

# 创金合信鑫祺混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：浙商银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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 2022 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.....	4
2.4 信息披露方式.....	错误!未定义书签。
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§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.....	9
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.....	11
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的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	41
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	41
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.....	45
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
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.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§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.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信鑫祺混合型证券投资基金	
基金简称	创金合信鑫祺混合	
基金主代码	009005	
交易代码	009005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 4 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,282,978,674.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信鑫祺混合 A	创金合信鑫祺混合 C
下属分级基金的交易代码	009005	009006
报告期末下属分级基金的份 额总额	955,637,443.38 份	327,341,231.01 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极的主动管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采取定量与定性相结合的方法，并通过“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，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。在资产配置中，本基金主要考虑（1）宏观经济指标，包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据、金融政策等，以判断经济波动对市场的影响；（2）微观经济指标，包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期；（3）市场方面指标，包括股票及债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金供求关系及其变化；（4）政策因素，与证券市场密切相关的各种政策出台对市场的影响等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%
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债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

### 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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田
		朱巍

	联系电话	0755-82820166	0571-87659806
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-868-0666	95527
传真		0755-25832571	0571-88268688
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）	浙江省杭州市萧山区鸿宁路 1788 号
办公地址		深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼	浙江省杭州市延安路 368 号
邮政编码		518052	310006
法定代表人		钱龙海	张荣森(代为履行法定代表人职责)

注：因原法定代表人辞任，浙商银行股份有限公司于 2022 年 1 月 14 日以书面传签方式召开第六届董事会 2022 年第一次临时会议，审议通过了《关于推举董事代为履行董事长职责的议案》。经全体董事一致表决同意，由执行董事、行长张荣森先生代为履行董事长、董事会战略委员会主任委员、董事会普惠金融发展委员会主任委员及法定代表人职责，直至选举产生新任董事长且其任职资格获银保监会核准之日止。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金中期报告备置地点	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

## 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、创金合信鑫祺混合 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	23,625,437.53
本期利润	22,763,892.98
加权平均基金份额本期利润	0.0377
本期加权平均净值利润率	3.00%
本期基金份额净值增长率	0.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	105,454,070.98
期末可供分配基金份额利润	0.1103
期末基金资产净值	1,061,091,514.36
期末基金份额净值	1.1103
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	30.44%

## 2、创金合信鑫祺混合 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	14,125,257.94
本期利润	-3,595,754.38
加权平均基金份额本期利润	-0.0085
本期加权平均净值利润率	-0.68%
本期基金份额净值增长率	0.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	33,038,514.77
期末可供分配基金份额利润	0.1009
期末基金资产净值	360,379,745.78
期末基金份额净值	1.1009
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	29.34%

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. 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

## 创金合信鑫祺混合 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	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去一个月	3.06%	0.28%	1.68%	0.21%	1.38%	0.07%
过去三个月	4.25%	0.52%	1.55%	0.28%	2.70%	0.24%
过去六个月	0.99%	0.48%	-1.42%	0.29%	2.41%	0.19%
过去一年	6.25%	0.39%	-1.29%	0.25%	7.54%	0.14%
自基金合同生效起至今	30.44%	0.41%	3.50%	0.26%	26.94%	0.15%

创金合信鑫祺混合 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	3.03%	0.28%	1.68%	0.21%	1.35%	0.07%
过去三个月	4.15%	0.52%	1.55%	0.28%	2.60%	0.24%
过去六个月	0.79%	0.48%	-1.42%	0.29%	2.21%	0.19%
过去一年	5.82%	0.39%	-1.29%	0.25%	7.11%	0.14%
自基金合同生效起至今	29.34%	0.41%	3.50%	0.26%	25.84%	0.15%

### 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

创金合信鑫祺混合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

(2020年03月04日-2022年06月30日)







## § 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 2.33 亿元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例 51.0729%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例 21.8884%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%。

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		
吕沂洋	本基金基金经理	2022 年 3 月 7 日	-	6	吕沂洋先生，中国国籍，中山大学金融学硕士，2015 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、固定收益部投资顾问，现任基金经理。

黄弢	本基金基金经理、权益投研总部执行总监、风格策略投资部和稳健收益投资部总监	2020 年 5 月 8 日	-	19	黄弢先生，中国国籍，清华大学法学硕士，2002 年 7 月加入长城基金管理有限公司，任市场部渠道主管，2005 年 11 月加入海富通基金管理有限公司，任市场部南方区总经理、2008 年 2 月加入深圳市鼎诺投资管理有限公司，任公司执行总裁，2017 年 5 月加入北京和聚投资管理有限公司任首席策略师，2018 年 4 月加入上海禾驹投资管理中心（有限合伙），任首席策略师，2020 年 2 月加入创金合信基金管理有限公司，现任权益投研总部执行总监、兼任风格策略投资部和稳健收益投资部总监、基金经理。
闫一帆	本基金基金经理	2020 年 3 月 20 日	-	12	闫一帆先生，中国国籍，新加坡南洋理工大学金融学硕士。2008 年 7 月就职于国泰君安证券股份有限公司。2011 年 5 月加入永安财产保险股份有限公司投资管理中心任固定收益研究员，2012 年 10 月加入第一创业证券股份有限公司资产管理部任固定收益研究员。2014 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司，历任信用研究主管、投资经理，现任固定收益部副总监，兼任基金经理。

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

从基金运作分析来看，年初基于整体的谨慎心态，权益仓位处于中等偏下水平，春节前随着市场下行，部分高景气成长行业的高估值有较大幅度的收缩，而景气度本身并没有明显变化，因此选择做逆势加仓的动作，增持新能源、医药、科技以及部分消费板块的标的。春节后由于俄乌危机以及随后事件的演绎，全球投资者对中国资产的风险溢价评估出现恶化趋势，并引发在美上市中概股、港股以及 A 股的系统性下行，在这个过程中，本基金的操作仍然以坚持逆势加仓为主，以选择具有更好估值性价比的龙头标的为主，行业增配方向与春节前相同。从政策层面来看，国内政策松动以达保增长为第一目标，但二级市场的投资人避险心态严重，导致基金传统重仓的价值和成长板块短期超跌，从走势来看，与历次熊市危机的演化历程并无本质差异，因此从更长周期来看，超跌的优质资产大概率会存在时间换空间的修复机会，一季度主要的动作是坚持和等待。

二季度在叠加上季度美联储意外加息节奏和幅度以及俄乌危机两大黑天鹅的基础上，又遭遇上海重大疫情的黑天鹅，使得市场在 4 月出现恐慌性下跌。截止 4 月底，本年度 A 股的跌幅超过了 2018 年全年，而估值水平也已接近 2018 年 10 月市场最恐慌阶段的大熊市底部。基于对政策动向、基本面研判、估值水平以及国内疫情和国际形势等多维度的评判，本基金管理人认为市场处于非理性的恐慌性下跌状态，这种状态并非常态且不能持久，因此选择逆势加仓，行业层面和个股层面维持分散的基本格局。在随后 5 月和 6 月，伴随市场进入反弹阶段，本基金管理人将阶段性超配的仓位又进行了一定程度的减持，使得基金仓位向中枢靠拢。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信鑫祺混合 A 基金份额净值为 1.1103 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.99%，同期业绩比较基准收益率为-1.42%；截至本报告期末创金合信鑫祺混合 C 基金份额净值为 1.1009 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.79%，同期业绩比较基准收益率为-1.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年是多重黑天鹅叠加的时间窗口，也是多年未见的情形，导致经济运行出现诸多原先意想不到的状况，与此相对应，政策端也在不断发力，无论是货币端、财政端还是中观行业政策，而包括疫情、俄乌危机以及美联储加息所发的市场反应都在往良性状况发展，再叠加市场经过大幅下行后，风险本身释放相对充分，尤其是以沪深 300 为代表的中大市值蓝筹股，估值水平也处于历史均值靠下的位置，因此市场整体性风险不大，在下半年经济复苏的大背景下，有理由对市场整体保持一个谨慎乐观的态度。

#### 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，本基金已实施利润分配 226,732,975.70 元，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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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

本报告期内，创金合信鑫祺混合型证券投资基金的管理人——创金合信基金管理有限公司在创金合信鑫祺混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人依法对创金合信基金管理有限公司编制和披露的创金合信鑫祺混合型证券投资基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、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：创金合信鑫祺混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,849,576.58	14,142,650.56
结算备付金		1,856,388.07	2,002,321.72
存出保证金		431,651.71	547,512.96
交易性金融资产	6.4.7.2	1,500,904,685.26	1,317,543,579.07
其中：股票投资		262,237,110.04	266,075,839.06
基金投资		-	-
债券投资		1,238,667,575.22	1,051,467,740.01
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	10,045,513.48	-
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		5,740,932.00	1,800,670.28

应收股利		-	-
应收申购款		8,036,449.45	257,620.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	18,707,535.64
资产总计		1,530,865,196.55	1,355,001,891.11
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		105,015,423.72	82,999,847.00
应付清算款		-	1,473,542.71
应付赎回款		2,057,848.91	699,257.15
应付管理人报酬		1,013,728.98	784,440.55
应付托管费		126,716.13	98,055.07
应付销售服务费		136,522.99	159,995.70
应付投资顾问费		-	-
应交税费		89,789.94	71,225.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	953,905.74	860,020.97
负债合计		109,393,936.41	87,146,384.54
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,282,978,674.39	984,211,729.43
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	138,492,585.75	283,643,777.14
净资产合计		1,421,471,260.14	1,267,855,506.57
负债和净资产总计		1,530,865,196.55	1,355,001,891.11

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，创金合信鑫祺混合 A 份额净值 1.1103 元，基金份额总额 955,637,443.38 份；创金合信鑫祺混合 C 份额净值 1.1009 元，基金份额总额 327,341,231.01 份；总份额合计 1,282,978,674.39 份。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信鑫祺混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		27,322,883.14	34,086,212.15

1.利息收入		157,647.01	7,325,504.89
其中：存款利息收入	6.4.7.9	130,229.72	122,738.58
债券利息收入		-	6,858,367.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		27,417.29	344,398.94
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		45,319,844.89	26,482,166.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	20,024,083.74	25,965,239.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	22,299,548.84	-419,288.21
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	2,996,212.31	936,215.91
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	-18,582,556.87	167,714.37
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	427,948.11	110,826.13
减：二、营业总支出		8,154,744.54	4,330,963.71
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	5,081,677.93	2,374,725.51
2.托管费	6.4.10.2.2	635,209.75	296,840.69
3.销售服务费	6.4.10.2.3	1,053,459.79	182,369.04
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		1,210,536.17	213,683.15
其中：卖出回购金融资产支出		1,210,536.17	213,683.15
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		50,749.47	13,482.93
8.其他费用	6.4.7.19	123,111.43	1,249,862.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,168,138.60	29,755,248.44
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,168,138.60	29,755,248.44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		19,168,138.60	29,755,248.44

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：创金合信鑫祺混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 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）	984,211,729.43	-	283,643,777.14	1,267,855,506.57
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）	984,211,729.43	-	283,643,777.14	1,267,855,506.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	298,766,944.96	-	-145,151,191.39	153,615,753.57
（一）、综合收益总额	-	-	19,168,138.60	19,168,138.60
（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）	298,766,944.96	-	62,413,645.71	361,180,590.67
其中：1.基金申购款	927,235,324.93	-	221,604,991.16	1,148,840,316.09
2.基金赎回款	-628,468,379.97	-	-159,191,345.45	-787,659,725.42
（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）	-	-	-226,732,975.70	-226,732,975.70
（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）	1,282,978,674.39	-	138,492,585.75	1,421,471,260.14
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	627,129,309.68	-	111,222,281.84	738,351,591.52
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）	627,129,309.68	-	111,222,281.84	738,351,591.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-62,245,825.53	-	16,657,449.91	-45,588,375.62
（一）、综合收益总额	-	-	29,755,248.44	29,755,248.44
（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）	-62,245,825.53	-	-13,097,798.53	-75,343,624.06
其中：1.基金申购款	377,929,625.59	-	75,013,960.03	452,943,585.62
2.基金赎回款	-440,175,451.12	-	-88,111,758.56	-528,287,209.68
（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）	564,883,484.15	-	127,879,731.75	692,763,215.90

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

创金合信鑫祺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[2020]123号《关于准予创金合信鑫祺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《创金合信鑫祺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 200,044,438.51 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 2000225 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信鑫祺混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 03 月 04 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,107,445.89 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,基金托管人为浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信鑫祺混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、金融衍生品(包括权证、股指期货等)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)。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 20%+中债综合指数收益率 $\times$ 80%。

### 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》、《创金合信鑫祺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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日至 2022 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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《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>》。

##### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 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 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产的未来现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证券清算款、应收利息和应收申购款，金额分别为 14,142,650.56 元、2,002,321.72 元、547,512.96 元、1,800,670.28 元、18,707,535.64 元和 257,620.88 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 14,148,138.83 元、2,003,312.82 元、547,784.00 元、1,800,670.28 元和 257,620.88 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,317,543,579.07 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,336,244,364.30 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-应付赎回费，金额分别为 82,999,847.00 元、1,473,542.71 元、699,257.15 元、784,440.55 元、98,055.07 元、159,995.70 元、635,933.48 元、32,087.46 元和 0.03 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付赎回费，金额分别为 83,031,934.46 元、1,473,542.71 元、699,257.15 元、784,440.55 元、98,055.07 元、159,995.70 元、635,933.48 元和 0.03 元。

(b) 修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	3,849,576.58
等于：本金	3,842,969.27
加：应计利息	6,607.31
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	3,849,576.58

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	310,877,892.13	-	262,237,110.04	-48,640,782.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,056,689.85	227,296,483.58	338,746.16
	银行间	994,737,345.79	12,367,391.64	1,011,371,091.64

	市场				
	合计	1,218,638,393.36	15,424,081.49	1,238,667,575.22	4,605,100.37
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,529,516,285.49	15,424,081.49	1,500,904,685.26	-44,035,681.72

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	10,045,513.48	-
合计	10,045,513.48	-

#### 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 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	155.69
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	849,238.62
其中：交易所市场	816,373.75
银行间市场	32,864.87
应付利息	-
预提费用	104,511.43
合计	953,905.74

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元



创金合信鑫祺混合 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	586,263,685.02	586,263,685.02
本期申购	699,097,426.44	699,097,426.44
本期赎回 (以“-”号填列)	-329,723,668.08	-329,723,668.08
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	955,637,443.38	955,637,443.38

创金合信鑫祺混合 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	397,948,044.41	397,948,044.41
本期申购	228,137,898.49	228,137,898.49
本期赎回 (以“-”号填列)	-298,744,711.89	-298,744,711.89
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	327,341,231.01	327,341,231.01

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

创金合信鑫祺混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	201,073,574.13	-30,124,387.12	170,949,187.01
本期利润	23,625,437.53	-861,544.55	22,763,892.98
本期基金份额交易产生的变动数	124,646,161.16	-41,924,444.03	82,721,717.13
其中：基金申购款	243,515,846.95	-75,885,466.63	167,630,380.32
基金赎回款	-118,869,685.79	33,961,022.60	-84,908,663.19
本期已分配利润	-170,980,726.14	-	-170,980,726.14
本期末	178,364,446.68	-72,910,375.70	105,454,070.98

创金合信鑫祺混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	133,064,275.87	-20,369,685.74	112,694,590.13
本期利润	14,125,257.94	-17,721,012.32	-3,595,754.38
本期基金份额交易产生的变动数	-33,531,057.80	13,222,986.38	-20,308,071.42
其中：基金申购款	71,175,630.61	-17,201,019.77	53,974,610.84
基金赎回款	-104,706,688.41	30,424,006.15	-74,282,682.26
本期已分配利润	-55,752,249.56	-	-55,752,249.56
本期末	57,906,226.45	-24,867,711.68	33,038,514.77

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	104,840.00
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	21,787.74
其他	3,601.98
合计	130,229.72

**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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	20,024,083.74
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	20,024,083.74

**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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,016,160,402.84
减：卖出股票成本总额	993,460,016.82
减：交易费用	2,676,302.28
买卖股票差价收入	20,024,083.74

**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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	21,386,542.24
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	913,006.60
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	22,299,548.84

**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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,213,876,107.78
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,189,978,592.93
减：应计利息总额	22,959,044.94
减：交易费用	25,463.31
买卖债券差价收入	913,006.60

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,996,212.31
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	2,996,212.31

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-18,582,556.87
——股票投资	-18,503,545.05
——债券投资	-79,011.82
——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	-18,582,556.87

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	427,834.00
转换费收入	114.11
合计	427,948.11

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	35,704.06
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	27,000.00
查询服务费	900.00
合计	123,111.43

### 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
浙商银行股份有限公司	基金托管人

第一创业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	2,009,584,700.37	100.00%	838,729,865.98	100.00%

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	139,268,021.70	100.00%	982,487,378.61	100.00%

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	1,099,600,000.00	100.00%	4,258,700,000.00	100.00%

###### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	1,455,208.34	100.00%	816,373.75	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	605,761.02	100.00%	236,677.91	100.00%

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,081,677.93	2,374,725.51
其中：支付销售机构的客户维护费	984,886.64	244,134.25

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 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.8\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	635,209.75	296,840.69

注：支付基金托管人浙商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

**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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信鑫祺混合 A	创金合信鑫祺混合 C	合计
创金合信直销	-	43,857.89	43,857.89
合计	-	43,857.89	43,857.89
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信鑫祺混合 A	创金合信鑫祺混合 C	合计
创金合信直销	-	15,359.86	15,359.86
合计	-	15,359.86	15,359.86

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 0.4% 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：

$$\text{日 C 类基金份额销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.4\% / \text{当年天数}。$$

**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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
浙商银行股份有限公司	3,849,576.58	104,840.00	23,145,979.67	80,932.10

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商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**

金额单位：人民币元

创金合信鑫祺混合 A

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2022 年 6 月 24 日	-	2022 年 6 月 24 日	1.923	105,724,304.06	65,256,422.08	170,980,726.14	-
合计	-	-	-	1.923	105,724,304.06	65,256,422.08	170,980,726.14	-

创金合信鑫祺混合 C

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2022 年 6 月 24 日	-	2022 年 6 月 24 日	1.907	8,521,531.18	47,230,718.38	55,752,249.56	-
合计	-	-	-	1.907	8,521,531.18	47,230,718.38	55,752,249.56	-

**6.4.12 期末（2022 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	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600941	中国移动	2021年12月24日	1-6个月(含)	新股锁定	57.58	60.26	87,363	5,030,361.54	5,264,494.38	-
688048	长光华芯	2022年3月25日	1-6个月(含)	科创板打新限售	80.80	111.97	6,790	548,632.00	760,276.30	-
688220	翱捷科技	2022年1月6日	1-6个月(含)	科创板打新限售	164.54	68.59	6,186	1,017,844.44	424,297.74	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	1-6个月(含)	创业板打新限售	17.27	14.83	3,878	66,973.06	57,510.74	-
301236	软通动力	2022年3月8日	1-6个月(含)	创业板打新限售	48.57	31.38	1,505	73,098.64	47,226.90	-
301200	大族数控	2022年2月18日	1-6个月(含)	创业板打新限售	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	1-6个月(含)	创业板打新限售	96.66	87.82	477	46,104.70	41,890.14	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	1-6个月(含)	创业板打新限售	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301150	中一科技	2022年4月14日	1-6个月(含)	创业板打新限售	109.18	82.76	403	43,997.64	33,352.28	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	1-6个月(含)	创业板打新限售	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301215	中汽股份	2022年2月28日	1-6个月(含)	创业板打新限售	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301201	诚达药业	2022年1月12日	1-6个月(含)	创业板打新限售	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-
301268	铭利达	2022年	1-6个月	创业板	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-

		3月29日	月(含)	打新限售						
301263	泰恩康	2022年3月22日	1-6个月(含)	创业板打新限售	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	1-6个月(含)	创业板打新限售	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301187	欧圣电气	2022年4月13日	1-6个月(含)	创业板打新限售	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
300834	星辉环材	2022年1月6日	1-6个月(含)	创业板打新限售	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301256	华融化学	2022年3月14日	1-6个月(含)	创业板打新限售	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301123	奕东电子	2022年1月14日	1-6个月(含)	创业板打新限售	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301120	新特电气	2022年4月11日	1-6个月(含)	创业板打新限售	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	1-6个月(含)	创业板打新限售	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301248	杰创智能	2022年4月13日	1-6个月(含)	创业板打新限售	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	1-6个月(含)	创业板打新限售	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301097	天益医疗	2022年3月25日	1-6个月(含)	创业板打新限售	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301116	益客食品	2022年1月10日	1-6个月(含)	创业板打新限售	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	1-6个月(含)	创业板打新限售	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	1-6个月(含)	创业板打新限售	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-

301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	1-6 个月(含)	创业板打新限售	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301163	宏德股份	2022 年 4 月 11 日	1-6 个月(含)	创业板打新限售	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	1-6 个月(含)	创业板打新限售	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	1-6 个月(含)	创业板打新限售	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	1-6 个月(含)	创业板打新限售	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-

#### 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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 105,015,423.72 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
012280764	22 海沧投资 SCP001	2022 年 7 月 6 日	101.02	300,000	30,306,772.60
102000186	20 北方稀土 MTN001	2022 年 7 月 6 日	101.87	100,000	10,187,123.29
102100152	21 芜湖宜居 MTN001	2022 年 7 月 6 日	103.43	200,000	20,686,405.48
1928034	19 交通银行 01	2022 年 7 月 6 日	102.56	6,000	615,335.84
2120018	21 东莞银行二级 01	2022 年 7 月 6 日	106.02	500,000	53,009,465.75
合计	-	-	-	1,106,000	114,805,102.96

##### 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浙商银行股份有限公司，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	20,538,515.07	26,044,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	131,458,580.82	146,334,164.60
合计	151,997,095.89	172,378,164.60

未评级债券包括国债、政策性金融债、超短期融资券。

#### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	264,120,972.18	203,784,600.00
AAA 以下	680,480,278.66	609,928,475.41
未评级	142,069,228.49	65,376,500.00
合计	1,086,670,479.33	879,089,575.41

未评级债券包括国债、政策性金融债。

#### 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 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 105,055,376.71 元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的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（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	3,849,576.58	-	-	-	3,849,576.58
结算备付金	1,856,388.07	-	-	-	1,856,388.07
存出保证金	431,651.71	-	-	-	431,651.71
交易性金融资产	468,107,423.86	760,159,281.99	10,400,869.37	262,237,110.04	1,500,904,685.26
买入返售金融资产	10,045,513.48	-	-	-	10,045,513.48
应收申购款	-	-	-	8,036,449.45	8,036,449.45
应收清算款	-	-	-	5,740,932.00	5,740,932.00
资产总计	484,290,553.70	760,159,281.99	10,400,869.37	276,014,491.49	1,530,865,196.55
负债					
卖出回购金融资产款	105,015,423.72	-	-	-	105,015,423.72
应付赎回款	-	-	-	2,057,848.91	2,057,848.91
应付管理人报酬	-	-	-	1,013,728.98	1,013,728.98
应付托管费	-	-	-	126,716.13	126,716.13
应付销售服务费	-	-	-	136,522.99	136,522.99
应交税费	-	-	-	89,789.94	89,789.94
其他负债	-	-	-	953,905.74	953,905.74
负债总计	105,015,423.72	-	-	4,378,512.69	109,393,936.41
利率敏感度缺口	379,275,129.98	760,159,281.99	10,400,869.37	271,635,978.80	1,421,471,260.14
上年度末 2021 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	14,142,650.56	-	-	-	14,142,650.56
结算备付金	2,002,321.72	-	-	-	2,002,321.72
存出保证金	547,512.96	-	-	-	547,512.96
交易性金融资产	465,945,164.60	573,779,100.00	11,743,475.41	266,075,839.06	1,317,543,579.07
应收利息	-	-	-	18,707,535.64	18,707,535.64
应收申购款	-	-	-	257,620.88	257,620.88
应收证券清算款	-	-	-	1,800,670.28	1,800,670.28
资产总计	482,637,649.84	573,779,100.00	11,743,475.41	286,841,665.86	1,355,001,891.11

负债					
卖出回购金融资产款	82,999,847.00	-	-	-	82,999,847.00
应付赎回款	-	-	-	699,257.15	699,257.15
应付管理人报酬	-	-	-	784,440.55	784,440.55
应付托管费	-	-	-	98,055.07	98,055.07
应付销售服务费	-	-	-	159,995.70	159,995.70
应付交易费用	-	-	-	635,933.48	635,933.48
应交税费	-	-	-	71,225.39	71,225.39
应付利息	-	-	-	32,087.46	32,087.46
应付证券清算款	-	-	-	1,473,542.71	1,473,542.71
其他负债	-	-	-	192,000.03	192,000.03
负债总计	82,999,847.00	-	-	4,146,537.54	87,146,384.54
利率敏感度缺口	399,637,802.84	573,779,100.00	11,743,475.41	282,695,128.32	1,267,855,506.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

假设	除市场利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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	1.市场利率平行上升相关风险变量的变动 25 个基点	-4,609,645.64	-4,121,070.84
	2.市场利率平行下降相关风险变量的变动 25 个基点	4,646,917.15	4,156,682.70

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.2.1 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。

#### 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	262,237,110.04	18.45	266,075,839.06	20.99
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	262,237,110.04	18.45	266,075,839.06	20.99

#### 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准上升 5%	19,907,730.21	15,134,393.73
	2.业绩比较基准下降 5%	-19,907,730.21	-15,134,393.73

#### 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

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	255,160,787.71
第二层次	1,238,666,529.41
第三层次	7,077,368.14
合计	1,500,904,685.26

##### 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、债券和基金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 2022 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(2021 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、卖出回购金融资产和其他金融负债，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 2022 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	262,237,110.04	17.13
	其中：股票	262,237,110.04	17.13
2	固定收益投资	1,238,667,575.22	80.91
	其中：债券	1,238,667,575.22	80.91
	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	10,045,513.48	0.66
	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	5,705,964.65	0.37
7	其他资产	14,209,033.16	0.93
8	合计	1,530,865,196.55	100.00

## 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	5,905,522.00	0.42
B	采矿业	5,225,733.00	0.37
C	制造业	155,408,164.67	10.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,420,911.00	0.10
E	建筑业	4,499,862.00	0.32
F	批发和零售业	36,292.74	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	9,744,426.00	0.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,964,861.38	2.32
J	金融业	18,938,532.09	1.33
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,758,347.78	0.76
M	科学研究和技术服务业	3,298,695.77	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	3,630,777.61	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,404,984.00	0.73
S	综合	-	-
	合计	262,237,110.04	18.45

### 7.2.2 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。

### 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	002415	海康威视	348,400	12,612,080.00	0.89
2	688111	金山办公	60,545	11,934,630.40	0.84
3	600031	三一重工	604,700	11,525,582.00	0.81
4	002027	分众传媒	1,595,600	10,738,388.00	0.76
5	300413	芒果超媒	311,900	10,404,984.00	0.73
6	002352	顺丰控股	174,600	9,744,426.00	0.69
7	000333	美的集团	160,900	9,716,751.00	0.68
8	000001	平安银行	638,100	9,558,738.00	0.67
9	600703	三安光电	381,100	9,367,438.00	0.66
10	688012	中微公司	74,746	8,726,595.50	0.61
11	000063	中兴通讯	333,300	8,509,149.00	0.60
12	002241	歌尔股份	242,000	8,131,200.00	0.57
13	601877	正泰电器	216,100	7,732,058.00	0.54
14	601100	恒立液压	122,400	7,554,528.00	0.53
15	600276	恒瑞医药	194,000	7,195,460.00	0.51
16	688016	心脉医疗	36,528	7,116,019.68	0.50
17	300601	康泰生物	140,600	6,352,308.00	0.45
18	600536	中国软件	146,394	5,942,132.46	0.42
19	002299	圣农发展	307,900	5,905,522.00	0.42
20	000977	浪潮信息	219,700	5,817,656.00	0.41
21	600941	中国移动	87,363	5,264,494.38	0.37
22	600038	中直股份	116,000	5,243,200.00	0.37
23	601899	紫金矿业	560,100	5,225,733.00	0.37
24	600529	山东药玻	185,300	5,179,135.00	0.36
25	300119	瑞普生物	284,502	4,975,939.98	0.35
26	000100	TCL 科技	1,021,100	4,891,069.00	0.34
27	601318	中国平安	101,161	4,723,207.09	0.33
28	000338	潍柴动力	375,400	4,681,238.00	0.33
29	601601	中国太保	197,900	4,656,587.00	0.33
30	601117	中国化学	478,200	4,499,862.00	0.32
31	601728	中国电信	1,158,673	4,321,850.29	0.30
32	000651	格力电器	111,100	3,746,292.00	0.26

33	600323	瀚蓝环境	174,066	3,568,353.00	0.25
34	300294	博雅生物	91,500	3,289,425.00	0.23
35	301096	百诚医药	41,372	3,268,388.00	0.23
36	000876	新希望	187,000	2,861,100.00	0.20
37	002493	荣盛石化	185,200	2,850,228.00	0.20
38	300451	创业慧康	362,000	2,606,400.00	0.18
39	301221	光庭信息	26,880	1,742,630.40	0.12
40	300760	迈瑞医疗	5,500	1,722,600.00	0.12
41	002984	森麒麟	46,800	1,455,948.00	0.10
42	600905	三峡能源	225,900	1,420,911.00	0.10
43	603421	鼎信通讯	146,900	1,069,432.00	0.08
44	000157	中联重科	155,200	956,032.00	0.07
45	688048	长光华芯	6,790	760,276.30	0.05
46	688220	翱捷科技	6,186	424,297.74	0.03
47	688230	芯导科技	3,632	253,114.08	0.02
48	688211	中科微至	4,426	180,270.98	0.01
49	688125	安达智能	3,774	179,415.96	0.01
50	688282	理工导航	3,185	152,784.45	0.01
51	301093	华兰股份	4,088	138,542.32	0.01
52	301100	风光股份	5,985	129,156.30	0.01
53	301196	唯科科技	2,705	102,319.16	0.01
54	688193	仁度生物	1,635	88,453.50	0.01
55	688236	春立医疗	4,052	80,229.60	0.01
56	301026	浩通科技	2,027	74,755.76	0.01
57	301217	铜冠铜箔	3,878	57,510.74	0.00
58	301236	软通动力	1,505	47,226.90	0.00
59	301033	迈普医学	1,076	45,310.36	0.00
60	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
61	301219	腾远钴业	477	41,890.14	0.00
62	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
63	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
64	301150	中一科技	403	33,352.28	0.00
65	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
66	300867	圣元环保	1,498	31,338.16	0.00
67	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
68	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.00
69	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
70	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
71	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
72	300981	中红医疗	842	21,235.24	0.00
73	301211	亨迪药业	967	20,964.56	0.00
74	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
75	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00

76	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
77	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
78	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
79	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
80	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
81	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
82	301166	优宁维	253	14,891.58	0.00
83	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
84	301179	泽宇智能	341	13,916.21	0.00
85	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
86	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
87	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
88	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
89	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
90	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
91	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
92	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
93	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
94	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
95	301182	凯旺科技	294	6,985.44	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	300760	迈瑞医疗	37,131,758.04	2.93
2	300750	宁德时代	34,033,508.00	2.68
3	002415	海康威视	20,930,762.00	1.65
4	600258	首旅酒店	20,406,804.00	1.61
5	002241	歌尔股份	19,592,558.40	1.55
6	601888	中国中免	19,189,731.00	1.51
7	603806	福斯特	19,015,834.46	1.50
8	600887	伊利股份	16,204,122.00	1.28
9	300122	智飞生物	14,923,999.79	1.18
10	002475	立讯精密	14,118,999.00	1.11
11	002371	北方华创	14,080,657.00	1.11
12	601012	隆基绿能	14,037,266.00	1.11
13	603259	药明康德	13,956,540.00	1.10
14	601877	正泰电器	13,623,408.00	1.07
15	300413	芒果超媒	13,450,432.00	1.06
16	603596	伯特利	13,077,635.00	1.03

17	603986	兆易创新	12,924,500.00	1.02
18	600690	海尔智家	12,856,437.80	1.01
19	002271	东方雨虹	12,850,273.00	1.01
20	600460	士兰微	12,836,379.00	1.01

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	36,656,051.32	2.89
2	300750	宁德时代	35,198,887.00	2.78
3	601888	中国中免	26,182,189.00	2.07
4	600258	首旅酒店	21,411,998.00	1.69
5	300122	智飞生物	21,286,994.00	1.68
6	603806	福斯特	19,925,685.88	1.57
7	603259	药明康德	17,584,531.40	1.39
8	000002	万科A	16,949,455.68	1.34
9	600887	伊利股份	16,573,597.00	1.31
10	603392	万泰生物	15,984,580.00	1.26
11	002371	北方华创	14,931,550.00	1.18
12	002475	立讯精密	14,495,487.00	1.14
13	601012	隆基绿能	14,447,418.00	1.14
14	002415	海康威视	14,207,168.00	1.12
15	002271	东方雨虹	13,640,771.00	1.08
16	603596	伯特利	13,574,605.00	1.07
17	002928	华夏航空	13,462,367.36	1.06
18	600976	健民集团	13,352,728.12	1.05
19	600460	士兰微	13,270,683.00	1.05
20	603986	兆易创新	13,257,681.00	1.05

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	1,008,124,832.85
卖出股票收入（成交）总额	1,016,160,402.84

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	152,672,830.13	10.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	191,322,639.72	13.46
	其中：政策性金融债	10,241,610.96	0.72
4	企业债券	203,411,266.54	14.31
5	企业短期融资券	101,148,115.07	7.12
6	中期票据	590,111,677.95	41.51
7	可转债（可交换债）	1,045.81	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,238,667,575.22	87.14

#### 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	2120018	21 东莞银行二级 01	500,000	53,009,465.75	3.73
2	200009	20 付息国债 09	500,000	51,351,767.12	3.61
3	019629	20 国债 03	500,000	50,472,082.19	3.55
4	012281608	22 泉州交通 SCP004	500,000	50,302,827.40	3.54
5	149173	20 申证 06	400,000	41,485,247.12	2.92

#### 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

2022 年 4 月 11 日, 东莞银行股份有限公司(下称:“东莞银行”), 收到行政处罚决定书(东银保监罚决字(2022)8 号), 因东莞银行股份有限公司贷款业务严重违反审慎经营规则, 违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条第三款、第四十六条第五项、第四十八条第二项, 《个人贷款管理暂行办法》第七条, 《住房城乡建设部人民银行银监会关于规范购房融资和加强反洗钱工作的通知》第一点, 《国务院关于调整和完善固定资产投资项目资本金制度的通知》第一点, 《国务院关于加强固定资产投资项目资本金管理的通知》第一点第一项, 中国银保监会东莞监管分局对东莞银行股份有限公司罚款合计 50 万元。

本基金投研人员分析认为, 在受到处罚后, 东莞银行改正态度积极, 并积极整改, 上述事件发生后该公司经营状况正常。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 21 东莞银行二级 01 进行了投资。

2021 年 7 月 13 日, 中国民生银行股份有限公司(简称:民生银行)收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监罚决字(2021)26 号), 因其监管发现问题屡查屡犯、检查发现问题整改不到位、对责任人员的责任认定和问责不到位、内部制度管理不足, 个别制度与监管要求冲突、配合现场检查不力、信息系统管控有效性不足、委托贷款委托人资质审查不审慎等多项违规行为, 违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则, 被中国银行保险监督管理委员会处以 11450 万元罚款。

2022 年 3 月 21 日, 民生银行收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监罚决字(2022)20 号), 因民生银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在多项违法违规行为, 违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则, 被中国银行保险监督管理委员会处以 490 万元罚款。

本基金投研人员分析认为, 在受到处罚后, 民生银行改正态度积极, 并积极整改, 上述事件发生后该公司经营状况正常。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 20 民生银行二级进行了投资。

### 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	431,651.71
2	应收清算款	5,740,932.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,036,449.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,209,033.16

### 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	123119	康泰转 2	1,045.81	-

### 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
创金合信鑫 祺混合 A	1,671	571,895.54	941,097,264 .69	98.48%	14,540,178. 69	1.52%
创金合信鑫 祺混合 C	24,345	13,445.93	285,587,369 .43	87.24%	41,753,861. 58	12.76%
合计	25,823	49,683.56	1,226,684,6 34.12	95.61%	56,294,040. 27	4.39%

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	创金合信鑫祺混合 A	998,806.70	0.10%
	创金合信鑫祺混合 C	38,685.51	0.01%
	合计	1,037,492.21	0.08%

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	创金合信鑫祺混合 A	50~100
	创金合信鑫祺混合 C	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信鑫祺混合 A	50~100
	创金合信鑫祺混合 C	0
	合计	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信鑫祺混合 A	创金合信鑫祺混合 C
基金合同生效日(2020年3月4日)基金份额总额	200,103,475.18	3,970.71
本报告期期初基金份额总额	586,263,685.02	397,948,044.41
本报告期基金总申购份额	699,097,426.44	228,137,898.49
减：报告期基金总赎回份额	329,723,668.08	298,744,711.89
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	955,637,443.38	327,341,231.01

## § 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的专门基金托管部门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。

## 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

本报告期内，未出现管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
第一创业证券	2	2,009,584,700.37	100.00%	1,455,208.34	100.00%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

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。

本基金报告期内新增东方证券 2 个交易单元。

### 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
第一创业证券	139,268,021.70	100.00%	1,099,600,000.00	100.00%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信基金管理有限公司 旗下基金 2021 年度第四季度报告提示性公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
2	创金合信鑫祺混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
3	创金合信鑫祺混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-08
4	创金合信鑫祺混合型证券投资基金（2022 年 3 月）招募说明书（更新）	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-09
5	创金合信鑫祺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	2022-03-09
6	创金合信鑫祺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	2022-03-09
7	创金合信鑫祺混合型证券投资基金 2021 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-30
8	创金合信鑫祺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
9	创金合信鑫祺混合型证券投资基金暂停大额申购(含定期定额投资)、大额转换转入业务的公	公司官网、上海证券报、中国证监会基金	2022-05-20

	告	电子披露网站	
10	创金合信基金管理有限公司关于创金合信鑫祺混合型证券投资基金 A 类开展直销渠道赎回费优惠活动的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-26
11	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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-10
12	创金合信鑫祺混合型证券投资基金分红公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-22

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220519 - 20220522	0.00	231,721,134.64	0.00	231,721,134.64	18.06%
机构	2	20220622 - 20220626	0.00	238,113,342.33	0.00	238,113,342.33	18.56%

#### 产品特有风险

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

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

2、大额赎回风险

(1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险;

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

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

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

创金合信基金成立于 2014 年 7 月,是第一家成立时即实现员工持股的基金公司。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 6 月 30 日，创金合信基金共管理 84 只公募基金，公募管理规模 1027.19 亿元。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”。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信鑫祺混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信鑫祺混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信鑫祺混合型证券投资基金 2022 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](http://www.cjxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日