

创金合信大健康混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：华夏银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	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.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§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.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	42
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 报告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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
7.6 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债券投资明细.....	49
7.7 报告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.....	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	49
7.9 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权证投资明细.....	49

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	55

§ 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	225,596,773.11 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	84,363,067.35 份	141,233,705.76 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，人们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

2.5 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、创金合信大健康混合 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-6,534,558.74
本期利润	-7,533,195.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0855
本期加权平均净值利润率	-9.61%
本期基金份额净值增长率	-9.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-16,031,392.83
期末可供分配基金份额利润	-0.1900
期末基金资产净值	68,331,674.52
期末基金份额净值	0.8100
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-19.00%

2、创金合信大健康混合 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-11,250,967.85
本期利润	-12,842,612.56
加权平均基金份额本期利润	-0.0868
本期加权平均净值利润率	-9.81%
本期基金份额净值增长率	-10.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-27,652,339.82
期末可供分配基金份额利润	-0.1958
期末基金资产净值	113,581,365.94
期末基金份额净值	0.8042
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-19.58%

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。

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

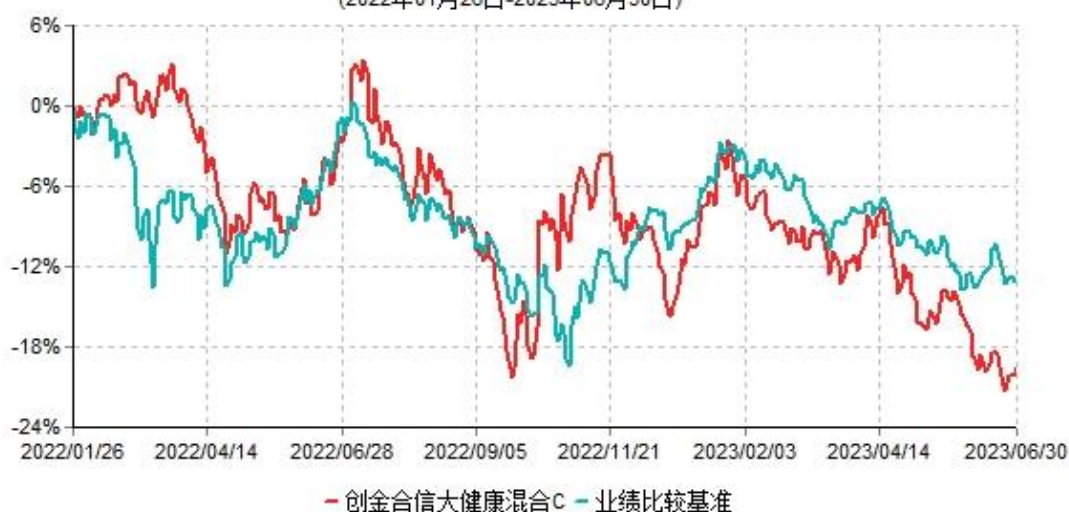
创金合信大健康混合 A

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
过去一个月	-4.69%	0.98%	1.01%	0.73%	-5.70%	0.25%
过去三个月	-9.45%	1.05%	-5.55%	0.67%	-3.90%	0.38%
过去六个月	-9.81%	1.08%	-4.73%	0.71%	-5.08%	0.37%
过去一年	-18.49%	1.49%	-12.15%	0.91%	-6.34%	0.58%
自基金合同生效起至今	-19.00%	1.39%	-12.89%	1.05%	-6.11%	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
过去一个月	-4.74%	0.98%	1.01%	0.73%	-5.75%	0.25%
过去三个月	-9.56%	1.05%	-5.55%	0.67%	-4.01%	0.38%
过去六个月	-10.04%	1.08%	-4.73%	0.71%	-5.31%	0.37%
过去一年	-18.91%	1.49%	-12.15%	0.91%	-6.76%	0.58%
自基金合同生效起至今	-19.58%	1.39%	-12.89%	1.05%	-6.69%	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-2023年06月30日)创金合信大健康混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年01月26日-2023年06月30日)

注：本基金建仓期为 6 个月。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 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（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	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	2022 年 1 月 26 日	-	11	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。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本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 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

上半年申万医药指数下跌 5.88%，第二季度板块调整较大。受业绩提速、国企改革等因素驱动，中成药、医药分销、化学制药表现较好；因订单及业绩增速下滑、高估值消化等原因，CXO、疫苗、医疗服务等跌幅较大。

上半年全国层面仿制药、中成药集采落地，降幅符合预期；省级层面药品、耗材集采持续推进，集采价格降幅趋缓，加上大品种基本完成集采，集采对行业边际影响减弱。此外政策延续对创新支持，医保局发布了医保谈判续约规则征求意见，加大了对创新药价格保护，国内药企创新能力不断提升，医药产业进入高质量发展阶段，投资上仍有较多结构性机会。

上半年，本基金围绕创新和消费升级布局，主要仓位集中在医疗设备、高值耗材、疫苗、中成药。上半年部分领域复苏偏慢，持仓个股业绩较弱影响股价，随着诊疗活动常态，预计下半年会有较好补偿。考虑到目前持仓个股估值性价比适合，持仓变化不大，等待业绩和估值逐步回归。

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 0.8100 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.81%，同期业绩比较基准收益率为-4.73%；截至本报告期末创金合信大健康混合 C 基金份额净值为 0.8042 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.04%，同期业绩比较基准收益率为-4.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内生产总值同比增长 5.5%，一季度防疫政策调整后经济快速反弹，二季度增长低于预期，地产、民间投资和出口压力较大，消费端修复较强。预计下半年逆周期调控

政策将托底经济增长，经济回归常态化运行。上半年股票市场呈现结构性行情，AI、中成药等板块表现较好，其他板块较弱。鉴于经济企稳，PPI 拐点显现，下半年经济有望修复，市场有望进入上行周期。医药板块整体运行平稳，集采常态化，政策支持创新、传承的大方向不变。在医药总盘子不断扩大背景下，板块仍有结构性机会。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内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 托管人对本中期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中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：创金合信大健康混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,267,684.76	682,055.21
结算备付金		-	-
存出保证金		6,239,625.04	12,499,977.36
交易性金融资产	6.4.7.2	170,743,620.43	207,283,069.47
其中：股票投资		170,148,901.56	207,055,886.58
基金投资		-	-
债券投资		594,718.87	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	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		1,145,148.17	-
应收股利		-	-
应收申购款		25,515.63	32,137.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		183,421,594.03	220,497,239.88
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,107,130.05	110,913.08
应付管理人报酬		229,061.71	280,045.30
应付托管费		38,176.94	46,674.22
应付销售服务费		47,551.98	58,518.50
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.40	1.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	86,630.49	173,000.00
负债合计		1,508,553.57	669,152.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	225,596,773.11	245,479,072.63
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-43,683,732.65	-25,650,985.24
净资产合计		181,913,040.46	219,828,087.39
负债和净资产总计		183,421,594.03	220,497,239.88

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，创金合信大健康混合 A 份额净值 0.8100 元，基金份额总额 84,363,067.35 份；创金合信大健康混合 C 份额净值 0.8042 元，基金份额总额 141,233,705.76 份；总份额合计 225,596,773.11 份。

6.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 26 日（基金合同生 效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-18,143,365.60	-2,277,665.01
1.利息收入		21,349.04	251,107.82
其中：存款利息收入	6.4.7.9	21,349.04	251,107.82
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		-	-

证券出借利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-15,583,819.87	-10,056,368.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-16,995,150.10	-10,599,658.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	19,543.58	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,391,786.65	543,290.15
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）	6.4.7.16	-2,590,281.28	7,510,936.46
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	9,386.51	16,659.47
减：二、营业总支出		2,232,442.27	2,970,029.59
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,561,026.30	2,073,870.66
2.托管费	6.4.10.2.2	260,171.04	345,645.11
3.销售服务费	6.4.10.2.3	325,453.54	470,737.90
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		1.01	-
8.其他费用	6.4.7.19	85,790.38	79,775.92
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-20,375,807.87	-5,247,694.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-20,375,807.87	-5,247,694.60
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-20,375,807.87	-5,247,694.60

注：本基金合同生效日为 2022 年 1 月 26 日，上年度可比期间为 2022 年 1 月 26 日至 2022 年 6 月 30 日。

6.3 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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（基金净值）	245,479,072.63	-	-25,650,985.24	219,828,087.39
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）	245,479,072.63	-	-25,650,985.24	219,828,087.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,882,299.52	-	-18,032,747.41	-37,915,046.93
（一）、综合收益总额	-	-	-20,375,807.87	-20,375,807.87
（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）	-19,882,299.52	-	2,343,060.46	-17,539,239.06
其中：1.基金申购款	6,503,735.53	-	-694,854.45	5,808,881.08
2.基金赎回款	-26,386,035.05	-	3,037,914.91	-23,348,120.14
（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）	225,596,773.11	-	-43,683,732.65	181,913,040.46
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 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（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）	-31,491,112.35	-	-2,405,325.68	-33,896,438.03
（一）、综合收益总额	-	-	-5,247,694.60	-5,247,694.60
（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）	-31,491,112.35	-	2,842,368.92	-28,648,743.43
其中：1.基金申购款	2,879,285.83	-	-150,399.16	2,728,886.67
2.基金赎回款	-34,370,398.18	-	2,992,768.08	-31,377,630.10
（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）	314,973,410.74	-	-2,405,325.68	312,568,085.06

注：本基金合同生效日为 2022 年 1 月 26 日，上年度可比期间为 2022 年 1 月 26 日至 2022 年 6 月 30 日。

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”)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,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《创金合信大健康混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 346,352,078.87 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 2200191 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信大健康混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 346,464,523.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 112,444.22 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”)。

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《创金合信大健康混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为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。本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%。

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》、《创金合信大健康混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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 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，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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	5,267,684.76
等于：本金	5,267,134.28
加：应计利息	550.48
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	5,267,684.76

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	187,002,047.33	-	170,148,901.56	-16,853,145.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所	548,900.00	308.87	594,718.87	45,510.00

	市场				
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	548,900.00	308.87	594,718.87	45,510.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		187,550,947.33	308.87	170,743,620.43	-16,807,635.77

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 2023 年 6 月 30 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	573.78
其中：交易所市场	573.78
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	85,790.38
其他应付	266.33
合计	86,630.49

6.4.7.7 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	91,399,143.41	91,399,143.41
本期申购	2,068,111.23	2,068,111.23
本期赎回（以“-”号填列）	-9,104,187.29	-9,104,187.29
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	84,363,067.35	84,363,067.35

创金合信大健康混合 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	154,079,929.22	154,079,929.22
本期申购	4,435,624.30	4,435,624.30
本期赎回（以“-”号填列）	-17,281,847.76	-17,281,847.76
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	141,233,705.76	141,233,705.76

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

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
上年度末	-3,862,381.61	-5,448,856.88	-9,311,238.49
本期利润	-6,534,558.74	-998,636.57	-7,533,195.31
本期基金份额交易产生的变动数	523,849.68	289,191.29	813,040.97
其中：基金申购款	-134,348.31	-61,699.77	-196,048.08
基金赎回款	658,197.99	350,891.06	1,009,089.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,873,090.67	-6,158,302.16	-16,031,392.83

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
上年度末	-7,175,199.91	-9,164,546.84	-16,339,746.75
本期利润	-11,250,967.85	-1,591,644.71	-12,842,612.56
本期基金份额交易产生的变动数	1,042,549.83	487,469.66	1,530,019.49
其中：基金申购款	-343,304.12	-155,502.25	-498,806.37
基金赎回款	1,385,853.95	642,971.91	2,028,825.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,383,617.93	-10,268,721.89	-27,652,339.82

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,389.25
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	9,959.79
合计	21,349.04

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-16,995,150.10
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	-16,995,150.10

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	384,316,729.40
减：卖出股票成本总额	400,297,091.37
减：交易费用	1,014,788.13
买卖股票差价收入	-16,995,150.10

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	252.81
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	19,290.77
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	19,543.58

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	84,807.98

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	65,500.00
减：应计利息总额	10.77
减：交易费用	6.44
买卖债券差价收入	19,290.77

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,391,786.65
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,391,786.65

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-2,590,281.28
——股票投资	-2,593,666.78
——债券投资	3,385.50
——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	-2,590,281.28

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	8,740.82
转换费收入	645.69
合计	9,386.51

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	26,283.01
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	85,790.38

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

本报告期不存在重大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
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。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未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

本基金于本报告期末及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,561,026.30	2,073,870.66
其中：支付销售机构的客户维护费	767,265.92	1,023,780.30

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023	上年度可比期间 2022 年 1 月
----	-------------------------	--------------------

	年 6 月 30 日	26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托 管费	260,171.04	345,645.11

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：

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

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信大健康混合 A	创金合信大健康混合 C	合计
创金合信直销	-	50.36	50.36
华夏银行	-	188,841.31	188,841.31
合计	-	188,891.67	188,891.67
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信大健康混合 A	创金合信大健康混合 C	合计
创金合信直销	-	-	-
华夏银行	-	250,248.38	250,248.38
合计	-	250,248.38	250,248.38

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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有限公司	5,267,684.76	11,389.25	8,270,673.38	14,181.57

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间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（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

						单价	位:股)			
301395	仁信新材	2023年 6月21 日	1个月 内(含)	新股未 上市	26.68	26.68	2,571	68,594.28	68,594.28	-
301488	豪恩汽电	2023年 6月26 日	1个月 内(含)	新股未 上市	39.78	39.78	1,615	64,244.70	64,244.70	-
301292	海科新源	2023年 6月29 日	1个月 内(含)	新股未 上市	19.99	19.99	3,109	62,148.91	62,148.91	-
688603	天承科技	2023年 6月30 日	1个月 内(含)	新股未 上市	55.00	55.00	907	49,885.00	49,885.00	-
301261	恒工精密	2023年 6月29 日	1个月 内(含)	新股未 上市	36.90	36.90	1,141	42,102.90	42,102.90	-
301202	朗威股份	2023年 6月28 日	1个月 内(含)	新股未 上市	25.82	25.82	1,388	35,838.16	35,838.16	-
001286	陕西能源	2023年 3月31 日	1-6个 月(含)	新股锁 定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
301293	三博脑科	2023年 4月25 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	29.60	71.42	217	6,423.20	15,498.14	-
688472	阿特斯	2023年 6月2 日	1-6个 月(含)	科创板 打新限 售	11.10	17.04	835	9,268.50	14,228.40	-
301419	阿莱德	2023年 2月2 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	24.80	43.85	322	7,985.60	14,119.70	-
301317	鑫磊股份	2023年 1月12 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	20.67	26.17	518	10,707.06	13,556.06	-
301310	鑫宏业	2023年 5月26 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	67.28	65.43	173	11,639.44	11,319.39	-
301320	豪江智能	2023年 6月1 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	13.06	20.62	544	7,104.64	11,217.28	-
688469	中芯集成	2023年 4月28 日	1-6个 月(含)	科创板 打新限 售	5.69	5.41	2,057	11,704.33	11,128.37	-
688629	华丰科技	2023年	1-6个	科创板	9.26	18.59	578	5,352.28	10,745.02	-

		6月16日	月(含)	打新限售						
688576	西山科技	2023年5月30日	1-6个月(含)	科创板打新限售	135.80	120.41	80	10,864.00	9,632.80	-
688531	日联科技	2023年3月24日	1-6个月(含)	科创板打新限售	152.38	135.97	70	10,666.60	9,517.90	-
301307	美利信	2023年4月14日	1-6个月(含)	创业板打新限售	32.34	31.86	298	9,637.32	9,494.28	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	1-6个月(含)	创业板打新限售	26.80	22.32	408	10,934.40	9,106.56	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	1-6个月(含)	科创板打新限售	26.74	40.68	222	5,936.28	9,030.96	-
688562	航天软件	2023年5月15日	1-6个月(含)	科创板打新限售	12.68	22.31	392	4,970.56	8,745.52	-
301387	光大同创	2023年4月10日	1-6个月(含)	创业板打新限售	58.32	45.36	187	10,905.84	8,482.32	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	1-6个月(含)	创业板打新限售	41.20	42.69	198	8,157.60	8,452.62	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	1-6个月(含)	创业板打新限售	71.88	92.60	91	6,541.08	8,426.60	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	1-6个月(含)	创业板打新限售	23.80	32.84	252	5,997.60	8,275.68	-
688146	中船特气	2023年4月13日	1-6个月(含)	科创板打新限售	36.15	38.13	215	7,772.25	8,197.95	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	1-6个月(含)	创业板打新限售	28.75	21.02	388	11,155.00	8,155.76	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	1-6个月(含)	科创板打新限售	39.99	36.71	220	8,797.80	8,076.20	-
301383	天键股份	2023年5月31日	1-6个月(含)	创业板打新限售	46.16	35.72	226	10,432.16	8,072.72	-

688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	75.00	90.76	87	6,525.00	7,896.12	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	16.24	16.95	451	7,324.24	7,644.45	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	26.68	26.68	286	7,630.48	7,630.48	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	32.29	51.12	149	4,811.21	7,616.88	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	38.13	31.03	244	9,303.72	7,571.32	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	21.86	23.85	315	6,885.90	7,512.75	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	35.00	51.23	145	5,075.00	7,428.35	-
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	21.17	23.50	311	6,583.87	7,308.50	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	37.40	36.07	202	7,554.80	7,286.14	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	39.78	39.78	180	7,160.40	7,160.40	-
301225	恒勃股份	2023 年 6 月 8 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	35.66	33.26	213	7,595.58	7,084.38	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	19.99	19.99	346	6,916.54	6,916.54	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	33.73	31.85	215	7,251.95	6,847.75	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	20.92	19.16	357	7,468.44	6,840.12	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	11.18	14.59	467	5,221.06	6,813.53	-

		日		售						
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	14.16	16.21	412	5,833.92	6,678.52	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	12.10	12.07	551	6,667.10	6,650.57	-
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	30.22	25.50	259	7,826.98	6,604.50	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	14.81	13.73	466	6,901.46	6,398.18	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	43.67	53.05	120	5,240.40	6,366.00	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	10.68	12.34	515	5,500.20	6,355.10	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	11.88	21.02	278	3,302.64	5,843.56	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	72.50	58.42	99	7,177.50	5,783.58	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	26.35	30.60	186	4,901.10	5,691.60	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	25.25	19.69	289	7,297.25	5,690.41	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	26.66	31.50	179	4,772.14	5,638.50	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	55.00	55.00	101	5,555.00	5,555.00	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	44.18	25.10	221	6,980.44	5,547.10	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	131.1 1	53.24	102	8,915.48	5,430.48	-
301157	华塑科技	2023 年	1-6 个	创业板	56.50	52.93	102	5,763.00	5,398.86	-

		3月1日	月(含)	打新限售						
688570	天玛智控	2023年5月29日	1-6个月(含)	科创板打新限售	30.26	25.33	208	6,294.08	5,268.64	-
301386	未来电器	2023年3月21日	1-6个月(含)	创业板打新限售	29.99	23.79	220	6,597.80	5,233.80	-
688429	时创能源	2023年6月20日	1-6个月(含)	科创板打新限售	19.20	25.53	203	3,897.60	5,182.59	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	1-6个月(含)	创业板打新限售	46.13	34.40	146	6,734.98	5,022.40	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	1-6个月(含)	科创板打新限售	25.28	29.87	158	3,994.24	4,719.46	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1-6个月(含)	创业板打新限售	36.90	36.90	127	4,686.30	4,686.30	-
301323	新莱福	2023年5月29日	1-6个月(含)	创业板打新限售	39.06	39.36	117	4,570.02	4,605.12	-
688623	双元科技	2023年5月31日	1-6个月(含)	科创板打新限售	125.88	86.79	52	6,545.76	4,513.08	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	1-6个月(含)	创业板打新限售	32.60	30.37	145	4,727.00	4,403.65	-
601061	中信金属	2023年3月30日	1-6个月(含)	新股锁定	6.58	7.58	572	3,763.76	4,335.76	-
688479	友车科技	2023年5月4日	1-6个月(含)	科创板打新限售	33.99	29.49	147	4,996.53	4,335.03	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	1-6个月(含)	创业板打新限售	34.00	34.93	122	4,148.00	4,261.46	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	1-6个月(含)	新股锁定	28.84	30.78	136	3,922.24	4,186.08	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1-6个月(含)	创业板打新限售	25.82	25.82	155	4,002.10	4,002.10	-

301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	24.66	22.51	154	3,797.64	3,466.54	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	11.66	12.26	220	2,565.20	2,697.20	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	10.36	11.84	218	2,258.48	2,581.12	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	20.68	25.49	101	2,088.68	2,574.49	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	25.98	24.53	73	1,896.54	1,790.69	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	15.38	14.87	114	1,753.32	1,695.18	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	44.48	39.48	40	1,779.20	1,579.20	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总 额	期末估值总 额	备 注
123199	山河转债	2023 年 6 月 12 日	1 个月 内(含)	新债未 上市	100.0 0	100.0 1	3,639	363,900.00	363,930.31	-

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。

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	594,718.87	227,182.89
未评级	-	-
合计	594,718.87	227,182.89

未评级债券包括国债、政策性金融债以及无第三方评级机构债项评级的其他债券。

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 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,267,684.76	-	-	-	5,267,684.76
存出保证金	6,239,625.04	-	-	-	6,239,625.04
交易性金融资产	-	-	594,718.87	170,148,901.56	170,743,620.43
应收申购款	-	-	-	25,515.63	25,515.63
应收清算款	-	-	-	1,145,148.17	1,145,148.17
资产总计	11,507,309.80	-	594,718.87	171,319,565.36	183,421,594.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,107,130.05	1,107,130.05
应付管理人报酬	-	-	-	229,061.71	229,061.71
应付托管费	-	-	-	38,176.94	38,176.94
应付销售服务费	-	-	-	47,551.98	47,551.98
应交税费	-	-	-	2.40	2.40
其他负债	-	-	-	86,630.49	86,630.49
负债总计	-	-	-	1,508,553.57	1,508,553.57
利率敏感度缺口	11,507,309.80	-	594,718.87	169,811,011.79	181,913,040.46
上年度末 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。

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日					
	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	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	1,374,672.18	-	-	-	1,374,672.18
资产合计	-	1,374,672.18	-	-	-	1,374,672.18
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,374,672.18	-	-	-	1,374,672.18

项目	上年度末 2022 年 6 月 30 日					
	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	合计
以外币计价的资产	-	-	-	-	-	-
交易性金	-	-	-	-	-	-

融资产						
资产合计	-	-	-	-	-	-
以外币计价的负债	-	-	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-	-	-

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	68,733.61	-
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-68,733.61	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	170,148,901.56	93.53	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	170,148,901.56	93.53	207,055,886.58	94.19

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1.业绩比较基准上升 5%	8,548,280.81	12,185,238.93
	2.业绩比较基准下降 5%	-8,548,280.81	-12,185,238.93

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。

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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	169,513,275.54
第二层次	722,695.08
第三层次	507,649.81
合计	170,743,620.43

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 2023 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(2022 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 2023 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 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	170,148,901.56	92.76
	其中：股票	170,148,901.56	92.76
2	固定收益投资	594,718.87	0.32
	其中：债券	594,718.87	0.32
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	5,267,684.76	2.87
7	其他资产	7,410,288.84	4.04
8	合计	183,421,594.03	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 1,374,672.18 元，占净值比为 0.76%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	143,209,987.05	78.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.02
E	建筑业	5,072.71	0.00
F	批发和零售业	14,675,062.68	8.07
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	97,991.92	0.05
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	8,268,478.52	4.55
N	水利、环境和公共设施管理业	19,948.97	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,462,240.06	1.35
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	168,774,229.38	92.78

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,374,672.18	0.76
合计	1,374,672.18	0.76

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 报告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	319,016	17,386,372.00	9.56
2	688198	佰仁医疗	156,981	16,657,253.91	9.16
3	688329	艾隆科技	370,000	11,988,000.00	6.59
4	600976	健民集团	135,793	10,468,282.3	5.75

				7	
5	603127	昭衍新药	202,000	8,261,800.00	4.54
6	603392	万泰生物	119,880	8,004,387.60	4.40
7	688050	爱博医疗	38,000	7,802,540.00	4.29
8	688389	普门科技	300,000	7,047,000.00	3.87
9	300358	楚天科技	440,000	6,569,200.00	3.61
10	300760	迈瑞医疗	18,600	5,576,280.00	3.07
11	688677	海泰新光	96,697	5,486,587.78	3.02
12	300452	山河药辅	306,650	5,347,976.00	2.94
13	300653	正海生物	130,000	4,470,700.00	2.46
14	002821	凯莱英	35,400	4,172,244.00	2.29
15	688139	海尔生物	80,000	4,117,600.00	2.26
16	002371	北方华创	12,000	3,811,800.00	2.10
17	300896	爱美客	5,800	2,580,710.00	1.42
18	300143	盈康生命	200,000	2,268,000.00	1.25
19	601607	上海医药	90,000	2,016,900.00	1.11
20	688356	键凯科技	18,000	1,917,900.00	1.05
21	600276	恒瑞医药	40,000	1,916,000.00	1.05
22	002422	科伦药业	61,700	1,831,256.00	1.01
23	600129	太极集团	28,000	1,665,720.00	0.92
24	600557	康缘药业	60,000	1,647,600.00	0.91
25	000423	东阿阿胶	30,000	1,603,500.00	0.88
26	000999	华润三九	24,000	1,455,840.00	0.80
27	H02273	固生堂	30,000	1,374,672.18	0.76
28	300595	欧普康视	45,300	1,367,607.00	0.75
29	603351	威尔药业	50,000	1,341,000.00	0.74
30	600085	同仁堂	23,000	1,323,880.00	0.73
31	600161	天坛生物	45,060	1,223,379.00	0.67
32	600488	津药药业	200,000	1,124,000.00	0.62
33	600460	士兰微	36,000	1,089,720.00	0.60
34	600529	山东药玻	37,000	1,007,140.00	0.55
35	002880	卫光生物	25,000	942,500.00	0.52
36	603998	方盛制药	70,000	882,700.00	0.49
37	300406	九强生物	35,000	816,550.00	0.45
38	600511	国药股份	20,000	777,000.00	0.43
39	600572	康恩贝	100,000	685,000.00	0.38
40	600420	国药现代	60,000	677,400.00	0.37
41	000028	国药一致	15,000	654,150.00	0.36
42	002275	桂林三金	35,000	630,350.00	0.35
43	301263	泰恩康	30,000	626,400.00	0.34
44	600211	西藏药业	10,000	594,000.00	0.33
45	600750	江中药业	26,000	570,180.00	0.31
46	000989	九芝堂	40,000	553,600.00	0.30

47	300396	迪瑞医疗	15,000	487,350.00	0.27
48	600285	羚锐制药	30,000	481,800.00	0.26
49	600329	达仁堂	10,500	471,345.00	0.26
50	688506	百利天恒	5,000	361,800.00	0.20
51	688016	心脉医疗	2,000	359,760.00	0.20
52	688278	特宝生物	8,000	351,280.00	0.19
53	688337	普源精电	4,760	286,837.60	0.16
54	600351	亚宝药业	40,000	284,000.00	0.16
55	605186	健麾信息	5,500	272,250.00	0.15
56	301311	昆船智能	6,564	193,506.72	0.11
57	002262	恩华药业	6,000	184,980.00	0.10
58	688271	联影医疗	1,325	182,863.25	0.10
59	688687	凯因科技	5,000	147,500.00	0.08
60	301015	百洋医药	4,000	111,040.00	0.06
61	688576	西山科技	798	105,169.88	0.06
62	688582	芯动联科	2,215	102,403.01	0.06
63	600763	通策医疗	1,000	96,860.00	0.05
64	688484	南芯科技	2,197	89,528.60	0.05
65	002864	盘龙药业	2,000	84,340.00	0.05
66	301291	明阳电气	2,433	78,932.72	0.04
67	301395	仁信新材	2,857	76,224.76	0.04
68	301488	豪恩汽电	1,795	71,405.10	0.04
69	301292	海科新源	3,455	69,065.45	0.04
70	688603	天承科技	1,008	55,440.00	0.03
71	301153	中科江南	635	47,599.60	0.03
72	301261	恒工精密	1,268	46,789.20	0.03
73	002219	新里程	10,000	45,200.00	0.02
74	301202	朗威股份	1,543	39,840.26	0.02
75	301239	普瑞眼科	374	36,681.92	0.02
76	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
77	301268	铭利达	440	18,422.80	0.01
78	301238	瑞泰新材	888	18,061.92	0.01
79	301293	三博脑科	217	15,498.14	0.01
80	301187	欧圣电气	795	14,683.65	0.01
81	688472	阿特斯	835	14,228.40	0.01
82	301419	阿莱德	322	14,119.70	0.01
83	301317	鑫磊股份	518	13,556.06	0.01
84	301310	鑫宏业	173	11,319.39	0.01
85	301320	豪江智能	544	11,217.28	0.01
86	688469	中芯集成	2,057	11,128.37	0.01
87	301363	美好医疗	249	10,953.51	0.01
88	688629	华丰科技	578	10,745.02	0.01
89	301366	一博科技	245	10,645.25	0.01

90	688531	日联科技	70	9,517.90	0.01
91	301307	美利信	298	9,494.28	0.01
92	301148	嘉戎技术	432	9,236.16	0.01
93	301303	真兰仪表	408	9,106.56	0.01
94	688562	航天软件	392	8,745.52	0.00
95	301387	光大同创	187	8,482.32	0.00
96	301141	中科磁业	198	8,452.62	0.00
97	301360	荣旗科技	91	8,426.60	0.00
98	301150	中一科技	168	8,401.68	0.00
99	301359	东南电子	328	8,357.44	0.00
100	301382	蜂助手	252	8,275.68	0.00
101	301151	冠龙节能	464	8,198.88	0.00
102	688146	中船特气	215	8,197.95	0.00
103	301429	森泰股份	388	8,155.76	0.00
104	301383	天键股份	226	8,072.72	0.00
105	688458	美芯晟	87	7,896.12	0.00
106	301408	华人健康	451	7,644.45	0.00
107	301227	森鹰窗业	275	7,625.75	0.00
108	301315	威士顿	149	7,616.88	0.00
109	688523	航天环宇	315	7,512.75	0.00
110	688535	华海诚科	145	7,428.35	0.00
111	688552	航天南湖	311	7,308.50	0.00
112	301295	C 美硕	202	7,286.14	0.00
113	301225	恒勃股份	213	7,084.38	0.00
114	301373	凌玮科技	215	6,847.75	0.00
115	688512	慧智微	357	6,840.12	0.00
116	688593	新相微	467	6,813.53	0.00
117	688334	西高院	412	6,678.52	0.00
118	688352	硕中科技	551	6,650.57	0.00
119	301262	海看股份	259	6,604.50	0.00
120	301388	欣灵电气	241	6,470.85	0.00
121	301332	德尔玛	466	6,398.18	0.00
122	688543	国科军工	120	6,366.00	0.00
123	688620	安凯微	515	6,355.10	0.00
124	001287	中电港	278	5,843.56	0.00
125	301232	飞沃科技	99	5,783.58	0.00
126	301428	世纪恒通	186	5,691.60	0.00
127	301305	朗坤环境	289	5,690.41	0.00
128	688433	华曙高科	179	5,638.50	0.00
129	301281	科源制药	221	5,547.10	0.00
130	301322	绿通科技	102	5,430.48	0.00
131	301157	华塑科技	102	5,398.86	0.00
132	688570	天玛智控	208	5,268.64	0.00

133	301386	未来电器	220	5,233.80	0.00
134	688429	时创能源	203	5,182.59	0.00
135	301203	国泰环保	146	5,022.40	0.00
136	688631	莱斯信息	158	4,719.46	0.00
137	301323	新莱福	117	4,605.12	0.00
138	688623	二元科技	52	4,513.08	0.00
139	301337	亚华电子	145	4,403.65	0.00
140	601061	中信金属	572	4,335.76	0.00
141	688479	友车科技	147	4,335.03	0.00
142	301170	锡南科技	122	4,261.46	0.00
143	001380	华纬科技	136	4,186.08	0.00
144	301376	致欧科技	154	3,466.54	0.00
145	601133	柏诚股份	220	2,697.20	0.00
146	601065	江盐集团	218	2,581.12	0.00
147	001328	登康口腔	101	2,574.49	0.00
148	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
149	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
150	603125	常青科技	73	1,790.69	0.00
151	001360	南矿集团	114	1,695.18	0.00
152	001367	海森药业	40	1,579.20	0.00
153	688448	磁谷科技	1	34.23	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300653	正海生物	15,624,507.50	7.11
2	688329	艾隆科技	14,008,671.76	6.37
3	300452	山河药辅	9,237,347.90	4.20
4	688389	普门科技	8,462,585.81	3.85
5	688139	海尔生物	8,200,524.83	3.73
6	600276	恒瑞医药	7,794,363.00	3.55
7	300558	贝达药业	7,482,624.00	3.40
8	688266	泽璟制药	7,269,290.38	3.31
9	300015	爱尔眼科	6,833,629.04	3.11
10	002422	科伦药业	6,349,214.00	2.89
11	600557	康缘药业	6,225,852.00	2.83
12	603998	方盛制药	6,175,921.80	2.81
13	600085	同仁堂	6,041,925.00	2.75
14	300347	泰格医药	6,008,472.00	2.73
15	300759	康龙化成	5,867,426.00	2.67

16	600129	太极集团	5,551,641.00	2.53
17	688677	海泰新光	5,494,458.66	2.50
18	603259	药明康德	5,370,930.00	2.44
19	000423	东阿阿胶	5,120,450.00	2.33
20	600329	达仁堂	4,922,276.00	2.24
21	300406	九强生物	4,916,040.00	2.24

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300760	迈瑞医疗	15,179,649.00	6.91
2	300122	智飞生物	12,774,408.54	5.81
3	688202	美迪西	11,034,158.76	5.02
4	300347	泰格医药	9,980,359.32	4.54
5	300015	爱尔眼科	8,553,616.72	3.89
6	688677	海泰新光	8,401,897.06	3.82
7	600276	恒瑞医药	7,708,170.38	3.51
8	300759	康龙化成	7,614,934.00	3.46
9	688266	泽璟制药	7,459,569.64	3.39
10	300653	正海生物	7,380,873.24	3.36
11	300558	贝达药业	7,258,469.00	3.30
12	603392	万泰生物	7,082,746.00	3.22
13	300633	开立医疗	6,749,344.00	3.07
14	600085	同仁堂	6,680,797.00	3.04
15	603127	昭衍新药	6,520,186.40	2.97
16	603998	方盛制药	5,917,361.99	2.69
17	600436	片仔癀	5,658,408.00	2.57
18	603259	药明康德	5,341,588.00	2.43
19	300896	爱美客	5,322,886.00	2.42
20	600329	中新药业	5,242,065.00	2.38
21	000423	东阿阿胶	5,115,470.00	2.33
22	600129	太极集团	4,934,488.00	2.24
23	600557	康缘药业	4,781,373.40	2.18
24	002422	科伦药业	4,698,204.00	2.14

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。

7.4.3 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	365,983,773.13
卖出股票收入（成交）总额	384,316,729.40

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。

7.5 报告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）	594,718.87	0.33
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	594,718.87	0.33

7.6 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	123199	山河转债	3,639	363,930.31	0.20
2	111010	立昂转债	1,850	230,788.56	0.13

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.2 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。

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 报告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	6,239,625.04
2	应收清算款	1,145,148.17
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	25,515.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,410,288.84

7.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111010	立昂转债	230,788.56	0.13

7.12.5 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。

§ 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
创金合信大 健康混合 A	2,521	33,464.13	795,515.96	0.94%	83,567,551. 39	99.06%
创金合信大 健康混合 C	5,499	25,683.53	3,140,706.5 0	2.22%	138,092,999 .26	97.78%
合计	7,936	28,427.01	3,936,222.4 6	1.74%	221,660,550 .65	98.26%

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	创金合信大健康混合 A	287,704.64	0.34%
	创金合信大健康混合 C	52.01	0.00%
	合计	287,756.65	0.13%

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 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	10~50
	创金合信大健康混合 C	0
	合计	10~50
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	0~10
	创金合信大健康混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 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
本报告期期初基金份额总额	91,399,143.41	154,079,929.22
本报告期基金总申购份额	2,068,111.23	4,435,624.30
减: 报告期基金总赎回份额	9,104,187.29	17,281,847.76
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	84,363,067.35	141,233,705.76

§ 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

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, 本基金托管人 2023 年 2 月 23 日发布公告, 胡捷先生自 2023 年 2 月 23 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内, 本基金托管人 2023 年 4 月 7 日发布公告, 朱绍刚先生自 2023 年 4 月 4 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	2	744,293,975.73	100.00%	545,539.13	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

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	84,807.98	100.00%	-	-	-	-

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	创金合信大健康混合型证券投资基金 2022 年	公司官网、中国证监	2023-01-20

	第 4 季度报告	会基金电子披露网站	
2	创金合信基金管理有限公司关于调整“特定投资群体”的客户适用范围的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-15
3	创金合信基金管理有限公司关于面向特定投资群体通过直销中心认购、申购（含定期定额投资）及转换转入旗下所有基金实施费率优惠的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-09
4	创金合信大健康混合型证券投资基金 2022 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
5	创金合信大健康混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21

§ 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

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。

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。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 2023 年 6 月 30 日，创金合信基金共管理 95 只公募基金，公募管理规模 1161.93 亿元。

§ 12 备查文件目录

12.1 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 2023 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.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日