

创金合信大健康混合型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：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：2023 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 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。

本报告财务资料已经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2022 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 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.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告.....	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55

8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	56
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	56
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	56
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	56
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
8.12	投资组合报告附注	56
§9	基金份额持有人信息	57
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	58
§10	开放式基金份额变动	58
§11	重大事件揭示	59
11.1	基金份额持有人大会决议	59
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	59
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4	基金投资策略的改变	59
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	59
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8	其他重大事件	60
§12	影响投资者决策的其他重要信息	61
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	61
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	61
§13	备查文件目录	62
13.1	备查文件目录	62
13.2	存放地点	62
13.3	查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信大健康混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	245,479,072.63 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	91,399,143.41 份	154,079,929.22 份

2.2 基金产品说明

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。</p> <p>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>

	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。 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
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	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。 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。

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	华夏银行股份有限公司
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	95577
传真	0755-25832571	010-85238680
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）	北京市东城区建国门内大街22号（100005）
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	北京市东城区建国门内大街22号（100005）
邮政编码	518052	100005
法定代表人	钱龙海	李民吉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金年度报告备置地点	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
----	----	------

会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、创金合信大健康混合 A

3.1.1 期间数据和指标	2022 年 1 月 26 日-2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-4,478,457.09
本期利润	-9,885,111.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0992
本期加权平均净值利润率	-10.51%
本期基金份额净值增长率	-10.19%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末
期末可供分配利润	-9,311,238.49
期末可供分配基金份额利润	-0.1019
期末基金资产净值	82,087,904.92
期末基金份额净值	0.8981
3.1.3 累计期末指标	2022 年末
基金份额累计净值增长率	-10.19%

2、创金合信大健康混合 C

3.1.1 期间数据和指标	2022 年 1 月 26 日-2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-10,273,767.25
本期利润	-19,084,467.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0989
本期加权平均净值利润率	-10.47%
本期基金份额净值增长率	-10.60%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末
期末可供分配利润	-16,339,746.75
期末可供分配基金份额利润	-0.1060
期末基金资产净值	137,740,182.47
期末基金份额净值	0.8940
3.1.3 累计期末指标	2022 年末
基金份额累计净值增长率	-10.60%

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 2022 年 1 月 26 日，截至报告期末，本基金成立不满一年。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 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
过去三个月	6.07%	1.99%	5.99%	1.26%	0.08%	0.73%
过去六个月	-9.63%	1.80%	-7.79%	1.07%	-1.84%	0.73%
自基金合同生效起至今	-10.19%	1.53%	-8.57%	1.19%	-1.62%	0.34%

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
过去三个月	5.94%	1.99%	5.99%	1.26%	-0.05%	0.73%
过去六个月	-9.85%	1.80%	-7.79%	1.07%	-2.06%	0.73%
自基金合同生效起至今	-10.60%	1.53%	-8.57%	1.19%	-2.03%	0.34%

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12月31日)

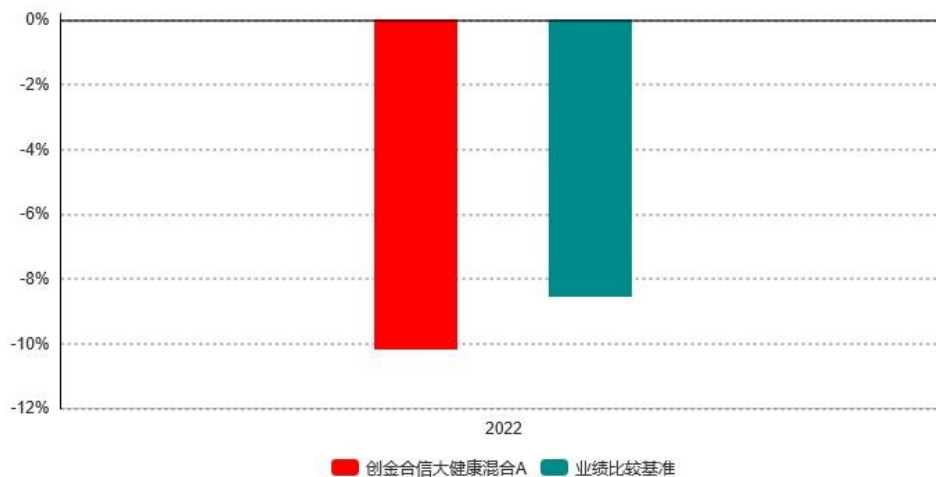


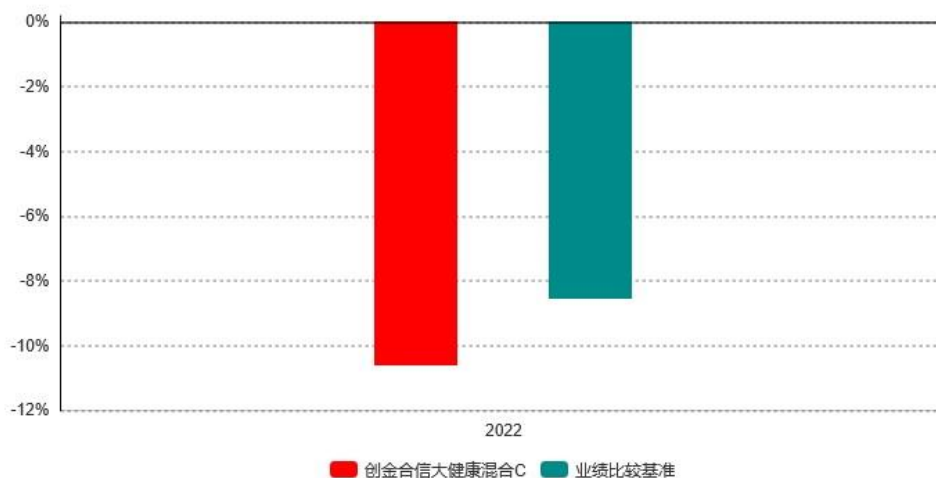


注：1、本基金合同于 2022 年 1 月 26 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。

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，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本基金于 2022 年 1 月 26 日成立，截至本报告期末成立未满 1 年，故本报告期净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2022 年 1 月 26 日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于 2014 年 7 月 3 日获得中国证监会批复，2014 年 7 月 9 日正式注册设立，注册地为深圳市。公司注册资本 26,096 万元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例 51.072961%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例 23.287094%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.47195%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.160791%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例 3.490956%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例 3.969957%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.910331%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.63596%。

公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，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	证券	说明
----	----	-----------	----	----

		(助理) 期限		从业年限	
		任职日期	离任日期		
毛丁丁	本基金基金经理	2022 年 9 月 14 日	-	7	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，任权益产品部投资研究岗。2020 年 12 月加入创金合信基金管理有限公司，历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	2022 年 1 月 26 日	-	10	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《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。

4.2 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》等法律法规，本公司制定了《创金合信基金管理有限公司公平交易与异常交易管理制度》（下称“管理制度”），该管理制度涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级

市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。本报告期内，本公司严格执行该管理制度的要求，实行了如下具体控制措施：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

执行投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立健全客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据，确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立健全不同投资组合的投资风格库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立健全公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司执行异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易室负责异常交易的日常实时监控，合规与风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

4.3.2 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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年医药板块受疫情散发多发、投融资数据下滑等影响，行业数据承压，全年申万医药指数下跌 20.3%。细分领域看，新冠药物相关、中成药、零售药店、业绩加速个股表现较好，CXO、疫苗等跌幅较大；风格上看，估值合理个股表现占优，高估值成长股调整消化估值。

2022 年，肝功能生化试剂、脊柱、电生理、种植牙等集采降幅都相对温和，释放出政策缓和的趋势，板块估值压力有望缓解。国内医药企业创新能力不断提高，已经有多个创新药实现海外授权，高端设备、高值耗材实现技术或销售积极进展，行业进入创新驱动阶段。落实到投资，更需要关注产品管线、研发投入等决定长期价值的变量。

2023 年，随着国内医疗就诊活动恢复，预计行业整体经营会逐步向好，受疫情影响大的医疗服务、高值耗材恢复更快。医药板块估值已到合理偏低水平，板块性价比较高。本基金目前持有医疗器械、疫苗、CXO、消费医疗等个股，持仓个股业绩稳定，配置均衡。

4.4.2 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 0.8981 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.19%，同期业绩比较基准收益率为-8.57%；截至本报告期末创金合信大健康混合 C 基金份额净值为 0.8940 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.60%，同期业绩比较基准收益率为-8.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年国内经济迎来疫后复苏。海外需求疲软背景下，内需重要性提升，工业生产制造和居民消费活动快速复苏；地产投资降幅收窄，实现平稳发展；预计货币政策保持相对宽松。随着企业盈利改善，加上 2022 年市场调到相对较低估值，证券场整体走势相对乐观。医药板块政策压力减小，行业在创新产品、消费升级驱动下盈利质量提升，板块走势相对乐观。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，

加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人的主要内部监察稽核工作如下：

合规管理方面，强化合规法务工作，严格审核公司业务、产品及其合同等法律文件，解读最新的法律法规，发布合规提示或警示，并通过合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行；加强合规制度建设，根据法律法规、监管政策要求，持续完善投资、研究、交易以及从业人员投资行为、薪酬考核、反洗钱等方面的管理制度；完善信息披露工作，优化信息披露流程及各部门信息披露的职责分工，及时履行信息披露工作。

风险控制方面，健全全面风险管理体系，加强权限管理，完善事前、事中和事后的风险管理体系；加强关联交易管理、内幕交易防控机制，严格履行关联交易决策审批程序，定期开展关于防止内幕交易的合规培训，严防内幕信息传递和内幕交易发生；健全公平交易与异常交易管理机制，严格按照法律法规以及公司公平交易与异常交易相关制度的要求，对所管理的不同投资组合之间发生的同向交易和反向交易进行监控。

监察稽核方面，公司定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，警示公司管理及业务运作中存在的风险，提出整改意见并监督落实；根据法律法规、监管政策要求，公司每年进行公司内部控制、合规管理有效性、反洗钱、廉洁从业、信息技术管理以及基金经理离任等方面的稽核评估工作。

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 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

报告期内，本基金托管人严格遵守《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规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2302776 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	创金合信大健康混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的创金合信大健康混合型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,自 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表

	<p>附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人创金合信基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2022 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇</p>

	<p>总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	叶云晖 查路凡
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
审计报告日期	2023年3月27日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：创金合信大健康混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	682,055.21

结算备付金		-
存出保证金		12,499,977.36
交易性金融资产	7.4.7.2	207,283,069.47
其中：股票投资		207,055,886.58
基金投资		-
债券投资		227,182.89
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		32,137.84
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		220,497,239.88
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		110,913.08
应付管理人报酬		280,045.30
应付托管费		46,674.22
应付销售服务费		58,518.50
应付投资顾问费		-
应交税费		1.39
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	173,000.00
负债合计		669,152.49
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	245,479,072.63
其他综合收益	7.4.8	-

未分配利润	7.4.8.1	-25,650,985.24
净资产合计		219,828,087.39
负债和净资产总计		220,497,239.88

注：1. 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，创金合信大健康混合 A 份额净值 0.8981 元，基金份额总额 91,399,143.41 份；创金合信大健康混合 C 份额净值 0.8940 元，基金份额总额 154,079,929.22 份；总份额合计 245,479,072.63 份；

2. 本财务报表的实际报告期间为 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效不满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：创金合信大健康混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-23,437,673.65
1.利息收入		287,323.66
其中：存款利息收入	7.4.8.2	287,323.66
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-9,581,718.16
其中：股票投资收益	7.4.8.3	-10,418,055.48
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.8.4	56.47
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.8.5	-
衍生工具收益	7.4.8.6	-
股利收益	7.4.8.7	836,280.85
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	7.4.8.8	-14,217,354.49

“-”号填列)		
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.8.9	74,075.34
减:二、营业总支出		5,531,905.18
1.管理人报酬	7.4.11.2.1	3,864,012.31
2.托管费	7.4.11.2.2	644,002.05
3.销售服务费	7.4.11.2.3	850,490.59
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	7.4.8.10	-
7.税金及附加		0.23
8.其他费用	7.4.8.11	173,400.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-28,969,578.83
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-28,969,578.83
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-28,969,578.83

注:本财务报表的实际报告期间为 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效不满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体:创金合信大健康混合型证券投资基金

本报告期:2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
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)	346,464,523.09	-	-	346,464,523.09

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-100,985,450.46	-	-25,650,985.24	-126,636,435.70
（一）、综合收益总额	-	-	-28,969,578.83	-28,969,578.83
（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）	-100,985,450.46	-	3,318,593.59	-97,666,856.87
其中：1.基金申购款	15,987,516.04	-	-1,218,614.22	14,768,901.82
2.基金赎回款	-116,972,966.50	-	4,537,207.81	-112,435,758.69
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	245,479,072.63	-	-25,650,985.24	219,828,087.39

注：本财务报表的实际报告期间为 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效不满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

____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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

创金合信大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”）2021 年 7 月 23 日证监许可[2021]2579 号文《关于准予创金合信大健康混合型证券投资基金注册的批复》核准募集。本基金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》及其配套规则和《创金合信大健康混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2022 年 1 月 26 日生效。本基金为契约型开放式，存续期

限不定，首次设立募集规模为 346,464,523.09 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，基金托管人为华夏银行股份有限公司(以下简称“华夏银行”)。

本基金于 2022 年 1 月 10 日至 2022 年 1 月 21 日募集，募集期间净认购资金人民币 346,352,078.87 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 112,444.22 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 346,464,523.09 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了毕马威华振验字第 2200191 号验资报告。

根据《创金合信大健康混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。收取认购费、申购费，但不计提销售服务费的基金份额类别为 A 类基金份额；不收取认购费、申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用不同，本基金不同类别的基金份额将分别计算并公告各类基金份额的基金份额净值，计算公式如下： T 日某类基金份额的基金份额净值= T 日该类基金份额的基金资产净值/ T 日该类基金份额的基金份额余额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《创金合信大健康混合型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《创金合信大健康混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括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）、港股通标的股票、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(含分离交易可转债)、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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%（投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%），投资于大健康主题证券资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况、自 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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

(1) 金融资产

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

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，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其他各类应付款项等。

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

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

(1) 金融资产的分类

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

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

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款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和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，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。

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

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

金融资产终止确认时, 其账面价值与收到的对价的差额, 计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外, 本基金按下述原则计量公允价值:

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中, 出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时, 根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具, 在估值日有报价的, 除会计准则规定的情况外, 将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量; 估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的, 采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的, 对报价进行调整, 确定公允价值。与上述金融工具相同, 但具有不同特征的, 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, 本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具, 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。采用估值技术确定公允价值时, 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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债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后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

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

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除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确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(a) 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；

(b) 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基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(c) 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；

(d) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

(1) 主要税项说明

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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入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。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f) 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。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	682,055.21
等于：本金	681,916.40
加：应计利息	138.81
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	682,055.21

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	221,315,365.57	-	207,055,886.58	-14,259,478.99	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	185,000.00	58.39	227,182.89	42,124.50
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	185,000.00	58.39	227,182.89	42,124.50
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	221,500,365.57	58.39	207,283,069.47	-14,217,354.49	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	173,000.00
合计	173,000.00

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信大健康混合 A		
项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	109,159,516.82	109,159,516.82
本期申购	4,743,450.39	4,743,450.39
本期赎回（以“-”号填列）	-22,503,823.80	-22,503,823.80
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	91,399,143.41	91,399,143.41

创金合信大健康混合 C		
项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	237,305,006.27	237,305,006.27
本期申购	11,244,065.65	11,244,065.65
本期赎回（以“-”号填列）	-94,469,142.70	-94,469,142.70
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	154,079,929.22	154,079,929.22

注：1. 申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

2. 本基金自 2022 年 1 月 10 日至 2022 年 1 月 21 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 346,352,078.87 元，其中 A 类基金募集有效净认购资金为 109,117,406.41 元，其中 C 类基金募集有效净认购资金为 237,234,672.46 元。根据《创金合信大健康混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 112,444.22 元，在本基金成立后，折算为 112,444.22 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

7.4.8 其他综合收益

7.4.8.1 未分配利润

单位：人民币元

创金合信大健康混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

本期利润	-4,478,457.09	-5,406,654.71	-9,885,111.80
本期基金份额交易产生的变动数	616,075.48	-42,202.17	573,873.31
其中：基金申购款	-175,264.98	-151,126.61	-326,391.59
基金赎回款	791,340.46	108,924.44	900,264.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,862,381.61	-5,448,856.88	-9,311,238.49

创金合信大健康混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-10,273,767.25	-8,810,699.78	-19,084,467.03
本期基金份额交易产生的变动数	3,098,567.34	-353,847.06	2,744,720.28
其中：基金申购款	-439,904.07	-452,318.56	-892,222.63
基金赎回款	3,538,471.41	98,471.50	3,636,942.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,175,199.91	-9,164,546.84	-16,339,746.75

7.4.8.2 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	27,697.93
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	-
其他	259,625.73
合计	287,323.66

7.4.8.3 股票投资收益

7.4.8.3.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,418,055.48
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	-10,418,055.48

7.4.8.3.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日） 至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	161,781,635.13
减：卖出股票成本总额	171,557,969.86
减：交易费用	641,720.75
买卖股票差价收入	-10,418,055.48

7.4.8.3.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无股票赎回差价收入。

7.4.8.3.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无股票申购差价收入。

7.4.8.3.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借差价收入。

7.4.8.4 债券投资收益

7.4.8.4.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日） 至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	56.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	56.47

7.4.8.4.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

7.4.8.4.3 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.8.4.4 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.8.5 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.8.6 衍生工具收益

7.4.8.6.1 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。

7.4.8.6.2 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。

7.4.8.7 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日） 至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	836,280.85
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	836,280.85

7.4.8.8 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-14,217,354.49
——股票投资	-14,259,478.99
——债券投资	42,124.50
——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	-14,217,354.49

7.4.8.9 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日） 至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	73,389.75
转换费收入	685.59
合计	74,075.34

7.4.8.10 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

7.4.8.11 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	53,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
账户维护费	400.00
合计	173,400.00

7.4.9 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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。

7.4.10 关联方关系

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

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
华夏银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
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。

7.4.11 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.11.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.11.1.1 股票交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.11.1.2 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。

7.4.11.1.3 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。

7.4.11.1.4 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。

7.4.11.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期末无应支付关联方的佣金。

7.4.11.2 关联方报酬

7.4.11.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,864,012.31
其中：支付销售机构的客户维护费	1,905,110.96

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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

7.4.11.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	644,002.05

注：支付基金托管人华夏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。

7.4.11.2.3 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 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信大健康混合 A	创金合信大健康混合 C	合计
创金合信直销	-	55.67	55.67
华夏银行	-	466,637.78	466,637.78
合计	-	466,693.45	466,693.45

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：

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

7.4.11.3 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。

7.4.11.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.11.4.1 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。

7.4.11.4.2 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。

7.4.11.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.11.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.11.5.2 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

本报告期末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.11.6 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 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有限公司	682,055.21	27,697.93

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

7.4.11.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.11.8 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。

7.4.12 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.13 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.13.1 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

7.4.13.1.1 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
688172	燕东微	2022 年 12 月 9 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	21.98	17.96	7,071	155,420.58	126,995.16	-
301269	华大九天	2022 年 7 月 21 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	32.69	87.94	322	10,526.18	28,316.68	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	33.65	69.68	374	12,585.10	26,060.32	-
301327	华宝新能	2022 年 9 月 8 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	237.50	176.97	109	25,887.50	19,289.73	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	3.82	6.01	2,819	10,768.58	16,942.19	-
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	58.00	86.49	175	10,150.00	15,135.75	-
301297	富乐德	2022 年 12 月 23 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	8.48	12.99	980	8,310.40	12,730.20	-
301195	北路智控	2022 年 7 月 25 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	71.17	73.04	170	12,098.90	12,416.80	-
301311	昆船智能	2022 年 11 月 23 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	13.88	15.86	657	9,119.16	10,420.02	-
301338	凯格精机	2022 年 8 月 8 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	46.33	48.99	206	9,543.98	10,091.94	-
301330	熵基科技	2022 年	1-6 个月	创业板	43.32	31.31	303	13,125.96	9,486.93	-

		8月10日	月(含)	打新限售						
301139	元道通信	2022年6月30日	1-6个月(含)	创业板打新限售	38.46	25.31	373	14,345.58	9,440.63	-
301132	满坤科技	2022年8月3日	1-6个月(含)	创业板打新限售	26.80	24.48	366	9,808.80	8,959.68	-
301363	美好医疗	2022年9月28日	1-6个月(含)	创业板打新限售	30.66	37.85	235	7,205.10	8,894.75	-
301377	鼎泰高科	2022年11月11日	1-6个月(含)	创业板打新限售	22.88	17.63	481	11,005.28	8,480.03	-
301379	天山电子	2022年10月19日	1-6个月(含)	创业板打新限售	31.51	24.63	342	10,776.42	8,423.46	-
301121	紫建电子	2022年8月1日	1-6个月(含)	创业板打新限售	61.07	49.77	169	10,320.83	8,411.13	-
301227	森鹰窗业	2022年9月16日	1-6个月(含)	创业板打新限售	38.25	29.49	275	10,518.75	8,109.75	-
301165	锐捷网络	2022年11月14日	1-6个月(含)	创业板打新限售	32.38	31.61	255	8,256.90	8,060.55	-
301290	东星医疗	2022年11月23日	1-6个月(含)	创业板打新限售	44.09	35.13	229	10,096.61	8,044.77	-
301389	隆扬电子	2022年10月18日	1-6个月(含)	创业板打新限售	22.50	17.16	465	10,462.50	7,979.40	-
301335	天元宠物	2022年11月11日	1-6个月(含)	创业板打新限售	49.98	33.82	230	11,495.40	7,778.60	-
301296	新巨丰	2022年8月26日	1-6个月(含)	创业板打新限售	18.19	14.90	504	9,167.76	7,509.60	-
301339	通行宝	2022年9月2日	1-6个月(含)	创业板打新限售	18.78	15.59	481	9,033.18	7,498.79	-
301398	星源卓镁	2022年12月8日	1-6个月(含)	创业板打新限售	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-

301171	易点天下	2022年 8月10 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	18.18	17.72	407	7,399.26	7,212.04	-
301313	凡拓数创	2022年 9月22 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301326	捷邦科技	2022年 9月9 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	51.72	36.62	191	9,878.52	6,994.42	-
301280	珠城科技	2022年 12月19 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	67.40	44.80	156	10,514.40	6,988.80	-
301115	建科股份	2022年 8月23 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	42.05	24.04	280	11,774.00	6,731.20	-
301176	逸豪新材	2022年 9月21 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	23.88	16.89	389	9,289.32	6,570.21	-
301359	东南电子	2022年 11月2 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301197	工大科雅	2022年 7月29 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	25.50	20.08	315	8,032.50	6,325.20	-
301300	远翔新材	2022年 8月9 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301366	一博科技	2022年 9月19 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	65.35	45.09	136	8,887.60	6,132.24	-
301270	汉仪股份	2022年 8月19 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301282	金禄电子	2022年 8月18 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	30.38	25.25	227	6,896.26	5,731.75	-
301319	唯特偶	2022年 9月22 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	47.75	53.27	104	4,966.00	5,540.08	-
301233	盛帮股份	2022年 6月24 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301265	华新环保	2022年 12月8 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	13.28	11.40	472	6,268.16	5,380.80	-

		日		售						
301388	欣灵电气	2022 年 10 月 26 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	25.88	21.60	241	6,237.08	5,205.60	-
301316	慧博云通	2022 年 9 月 29 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301276	嘉曼服饰	2022 年 9 月 1 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	40.66	22.61	212	8,619.92	4,793.32	-
301309	万得凯	2022 年 9 月 8 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	39.00	24.46	143	5,577.00	3,497.78	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

7.4.13.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.13.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.3.2 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。

7.4.13.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.14 金融工具风险及管理

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 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华夏银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所（场内）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，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质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。

7.4.14.2.1 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。

7.4.14.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.14.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.14.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	227,182.89
未评级	-
合计	227,182.89

7.4.14.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.14.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.14.3 流动性风险

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

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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.14.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

7.4.14.4 市场风险

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

7.4.14.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.14.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
----------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
银行存款	682,055.21	-	-	-	682,055.21
存出保证金	12,499,977.36	-	-	-	12,499,977.36
交易性金融资产	-	-	227,182.89	207,055,886.58	207,283,069.47
应收申购款	-	-	-	32,137.84	32,137.84
资产总计	13,182,032.57	-	227,182.89	207,088,024.42	220,497,239.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	110,913.08	110,913.08
应付管理人报酬	-	-	-	280,045.30	280,045.30
应付托管费	-	-	-	46,674.22	46,674.22
应付销售服务费	-	-	-	58,518.50	58,518.50
应交税费	-	-	-	1.39	1.39
其他负债	-	-	-	173,000.00	173,000.00
负债总计	-	-	-	669,152.49	669,152.49
利率敏感度缺口	13,182,032.57	-	227,182.89	206,418,871.93	219,828,087.39

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

7.4.14.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末无利率风险的敏感性分析。

7.4.14.4.2 外汇风险

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

7.4.14.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无外汇风险的敏感性分析。

7.4.14.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，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。

7.4.14.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	207,055,886.58	94.19
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	207,055,886.58	94.19

7.4.14.4.3.2 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 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准上升 5%	12,185,238.93
	2.业绩比较基准下降 5%	-12,185,238.93

7.4.15 公允价值

7.4.15.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.15.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.15.2.1 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 2022 年 12 月 31 日
第一层次	206,766,669.64
第二层次	-
第三层次	516,399.83
合计	207,283,069.47

7.4.15.2.2 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。

7.4.15.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.15.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	558,522.75	558,522.75
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-42,122.92	-42,122.92
其中：计入损益的利得或损失	-	-42,122.92	-42,122.92
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	516,399.83	516,399.83
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-42,122.92	-42,122.92

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益项目。

7.4.15.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	516,399.83	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.91%-247.56%	负相关

7.4.15.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

7.4.15.4 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。

7.4.16 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 12 月 31 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	207,055,886.58	93.90
	其中：股票	207,055,886.58	93.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	227,182.89	0.10
	其中：债券	227,182.89	0.10
	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	682,055.21	0.31
8	其他资产	12,532,115.20	5.68
9	合计	220,497,239.88	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	159,291,393.47	72.46
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	5,955,793.71	2.71
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	554,126.62	0.25
J	金融业	82,553.38	0.04
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	35,684,635.82	16.23
N	水利、环境和公共设施管理业	180,243.26	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,307,140.32	2.41
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	207,055,886.58	94.19

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300633	开立医疗	368,917	20,227,719.11	9.20
2	688198	佰仁医疗	154,000	19,866,000.00	9.04
3	300760	迈瑞医疗	62,800	19,842,916.00	9.03
4	603392	万泰生物	149,200	18,903,640.00	8.60
5	603127	昭衍新药	282,914	16,525,006.74	7.52
6	688202	美迪西	61,586	13,172,629.54	5.99
7	300122	智飞生物	138,954	12,204,329.82	5.55
8	688677	海泰新光	98,945	11,180,785.00	5.09
9	688050	爱博医疗	38,000	8,766,600.00	3.99
10	300896	爱美客	13,800	7,815,630.00	3.56
11	600976	健民集团	119,859	5,955,793.71	2.71
12	002821	凯莱英	35,400	5,239,200.00	2.38
13	688356	键凯科技	29,000	4,539,950.00	2.07
14	300358	楚天科技	300,000	4,425,000.00	2.01
15	300347	泰格医药	36,400	3,814,720.00	1.74
16	300601	康泰生物	99,960	3,151,738.80	1.43
17	002371	北方华创	12,000	2,703,600.00	1.23
18	600460	士兰微	66,000	2,164,140.00	0.98
19	300015	爱尔眼科	60,000	1,864,200.00	0.85

20	600763	通策医疗	12,000	1,835,880.00	0.84
21	300759	康龙化成	25,000	1,700,000.00	0.77
22	600085	同仁堂	35,600	1,590,608.00	0.72
23	600436	片仔癀	5,500	1,586,530.00	0.72
24	605358	立昂微	37,000	1,576,200.00	0.72
25	600276	恒瑞医药	39,933	1,538,618.49	0.70
26	000516	国际医学	110,000	1,346,400.00	0.61
27	000423	东阿阿胶	30,000	1,221,000.00	0.56
28	603351	威尔药业	50,000	1,081,500.00	0.49
29	688212	澳华内镜	15,000	982,350.00	0.45
30	300171	东富龙	40,000	949,200.00	0.43
31	688271	联影医疗	4,708	833,221.84	0.38
32	600572	康恩贝	160,000	756,800.00	0.34
33	300396	迪瑞医疗	20,200	497,122.00	0.23
34	000403	派林生物	20,000	455,200.00	0.21
35	688266	泽璟制药	10,000	417,000.00	0.19
36	600079	人福医药	17,000	406,130.00	0.18
37	300049	福瑞股份	15,000	366,450.00	0.17
38	600161	天坛生物	13,920	330,321.60	0.15
39	301230	泓博医药	6,000	320,520.00	0.15
40	688337	普源精电	3,216	314,171.04	0.14
41	688235	百济神州	2,000	264,900.00	0.12
42	603882	金域医学	3,000	234,600.00	0.11
43	301367	怡和嘉业	1,000	219,570.00	0.10
44	301327	华宝新能	1,087	203,398.23	0.09
45	603896	寿仙谷	5,000	198,300.00	0.09
46	300294	博雅生物	5,000	182,800.00	0.08
47	688197	首药控股	7,200	174,816.00	0.08
48	301175	中科环保	28,184	170,907.74	0.08
49	300705	九典制药	7,000	170,100.00	0.08
50	603998	方盛制药	20,200	161,802.00	0.07
51	002007	华兰生物	7,000	158,410.00	0.07
52	301095	广立微	1,744	154,823.82	0.07
53	301297	富乐德	9,794	145,028.34	0.07
54	600566	济川药业	5,000	136,100.00	0.06
55	002422	科伦药业	5,000	133,050.00	0.06
56	688475	萤石网络	5,063	131,283.59	0.06
57	688172	燕东微	7,071	126,995.16	0.06
58	301195	北路智控	1,700	126,707.80	0.06
59	301311	昆船智能	6,564	115,151.13	0.05
60	301139	元道通信	3,730	94,943.42	0.04
61	688147	微导纳米	3,566	89,435.28	0.04
62	301290	东星医疗	2,281	84,851.13	0.04

63	301389	隆扬电子	4,644	84,455.10	0.04
64	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.04
65	301313	凡拓数创	2,464	79,626.97	0.04
66	301398	星源卓镁	2,549	78,837.80	0.04
67	688496	清越科技	8,480	76,998.40	0.04
68	301280	珠城科技	1,558	73,934.30	0.03
69	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.03
70	688525	佰维存储	3,815	61,268.90	0.03
71	301282	金禄电子	2,266	59,296.28	0.03
72	301153	中科江南	353	37,573.32	0.02
73	301309	万得凯	1,423	35,523.38	0.02
74	301269	华大九天	322	28,316.68	0.01
75	002317	众生药业	1,000	26,990.00	0.01
76	301239	普瑞眼科	374	26,060.32	0.01
77	301268	铭利达	440	22,092.40	0.01
78	301238	瑞泰新材	888	19,971.12	0.01
79	301187	欧圣电气	795	13,451.40	0.01
80	301112	信邦智能	399	12,404.91	0.01
81	301338	凯格精机	206	10,091.94	0.00
82	301330	熵基科技	303	9,486.93	0.00
83	301148	嘉戎技术	432	9,335.52	0.00
84	301132	满坤科技	366	8,959.68	0.00
85	301363	美好医疗	235	8,894.75	0.00
86	301377	鼎泰高科	481	8,480.03	0.00
87	301379	天山电子	342	8,423.46	0.00
88	301121	紫建电子	169	8,411.13	0.00
89	301150	中一科技	129	8,321.79	0.00
90	301227	森鹰窗业	275	8,109.75	0.00
91	301165	锐捷网络	255	8,060.55	0.00
92	301151	冠龙节能	464	7,892.64	0.00
93	301335	天元宠物	230	7,778.60	0.00
94	301296	新巨丰	504	7,509.60	0.00
95	301339	通行宝	481	7,498.79	0.00
96	301171	易点天下	407	7,212.04	0.00
97	301326	捷邦科技	191	6,994.42	0.00
98	301115	建科股份	280	6,731.20	0.00
99	301176	逸豪新材	389	6,570.21	0.00
100	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
101	301197	工大科雅	315	6,325.20	0.00
102	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
103	301366	一博科技	136	6,132.24	0.00
104	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
105	301319	唯特偶	104	5,540.08	0.00

106	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
107	301265	华新环保	472	5,380.80	0.00
108	301388	欣灵电气	241	5,205.60	0.00
109	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
110	301276	嘉曼服饰	212	4,793.32	0.00
111	603707	健友股份	200	3,608.00	0.00
112	688448	磁谷科技	1	23.51	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	603127	昭衍新药	28,604,812.84	13.01
2	300760	迈瑞医疗	28,235,709.50	12.84
3	603392	万泰生物	28,118,099.00	12.79
4	300122	智飞生物	26,180,780.82	11.91
5	688202	美迪西	19,265,876.78	8.76
6	688198	佰仁医疗	18,673,784.90	8.49
7	600976	健民集团	18,200,704.52	8.28
8	688356	键凯科技	17,537,924.98	7.98
9	300633	开立医疗	17,534,597.07	7.98
10	688050	爱博医疗	16,665,795.15	7.58
11	300358	楚天科技	15,703,144.00	7.14
12	300601	康泰生物	13,446,753.84	6.12
13	002821	凯莱英	12,637,101.00	5.75
14	002371	北方华创	10,670,345.97	4.85
15	688677	海泰新光	10,416,189.87	4.74
16	300896	爱美客	9,359,498.00	4.26
17	605358	立昂微	8,770,617.00	3.99
18	002932	明德生物	7,255,407.70	3.30
19	300171	东富龙	7,130,241.00	3.24
20	600460	士兰微	6,954,226.00	3.16

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	688050	爱博医疗	11,540,468.05	5.25
2	688356	键凯科技	10,800,886.57	4.91
3	603127	昭衍新药	9,071,949.00	4.13

4	300122	智飞生物	8,657,665.00	3.94
5	300633	开立医疗	8,190,430.85	3.73
6	300358	楚天科技	8,106,362.00	3.69
7	600976	健民集团	7,962,361.00	3.62
8	300760	迈瑞医疗	7,801,642.00	3.55
9	002932	明德生物	6,779,728.70	3.08
10	300601	康泰生物	5,853,200.00	2.66
11	002371	北方华创	5,204,650.00	2.37
12	605358	立昂微	5,049,528.00	2.30
13	300171	东富龙	4,081,509.00	1.86
14	603392	万泰生物	3,919,711.25	1.78
15	002821	凯莱英	3,374,525.00	1.54
16	300896	爱美客	2,735,882.00	1.24
17	600519	贵州茅台	2,655,309.00	1.21
18	603939	益丰药房	2,179,424.00	0.99
19	300482	万孚生物	1,897,048.00	0.86
20	600460	士兰微	1,844,648.00	0.84

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	392,873,335.43
卖出股票收入（成交）总额	161,781,635.13

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。

8.5 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	227,182.89	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	227,182.89	0.10

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111010	立昂转债	1,850	227,182.89	0.10

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

2022 年 11 月 16 日，上海美迪西生物医药股份有限公司（下称“美迪西”，股票代码：688202.SH）收到行政处罚决定书（浦第 2120224058 号）显示，由于“未按照规定及时、如实向卫生行政部门申报产生职业病危害的项目，未按照规定组织职业健康检查、建立职业健康监护档案或者未将检查结果书面告知劳动者，未按照规定对工作场所职业病危害因素进行检测、评价”，上述行为违反了《中华人民共和国职业病防治法》第十六条第二款、第三十五条第一款、第二十六条第二款的相关规定，根据《中华人民共和国职业病防治法》相关处罚规定，浦东新区卫健委对美迪西警告，并作出合计罚款 18 万元的行政处罚决定。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，美迪西公司改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该公司经营状况正常。此外，18 万元罚款相对于美迪西公司 2021 年 2.82 亿元归属母公司净利润而言影响十分有限。该公司作为国内临床前研发外包服务龙头公司之一，目前估值处于历史底部，维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对美迪西进行了投资。

8.12.2

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。

8.12.3 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	12,499,977.36
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	32,137.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,532,115.20

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	人均持有的 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	持有份额	占总份额比	

				例		例
创金合信大健康混合 A	2,711	33,714.18	795,515.96	0.87%	90,603,627.45	99.13%
创金合信大健康混合 C	5,976	25,783.12	3,140,706.50	2.04%	150,939,222.72	97.96%
合计	8,598	28,550.72	3,936,222.46	1.60%	241,542,850.17	98.40%

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）。

9.2 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	创金合信大健康混合 A	104,781.70	0.11%
	创金合信大健康混合 C	25,102.56	0.02%
	合计	129,884.26	0.05%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	创金合信大健康混合 A	0~10
	创金合信大健康混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信大健康混合 A	0
	创金合信大健康混合 C	0
	合计	0

§ 10 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	4,743,450.39	11,244,065.65
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	22,503,823.80	94,469,142.70
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）	-	-

本报告期末基金份额总额	91,399,143.41	154,079,929.22
-------------	---------------	----------------

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金的基金托管人未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 53,000.00 元，该审计机构连续提供审计服务的年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

			额的比例			
华创证券	2	541,219,915.10	100.00%	398,958.48	100.00%	-

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。

本基金在报告期内成立，交易单元均于本期内新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
华创证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信大健康混合型证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-27
2	创金合信基金管理有限公司关于旗下创金合信大健康混合型证券投资基金可投资于科创板股票及相关风险揭示的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-27
3	创金合信大健康混合型证券投资基金(A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	2022-01-28
4	创金合信大健康混合型证券投资基金(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	2022-01-28
5	创金合信大健康混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21

6	创金合信大健康混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-22
7	创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金转换业务规则说明的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-10
8	创金合信大健康混合型证券投资基金（2022 年 7 月）招募说明书（更新）	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-13
9	创金合信大健康混合型证券投资基金(A 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	2022-07-13
10	创金合信大健康混合型证券投资基金(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	2022-07-13
11	创金合信大健康混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-20
12	创金合信基金管理有限公司关于暂停北京微动利基金销售有限公司、喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2022-08-18
13	创金合信大健康混合型证券投资基金 2022 年中期报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-08-30
14	创金合信大健康混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-15
15	创金合信大健康混合型证券投资基金（2022 年 9 月）招募说明书（更新）	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-16
16	创金合信大健康混合型证券投资基金(A 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	2022-09-16
17	创金合信大健康混合型证券投资基金(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	2022-09-16
18	创金合信大健康混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-25

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期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。

12.2 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。2022 年 7 月，创金合信基金荣获证券时报第十七届“明星基金公司成长奖”。截至 2022 年 12 月 31 日，创金合信基金共管理 90 只公募基金，公募管理规模 940.93 亿元。

§ 13 备查文件目录

13.1 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 年度报告原文。

13.2 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

13.3 查阅方式

www.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日