

创金合信大健康混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告

2022 年 03 月 31 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：2022 年 4 月 21 日

| | |
|---|----|
| §1 重要提示..... | 2 |
| §2 基金产品概况..... | 2 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现..... | 3 |
| 3.1 主要财务指标..... | 3 |
| 3.2 基金净值表现..... | 4 |
| §4 管理人报告..... | 5 |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介..... | 5 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 5 |
| 4.3 公平交易专项说明..... | 6 |
| 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析..... | 6 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现..... | 7 |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明..... | 7 |
| §5 投资组合报告..... | 7 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况..... | 7 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 7 |
| 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细..... | 8 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 8 |
| 5.5 报告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..... | 9 |
| 5.6 报告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..... | 9 |
| 5.7 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..... | 9 |
| 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细..... | 9 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 9 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 9 |
| 5.11 投资组合报告附注..... | 9 |
| §6 开放式基金份额变动..... | 10 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况..... | 10 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况..... | 11 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细..... | 11 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息..... | 11 |
| 8.1 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..... | 11 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 11 |
| §9 备查文件目录..... | 11 |
| 9.1 备查文件目录..... | 11 |
| 9.2 存放地点..... | 11 |
| 9.3 查阅方式..... | 11 |

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 创金合信大健康混合 |
| 基金主代码 | 013348 |
| 交易代码 | 013348 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 1 月 26 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 346,464,523.09 份 |
| 投资目标 | 本基金主要通过精选大健康主题相关证券，在合理控制风险的前提下，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、大健康主题的界定</p> <p>随着经济的提升、医疗技术的提升以及健康观念的进步，人民对健康的追求不仅仅体现在身体健康，还体现在精神、心理、生理、社会、环境、道德健康等方方面面。未来，健康消费需求还将得到进一步的释放，大健康产业将迎来新机遇。本基金将重点投资于大健康主题的相关行业和公司，具体如下：</p> <p>(1)与人类身体健康直接相关的从事医药健康相关产品或服</p> |

| | | |
|-----------------|---|------------------|
| | <p>务研发、生产或销售的行业和公司，主要包括但不限于化学制药、中药、生物制品、医药商业、医疗器械、医疗服务、健康保健服务、健康保险、休闲健身、环保防疫及养老服务等；</p> <p>(2) 满足居民基本健康生活需求相关的衣食住行等行业和公司，主要包括健康食品、健康服饰、绿色出行、绿色家电、互联网医疗等；</p> <p>(3) 满足居民精神健康需求的相关产品和服务的行业和公司，主要包括健身锻炼、健康文化与资讯、旅游服务等。</p> <p>若未来由于技术进步或政策变化导致本基金大健康主题相关行业和公司相关业务的覆盖范围发生变动，基金管理人在履行适当程序后有权对上述定义进行补充和修订并及时公告。</p> <p>3、股票投资策略。4、固定收益品种投资策略。5、衍生产品投资策略。6、其他</p> | |
| 业绩比较基准 | 中证医药卫生指数收益率×30%+中证内地消费主题指数收益率×30%+中证港股通综合指数收益率×20%+人民币活期存款利率(税后)×20% | |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，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，低于股票型基金。</p> <p>本基金除可投资 A 股外，还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> | |
| 基金管理人 | 创金合信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 华夏银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信大健康混合 A | 创金合信大健康混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 013348 | 013349 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 109,159,516.82 份 | 237,305,006.27 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)-2022 年 3 月 31 日 | |
|----------------|--|----------------|
| | 创金合信大健康混合 A | 创金合信大健康混合 C |
| 1.本期已实现收益 | -628,270.23 | -1,574,110.85 |
| 2.本期利润 | 1,160,471.65 | 2,312,642.77 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0106 | 0.0097 |
| 4.期末基金资产净值 | 110,319,988.47 | 239,617,649.04 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0106 | 1.0097 |

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、本基金合同生效日为 2022 年 1 月 26 日，截至本报告期末，本基金成立不满一季度。合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

创金合信大健康混合 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 1.06% | 0.87% | -7.06% | 1.55% | 8.12% | -0.68% |

创金合信大健康混合 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 0.97% | 0.87% | -7.06% | 1.55% | 8.03% | -0.68% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

创金合信大健康混合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
(2022年01月26日-2022年03月31日)





注：1、本基金合同于 2022 年 1 月 26 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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 皮劲松 | 本基金基金经理 | 2022 年 1 月 26 日 | - | 9 | 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 月加入东莞证券研究所任研究员，2014 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司，历任研究员、投资经理，现任基金经理。 |

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年 1 季度申万医药指数下跌 10.8%，表现较好的主要有新冠药物及原料供应商、新冠抗原检测、低估值中药、疫苗等，高估值个股普遍调整较大。市场关注点集中在新冠药物，主要是 1 季度国内疫情散发，药物是控制疫情重要手段。国家药监局也提出加快推动新冠药物审批上市，国产新冠药物获批临近。

政策方面，国家医保局提出 2022 年常态化开展药品集采，开展脊柱高值耗材集采。1 季度已有广东、湖北等联盟药品集采，部分品种降幅较大，竞争格局好的品种影响可控，预计今年政策压力比 2021 年有所缓解。此外，国家医保局发布了 2021 年医保资金收支情况，收支保持较快增长；工信部等也发布了“十四五”医药工业发展规划，提出医药工业营业收入、利润总额年均增速保持在 8%以上，推动行业高质量发展。

投资策略，关注产业趋势和个股基本面。创新是医药发展的主题，国内创新药、创新器械、CXO 逐步走向全球，部分企业已具备全球竞争力；国内医疗消费潜力较大，关注消费逐步升级的领域，如疫苗、医疗服务等。个股层面，跟踪企业经营趋势，寻找基本面扎

实增长确定的公司。本基金今年 1 月份成立，考虑到当前医药性价比较高，持仓以医药为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信大健康混合 A 基金份额净值为 1.0106 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.06%，同期业绩比较基准收益率为-7.06%；截至本报告期末创金合信大健康混合 C 基金份额净值为 1.0097 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.97%，同期业绩比较基准收益率为-7.06%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 203,228,399.45 | 57.97 |
| | 其中：股票 | 203,228,399.45 | 57.97 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,388,590.54 | 1.25 |
| 8 | 其他资产 | 142,977,281.63 | 40.78 |
| 9 | 合计 | 350,594,271.62 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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

| | | | (%) |
|---|------------------|----------------|-------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 156,676,327.14 | 44.77 |
| 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 | 6,129,000.00 | 1.75 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 40,423,072.31 | 11.55 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 203,228,399.45 | 58.08 |

5.2.2 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投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 | 603392 | 万泰生物 | 116,000 | 32,248,000.00 | 9.22 |
| 2 | 300122 | 智飞生物 | 224,954 | 31,043,652.00 | 8.87 |
| 3 | 603127 | 昭衍新药 | 219,953 | 25,314,390.77 | 7.23 |
| 4 | 300760 | 迈瑞医疗 | 72,000 | 22,122,000.00 | 6.32 |
| 5 | 688198 | 佰仁医疗 | 95,000 | 14,990,050.00 | 4.28 |
| 6 | 688202 | 美迪西 | 32,847 | 14,863,924.44 | 4.25 |
| 7 | 002371 | 北方华创 | 35,000 | 9,590,000.00 | 2.74 |
| 8 | 300896 | 爱美客 | 20,000 | 9,500,000.00 | 2.71 |
| 9 | 300358 | 楚天科技 | 450,000 | 8,316,000.00 | 2.38 |
| 10 | 300171 | 东富龙 | 160,000 | 6,302,400.00 | 1.80 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 142,977,281.63 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 142,977,281.63 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 创金合信大健康混合 A | 创金合信大健康混合 C |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2022 年 1 月 26 日)基金份额总额 | 109,159,516.82 | 237,305,006.27 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | - | - |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | - | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 109,159,516.82 | 237,305,006.27 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期末未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 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。股东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 家投资合伙企业构成。秉承“以客户为中心”的文化理念，创金合信基金迅速构建起独特的服务优势和核心竞争力，并在客户数量和规模上取得快速突破。截至 2022 年 3 月 31 日，创金合信基金共管理 82 只公募基金，公募管理规模 883.83 亿元。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《创金合信大健康混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信大健康混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信大健康混合型证券投资基金 2022 年 1 季度报告原文。

9.2 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

9.3 查阅方式

www.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2022 年 4 月 21 日