

---

# 创金合信鑫益混合型证券投资基金

## 2020 年中期报告

2020 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:宁波银行股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 31 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年08月20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2020年02月26日起至2020年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
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	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52

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.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信鑫益混合型证券投资基金	
基金简称	创金合信鑫益混合	
基金主代码	008909	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年02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	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	204,863,223.85份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信鑫益混合A	创金合信鑫益混合C
下属分级基金的交易代码	008909	008910
报告期末下属分级基金的份额总额	202,433,108.05份	2,430,115.80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	<p>1. 资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

## 2. 股票投资策略

本基金将通过基本面分析，结合定性和定量分析方法，构建运营状况健康、治理结构完善、经营管理稳健的股票投资组合。定性分析包括深入了解上市公司的公司治理结构、管理团队、经营主业、所属细分行业的产业政策和政策的变化趋势、核心商业模式，及该商业模式的稳定性和可持续性、战略规划和长期发展前景等；定量分析包括重点关注盈利能力、成长能力、负债水平、营运能力等维度，本基金重点关注的估值指标包括但不限于市盈率（P/E）、市净率（P/B）、市现率（P/CF）、市销率（P/S）、股息率（D/P）、经济价值/息税折旧摊销前利润（EV/EBIT）等相对估值指标，以及资产重置价格、现金流贴现模型（DCF）、股息率贴现模型（DDM）等绝对估值指标。精选基本面良好、未来盈利空间和发展潜力大的股票。

## 3. 债券投资策略

本基金结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。在个券选择选择方面，本基金将以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，合理运用投资管理策略，实施积极主动的债券投资管理。

## 4. 股指期货、股票期权合约投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约、股票期权合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。基金管理人将根据审慎原则，授权特定的管理人员负责期权的投资审批事项，以防范股票期权投资的风险。

## 5. 国债期货投资策略

为更好地管理投资组合的利率风险、改善组合的风险收益特性，本基金将本着谨慎的原则，以套期保

	<p>值为目的，在风险可控的前提下，参与国债期货的投资。</p> <p>6. 资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，长期来看，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，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	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋
	联系电话	0755-23838908
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com
客户服务电话	400-868-0666	0574-83895886
传真	0755-25832571	0574-89103213
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）	浙江省宁波市鄞州区宁东路345号
办公地址	深圳市福田区福华一路15号投行大厦15层	浙江省宁波市鄞州区宁东路345号
邮政编码	518000	315100
法定代表人	刘学民	陆华裕

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

## 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	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

## § 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年02月26日(基金合同生效日)-2020年06月30日)	
	创金合信鑫益混合A	创金合信鑫益混合C
本期已实现收益	-11,719,697.00	-230,792.05
本期利润	24,734,886.60	319,135.91
加权平均基金份额本期利润	0.1218	0.0928
本期加权平均净值利润率	12.56%	9.60%
本期基金份额净值增长率	12.22%	12.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
期末可供分配利润	-11,668,746.19	-143,380.12
期末可供分配基金份额利润	-0.0576	-0.0590
期末基金资产净值	227,162,329.46	2,723,211.94



期末基金份额净值	1.1222	1.1206
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2020年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	12.22%	12.06%

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。4. 本基金合同生效日为2020年02月26日，截至报告期末，本基金成立不满半年。合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 创金合信鑫益混合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	14.63%	1.07%	5.04%	0.62%	9.59%	0.45%
过去三个月	25.51%	1.12%	8.62%	0.63%	16.89%	0.49%
自基金合同生效起至今	12.22%	1.42%	0.73%	0.97%	11.49%	0.45%

##### 创金合信鑫益混合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	14.58%	1.07%	5.04%	0.62%	9.54%	0.45%
过去三个月	25.37%	1.12%	8.62%	0.63%	16.75%	0.49%
自基金合同生效起至今	12.06%	1.42%	0.73%	0.97%	11.33%	0.45%

### 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变动的比较



注：1、本基金的基金合同于 2020 年 02 月 26 日生效，截至报告期末，本基金成立不满一年。

2、按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同(第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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。报告期内，本公司共发行8只公募基金。截至2020年6月30日，本公司共管理49只公募基金，其中混合型产品13只、指数型产品5只、债券型产品20只、股票型产品10只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约340.38亿元。

#### 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		
曹春林	本基金基金经理	2020-02-26	-	15年	曹春林先生，中国国籍，厦门大学学士，1998年7月就职于中国银河证券，从事研究工作。2004年3月就职于茂业集团，从事资本运作、证券投资工作。2010年4月加盟第一创业证券股份有限公司，历任资产管理部行业研究员、资产管理部投资部副总监。2014年8月加入创金合基金管理有限公司，曾任资管投资部副总监兼投资经理，现任基金经理。
王妍	本基金基金经理	2020-03-02	-	10年	王妍女士，中国国籍，吉林大学经济学博士。曾就职于天相投资顾问有限公司担任总裁业务助理。2009年加入第一创业证券资产管理部任高级研究员、研究部总监助理。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，现任行业投资研究部执行总监、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》的相关决定。

## 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》、《证券投资基金销售管理办法》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

#### 1. 宏观经济分析

1月底新冠疫情开始爆发，经济停摆，政策为了稳增长持续宽松；2月中下旬，国内疫情总体得控，但3月底海外疫情开始愈演愈烈的，受超预期下调超额存款准备金率和定向降准的影响，债券收益率继续大幅下行。4月中下旬开始，金融、经济数据边际改善，两会召开时间确定，并提出防范资金套利空转问题，预示着经济基本面探底回升势头良好，国内疫情防控取得较好成效，监管层开始重视宽松货币政策带来的“后遗症”，央行货币政策开始进入“观测期”，叠加利率债供给压力，资金价格不断抬升，5月份至6月份，债市进入上行态势。二季度债市的变化核心在于央行撤出应对疫情的危机模式，更加注重保增长和防风险的平衡，货币政策出现边际收紧。

#### 2. 市场回顾

2020年上半年债券市场呈现先下行后大幅上行的行情。10年国债利率整体上行5bp左右，最低下探至2.5%附近；隔夜回购利率中枢从2%以上下降到1%以内，5月后又重新上行至2%附近。

上半年受国内国外疫情影响，在各国央行纷纷出台经济刺激政策背景下，全球风险资产在急跌后，出现不同程度的反弹修复。尽管IMF不断下修全球增长预期，但各国均积极推进复工复产，权益市场表现大超预期。作为率先走出疫情阴霾的中国权益市场也同样有较好表现，上证指数上涨15.75%，沪深300上涨17.58%，创业板指上涨37.41%。

### 3. 运行分析

上半年，债券部分，本基金保持合适的久期和杠杆比例，主要配置AA+及以上高评级信用债，在保持组合流动性的前提下增厚组合收益。

权益部分，以行业轮动和精选个股为主要策略。宏观层面，密切跟踪经济核心指标，研判货币政策、财政政策动向及汇率走势，紧密关注国际经济政治动态，以判断股票和债券的相对风险收益比，由此调整相对仓位。中观层面，密切关注影响行业景气度的核心要素，把握行业发展动态，选择在科技、医药、消费、工业、金融地产等五大领域中，中长期确定性强、趋势向上的细分子行业，并通过调整配置比例实现行业轮动。个股层面，精选优质龙头公司，在市场水平偏低的位置坚定持有。

#### 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益混合A基金份额净值为1.1222元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为12.22%，同期业绩比较基准收益率为0.73%；截至报告期末创金合信鑫益混合C基金份额净值为1.1206元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为12.06%，同期业绩比较基准收益率为0.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

向前看，经济延续回暖，但恢复速度有所放缓，供需不平衡继续，货币政策的宽松基调未变，稳增长仍是重要目标，政策短期难转向，但也难以回到3-4月份的宽松状态。外部方面，欧洲疫情得控和经济重启，经济表现逐渐恢复，美国疫情因重启及抗议活动，再度爆发，恢复前景暗淡。外需总体偏弱。内部方面，经济持续改善，但很可能已走过最快的复苏阶段，且疫情对餐饮旅游服务等相关领域的压制仍存在，经济仍运行在潜在增速以下。

#### 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

本基金本报告期未出现连续二十个工作日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, 本托管人在创金合信鑫益混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中, 严格遵守《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, 本托管人根据《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, 对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督, 对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核, 未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注: 财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体: 创金合信鑫益混合型证券投资基金

报告截止日: 2020年06月30日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2020年06月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	21,740,839.28
结算备付金		740,209.28
存出保证金		241,498.73
交易性金融资产	6.4.7.2	206,933,302.19
其中：股票投资		206,933,302.19
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		801,618.86
应收利息	6.4.7.5	6,502.28
应收股利		-
应收申购款		33,183.49
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		230,497,154.11
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年06月30日</b>
<b>负债：</b>		
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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		34,548.44
应付管理人报酬		139,896.97



应付托管费		17,487.11
应付销售服务费		983.96
应付交易费用	6.4.7.7	354,826.97
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	63,869.26
负债合计		611,612.71
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	204,863,223.85
未分配利润	6.4.7.10	25,022,317.55
所有者权益合计		229,885,541.40
负债和所有者权益总计		230,497,154.11

注：1. 报告截止日2020年06月30日，基金份额总额204,863,223.85份，其中下属A类基金份额202,433,108.05份，C类基金份额2,430,115.80份。下属A类基金份额净值1.1222元，C类基金份额净值1.1206元。2. 本基金合同生效日为2020年02月26日，2020年半年度实际报告期间为2020年02月26日至2020年06月30日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信鑫益混合型证券投资基金

本报告期：2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日
<b>一、收入</b>		27,023,292.36
1. 利息收入		155,608.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	133,269.82
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		22,339.15
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,138,945.84
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-10,778,167.03
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	639,221.19
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	37,004,511.56
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	2,117.67
<b>减：二、费用</b>		1,969,269.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	548,021.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	68,502.67
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,520.11
4. 交易费用	6.4.7.18	1,284,012.14
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.19	64,213.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		25,054,022.51
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		25,054,022.51

注：本财务报表的实际报告期间为2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信鑫益混合型证券投资基金

本报告期：2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	206,710,945.17	-	206,710,945.17
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	25,054,022.51	25,054,022.51
三、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)	-1,847,721.32	-31,704.96	-1,879,426.28
其中：1. 基金申购款	177,048.79	7,699.39	184,748.18
2. 基金赎回 款	-2,024,770.11	-39,404.35	-2,064,174.46
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	204,863,223.85	25,022,317.55	229,885,541.40

注：本财务报表的实际报告期间为2020年02月26日(基金合同生效日)至2020年06月30日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

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

创金合信鑫益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”）《关于准予创金合信鑫益混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]2951号文）批准，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》及其配套规则和《创金合信鑫益混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2020年02月26日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为206,710,945.17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，基金托管人为宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”）。

本基金于2020年01月13日至2020年02月07日募集，募集期间净认购资金人民币206,683,016.24元。上述募集资金已由毕马威振华会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了毕马威振华验字第2000223号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《创金合信鑫益混合型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《创金合信鑫益混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、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、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、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、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、货币市场工具、同业存单、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）。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%

### 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》、《创金合信鑫益混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2020年02月26日(基金合同生效日)至2020年06月30日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

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

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和

报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 本基金各类基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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《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》、财税[2016]36号《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《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《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，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%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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 2020年06月30日
活期存款	21,740,839.28
定期存款	-
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	-
合计	21,740,839.28

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	169,928,790.63	206,933,302.19	37,004,511.56
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	169,928,790.63	206,933,302.19	37,004,511.56

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	6,060.48
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	333.10
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	108.70
合计	6,502.28

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	354,826.97
银行间市场应付交易费用	-

合计	354,826.97
----	------------

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	55.48
预提费用	63,813.78
合计	63,869.26

## 6.4.7.9 实收基金

## 6.4.7.9.1 创金合信鑫益混合A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信鑫益混合A)	本期2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	203,121,777.80	203,121,777.80
本期申购	79,482.41	79,482.41
本期赎回（以“-”号填列）	-768,152.16	-768,152.16
本期末	202,433,108.05	202,433,108.05

## 6.4.7.9.2 创金合信鑫益混合C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信鑫益混合C)	本期2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,589,167.37	3,589,167.37
本期申购	97,566.38	97,566.38
本期赎回（以“-”号填列）	-1,256,617.95	-1,256,617.95
本期末	2,430,115.80	2,430,115.80

注：1. 申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

2. 本基金自2020年01月13日至2020年02月07日止期间公开发售,共募集有效净认购资金206,683,016.24元,其中A类基金募集有效净认购资金为203,094,420.25元,C类基金募集有效净认购资金为3,588,595.99元。根据《创金合信鑫益混合型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入27,928.93元,在本基金成立后,折算为27,928.93的基金份额,划入基金份额持有人账户。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 创金合信鑫益混合A

单位：人民币元

项目 (创金合信鑫益混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-11,719,697.00	36,454,583.60	24,734,886.60
本期基金份额交易产生的变动数	50,950.81	-56,616.00	-5,665.19
其中：基金申购款	-5,206.99	10,151.28	4,944.29
基金赎回款	56,157.80	-66,767.28	-10,609.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,668,746.19	36,397,967.60	24,729,221.41

##### 6.4.7.10.2 创金合信鑫益混合C

单位：人民币元

项目 (创金合信鑫益混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-230,792.05	549,927.96	319,135.91
本期基金份额交易产生的变动数	87,411.93	-113,451.70	-26,039.77
其中：基金申购款	-6,985.80	9,740.90	2,755.10
基金赎回款	94,397.73	-123,192.60	-28,794.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-143,380.12	436,476.26	293,096.14

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日
活期存款利息收入	124,456.10
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	7,983.06
其他	830.66
合计	133,269.82

## 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日
卖出股票成交总额	430,360,891.06
减：卖出股票成本总额	441,139,058.09
买卖股票差价收入	-10,778,167.03

## 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

## 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
----	----

	2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	639,221.19
基金投资产生的股利收益	-
合计	639,221.19

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	37,004,511.56
——股票投资	37,004,511.56
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	37,004,511.56

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日
基金赎回费收入	2,117.67
合计	2,117.67

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日
交易所市场交易费用	1,284,012.14
银行间市场交易费用	-
合计	1,284,012.14

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日
审计费用	19,103.94
信息披露费	44,709.84
账户维护费	400.00
合计	64,213.78

## 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
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金托管人
第一创业证券股份有限公司（“第一创业证券”）	基金管理人的股东
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 2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	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	1,038,359,557.01	100.00%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 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 2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	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	205,900,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06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	占期末应付佣金总量的比例
第一创业证券股份有限公司	749,474.00	100.00%	354,826.97	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 2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	548,021.15
其中：支付销售机构的客户维护费	8,130.29

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	68,502.67

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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		
	2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信鑫益混合A	创金合信鑫益混合C	合计
创金合信直销	0.00	2.07	2.07
合计	0.00	2.07	2.07

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，仅就C类基金份额收取销售服务费。C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.4%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

#### 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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 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 2020年02月26日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
宁波银行股份有限公司	21,740,839.28	124,456.10

本基金的银行存款由基金托管人宁波银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金于本期未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2020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	可流通日	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
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新发流通受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新发流通受限	36.18	36.18	2,783	100,688.94	100,688.94	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新发流通受限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新发流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新发流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新发流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新发流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新发流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020-06-	2020-07-	新发流通	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

		22	01	受限					
--	--	----	----	----	--	--	--	--	--

#### 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2020年06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为0, 无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月30日止, 本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0, 无抵押债券。

#### 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、监察稽核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同责任, 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和债券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宁波银行, 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。

#### 6.4.13.3 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2020年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不付息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不付息，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时间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附注6.4.12。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%。于2020年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.18%。

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。于2020年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为229,086,454.55元，超过经确认的当日净赎回金额。

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、存出保证金及买入返售金融资产投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年06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	21,740,839.28	-	-	-	21,740,839.28
结算备付金	740,209.28	-	-	-	740,209.28



存出保证金	241,498.73	-	-	-	241,498.73
交易性金融资产	-	-	-	206,933,302.19	206,933,302.19
应收证券清算款	-	-	-	801,618.86	801,618.86
应收利息	-	-	-	6,502.28	6,502.28
应收申购款	-	-	-	33,183.49	33,183.49
资产总计	22,722,547.29	-	-	207,774,606.82	230,497,154.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	34,548.44	34,548.44
应付管理人报酬	-	-	-	139,896.97	139,896.97
应付托管费	-	-	-	17,487.11	17,487.11
应付销售服务费	-	-	-	983.96	983.96
应付交易费用	-	-	-	354,826.97	354,826.97
其他负债	-	-	-	63,869.26	63,869.26
负债总计	-	-	-	611,612.71	611,612.71
利率敏感度缺口	22,722,547.29	-	-	207,162,994.11	229,885,541.40

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

于2020年6月30日，本基金未持有债券资产(2019年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019年12月31日：同)。

#### 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。

#### 6.4.13.4.3 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 2020年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	206,933,302.19	90.02
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	206,933,302.19	90.02

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他条件不变的情况下	
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

	2020年06月30日	
比较基准上涨5%		12,198,661.30
比较基准下降5%		-12,198,661.30

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值(a)金融工具公允价值计量的方法公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。(b)持续的以公允价值计量的金融工具(i)各层次金融工具公允价值于2020年06月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为206,510,812.92元,属于第二层次的余额为422,489.27元,无属于第三层次的余额。(ii)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公允价值应属第二层次还是第三层次。(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额无。(c)非持续的以公允价值计量的金融工具于2020年06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。(d)不以公允价值计量的金融工具不以公允价值计量的金融资产和负债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相差很小。(2)其他除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	206,933,302.19	89.78
	其中:股票	206,933,302.19	89.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,481,048.56	9.75
8	其他各项资产	1,082,803.36	0.47
9	合计	230,497,154.11	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	184,499,263.42	80.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	496.98	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	27,750.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,135,345.07	3.54
J	金融业	9,224,056.00	4.01
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	5,033,624.40	2.19
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	206,933,302.19	90.02

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002271	东方雨虹	344,900	14,013,287.00	6.10
2	600519	贵州茅台	7,600	11,117,888.00	4.84
3	600529	山东药玻	182,420	10,580,360.00	4.60
4	600438	通威股份	592,553	10,298,571.14	4.48
5	000661	长春高新	22,906	9,970,981.80	4.34
6	300482	万孚生物	90,676	9,430,304.00	4.10
7	300750	宁德时代	52,400	9,136,464.00	3.97
8	300595	欧普康视	119,850	8,310,399.00	3.62
9	600584	长电科技	225,100	7,038,877.00	3.06
10	002475	立讯精密	134,807	6,922,339.45	3.01
11	600703	三安光电	270,200	6,755,000.00	2.94
12	600809	山西汾酒	43,526	6,311,270.00	2.75
13	600276	恒瑞医药	63,932	5,900,923.60	2.57
14	002891	中宠股份	130,800	5,347,104.00	2.33
15	002901	大博医疗	44,600	5,320,334.00	2.31
16	002129	中环股份	234,514	5,267,184.44	2.29
17	603127	昭衍新药	47,880	5,033,624.40	2.19
18	601689	拓普集团	170,700	4,762,530.00	2.07
19	603986	兆易创新	19,920	4,699,327.20	2.04
20	300598	诚迈科技	24,630	4,664,922.00	2.03
21	000651	格力电器	77,700	4,395,489.00	1.91

22	300059	东方财富	206,560	4,172,512.00	1.82
23	002798	帝欧家居	120,300	3,906,141.00	1.70
24	600036	招商银行	114,800	3,871,056.00	1.68
25	002812	恩捷股份	54,700	3,599,260.00	1.57
26	688126	沪硅产业	92,254	3,162,467.12	1.38
27	300558	贝达药业	21,100	2,953,578.00	1.28
28	002460	赣锋锂业	47,250	2,531,182.50	1.10
29	002920	德赛西威	38,500	2,361,205.00	1.03
30	300451	创业慧康	121,050	2,238,214.50	0.97
31	601100	恒立液压	27,900	2,237,580.00	0.97
32	603363	傲农生物	95,200	2,224,824.00	0.97
33	002402	和而泰	137,100	2,222,391.00	0.97
34	603659	璞泰来	21,500	2,214,930.00	0.96
35	000876	新希望	71,500	2,130,700.00	0.93
36	603160	汇顶科技	7,574	1,688,244.60	0.73
37	603916	苏博特	67,000	1,685,050.00	0.73
38	600600	青岛啤酒	16,757	1,281,910.50	0.56
39	600984	建设机械	49,400	1,225,120.00	0.53
40	300454	深信服	5,900	1,215,164.00	0.53
41	601162	天风证券	194,800	1,180,488.00	0.51
42	000858	五粮液	6,400	1,095,168.00	0.48
43	600522	中天科技	63,300	724,785.00	0.32
44	002497	雅化集团	68,500	632,255.00	0.28
45	688505	复旦张江	10,807	367,762.21	0.16
46	000063	中兴通讯	3,300	132,429.00	0.06
47	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.05
48	688027	国盾量子	2,783	100,688.94	0.04
49	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.04
50	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.04
51	603087	甘李药业	688	69,006.40	0.03
52	600754	锦江酒店	1,000	27,750.00	0.01

53	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
54	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
55	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
56	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
57	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
58	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
59	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
60	002594	比亚迪	100	7,180.00	0.00
61	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
62	002405	四维图新	300	4,947.00	0.00
63	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
64	601390	中国中铁	99	496.98	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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000063	中兴通讯	24,174,047.00	10.52
2	600438	通威股份	20,022,494.37	8.71
3	601186	中国铁建	16,927,788.00	7.36
4	601100	恒立液压	16,310,726.77	7.10
5	300750	宁德时代	13,960,697.99	6.07
6	002271	东方雨虹	13,824,546.50	6.01
7	600585	海螺水泥	13,802,459.00	6.00
8	600031	三一重工	13,530,539.00	5.89
9	300482	万孚生物	12,964,514.04	5.64
10	002812	恩捷股份	12,108,948.00	5.27
11	002460	赣锋锂业	12,019,287.55	5.23
12	603369	今世缘	11,993,203.22	5.22
13	600519	贵州茅台	11,806,056.63	5.14

14	300630	普利制药	11,074,082.48	4.82
15	000876	新希望	11,054,126.00	4.81
16	600809	山西汾酒	10,980,298.62	4.78
17	600486	扬农化工	10,036,025.00	4.37
18	002212	南洋股份	9,993,409.52	4.35
19	600498	烽火通信	9,989,131.75	4.35
20	603986	兆易创新	9,180,384.21	3.99
21	000651	格力电器	9,131,422.00	3.97
22	600048	保利地产	8,995,369.00	3.91
23	603939	益丰药房	8,990,833.10	3.91
24	000661	长春高新	8,921,621.45	3.88
25	000425	徐工机械	8,824,832.00	3.84
26	600529	山东药玻	8,231,483.80	3.58
27	002385	大北农	7,993,140.00	3.48
28	002594	比亚迪	6,997,866.98	3.04
29	300558	贝达药业	6,992,581.00	3.04
30	600703	三安光电	6,770,362.95	2.95
31	603160	汇顶科技	6,102,816.00	2.65
32	600584	长电科技	6,099,894.00	2.65
33	002541	鸿路钢构	6,030,256.00	2.62
34	000656	金科股份	5,993,331.44	2.61
35	300059	东方财富	5,444,418.20	2.37
36	601162	天风证券	5,316,912.13	2.31
37	300595	欧普康视	5,009,690.50	2.18
38	601669	中国电建	4,999,729.00	2.17
39	601800	中国交建	4,999,103.00	2.17
40	601066	中信建投	4,999,039.00	2.17
41	601088	中国神华	4,999,025.00	2.17
42	300037	新宙邦	4,998,591.50	2.17
43	000786	北新建材	4,998,343.00	2.17
44	601390	中国中铁	4,998,117.00	2.17



45	002458	益生股份	4,997,909.50	2.17
46	600522	中天科技	4,997,287.00	2.17
47	600487	亨通光电	4,996,166.26	2.17
48	601668	中国建筑	4,993,836.00	2.17
49	601698	中国卫通	4,990,572.00	2.17
50	000858	五粮液	4,990,490.00	2.17
51	603363	傲农生物	4,982,852.00	2.17
52	600276	恒瑞医药	4,806,832.65	2.09

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000063	中兴通讯	22,833,520.00	9.93
2	601100	恒立液压	16,955,826.00	7.38
3	601186	中国铁建	15,609,633.00	6.79
4	600031	三一重工	14,334,716.17	6.24
5	600585	海螺水泥	13,718,887.02	5.97
6	300630	普利制药	11,576,076.50	5.04
7	600486	扬农化工	10,712,390.00	4.66
8	600438	通威股份	10,131,820.00	4.41
9	600498	烽火通信	9,725,561.74	4.23
10	000876	新希望	9,716,866.00	4.23
11	002212	南洋股份	9,664,932.81	4.20
12	603369	今世缘	9,398,419.00	4.09
13	002460	赣锋锂业	9,012,428.00	3.92
14	603939	益丰药房	8,978,945.90	3.91
15	000425	徐工机械	8,481,577.98	3.69
16	600048	保利地产	8,186,939.00	3.56
17	002812	恩捷股份	8,163,603.00	3.55

18	002385	大北农	7,297,148.28	3.17
19	300750	宁德时代	6,778,712.00	2.95
20	002541	鸿路钢构	6,345,564.00	2.76
21	000656	金科股份	6,280,342.81	2.73
22	300482	万孚生物	6,114,355.00	2.66
23	002594	比亚迪	5,803,394.00	2.52
24	600809	山西汾酒	5,451,863.00	2.37
25	601066	中信建投	5,366,717.00	2.33
26	000786	北新建材	5,065,648.00	2.20
27	601668	中国建筑	4,768,356.00	2.07
28	601669	中国电建	4,731,620.00	2.06
29	600720	祁连山	4,677,527.00	2.03
30	601088	中国神华	4,671,799.80	2.03

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	611,067,848.72
卖出股票收入（成交）总额	430,360,891.06

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 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

**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**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**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 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	241,498.73
2	应收证券清算款	801,618.86
3	应收股利	-
4	应收利息	6,502.28

5	应收申购款	33,183.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,082,803.36

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

### § 8 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
创金合信鑫益混合A	465	435,340.02	200,024,000.00	98.81%	2,409,108.05	1.19%
创金合信鑫益混合C	444	5,473.23	0.00	0.00%	2,430,115.80	100.00%
合计	836	245,051.70	200,024,000.00	97.64%	4,839,223.85	2.36%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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	创金合信鑫益混合A	15,690.48	0.01%
	创金合信鑫益混合C	3,441.93	0.14%
	合计	19,132.41	0.01%

### 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	创金合信鑫益混合A	0~10
	创金合信鑫益混合C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信鑫益混合A	0~10
	创金合信鑫益混合C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信鑫益混合A	创金合信鑫益混合C
基金合同生效日(2020年02月26日)基金份额总额	203,121,777.80	3,589,167.37
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	79,482.41	97,566.38
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	768,152.16	1,256,617.95
基金合同生效日起至报告期期末	-	-

基金拆分变动份额		
本报告期末基金份额总额	202,433,108.05	2,430,115.80

本基金基金合同生效日为2020年02月26日。

## § 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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 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	1,038,359,557.01	100.00%	749,474.00	100.00%	-
--------	---	------------------	---------	------------	---------	---

注：交易单元的选择标准和程序：

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(3) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金在报告期内成立，交易单元均于本期内新增。

#### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
第一创业证券	-	-	205,900,000.00	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	创金合信鑫益混合型证券投资基金基金份额发售公告	公司官网、中国证券报	2020-01-10
2	创金合信基金管理有限公司关于创金合信鑫益混合型证券投资基金延长募集期的公告	公司官网、中国证券报	2020-02-06
3	创金合信基金管理有限公司关于创金合信鑫益混合型证	公司官网、中国证券报	2020-02-15

	券投资基金提前结束募集的公告		
4	创金合信鑫益混合型证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、中国证券报	2020-02-27
5	创金合信鑫益混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、中国证券报	2020-03-03
6	创金合信鑫益混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2020年3月）	公司官网、中国证券报	2020-03-04
7	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票及相关风险揭示的公告	公司官网、中国证券报	2020-03-12
8	创金合信鑫益混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	公司官网、中国证券报	2020-05-19

## § 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	20200226 - 20200630	0.00	50,005,750.00	0.00	50,005,750.00	24.41%
	2	20200226 - 20200630	0.00	50,005,750.00	0.00	50,005,750.00	24.41%
	3	20200226 - 20200630	0.00	100,012,500.00	0.00	100,012,500.00	48.82%

#### 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)若本基金在短期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

本报告期内，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信鑫益混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信鑫益混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信鑫益混合型证券投资基金2020年中期报告原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

### 12.3 查阅方式

[www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司  
二〇二〇年八月三十一日