申购份额	1,124,418.64	966,277.32
减：报告期基金总赎回份额	266,941.15	1,649,250.66
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,200,098.26	6,309,012.66

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2024 年 7 月 1 日起，宋明华先生担任公司监事会主席；

2024 年 7 月 1 日起，郑晓敏女士担任公司职工监事。

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金香港	1	24,819,872.74	26.23%	23,648.31	31.22%	-

第一创业 证券	4	69,809,355.36	73.77%	52,103.60	68.78%	-
------------	---	---------------	--------	-----------	--------	---

注：交易单元的选择标准和程序：

（1）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（3）经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（4）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要，并能为基金提供全面的信息服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

### 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

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
中金香港	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金（QDII）开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-13
2	创金合信基金管理有限公司关于旗下所有基金产品在直销柜台实施费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-30
3	创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金（QDII）2024 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
4	创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资	公司官网、中国证监	2024-06-27

	基金（QDII）(A 类份额)基金产品资料概要更新	会基金电子披露网站	
5	创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金（QDII）(C 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-27
6	创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金（QDII）(2024 年 6 月) 招募说明书（更新）	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-27

## § 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

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	20240101 - 20240630	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	79.94%

#### 产品特有风险

本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形,可能会存在以下风险:

1、大额申购风险在发生投资者大额申购时,若本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。

2、大额赎回风险

(1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险;

(2)若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,将可能对基金管理人的管理造成影响;

(3)基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金,可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作;

(4)因基金净值精度计算问题,可能因赎回费归入基金资产,导致基金净值有较大波动;

(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续条件,可能导致基金合同终止、清算等风险。本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止上述风险,最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

创金合信基金成立于 2014 年 7 月,是第一家成立时即实现员工持股的基金公司,由第一创业证券股份有限公司、以及经营管理层和核心员工持股的 7 家合伙企业出资设立。创金合信基金成立以来坚持以客户为中心,倡导合伙文化,致力于为客户提供优质的产品和服务。截至 2024 年 6 月 30 日,创金合信基金共管理 99 只公募基金,公募管理规模 1615.63 亿元。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》；
- 2、《创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金（QDII）托管协议》；
- 3、创金合信全球医药生物股票型发起式证券投资基金（QDII）2024 年中期报告原文。

### 12.2 存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

### 12.3 查阅方式

[www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日