

创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 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.....	5
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	35
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12	投资组合报告附注	41
§8	基金份额持有人信息	41
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	42
§9	开放式基金份额变动	43
§10	重大事件揭示	43
10.1	基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4	基金投资策略的改变	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8	其他重大事件	45
§11	影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	46
§12	备查文件目录	46
12.1	备查文件目录	46
12.2	存放地点	46
12.3	查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信港股通大消费精选股票	
基金主代码	009733	
交易代码	009733	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 8 月 27 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	12,524,276.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信港股通大消费精选股票 A	创金合信港股通大消费精选股票 C
下属分级基金的交易代码	009733	009734
报告期末下属分级基金的份额总额	6,287,252.49 份	6,237,024.43 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选 A 股及港股市场大消费主题行业中的优质公司，在合理控制风险的前提下，通过积极的主动管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过"自上而下"与"自下而上"相结合的主动投资管理策略，综合考虑宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，评估股票、债券、货币市场工具及金融衍生品等大类资产的估值水平和投资价值，形成对大类资产预期收益及风险的判断，持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。
业绩比较基准	中证港股通大消费主题指数收益率（使用估值汇率折算）×90%+中债综合（全价）指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋
	联系电话	0755-23838944
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfun
		龚小武
		021-52629999-212056
		gongxiaowu@cib.com.cn

		d.com	
客户服务电话		400-868-0666	95561
传真		0755-25832571	021-62159217
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）		福州市湖东路154号
办公地址	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层		上海市银城路167号兴业大厦4楼
邮政编码	518000		200120
法定代表人	刘学民		吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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

1、创金合信港股通大消费精选股票 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	-183,498.58
本期利润	22,915.30
加权平均基金份额本期利润	0.0036
本期加权平均净值利润率	0.35%
本期基金份额净值增长率	1.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	-265,317.70

期末可供分配基金份额利润	-0.0422
期末基金资产净值	6,610,861.05
期末基金份额净值	1.0515
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	5.15%

2、创金合信港股通大消费精选股票 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	-208,404.15
本期利润	45,875.21
加权平均基金份额本期利润	0.0070
本期加权平均净值利润率	0.69%
本期基金份额净值增长率	1.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	-299,116.74
期末可供分配基金份额利润	-0.0480
期末基金资产净值	6,519,674.56
期末基金份额净值	1.0453
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	4.53%

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 8 月 27 日，无上年度可比期间。

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

创金合信港股通大消费精选股票 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	2.46%	1.09%	3.94%	1.14%	-1.48%	-0.05%
过去三个月	8.49%	1.27%	9.83%	1.27%	-1.34%	0.00%
过去六个月	1.86%	1.89%	8.74%	1.83%	-6.88%	0.06%
自基金合同生效起至今	5.15%	1.56%	23.28%	1.72%	-18.13%	-0.16%

创金合信港股通大消费精选股票 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	2.39%	1.09%	3.94%	1.14%	-1.55%	-0.05%
过去三个月	8.30%	1.27%	9.83%	1.27%	-1.53%	0.00%
过去六个月	1.51%	1.89%	8.74%	1.83%	-7.23%	0.06%
自基金合同生效起至今	4.53%	1.56%	23.28%	1.72%	-18.75%	-0.16%

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

创金合信港股通大消费精选股票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08月27日-2021年06月30日)





注：1、本基金合同于 2020 年 8 月 27 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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 13 只公募基金。截至 2021 年 6 月 30 日，本公司共管理 69 只公募基金，其中混合型产品 19 只、指数型产品 4 只、债券型产品 23 只、股票型产品 22 只、货币型产品 1 只；管理的公募基金规模约 559.29 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		
胡尧盛	本基金基金经理	2020 年 8 月 27 日	-	8	胡尧盛先生，中国国籍，江西财经大学金融学硕士，2013 年 7 月加入国元咨询服务（深圳）有限公司，任研究部研究员，负责港股市场消费品行业研究分析工作。2015 年 6 月加入创金合信基金管理有限公司任研究部研究员，现任基金经理。

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

2、证券从业年限的含义遵从行业协会《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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，香港市场的走势一波三折，前高后低。春节前市场情绪极为亢奋，涨幅大，春节后市场回调，回撤幅度也大。香港市场受海内外流动性影响较大，在对全球流动性收紧的背景下，港股表现明显弱于 A 股和港股。结构表现来看，原材料、能源、公用事业领涨，而必选消费、可选消费、科技行业跑输明显。

考虑到香港市场的特殊性，我们对于估值的看重程度过高，因此采取了相对谨慎和分散的投资思路，事后来看，效果并不尽如人意。特别是春节前和春节后的市场波动，对行为模式的影响较大，节前市场情绪极高，对操作也造成一定程度的扰动。春节后市场下跌大幅超出预期，回撤也并没有控制住。随后市场出现上涨，但是“短期高增长”取代了“长期确定性”，持仓的标的反弹幅度较弱。医药，新能源汽车，能源等表现靓丽。由于港股和 A 股有非常大的区别，港股由于有做空机制，估值相比较 A 股更重要，但短期也会阶段性受到资金持续流入的影响。策略上选择了一些长期投资逻辑确定，有空间，估值合理或偏低的标的进行持有，但是效果并不理想，市场依然选择性忽略，追逐短期景气度更高的板块和行业。

然而，我们认为，部分行业和个股进入了极佳的左侧布局区间，特别是未来 3-5 年成长路径情绪，复合增速能做到 25%左右的公司，当前估值水平较低，安全边际较高。另外，我们认为，港股互联网板块受到政策压制，下跌幅度大。近期滴滴事件的突发，进一步加剧了对港股互联网板块的负面情绪，但我们认为，滴滴事件本身更多的是一个个体事件，并不能代表行业，更不能依此类推至其他互联网公司，并且有很多公司本身也和反垄断政策并不相关，甚至还有政策的支持，比如半导体、硬件、电子（新能源汽车产业链）、SAAS 等，而且互联网龙头公司也更多的表达出了拥抱监管的积极态度。未来的前景依然值得看好。

我们会在何时的时机，对仓位进行集中，优中选优，等待拐点。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信港股通大消费精选股票 A 基金份额净值为 1.0515 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.86%，同期业绩比较基准收益率为 8.74%；截至本报告期末创金合信港股通大消费精选股票 C 基金份额净值为 1.0453 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.51%，同期业绩比较基准收益率为 8.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

香港市场受流动性的影响更大，短期和美股的关联性较强，在未来美股因为流动性边际收紧而出现调整时，港股市场也会面临一定的调整。但由于市场整体近期下跌幅度较大，因为我们也弱化了美股未来对港股的负面影响。而考虑到行业、细分行业和个股层面，我们依然坚持自下而上选股的策略，在出现合适的估值水平时（特别是因为市场层面而非公司

层面带来的估值收缩)，对于核心标的给予超配的仓位。在不确定性仍存的情况下，若后续出现了一些官方态度的缓和，或者一些以文件形式而出台的监管法规等类似的信号时，也将确立我们进一步提高仓位的时机。

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

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	564,775.91	1,017,375.86
结算备付金		19.98	208,851.00
存出保证金		4,646.23	67,890.45
交易性金融资产	6.4.7.2	12,783,009.17	10,611,833.14
其中：股票投资		12,123,790.77	10,029,891.34
基金投资		-	-
债券投资		659,218.40	581,941.80
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	10,544.38	12,957.37
应收股利		3,005.79	16.88
应收申购款		22,675.98	3,116.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		13,388,677.44	11,922,041.09

负债和所有者权益		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		123,063.14	294,022.24
应付赎回款		90,089.69	81,546.61
应付管理人报酬		16,152.58	13,829.32
应付托管费		2,153.64	1,843.89
应付销售服务费		3,776.39	3,231.08
应付交易费用	6.4.7.7	9,466.16	12,941.33
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	13,440.23	77,005.00
负债合计		258,141.83	484,419.47
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	12,524,276.92	11,093,087.78
未分配利润	6.4.7.10	606,258.69	344,533.84
所有者权益合计		13,130,535.61	11,437,621.62
负债和所有者权益总计		13,388,677.44	11,922,041.09

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，创金合信港股通大消费精选股票 A 份额净值 1.0515 元，基金份额总额 6,287,252.49 份；创金合信港股通大消费精选股票 C 份额净值 1.0453 元，基金份额总额 6,237,024.43 份；总份额合计 12,524,276.92 份。

6.2 利润表

会计主体：创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021
----	-----	-------------------------

		年 6 月 30 日
一、收入		283,287.15
1. 利息收入		5,858.57
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,812.28
债券利息收入		3,046.29
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
证券出借利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-197,072.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-247,708.68
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-41.30
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	50,677.18
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	460,693.24
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	13,808.14
减：二、费用		214,496.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	98,244.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	13,099.23
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	23,310.77
4. 交易费用	6.4.7.18	56,795.49
5. 利息支出		78.31

其中：卖出回购金融资产支出		78.31
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.19	22,968.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		68,790.51
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		68,790.51

注：本基金合同生效日为 2020 年 8 月 27 日，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 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）	11,093,087.78	344,533.84	11,437,621.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	68,790.51	68,790.51
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）	1,431,189.14	192,934.34	1,624,123.48
其中：1. 基金申购款	5,786,217.81	334,142.97	6,120,360.78
2. 基金赎回款	-4,355,028.67	-141,208.63	-4,496,237.30
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)	12,524,276.92	606,258.69	13,130,535.61
---------------------	---------------	------------	---------------

注：本基金合同生效日为 2020 年 8 月 27 日，无上年度可比期间。

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____ ____沈琼____
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

创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金（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”）2020 年 6 月 1 日证监许可 [2020] 1042 号文《关于准予创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金注册的批复》核准募集。本基金由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2020 年 8 月 27 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 11,041,174.80 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）。

本基金于 2020 年 8 月 21 日募集，募集期间净认购资金人民币 11,040,824.36 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 350.44 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 11,041,174.80 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了毕马威华振验字第 2000468 号验资报告。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,350.03 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于国内依法发行

上市的股票（包括主板、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）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、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、同业存单、货币市场工具、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）。本基金股票投资占基金资产的比例为 80% - 95%（投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%），投资于大消费主题相关上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证港股通大消费主题指数收益率（使用估值汇率折算） $\times 90\%$ + 中债综合（全价）指数收益率 $\times 10\%$ 。

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》、《创金合信港股通大消费精选股票型发起式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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本基金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[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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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日起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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	564,775.91
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	564,775.91

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	11,174,143.04	12,123,790.77	949,647.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	659,372.50	659,218.40
	银行间市场	-	-
	合计	659,372.50	659,218.40
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	11,833,515.54	12,783,009.17	949,493.63

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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	45.47
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	-
应收债券利息	10,498.11
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	-
应收出借证券利息	-
其他	0.80
合计	10,544.38

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	9,466.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	9,466.16

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	51.66
应付证券出借违约金	-
预提费用	13,388.57
合计	13,440.23

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信港股通大消费精选股票 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,524,182.39	5,524,182.39
本期申购	2,352,873.51	2,352,873.51
本期赎回（以“-”号填列）	-1,589,803.41	-1,589,803.41
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	6,287,252.49	6,287,252.49

创金合信港股通大消费精选股票 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,568,905.39	5,568,905.39
本期申购	3,433,344.30	3,433,344.30
本期赎回（以“-”号填列）	-2,765,225.26	-2,765,225.26
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	6,237,024.43	6,237,024.43

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

创金合信港股通大消费精选股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-63,898.88	242,359.30	178,460.42
本期利润	-183,498.58	206,413.88	22,915.30
本期基金份额交易产生的变动数	-17,920.24	140,153.08	122,232.84
其中：基金申购款	-65,317.16	218,615.60	153,298.44
基金赎回款	47,396.92	-78,462.52	-31,065.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-265,317.70	588,926.26	323,608.56

创金合信港股通大消费精选股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-77,431.92	243,505.34	166,073.42
本期利润	-208,404.15	254,279.36	45,875.21
本期基金份额交易产生的变动数	-13,280.67	83,982.17	70,701.50
其中：基金申购款	-107,072.04	287,916.57	180,844.53
基金赎回款	93,791.37	-203,934.40	-110,143.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-299,116.74	581,766.87	282,650.13

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,427.38
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	1,363.29
其他	21.61
合计	2,812.28

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	14,116,725.44
减：卖出股票成本总额	14,364,434.12
买卖股票差价收入	-247,708.68

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,533,510.58
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,503,991.70
减：应收利息总额	29,560.18
买卖债券差价收入	-41.30

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	50,677.18
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	50,677.18

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	460,693.24
——股票投资	461,016.84
——债券投资	-323.60
——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	460,693.24

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,808.14
合计	13,808.14

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	56,795.49
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	56,795.49

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	13,388.57
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	580.00
账户维护费	9,000.00
合计	22,968.57

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
兴业银行股份有限公司	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
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 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
第一创业证券股份有限公司	25,155,122.86	83.53%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

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 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	20,124.04	84.93%	8,008.33	84.60%

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 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	98,244.27
其中：支付销售机构的客户维护费	9,521.18

注：支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	13,099.23

注：支付基金托管人兴业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.2%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

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 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		
	创金合信港股通大消费精选股票 A	创金合信港股通大消费精选股票 C	合计
创金合信直销	-	17,791.68	17,791.68
合计	-	17,791.68	17,791.68

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 0.7%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：

$$\text{日 C 类基金份额销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.7\% / \text{当年天数}。$$

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未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

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	创金合信港股通大消费精选	创金合信港股通大消费精选

	股票 A	股票 C
报告期初持有的基金份额	5,000,175.03	5,000,175.00
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,175.03	5,000,175.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	79.53%	80.17%

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	564,775.91	1,427.38

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业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区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区间均无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的金融工具风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、合规与风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手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兴业银行，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。

6.4.13.2.1 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	659,218.40	581,941.80
合计	659,218.40	581,941.80

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

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

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 2021 年 06 月 30 日，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 2021 年 06 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 0.00%。

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 2021 年 06 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 13,361,288.98 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、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	564,775.91	-	-	-	564,775.91
结算备付金	19.98	-	-	-	19.98
存出保证金	4,646.23	-	-	-	4,646.23
交易性金融资产	659,218.40	-	-	12,123,790.77	12,783,009.17
应收利息	-	-	-	10,544.38	10,544.38
应收股利	-	-	-	3,005.79	3,005.79
应收申购款	-	-	-	22,675.98	22,675.98
资产总计	1,228,660.52	-	-	12,160,016.92	13,388,677.44
负债					
应付证券清算款	-	-	-	123,063.14	123,063.14
应付赎回款	-	-	-	90,089.69	90,089.69
应付管理人报酬	-	-	-	16,152.58	16,152.58
应付托管费	-	-	-	2,153.64	2,153.64
应付销售服务费	-	-	-	3,776.39	3,776.39
应付交易费用	-	-	-	9,466.16	9,466.16
其他负债	-	-	-	13,440.23	13,440.23
负债总计	-	-	-	258,141.83	258,141.83
利率敏感度缺口	1,228,660.52	-	-	11,901,875.09	13,130,535.61
上年度末 2020 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	1,017,375.86	-	-	-	1,017,375.86
结算备付金	208,851.00	-	-	-	208,851.00
存出保证金	67,890.45	-	-	-	67,890.45
交易性金融资产	581,941.80	-	-	10,029,891.34	10,611,833.14
应收利息	-	-	-	12,957.37	12,957.37
应收股利	-	-	-	16.88	16.88
应收申购款	-	-	-	3,116.39	3,116.39
资产总计	1,876,059.11	-	-	10,045,981.98	11,922,041.09
负债					
应付证券清算款	-	-	-	294,022.24	294,022.24
应付赎回款	-	-	-	81,546.61	81,546.61
应付管理人报酬	-	-	-	13,829.32	13,829.32
应付托管费	-	-	-	1,843.89	1,843.89

应付销售服务费	-	-	-	3,231.08	3,231.08
应付交易费用	-	-	-	12,941.33	12,941.33
其他负债	-	-	-	77,005.00	77,005.00
负债总计	-	-	-	484,419.47	484,419.47
利率敏感度缺口	1,876,059.11	-	-	9,561,562.51	11,437,621.62

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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.02%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	11,553,931.77	-	-	-	11,553,931.77
应收股利	-	3,005.79	-	-	-	3,005.79
资产合计	-	11,556,937.56	-	-	-	11,556,937.56
以外币计价的负债						
应付证券清算款	-	123,063.14	-	-	-	123,063.14
负债合计	-	123,063.14	-	-	-	123,063.14
资产负债表外汇风险敞口净额	-	11,433,874.42	-	-	-	11,433,874.42

项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日
----	-----------------------

	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	7,420,619.54	-	-	-	7,420,619.54
应收股利	-	16.88	-	-	-	16.88
资产合计	-	7,420,636.42	-	-	-	7,420,636.42
以外币计价的负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	7,420,636.42	-	-	-	7,420,636.42

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	577,696.59	371,031.82
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-577,696.59	-371,031.82	

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	12,123,790.77	92.33	10,029,891.34	87.69
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	12,123,790.77	92.33	10,029,891.34	87.69

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准上升 5%	25,275.96	87,156.35
	2.业绩比较基准下降 5%	-25,275.96	-87,156.35

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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 2021 年 6 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 12,123,790.77 元，属于第二层次的余额为 659,218.40 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 10,029,891.34 元，属于第二层次的余额为 581,941.80 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。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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 2021 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(2020 年 12 月 31 日：同)。

(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。

6.4.14.2

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 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	12,123,790.77	90.55
	其中：股票	12,123,790.77	90.55
2	固定收益投资	659,218.40	4.92
	其中：债券	659,218.40	4.92
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	564,795.89	4.22
7	其他资产	40,872.38	0.31
8	合计	13,388,677.44	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 11,553,931.77 元，占净值比为 87.99%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	329,779.00	2.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	240,080.00	1.83
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	569,859.00	4.34

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	6,174,896.39	47.03
日常消费品	2,104,888.40	16.03
金融	8,856.99	0.07
医疗保健	1,682,322.02	12.81
工业	225,660.10	1.72
信息技术	749,456.79	5.71
电信服务	485,934.72	3.70
地产业	121,916.36	0.93
合计	11,553,931.77	87.99

以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	H02269	药明生物	9,192	1,088,378.61	8.29
2	H03690	美团-W	3,798	1,012,540.84	7.71
3	H00291	华润啤酒	15,820	918,154.52	6.99
4	H01999	敏华控股	57,600	894,332.90	6.81
5	H02313	申洲国际	5,000	815,854.44	6.21
6	H02020	安踏体育	5,000	760,521.12	5.79
7	H02382	舜宇光学科 技	3,182	649,740.32	4.95
8	H01801	信达生物	7,883	593,943.41	4.52
9	H02319	蒙牛乳业	14,000	546,926.18	4.17
10	H03606	福耀玻璃	11,600	527,971.40	4.02
11	H06169	宇华教育	90,000	526,457.02	4.01
12	H00700	腾讯控股	1,000	485,934.72	3.70
13	H06690	海尔智家	20,600	464,516.98	3.54
14	H00027	银河娱乐	7,218	373,270.01	2.84
15	H01928	金沙中国有 限公司	12,400	337,391.80	2.57
16	H09633	农夫山泉	8,666	280,860.87	2.14
17	H01458	周黑鸭	33,500	259,513.27	1.98
18	H00880	澳博控股	35,000	246,961.34	1.88
19	601888	中国中免	800	240,080.00	1.83
20	000858	五粮液	800	238,312.00	1.81
21	H00669	创科实业	2,000	225,660.10	1.72
22	H09928	时代邻里	22,000	121,916.36	0.93
23	H02331	李宁	1,500	118,321.78	0.90
24	H02013	微盟集团	7,000	99,716.47	0.76
25	H03331	维达国际	5,000	99,433.56	0.76
26	H01211	比亚迪股份	500	96,604.49	0.74
27	600809	山西汾酒	200	89,600.00	0.68
28	H00388	香港交易所	23	8,856.99	0.07
29	603020	爱普股份	100	1,867.00	0.01
30	H00667	中国东方教 育	15	152.27	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	H06169	宇华教育	786,373.85	6.88
2	H00762	中国联通	762,972.20	6.67
3	H03606	福耀玻璃	738,268.75	6.45
4	H00027	银河娱乐	708,763.62	6.20
5	H01999	敏华控股	687,373.03	6.01
6	H00941	中国移动	670,728.47	5.86
7	H02269	药明生物	661,076.70	5.78
8	H03690	美团-W	639,630.62	5.59
9	H02319	蒙牛乳业	591,682.79	5.17
10	H06690	海尔智家	583,588.47	5.10
11	H09633	农夫山泉	524,905.06	4.59
12	H00168	青岛啤酒股份	497,747.57	4.35
13	H02020	安踏体育	448,554.43	3.92
14	H02382	舜宇光学科技	442,642.14	3.87
15	H06862	海底捞	433,171.64	3.79
16	H00880	澳博控股	431,678.60	3.77
17	H01928	金沙中国有限公司	396,216.85	3.46
18	H02331	李宁	395,518.34	3.46
19	000858	五粮液	393,385.00	3.44
20	601888	中国中免	375,597.00	3.28
21	H00388	香港交易所	365,081.42	3.19
22	H01801	信达生物	296,098.19	2.59
23	H00700	腾讯控股	291,331.93	2.55
24	H01211	比亚迪股份	280,200.37	2.45
25	H01458	周黑鸭	267,225.28	2.34
26	H06185	康希诺生物-B	249,683.93	2.18
27	H00175	吉利汽车	249,110.54	2.18
28	H00669	创科实业	239,591.14	2.09
29	H00291	华润啤酒	236,156.10	2.06

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	H00762	中国联通	926,122.99	8.10
2	H00941	中国移动	756,433.27	6.61
3	600519	贵州茅台	615,447.00	5.38
4	000333	美的集团	551,611.00	4.82

5	H00168	青岛啤酒股份	523,155.90	4.57
6	H00388	香港交易所	519,119.73	4.54
7	H00027	银河娱乐	495,387.49	4.33
8	H06169	宇华教育	490,554.01	4.29
9	000858	五粮液	462,391.00	4.04
10	H06862	海底捞	457,699.99	4.00
11	H00700	腾讯控股	436,659.99	3.82
12	H00667	中国东方教育	361,936.37	3.16
13	H01093	石药集团	354,172.77	3.10
14	H00175	吉利汽车	338,349.33	2.96
15	H00880	澳博控股	312,491.24	2.73
16	H02331	李宁	291,570.46	2.55
17	688526	科前生物	290,403.35	2.54
18	H06185	康希诺生物-B	287,943.59	2.52
19	H01336	新华保险	283,750.92	2.48
20	000596	古井贡酒	277,064.00	2.42
21	H00966	中国太平	255,438.09	2.23
22	H03690	美团-W	249,955.34	2.19
23	H03606	福耀玻璃	248,410.97	2.17
24	H01691	J S 环球生活	241,618.81	2.11
25	H02382	舜宇光学科技	229,176.37	2.00

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	15,997,316.71
卖出股票收入（成交）总额	14,116,725.44

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	659,218.40	5.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	659,218.40	5.02
----	----	------------	------

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	019640	20 国债 10	3,470	347,000.00	2.64
2	019649	21 国债 01	3,120	312,218.40	2.38

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 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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货无合约。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

7.12.3 报告期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,646.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	3,005.79
4	应收利息	10,544.38
5	应收申购款	22,675.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,872.38

7.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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	352	17,861.51	5,000,175.0	79.53%	1,287,077.4	20.47%

港股通大消费精选股票 A			3		6	
创金合信港股通大消费精选股票 C	656	9,507.66	5,000,175.00	80.17%	1,236,849.43	19.83%
合计	966	12,965.09	10,000,350.03	79.85%	2,523,926.89	20.15%

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	创金合信港股通大消费精选股票 A	5,554.11	0.09%
	创金合信港股通大消费精选股票 C	88,545.14	1.42%
	合计	94,099.25	0.75%

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	创金合信港股通大消费精选股票 A	0~10
	创金合信港股通大消费精选股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信港股通大消费精选股票 A	0
	创金合信港股通大消费精选股票 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,350.03	79.85	10,000,350.03	79.85	36 个月
基金管理人高级管理人员	1,778.64	0.01	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,128.67	79.86	10,000,350.03	79.85	36 个月

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信港股通大消费精选股票 A	创金合信港股通大消费精选股票 C
基金合同生效日(2020 年 8 月 27 日)基金份额总额	5,590,494.80	5,450,680.00
本报告期期初基金份额总额	5,524,182.39	5,568,905.39
本报告期基金总申购份额	2,352,873.51	3,433,344.30
减：报告期基金总赎回份额	1,589,803.41	2,765,225.26
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	6,287,252.49	6,237,024.43

§ 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

创金合信基金管理有限公司监事杨健先生辞任监事职务，2021 年 3 月 3 日，经创金合信基金管理有限公司股东会 2021 年第一次会议审议通过，选举宋明华先生担任公司监事。

本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门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，本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未发生受到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	25,155,122.86	83.53%	20,124.04	84.93%	-
中信建投证券	2	4,958,919.29	16.47%	3,569.57	15.07%	-

注：交易单元的选择标准和程序：

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

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

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

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

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

本基金报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	1,853,542.30	100.00%	700,000.00	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	创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金 2020 年第四季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-22
2	创金合信基金管理有限公司关于创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金 2020 年岁末及 2021 年非港股通交易日暂停申购及赎回业务的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-06
3	创金合信基金管理有限公司关于修订公司旗下部分公开募集证券投资基金基金合同有关条款的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-24
4	创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
5	创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-22
6	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-17

§ 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过 20% 的时间区间					
机构	1	20210101 - 20210630	10,000,350.03	0.00	0.00	10,000,350.03	79.85%

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

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、《创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金基金合同》;
- 2、《创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金托管协议》;
- 3、创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金 2021 年中期报告原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路 115 号投行大厦 15 楼

12.3 查阅方式

www.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日