

# 创金合信瑞裕混合型证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 2 月 4 日（基金合同生效日）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.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	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.....	14
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.....	39
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	44
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.....	44
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.....	44

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12	投资组合报告附注	44
§8	基金份额持有人信息	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§9	开放式基金份额变动	46
§10	重大事件揭示	46
10.1	基金份额持有人大会决议	46
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	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4	基金投资策略的改变	47
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8	其他重大事件	48
§11	影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	49
§12	备查文件目录	49
12.1	备查文件目录	49
12.2	存放地点	50
12.3	查阅方式	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信瑞裕混合型证券投资基金	
基金简称	创金合信瑞裕混合	
基金主代码	011444	
交易代码	011444	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 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	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	200,028,919.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信瑞裕混合 A	创金合信瑞裕混合 C
下属分级基金的交易代码	011444	011445
报告期末下属分级基金的份 额总额	200,019,179.28 份	9,740.00 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×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，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋
		陆志俊

	联系电话	0755-23838944	95559
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-868-0666	95559
传真		0755-25832571	021-62701216
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）	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		518000	200336
法定代表人		刘学民	任德奇

## 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、创金合信瑞裕混合 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 2 月 4 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,117,268.39
本期利润	-17,320,380.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0866
本期加权平均净值利润率	-9.55%
本期基金份额净值增长率	-8.66%

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	-17,319,790.95
期末可供分配基金份额利润	-0.0866
期末基金资产净值	182,699,388.33
期末基金份额净值	0.9134
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	-8.66%

## 2、创金合信瑞裕混合 C

3.1.1 期间数据和指标	2021年2月4日-2021年6月30日
本期已实现收益	1,179.91
本期利润	-12,660.17
加权平均基金份额本期利润	-0.1540
本期加权平均净值利润率	-16.95%
本期基金份额净值增长率	-8.83%
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	-860.16
期末可供分配基金份额利润	-0.0883
期末基金资产净值	8,879.84
期末基金份额净值	0.9117
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	-8.83%

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 2021 年 2 月 4 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

创金合信瑞裕混合 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	-0.16%	0.75%	-1.54%	0.56%	1.38%	0.19%
过去三个月	1.52%	0.97%	2.50%	0.68%	-0.98%	0.29%
自基金合同 生效起至今	-8.66%	1.24%	-3.12%	0.90%	-5.54%	0.34%

创金合信瑞裕混合 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	-0.22%	0.75%	-1.54%	0.56%	1.32%	0.19%
过去三个月	1.40%	0.97%	2.50%	0.68%	-1.10%	0.29%
自基金合同 生效起至今	-8.83%	1.24%	-3.12%	0.90%	-5.71%	0.34%

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







注：1、本基金合同于 2021 年 2 月 4 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。

3、自 2021 年 6 月 30 日起，本基金的业绩比较基准由原来的“沪深 300 指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%”变更为“沪深 300 指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率×10%+中债综合指数收益率×30%”。上述事项已于 2021 年 7 月 2 日在指定媒体上公告。

## § 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		
何媛	本基金基金经理	2021 年 2 月 18 日	-	6	何媛女士，中国国籍，新加坡国立大学应用经济学硕士研究生，2014 年 10 月加入九泰基金管理有限公司产业投资部任投资经理，2015 年 11 月加入天弘基金管理有限公司资本运作部任总经理助理，2017 年 8 月加入金鹰基金管理有限公司专户投资部任投资总监，2018 年 9 月加入信达澳银基金管理有限公司权益投资总部任副总监，2020 年 3 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任资管投资部副总监，现任 MOMFOF 投资研究部副总监、定增新股策略部副总监、基金经理。
王妍	本基金基金经理	2021 年 2 月 4 日	-	11	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

今年上半年从国内宏观经济来看，随着去年整体经济恢复的情况较好，市场对流动性收紧的预期持续，导致了一季度的市场大幅回调。随着一季度实体经济的增速见顶，二季度的经济呈现出 PPI 逐步走高而 CPI 相对稳定的态势，上游原材料涨价是推高 PPI 的主要原因，消费端和服务端的贡献较弱。从国际环境来看，美国作为主要的世界经济体，疫情得到有效控制后，经济复苏成为主基调，伴随着经济的复苏和货币政策尚未收紧，通胀预期有所抬头，就业率的恢复将会成为未来关注的主要指标，美国就业率的水平和美债的收益水平会成为今年的扰动因素。市场对于美国的流动性收紧有持续的预期。

本基金在报告期内综合国际国内宏观环境，今年的股票市场相较于去年结构性的板块性的差异将会加大，本基金的投资策略为中大盘价值的投资策略，根据市场环境的变化做适度微调，但不会在整体策略上做较大的偏移。因此今年上半年的行业配置上收到食品饮料、家电等行业的拖累较大，随着高成长行业的估值持续扩张，下半年中大盘价值的板块有望实现均值回归，所以本基金依然会维持在中大盘价值的配置，并根据行业景气度的变化和个股的变化，做适当微调。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信瑞裕混合 A 基金份额净值为 0.9134 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.66%，同期业绩比较基准收益率为-3.12%；截至本报告期末创金合信瑞裕混合 C 基金份额净值为 0.9117 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.83%，同期业绩比较基准收益率为-3.12%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着一季度实体经济的增速见顶，未来经济增长持续动力的角度来看，国内的经济主要推动力可能会出现结构上的转变。过去依靠庞大的国内市场，消费是推动经济发展的重要部分。随着人口红利的消失，消费对于国内经济的推动力会边际下降，反而需要依靠制造业来助力经济的转型升级。因此，从实体经济上看，受益于制造业崛起和高科技行业国产化替代的产业升级的趋势，电子、光伏、网络安全等行业会长期收益，医药、消费等行业持续看好消费升级和改善的板块。展望下半年，货币政策将会维持稳定并根据实体经济的情况进行适度调节，全面降准的信号释放由此带来的下半年流动性会维持稳定并且边际宽松的态势。因此，从国内的金融环境上看，下半年对资产市场将会偏友好。

从国际经济环境上看，美国和欧洲的经济正在快速恢复，并且在部分行业可能朝向经济过热的态势转变，因此美国和欧洲的货币政策依然存在收紧的预期。美国和欧洲的经济恢复，也推高了全球对于大宗商品、上游原材料的需求，受到疫情的影响，供给端却恢复较慢，因此大宗商品和上游原材料的价格预计会维持在高位震荡。

综合来看，全球经济快速复苏并且会朝着过热的方向转变，国内作为疫情后率先复苏的经济体，下半年经济将会承受相对较大的增长压力，因此下半年国际的金融环境将会有持续偏紧的预期，国内的金融政策反而相对边际宽松。从行业板块上看，下半年将主要关注长久期的资产，关注产业链长期趋势向好，并且产业链格局持续优化的行业和板块，回避相对估值过高但增速低于预期，以及过分依赖通胀的品种。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对创金合信瑞裕混合型证券投资基金的托管过程中,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,不存在任何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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,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：创金合信瑞裕混合型证券投资基金

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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	16,532,971.24
结算备付金		29,927.36
存出保证金		56,021.07
交易性金融资产	6.4.7.2	165,936,975.82
其中：股票投资		165,936,975.82
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		386,025.51
应收利息	6.4.7.5	1,354.08
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		182,943,275.08
负债和所有者权益		本期末 2021 年 6 月 30 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		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		118,395.21
应付托管费		14,799.41
应付销售服务费		13.67
应付交易费用	6.4.7.7	29,408.47
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	72,390.15
负债合计		235,006.91
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	200,028,919.28
未分配利润	6.4.7.10	-17,320,651.11

所有者权益合计		182,708,268.17
负债和所有者权益总计		182,943,275.08

注：1. 报告截止日 2021 年 6 月 30 日，创金合信瑞裕混合 A 份额净值 0.9134 元，基金份额总额 200,019,179.28 份；创金合信瑞裕混合 C 份额净值 0.9117 元，基金份额总额 9,740.00 份；总份额合计 200,028,919.28 份；

2. 本财务报表的实际报告期间为 2021 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 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：创金合信瑞裕混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		-16,383,313.77
1. 利息收入		42,805.68
其中：存款利息收入	6.4.7.11	42,805.68
债券利息收入		0.00
资产支持证券利息收入		0.00
买入返售金融资产收入		0.00
其他利息收入		0.00
证券出借利息收入		0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,025,322.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,557,088.75
基金投资收益		0.00
债券投资收益	6.4.7.13	0.00
资产支持证券投资收益		0.00

贵金属投资收益		0.00
衍生工具收益	6.4.7.14	0.00
股利收益	6.4.7.15	1,468,234.17
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-22,451,489.07
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	46.70
减：二、费用		949,727.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	583,403.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	72,925.45
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	121.96
4. 交易费用	6.4.7.18	219,492.03
5. 利息支出		0.00
其中：卖出回购金融资产支出		0.00
6. 税金及附加		0.00
7. 其他费用	6.4.7.19	73,783.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-17,333,040.77
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-17,333,040.77

注：本财务报表的实际报告期间为 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 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：创金合信瑞裕混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）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)	200,132,488.56	-	200,132,488.56
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	-17,333,040.77	-17,333,040.77
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)	-103,569.28	12,389.66	-91,179.62
其中: 1. 基金申购款	8,591.79	-892.71	7,699.08
2. 基金赎回款	-112,161.07	13,282.37	-98,878.70
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)	200,028,919.28	-17,320,651.11	182,708,268.17

注: 本财务报表的实际报告期间为 2021 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 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\_\_\_\_                    \_\_\_\_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

创金合信瑞裕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]2352 号文《关于准予创金合信瑞裕混合型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《创金合信瑞裕混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2021 年 2 月 4 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 200,132,488.56 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，基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。

本基金于 2021 年 2 月 2 日至 2021 年 2 月 2 日募集，募集期间净认购资金人民币 200,132,488.56 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 0 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 200,132,488.56 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 2100102 号验资报告。

根据《创金合信瑞裕混合型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、前端申购费，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。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、《创金合信瑞裕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《创金合信瑞裕混合型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、存托凭证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、同业存单、货币市场工具、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金股票投资占基金资产的比例为 50% - 95%；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：沪深 300 指数收益率  $\times$  70% + 中债综合指数收益率  $\times$  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》、《创金合信瑞裕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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 2 月 4 日(基金合同生效日)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 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 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自 2021 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间。

#### 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和债券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认列。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认列，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及由基金管理人缴纳的增值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、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；2、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；基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；3、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；4、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；5、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；6、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和债券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。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,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》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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	16,532,971.24
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	16,532,971.24

### 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	188,388,464.89	165,936,975.82	-22,451,489.07
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	188,388,464.89	165,936,975.82	-22,451,489.07

### 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	1,315.38
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	13.50
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	-
应收出借证券利息	-
其他	25.20
合计	1,354.08

**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	29,408.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	29,408.47

**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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	72,390.15
合计	72,390.15

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

创金合信瑞裕混合 A	
项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30

	日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	200,027,738.56	200,027,738.56
本期申购	8,591.79	8,591.79
本期赎回（以“-”号填列）	-17,151.07	-17,151.07
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	200,019,179.28	200,019,179.28

创金合信瑞裕混合 C		
项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	104,750.00	104,750.00
本期申购	0.00	0.00
本期赎回（以“-”号填列）	-95,010.00	-95,010.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	9,740.00	9,740.00

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 2021 年 2 月 2 日至 2021 年 2 月 2 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 200,132,488.56 元，其中 A 类基金募集有效净认购资金为人民币 200,027,738.56 元，C 类基金募集有效净认购资金为人民币 104,750.00 元。根据《创金合信瑞裕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人民币 0.00 元，在本基金成立后，折算为 0.00 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

单位：人民币元

创金合信瑞裕混合 A			
项目	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	5,117,268.39	-22,437,648.99	-17,320,380.60
本期基金份额交易产生的变动数	-132.00	721.65	589.65
其中：基金申购款	1.74	-894.45	-892.71
基金赎回款	-133.74	1,616.10	1,482.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,117,136.39	-22,436,927.34	-17,319,790.95

创金合信瑞裕混合 C			
项目	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	1,179.91	-13,840.08	-12,660.17

本期基金份额交易产生的变动数	-948.02	12,748.03	11,800.01
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-948.02	12,748.03	11,800.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	231.89	-1,092.05	-860.16

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	39,354.31
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	3,166.85
其他	284.52
合计	42,805.68

#### 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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	24,214,005.30
减：卖出股票成本总额	19,656,916.55
买卖股票差价收入	4,557,088.75

#### 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

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 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
----	---

股票投资产生的股利收益	1,468,234.17
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,468,234.17

#### 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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-22,451,489.07
——股票投资	-22,451,489.07
——债券投资	-
——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	-22,451,489.07

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	35.56
转换费收入	11.14
合计	46.70

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	219,492.03
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	219,492.03

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	23,537.64
信息披露费	48,852.51
证券出借违约金	-
汇划手续费	993.73
其他费用	400.00
合计	73,783.88

#### 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
交通银行股份有限公司	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 2 月 4 日（基金合同生效日）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	190,920,268.07	84.69%

#### 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 2 月 4 日（基金合同生效日）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	138,210.02	84.64%	29,408.47	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 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	583,403.68
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.8% / 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 2 月 4 日（基金合同生效
----	--------------------------

	日)至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	72,925.45

注：支付基金托管人交通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 2021 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信瑞裕混合 A	创金合信瑞裕混合 C	合计
创金合信直销	-	121.96	121.96
合计	-	121.96	121.96

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

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。

##### 6.4.10.5.2 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

本报告期末无除基金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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	16,532,971.24	39,354.31

注：本基金的银行存款由基金托管人交通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**

本基金本报告期末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
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	网下申购限售	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688269	凯立新材	2021年6月1日	2021年12月9日	科创板打新限售	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
688613	奥精医疗	2021年5月13日	2021年11月22日	科创板打新限售	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	-
688315	诺禾致源	2021年4月2日	2021年10月13日	科创板打新限售	12.76	39.20	3,414	43,562.64	133,828.80	-
688662	富信科技	2021年3月25日	2021年10月8日	科创板打新限售	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-
688113	联测科技	2021年	2021年	科创板	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	-

		4月26日	11月8日	打新限售						
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	1,488	57,808.80	57,808.80	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	1,999	43,898.04	43,898.04	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	创业板打新限售	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	创业板打新限售	12.54	27.89	581	7,285.74	16,204.09	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	创业板打新限售	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	创业板打新限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	创业板打新限售	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-

301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	创业板 打新限 售	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	创业板 打新限 售	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	创业板 打新限 售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	创业板 打新限 售	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	创业板 打新限 售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	创业板 打新限 售	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

#### 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交通银行，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

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末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

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。

#### 6.4.13.3.1 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 3.39%。

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 176,661,755.73 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	16,532,971.24	-	-	-	16,532,971.24
结算备付金	29,927.36	-	-	-	29,927.36
存出保证金	56,021.07	-	-	-	56,021.07
交易性金融资产	-	-	-	165,936,975.82	165,936,975.82
应收证券清算款	-	-	-	386,025.51	386,025.51
应收利息	-	-	-	1,354.08	1,354.08
资产总计	16,618,919.67	-	-	166,324,355.41	182,943,275.08
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	118,395.21	118,395.21
应付托管费	-	-	-	14,799.41	14,799.41
应付销售服务费	-	-	-	13.67	13.67
应付交易费用	-	-	-	29,408.47	29,408.47
其他负债	-	-	-	72,390.15	72,390.15
负债总计	-	-	-	235,006.91	235,006.91

利率敏感度缺口	16,618,919.67	-	-	166,089,348.50	182,708,268.17
---------	---------------	---	---	----------------	----------------

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。

#### 6.4.13.4.2 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 2021 年 6 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	165,936,975.82	90.82
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	165,936,975.82	90.82

##### 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）
	1.业绩比较基准上升 5%	9,430,894.46
2.业绩比较基准下降 5%	-9,430,894.46	

#### 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 159,742,758.98 元，属于第二层次的余额为 6,194,216.84 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。

##### (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	165,936,975.82	90.70
	其中：股票	165,936,975.82	90.70
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	16,562,898.60	9.05
7	其他资产	443,400.66	0.24
8	合计	182,943,275.08	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	-	-
B	采矿业	8,301,856.00	4.54
C	制造业	118,440,637.78	64.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	2.82
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	17,939.46	0.01
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	4,036,030.40	2.21
J	金融业	16,719,154.34	9.15
K	房地产业	9,995,438.00	5.47
L	租赁和商务服务业	3,121,040.00	1.71
M	科学研究和技术服务业	133,828.80	0.07
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	165,936,975.82	90.82

### 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	600519	贵州茅台	8,100	16,659,270.00	9.12
2	601877	正泰电器	441,900	14,750,622.00	8.07
3	000333	美的集团	192,800	13,760,136.00	7.53
4	601318	中国平安	207,800	13,357,384.00	7.31
5	600276	恒瑞医药	189,720	12,895,268.40	7.06
6	000002	万科A	419,800	9,995,438.00	5.47
7	601012	隆基股份	112,140	9,962,517.60	5.45
8	000858	五粮液	32,800	9,770,792.00	5.35
9	601088	中国神华	425,300	8,301,856.00	4.54
10	300124	汇川技术	101,100	7,507,686.00	4.11
11	601100	恒立液压	85,840	7,375,372.80	4.04
12	600585	海螺水泥	161,400	6,625,470.00	3.63
13	002271	东方雨虹	111,200	6,151,584.00	3.37
14	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	2.82
15	002410	广联达	59,000	4,023,800.00	2.20
16	002415	海康威视	60,200	3,882,900.00	2.13
17	600036	招商银行	61,396	3,327,049.24	1.82
18	000651	格力电器	62,200	3,240,620.00	1.77
19	601888	中国中免	10,400	3,121,040.00	1.71
20	600031	三一重工	103,000	2,994,210.00	1.64
21	600887	伊利股份	53,000	1,951,990.00	1.07
22	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.11
23	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.09
24	688315	诺禾致源	3,414	133,828.80	0.07
25	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.04
26	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.04
27	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.04
28	688499	利元亨	1,488	57,808.80	0.03
29	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
30	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02

31	688087	英科再生	1,999	43,898.04	0.02
32	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
33	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.02
34	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
35	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
36	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
37	301009	可靠股份	581	16,204.09	0.01
38	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
39	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
40	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
41	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
42	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
43	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
44	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
45	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
46	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
47	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
48	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	20,376,328.75	11.15
2	000333	美的集团	18,522,486.00	10.14
3	600276	恒瑞医药	17,123,340.96	9.37
4	601318	中国平安	16,267,142.00	8.90
5	601877	正泰电器	15,446,644.00	8.45
6	000002	万科A	12,321,283.00	6.74
7	000858	五粮液	11,164,708.00	6.11
8	601100	恒立液压	10,111,137.69	5.53
9	601012	隆基股份	9,619,780.00	5.27
10	601088	中国神华	8,945,698.00	4.90
11	600585	海螺水泥	8,502,229.00	4.65
12	300124	汇川技术	7,285,945.39	3.99
13	002271	东方雨虹	6,302,915.00	3.45
14	601888	中国中免	5,576,796.00	3.05
15	600036	招商银行	5,467,035.16	2.99
16	002706	良信股份	4,939,248.64	2.70
17	002410	广联达	4,901,009.00	2.68
18	600887	伊利股份	4,749,222.00	2.60

19	600031	三一重工	4,393,420.00	2.40
20	002415	海康威视	3,777,426.00	2.07

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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002706	良信股份	4,193,505.60	2.30
2	600887	伊利股份	1,997,998.00	1.09
3	600036	招商银行	1,997,603.00	1.09
4	603259	药明康德	1,869,336.00	1.02
5	600905	三峡能源	1,757,676.00	0.96
6	601088	中国神华	1,649,392.00	0.90
7	601888	中国中免	1,587,023.00	0.87
8	600519	贵州茅台	1,301,053.00	0.71
9	688131	皓元医药	348,585.60	0.19
10	688690	纳微科技	312,960.73	0.17
11	688076	诺泰生物	279,009.36	0.15
12	688538	和辉光电	213,771.05	0.12
13	688345	博力威	194,882.25	0.11
14	688601	力芯微	184,828.00	0.10
15	688575	亚辉龙	184,109.50	0.10
16	688621	阳光诺和	183,376.29	0.10
17	688606	奥泰生物	179,464.38	0.10
18	688383	新益昌	171,732.10	0.09
19	688276	百克生物	168,335.14	0.09
20	301015	百洋医药	164,834.40	0.09

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	208,045,381.44
卖出股票收入（成交）总额	24,214,005.30

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### **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	56,021.07
2	应收证券清算款	386,025.51
3	应收股利	-
4	应收利息	1,354.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	443,400.66

### 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。

## § 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
创金合信瑞裕混合A	176	1,136,472.61	-	-	200,019,179.28	100.00%
创金合信瑞裕混合C	55	177.09	-	-	9,740.00	100.00%
合计	205	975,750.83	-	-	200,028,919.28	100.00%

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	创金合信瑞裕混合 A	12,830.07	0.01%
	创金合信瑞裕混合 C	940.00	9.65%
	合计	13,770.07	0.01%

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	创金合信瑞裕混合 A	0~10
	创金合信瑞裕混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信瑞裕混合 A	0
	创金合信瑞裕混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信瑞裕混合 A	创金合信瑞裕混合 C
基金合同生效日(2021年2月4日)基金份额总额	200,027,738.56	104,750.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	8,591.79	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	17,151.07	95,010.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	200,019,179.28	9,740.00

## § 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，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于2021年6月30日表决通过了《关于修改创金合信瑞裕混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

## 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	190,920,268.07	84.69%	138,210.02	84.64%	-
海通证券	2	34,507,089.82	15.31%	25,084.74	15.36%	-

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	
	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	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

### 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	创金合信瑞裕混合型证券投资基金基金份额发售公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-30
2	创金合信瑞裕混合型证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-05
3	创金合信瑞裕混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-18
4	创金合信瑞裕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、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-20
5	创金合信基金管理有限公司关于旗下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	2021-03-04
6	创金合信基金管理有限公司关于以通讯方式召开创金合信瑞裕混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-25
7	创金合信基金管理有限公司关于以通讯方式召开创金合信瑞裕混合型证券投资基金基金份额	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子	2021-05-26

	持有人大会的第一次提示性公告	披露网站	
8	创金合信基金管理有限公司关于以通讯方式召开创金合信瑞裕混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-27

## § 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
个人	1	20210204 - 20210630	99,999,000.00	0.00	0.00	99,999,000.00	49.99%
个人	2	20210204 - 20210630	99,999,000.00	0.00	0.00	99,999,000.00	49.99%

#### 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、《创金合信瑞裕混合型证券投资基金基金合同》;
- 2、《创金合信瑞裕混合型证券投资基金托管协议》;

3、创金合信瑞裕混合型证券投资基金 2021 年中期报告原文。

## 12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15 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

2021 年 8 月 30 日