

创金合信量化发现灵活配置混合型证 券投资基金 2022 年第 1 季度报告

2022 年 03 月 31 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 4 月 21 日

| | |
|---|----|
| §1 重要提示..... | 2 |
| §2 基金产品概况..... | 2 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现..... | 3 |
| 3.1 主要财务指标..... | 3 |
| 3.2 基金净值表现..... | 3 |
| §4 管理人报告..... | 4 |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介..... | 4 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 5 |
| 4.3 公平交易专项说明..... | 6 |
| 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析..... | 6 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现..... | 6 |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明..... | 7 |
| §5 投资组合报告..... | 7 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况..... | 7 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 7 |
| 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细..... | 8 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 8 |
| 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细..... | 9 |
| 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明 细..... | 9 |
| 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 9 |
| 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细..... | 9 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 9 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 9 |
| 5.11 投资组合报告附注..... | 10 |
| §6 开放式基金份额变动..... | 10 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况..... | 11 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况..... | 11 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细..... | 11 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息..... | 11 |
| 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况..... | 11 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 12 |
| §9 备查文件目录..... | 12 |
| 9.1 备查文件目录..... | 12 |
| 9.2 存放地点..... | 12 |
| 9.3 查阅方式..... | 12 |

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-------------|--|--------------|
| 基金简称 | 创金合信量化发现混合 | |
| 基金主代码 | 003241 | |
| 交易代码 | 003241 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 9 月 27 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 96,721,412.43 份 | |
| 投资目标 | 本基金运用数量化投资模型指导资产配置和股票选择决策，力争持续获取超越业绩比较基准的投资回报。 | |
| 投资策略 | 本基金采取"自上而下"和"自下而上"相结合的方式，以宏观经济数据、上市公司相关数据、资本/资金市场相关数据为研究与分析对象，建立数量化投资模型，指导资产配置和股票选择决策。一方面，本基金基于对资本市场参与主体行为趋势的研究，从"自上而下"的角度进行资产配置；另一方面，本基金采用量化选股模型，从与上市公司相关的数据中发现有价值的信息，以"自下而上"的视角精选股票投资组合。 | |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率×80%+银行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，其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 创金合信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信量化发现混合 A | 创金合信量化发现混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003241 | 003242 |

| | | |
|---------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期末下属分级基金的份 额总额 | 38,218,699.08 份 | 58,502,713.35 份 |
|---------------------|-----------------|-----------------|

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022 年 1 月 1 日—2022 年 3 月 31 日） | |
|--------------------|-------------------------------------|----------------|
| | 创金合信量化发现混合 A | 创金合信量化发现混合 C |
| 1.本期已实现收益 | -8,160,031.73 | -8,249,456.68 |
| 2.本期利润 | -11,776,159.22 | -10,990,296.65 |
| 3.加权平均基金份额本期利 润 | -0.2208 | -0.2094 |
| 4.期末基金资产净值 | 55,098,485.43 | 80,639,447.84 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.4417 | 1.3784 |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信量化发现混合 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 | -12.27% | 1.43% | -11.30% | 1.20% | -0.97% | 0.23% |
| 过去六个月 | -9.65% | 1.15% | -8.71% | 0.95% | -0.94% | 0.20% |
| 过去一年 | 3.45% | 1.05% | 1.20% | 0.85% | 2.25% | 0.20% |
| 过去三年 | 60.96% | 1.22% | 12.52% | 1.08% | 48.44% | 0.14% |
| 过去五年 | 48.31% | 1.16% | 4.55% | 1.05% | 43.76% | 0.11% |
| 自基金合同 生效起至今 | 44.17% | 1.12% | 6.58% | 1.01% | 37.59% | 0.11% |

创金合信量化发现混合 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 | -12.44% | 1.43% | -11.30% | 1.20% | -1.14% | 0.23% |
| 过去六个月 | -10.01% | 1.15% | -8.71% | 0.95% | -1.30% | 0.20% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一年 | 2.62% | 1.05% | 1.20% | 0.85% | 1.42% | 0.20% |
| 过去三年 | 57.12% | 1.22% | 12.52% | 1.08% | 44.60% | 0.14% |
| 过去五年 | 42.44% | 1.16% | 4.55% | 1.05% | 37.89% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 37.84% | 1.12% | 6.58% | 1.01% | 31.26% | 0.11% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业 | 说明 |
|----|----|-------------|------|----|
|----|----|-------------|------|----|

| | | 任职日期 | 离任日期 | 年限 | |
|-----|-----------------------------|------------------|------|----|---|
| 李添峰 | 本基金基金经理 | 2021 年 11 月 16 日 | - | 9 | 李添峰先生，中国国籍，中国人民大学理学硕士，2012 年加入国海证券股份有限公司，历任证券资产管理分公司量化投资研究员、产品经理。2015 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，历任产品研发部产品经理、指数策略投资研究部投资经理、组合风险研究与服务部投资风险研究员，量化指数与国际部投资经理，现任基金经理。 |
| 董梁 | 本基金基金经理、首席量化投资官兼任量化指数与国际部总监 | 2019 年 7 月 5 日 | - | 18 | 董梁先生，中国香港，美国密歇根大学材料科学博士，2005 年 3 月加入美国巴克莱环球投资(Barclays Global Investors)任高级研究员、基金经理,负责美股量化模型开发及投资工作。2009 年 8 月加入瑞士信贷(Credit-Suisse)任自营交易员,负责港股量化模型开发和投资,以及环球股指期货期权的量化投资。2011 年 1 月加入信达国际任执行董事、基金经理,进行港股投资。2012 年 8 月加入华安基金管理有限公司,任系统化投资部量化投资总监、基金经理。2015 年加入香港启智资产管理有限公司 (Zentific Investment Management) 任投资部基金经理。2017 年 9 月加入创金合信基金管理有限公司,现任首席量化投资官,兼量化指数与国际部总监、基金经理。 |

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

2、证券从业年限的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年一季度，海内外环境复杂性不确定性加剧，部分事件明显超出预期，世界经济复苏放缓，全球粮食、能源等大宗商品市场大幅波动。海外方面，俄乌战争爆发，推动大宗商品价格急速上涨，全球经济面临滞涨风险。在持续高通胀背景下，美联储当前主要任务是控通胀，有可能加快加息和缩表进度，美债收益率快速上行。国内方面，疫情在多地反复，多个城市相继采用“静态管理模式”，坚持动态清零政策，目标是以最小化代价实现最大的防疫效果，但客观上造成经济循环畅通遇到一些制约，新的下行压力进一步加大。为了应对国内外的复杂形势，“稳增长”在一段时期内将是政策主线，各部门、各地方陆续落地相关政策，统筹稳增长、调结构、推改革，切实稳住宏观经济大盘。大类资产方面，原油价格大幅上涨，美元指数、黄金小幅上行，美股、A 股震荡下行。国内股市风格方面，价值风格大幅跑赢成长风格。

2022 年一季度，中证 500 指数震荡下行，行业间收益率分化比较明显。业绩基准指数成份股内，收益贡献排序靠前的行业是煤炭、房地产、银行，收益贡献排序靠后的行业是电子、电力设备、国防军工。风格方面，成份股内价值因子表现较好，成长因子表现较差。

报告期内模型运行平稳，我们坚持自下而上的量化选股模型，控制股票组合相对业绩基准指数在行业和风格因子等维度上的主动暴露，追求跟踪误差控制下的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信量化发现混合 A 基金份额净值为 1.4417 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.27%，同期业绩比较基准收益率为-11.30%；截至本报告期末创金合信量化发现混合 C 基金份额净值为 1.3784 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.44%，同期业绩比较基准收益率为-11.30%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 123,472,697.58 | 90.51 |
| | 其中：股票 | 123,472,697.58 | 90.51 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,839,425.92 | 1.35 |
| | 其中：债券 | 1,839,425.92 | 1.35 |
| | 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 | 10,317,192.22 | 7.56 |
| 8 | 其他资产 | 793,207.47 | 0.58 |
| 9 | 合计 | 136,422,523.19 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 4,350,801.00 | 3.21 |
| C | 制造业 | 79,567,704.98 | 58.62 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,827,766.00 | 2.08 |
| E | 建筑业 | 1,095,123.00 | 0.81 |
| F | 批发和零售业 | 3,534,179.62 | 2.60 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,483,051.75 | 4.04 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 11,055,159.02 | 8.14 |
| J | 金融业 | 10,218,940.60 | 7.53 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| K | 房地产业 | 1,821,918.00 | 1.34 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,437,577.49 | 1.06 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 401,536.67 | 0.30 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 756,060.45 | 0.56 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 243,768.00 | 0.18 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 455,975.00 | 0.34 |
| S | 综合 | 223,136.00 | 0.16 |
| | 合计 | 123,472,697.58 | 90.96 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 000733 | 振华科技 | 15,715 | 1,782,081.00 | 1.31 |
| 2 | 300363 | 博腾股份 | 16,900 | 1,633,385.00 | 1.20 |
| 3 | 688099 | 晶晨股份 | 13,525 | 1,526,972.50 | 1.12 |
| 4 | 300751 | 迈为股份 | 2,800 | 1,473,304.00 | 1.09 |
| 5 | 600765 | 中航重机 | 34,300 | 1,471,127.00 | 1.08 |
| 6 | 600233 | 圆通速递 | 85,271 | 1,470,924.75 | 1.08 |
| 7 | 605358 | 立昂微 | 16,400 | 1,457,796.00 | 1.07 |
| 8 | 600885 | 宏发股份 | 30,800 | 1,454,684.00 | 1.07 |
| 9 | 000728 | 国元证券 | 202,300 | 1,446,445.00 | 1.07 |
| 10 | 600141 | 兴发集团 | 42,737 | 1,420,150.51 | 1.05 |

5.4 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 | 1,818,924.66 | 1.34 |
| 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） | 20,501.26 | 0.02 |
| 8 | 同业存单 | - | - |

| | | | |
|----|----|--------------|------|
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,839,425.92 | 1.36 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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 | 019654 | 21 国债 06 | 17,790 | 1,818,924.66 | 1.34 |
| 2 | 127058 | 科伦转债 | 205 | 20,501.26 | 0.02 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|-------------------|--------|----------|--------------|------------|-------------|
| IC2206 | IC2206 | 4 | 4,997,280.00 | 138,171.43 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 138,171.43 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -661,244.79 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 29,091.43 |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货，均以套期保值为目的。本报告期进行了少量的多头套保。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 746,421.20 |
| 2 | 应收证券清算款 | 43,257.08 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,529.19 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 793,207.47 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 创金合信量化发现混合 A | 创金合信量化发现混合 C |
|--------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 59,485,266.01 | 69,261,517.65 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 171,840.91 | 21,917,511.20 |
| 减：报告期期间基金总赎回 | 21,438,407.84 | 32,676,315.50 |

| | | |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 份额 | | |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 38,218,699.08 | 58,502,713.35 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20220101 - 20220125 | 26,432,358.63 | 0.00 | 26,432,358.63 | 0.00 | 0.00% |
| 机构 | 2 | 20220318 - 20220331 | 11,466,053.14 | 15,805,318.62 | 0.00 | 27,271,371.76 | 28.20% |

产品特有风险

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

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

2、大额赎回风险

(1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险;

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

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

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

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

创金合信基金成立于 2014 年 7 月，是第一家成立时即实现员工持股的基金公司。股东由第一创业证券股份有限公司、以及经营管理层和核心员工持股的 7 家投资合伙企业构成。秉承“以客户为中心”的文化理念，创金合信基金迅速构建起独特的服务优势和核心竞争力，并在客户数量和规模上取得快速突破。截至 2022 年 3 月 31 日，创金合信基金共管理 82 只公募基金，公募管理规模 883.83 亿元。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金 2022 年 1 季度报告原文。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2022 年 4 月 21 日