

# 创金合信恒利超短债债券型证券投资 基金 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	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.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	40
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	40
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	42
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.....	42
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.....	42

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
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.....	49
12.3 查阅方式.....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信恒利超短债债券型证券投资基金		
基金简称	创金合信恒利超短债债券		
基金主代码	006076		
交易代码	006076		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2018 年 8 月 2 日		
基金管理人	创金合信基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	2,516,223,379.54 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	创金合信恒利超短债债券 A	创金合信恒利超短债债券 C	创金合信恒利超短债债券 E
下属分级基金的交易代码	006076	006077	008959
报告期末下属分级基金的份额总额	2,122,631,544.52 份	346,246,720.81 份	47,345,114.21 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将投资组合的平均剩余期限控制在 270 天以内，力争在保持投资组合较高流动性的前提下，获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	为了保持本基金明显的收益风险特征，本基金投资组合的平均剩余期限将控制在 270 天以内，主要投资超短债主题证券，力争在保持投资组合较高流动性的前提下，获取超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中证短融 AAA 指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，长期来看，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田
	联系电话	0755-82820166
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com
客户服务电话	400-868-0666	95588

传真	0755-25832571	010-66105798
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）	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道5035华润前海大厦A座36-38楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	518052	100140
法定代表人	钱龙海	陈四清

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道5035华润前海大厦A座36-38楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

#### 1、创金合信恒利超短债债券 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	9,223,823.03
本期利润	9,404,691.63
加权平均基金份额本期利润	0.0142
本期加权平均净值利润率	1.23%
本期基金份额净值增长率	1.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	249,850,188.37
期末可供分配基金份额利润	0.1177
期末基金资产净值	2,392,280,669.48

期末基金份额净值	1.1270
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	15.70%

## 2、创金合信恒利超短债债券 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,012,412.86
本期利润	4,487,570.56
加权平均基金份额本期利润	0.0151
本期加权平均净值利润率	1.33%
本期基金份额净值增长率	1.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	35,388,770.61
期末可供分配基金份额利润	0.1022
期末基金资产净值	384,843,192.19
期末基金份额净值	1.1115
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	14.15%

## 3、创金合信恒利超短债债券 E

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	975,160.60
本期利润	997,341.94
加权平均基金份额本期利润	0.0164
本期加权平均净值利润率	1.44%
本期基金份额净值增长率	1.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	5,223,577.61
期末可供分配基金份额利润	0.1103
期末基金资产净值	53,022,562.59
期末基金份额净值	1.1199
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	7.55%

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、本基金从 2020 年 2 月 4 日起新增 E 类份额，E 类份额自 2020 年 2 月 4 日起存续。

### 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

创金合信恒利超短债债券 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	0.13%	0.01%	0.18%	0.01%	-0.05%	0.00%
过去三个月	0.83%	0.01%	0.78%	0.01%	0.05%	0.00%
过去六个月	1.54%	0.01%	1.54%	0.01%	0.00%	0.00%
过去一年	3.59%	0.02%	3.10%	0.01%	0.49%	0.01%
过去三年	10.61%	0.02%	9.03%	0.02%	1.58%	0.00%
自基金合同生效起至今	15.70%	0.02%	12.27%	0.02%	3.43%	0.00%

创金合信恒利超短债债券 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	0.11%	0.01%	0.18%	0.01%	-0.07%	0.00%
过去三个月	0.75%	0.01%	0.78%	0.01%	-0.03%	0.00%
过去六个月	1.37%	0.01%	1.54%	0.01%	-0.17%	0.00%
过去一年	3.24%	0.02%	3.10%	0.01%	0.14%	0.01%
过去三年	9.44%	0.02%	9.03%	0.02%	0.41%	0.00%
自基金合同生效起至今	14.15%	0.02%	12.27%	0.02%	1.88%	0.00%

创金合信恒利超短债债券 E

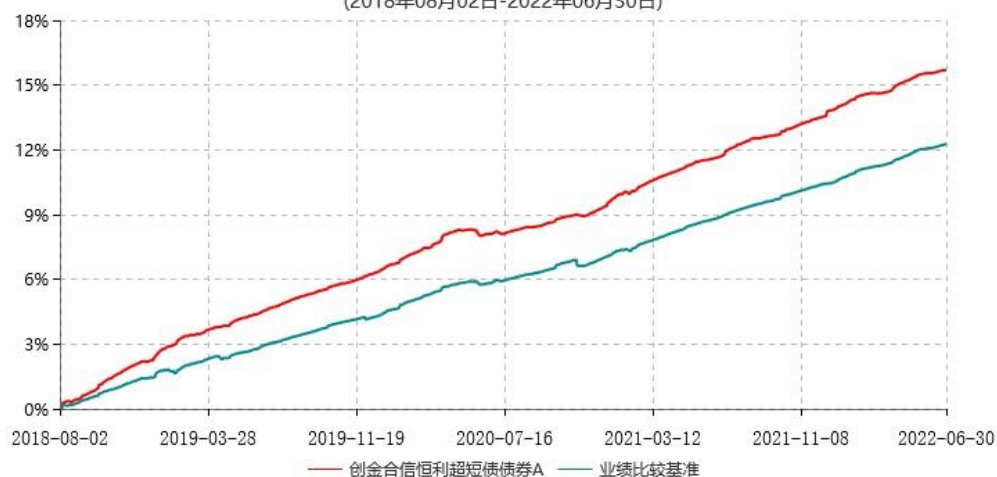
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.13%	0.01%	0.18%	0.01%	-0.05%	0.00%
过去三个月	0.81%	0.01%	0.78%	0.01%	0.03%	0.00%
过去六个月	1.48%	0.01%	1.54%	0.01%	-0.06%	0.00%
过去一年	3.49%	0.02%	3.10%	0.01%	0.39%	0.01%
自基金合同生效起至今	7.55%	0.02%	7.11%	0.02%	0.44%	0.00%

### 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



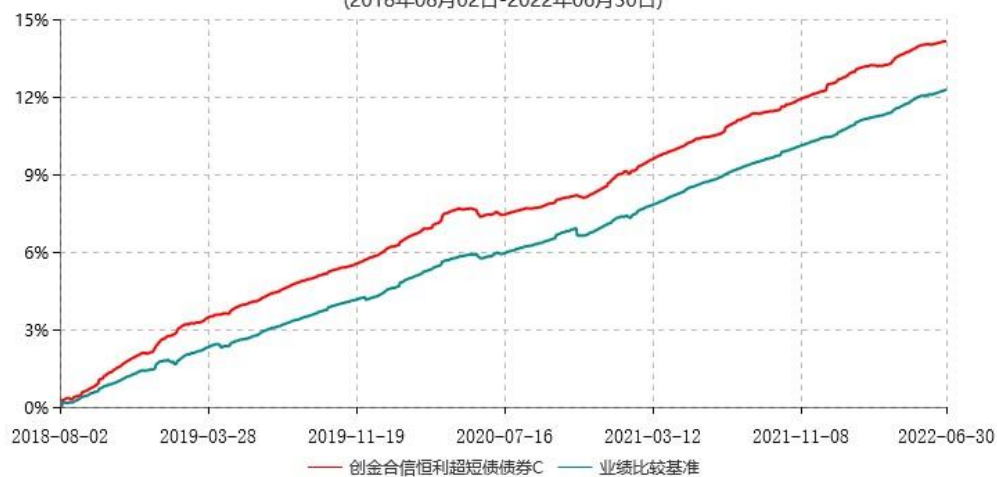
创金合信恒利超短债债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年08月02日-2022年06月30日)



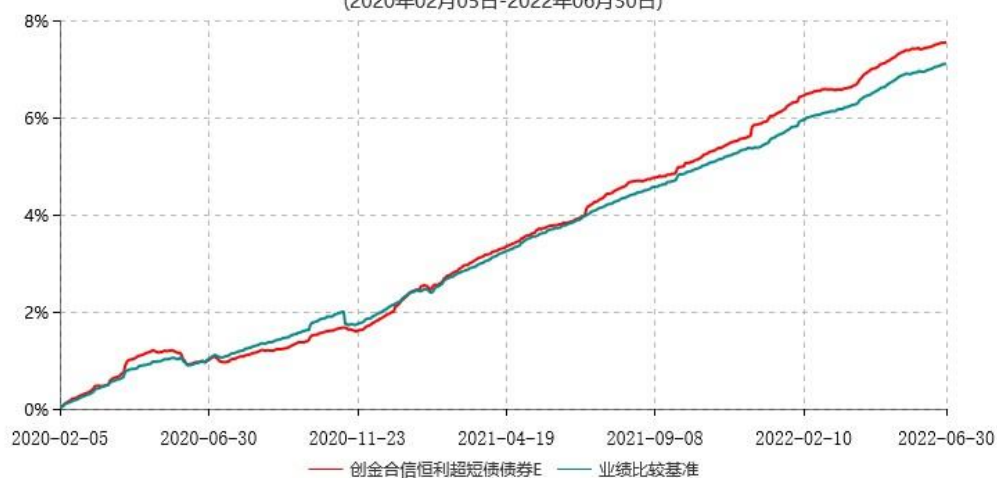
创金合信恒利超短债债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年08月02日-2022年06月30日)



创金合信恒利超短债债券E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02月05日-2022年06月30日)



## § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于 2014 年 7 月 3 日获得中国证监会批复，2014 年 7 月 9 日正式注册设立，注册地为深圳市。公司注册资本 2.33 亿元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例 51.0729%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例 21.8884%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%。

公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吕沂洋	本基金基金经理	2022 年 3 月 7 日	-	6	吕沂洋先生，中国国籍，中山大学金融学硕士，2015 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、固定收益部投资顾问，现任基金经理。
谢创	本基金基金经理	2018 年 9 月 11 日	-	6	谢创先生，中国国籍，西南财经大学金融工程硕士，2015 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任交易部交易员，固定收益部基金经理助理，现任基金经理。
王一兵	本基金基金经理、固定收益部总监（已离任）	2018 年 8 月 2 日	2022 年 3 月 7 日	18	王一兵先生，中国国籍，四川大学 MBA。曾任职于四川和正期货公司，2009 年 3 月加入第一创业证券股份有限公司，历任固定收益部高级交易经理、资产管理部投资经理、固定收益部投资副总监。2014 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司，现任固定收益部总监、基金经理。
郑振源	本基金基金经理	2018 年 8 月 2 日	-	12	郑振源先生，中国国籍，中国人民银行研究生部经济学硕士。2009 年 7 月加入第一创业证券研究所，担任宏观债券研究员。2012 年 7 月加入第一创业证券资产管理部，先后担任宏观债券研究员、投资主办等职务。2014 年 8 月加入创金

					合信基金管理有限公司，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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

2022 年上半年，债市多空因素交织；疫情是重要的宏观变量与超预期因素；尤其上海疫情，对国内经济形成较大的负面冲击。各地房地产政策趋于放松，销售有所提升但复苏斜率不高；通胀总体低位可控；防疫政策有所边际放松，对于消费有所提振但作用尚待观察；外部方面，海外通胀高企，美联储处于加息周期；货币政策方面，央行基于应对疫情、支持地方债发行等因素，采用包括降息降准等措施，维持流动性整体偏宽松。债市方面，由于宽松的资金面，上半年尤其是二季度短期债券利率下行较大，信用利差有所压缩；由于市场对于基本面复苏情况的不确定与分歧，长端在 6 月底前整体维持震荡。

上半年，本产品坚持超短债基金的定位，通过将产品平均剩余期限维持在中性水平，严格控制产品回撤。作为超短债基金，产品主要投资剩余期限在 270 天内的高评级短债，以把握此期限短债的骑乘收益；在今年上半年中，产品久期总体久期保持在中性水平，在控制回撤的前提下把握了短端债券收益率下行的机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信恒利超短债债券 A 基金份额净值为 1.1270 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.54%，同期业绩比较基准收益率为 1.54%；截至本报告期末创金合信恒利超短债债券 C 基金份额净值为 1.1115 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.37%，同期业绩比较基准收益率为 1.54%；截至本报告期末创金合信恒利超短债债券 E 基金份额净值为 1.1199 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.48%，同期业绩比较基准收益率为 1.54%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，全球经济增长放缓、通胀高位运行，地缘政治冲突持续，外部环境更趋复杂严峻，国内经济恢复基础尚需稳固；但经济总体在恢复阶段，最差的阶段可能已过去，随着基建发力、房地产及消费逐步恢复，经济数据可能会逐步回升；通胀预计在可控区间，下半年通胀压力更多来自猪价因素，而非总需求因素，核心 CPI 有望保持稳定；货币政策方面，在 8 月中旬超预期降低政策利率后，央行短期内预计仍会维持偏宽松货币环境。对于债市而言，市场对于资金面边际收紧的担忧有所缓和，可能有助于收益率曲线期限利差的压缩。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金已实施利润分配 72,780,039.05 元，符合合同约定。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在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,本基金的管理人—创金合信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对创金合信基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：创金合信恒利超短债债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,743,685.94	3,052,808.77
结算备付金		365,256.89	11,044.17
存出保证金		8,464.75	3,786.31
交易性金融资产	6.4.7.2	3,036,310,595.37	556,971,392.60
其中：股票投资		-	-

基金投资		-	-
债券投资		3,036,310,595.37	556,971,392.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	50,000,000.00	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		101,679.59	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,974,944.13	3,388,613.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	9,263,112.16
资产总计		3,097,504,626.67	572,690,757.99
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		266,005,202.14	96,513,116.76
应付清算款		-	-
应付赎回款		56,858.66	-
应付管理人报酬		634,820.96	126,018.05
应付托管费		211,606.98	42,005.98
应付销售服务费		124,031.88	78,959.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		176,541.70	41,227.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	149,140.09	249,656.36
负债合计		267,358,202.41	97,050,984.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,516,223,379.54	420,203,509.31
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	313,923,044.72	55,436,264.19
净资产合计		2,830,146,424.26	475,639,773.50
负债和净资产总计		3,097,504,626.67	572,690,757.99

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，创金合信恒利超短债债券 A 份额净值 1.1270 元，基金份额总额 2,122,631,544.52 份；创金合信恒利超短债债券 C 份额净值 1.1115 元，基金份额总额 346,246,720.81 份；创金合信恒利超短债债券 E 份额净值 1.1199 元，基金份额总额 47,345,114.21 份；总份额合计 2,516,223,379.54 份。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信恒利超短债债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		19,130,674.76	9,384,353.26
1.利息收入		45,363.68	7,591,817.12
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,755.09	9,155.16
债券利息收入		-	7,203,020.34
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		31,608.59	379,641.62
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		18,300,788.75	334,859.07
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	18,300,788.75	334,859.07
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	678,207.64	1,276,887.40
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”	6.4.7.17	106,314.69	180,789.67

号填列)			
减：二、营业总支出		4,241,070.63	2,208,213.31
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,696,051.42	625,793.07
2.托管费	6.4.10.2.2	565,350.44	208,597.62
3.销售服务费	6.4.10.2.3	614,959.04	541,168.89
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		1,178,955.96	669,223.73
其中：卖出回购金融资产支出		1,178,955.96	669,223.73
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		58,111.84	21,012.27
8.其他费用	6.4.7.19	127,641.93	142,417.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,889,604.13	7,176,139.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,889,604.13	7,176,139.95
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14,889,604.13	7,176,139.95

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：创金合信恒利超短债债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	420,203,509.31	-	55,436,264.19	475,639,773.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	420,203,509.31	-	55,436,264.19	475,639,773.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,096,019,870.23	-	258,486,780.53	2,354,506,650.76
（一）、综合收益总额	-	-	14,889,604.13	14,889,604.13
（二）、本期基金	2,096,019,870.23	-	316,377,215.45	2,412,397,085.68



份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	2,811,662,789.94	-	416,649,134.53	3,228,311,924.47
2.基金赎回款	-715,642,919.71	-	-100,271,919.08	-815,914,838.79
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-72,780,039.05	-72,780,039.05
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2,516,223,379.54	-	313,923,044.72	2,830,146,424.26
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	377,700,939.93	-	34,062,716.26	411,763,656.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	377,700,939.93	-	34,062,716.26	411,763,656.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,519,000.13	-	6,253,471.60	-265,528.53
（一）、综合收益总额	-	-	7,176,139.95	7,176,139.95
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-6,519,000.13	-	-922,668.35	-7,441,668.48
其中：1.基金申购款	427,517,368.00	-	42,446,510.70	469,963,878.70
2.基金赎回款	-434,036,368.13	-	-43,369,179.05	-477,405,547.18

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	371,181,939.80	-	40,316,187.86	411,498,127.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_苏彦祝\_\_\_\_                      \_\_\_\_奚胜田\_\_\_\_                      \_\_\_\_吉祥\_\_\_\_  
基金管理人负责人              主管会计工作负责人              会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

创金合信恒利超短债债券型证券投资基金(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[2018]893号《关于准予创金合信恒利超短债债券型证券投资基金注册的批复》核准,由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信恒利超短债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币302,877,198.66元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0244号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信恒利超短债债券型证券投资基金基金合同》于2018年8月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为302,928,721.57份基金份额,其中认购资金利息折合51,522.91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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《创金合信恒利超短债债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类和E类基金份额。本基金A类、C类基金份额和E类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额、C类基金份额

和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信恒利超短债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、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(含证券公司短期公司债券)、商业银行次级债、中期票据、短期融资券(含超级短期融资券)、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、资产支持证券、银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：中证短融 AAA 指数收益率。

#### 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》、《创金合信恒利超短债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》。

(a) 新金融工具准则

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

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

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

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

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

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 3,052,808.77 元、11,044.17 元、3,786.31 元、9,263,112.16 元和 3,388,613.98 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收申购款，金额分别为 3,053,124.43 元、11,049.23 元、3,788.18 元和 3,388,613.98 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 556,971,392.60 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 566,234,182.17 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产、应付利息、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和应付交易费用，金额分别为 96,513,116.76 元、44,093.49 元、126,018.05 元、42,005.98 元、78,959.67 元和 23,562.87 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 96,557,210.25 元、126,018.05 元、42,005.98 元、78,959.67 元和 23,562.87 元。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002] 128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统

挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 [2017] 90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	3,743,685.94
等于：本金	3,742,544.64

加：应计利息	1,141.30
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,743,685.94

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	228,505,191.59	2,875,146.65	231,778,529.65	398,191.41
	银行间市场	2,773,131,185.79	29,171,065.72	2,804,532,065.72	2,229,814.21
	合计	3,001,636,377.38	32,046,212.37	3,036,310,595.37	2,628,005.62
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	3,001,636,377.38	32,046,212.37	3,036,310,595.37	2,628,005.62	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	50,000,000.00	-



银行间市场	-	-
合计	50,000,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	49.96
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	49,538.10
其中：交易所市场	-
银行间市场	49,538.10
应付利息	-
预提费用	99,552.03
合计	149,140.09

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信恒利超短债债券 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	154,927,624.84	154,927,624.84
本期申购	2,096,142,312.56	2,096,142,312.56
本期赎回（以“-”号填列）	-128,438,392.88	-128,438,392.88
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	2,122,631,544.52	2,122,631,544.52

创金合信恒利超短债债券 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	212,017,232.51	212,017,232.51
本期申购	362,317,648.50	362,317,648.50
本期赎回（以“-”号填列）	-228,088,160.20	-228,088,160.20
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	346,246,720.81	346,246,720.81

创金合信恒利超短债债券 E		
---------------	--	--

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	53,258,651.96	53,258,651.96
本期申购	353,202,828.88	353,202,828.88
本期赎回（以“-”号填列）	-359,116,366.63	-359,116,366.63
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	47,345,114.21	47,345,114.21

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

创金合信恒利超短债债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	20,350,415.23	1,262,616.57	21,613,031.80
本期利润	9,223,823.03	180,868.60	9,404,691.63
本期基金份额交易产生的变动数	280,674,791.63	18,355,451.42	299,030,243.05
其中：基金申购款	298,795,838.69	19,494,707.60	318,290,546.29
基金赎回款	-18,121,047.06	-1,139,256.18	-19,260,303.24
本期已分配利润	-60,398,841.52	-	-60,398,841.52
本期末	249,850,188.37	19,798,936.59	269,649,124.96

创金合信恒利超短债债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	25,018,762.30	1,718,001.93	26,736,764.23
本期利润	4,012,412.86	475,157.70	4,487,570.56
本期基金份额交易产生的变动数	17,297,460.96	1,014,541.14	18,312,002.10
其中：基金申购款	45,605,596.58	2,999,038.44	48,604,635.02
基金赎回款	-28,308,135.62	-1,984,497.30	-30,292,632.92
本期已分配利润	-10,939,865.51	-	-10,939,865.51
本期末	35,388,770.61	3,207,700.77	38,596,471.38

创金合信恒利超短债债券 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	6,638,358.55	448,109.61	7,086,468.16
本期利润	975,160.60	22,181.34	997,341.94
本期基金份额交易产生的变动数	-948,609.52	-16,420.18	-965,029.70
其中：基金申购款	46,641,520.00	3,112,433.22	49,753,953.22
基金赎回款	-47,590,129.52	-3,128,853.40	-50,718,982.92
本期已分配利润	-1,441,332.02	-	-1,441,332.02
本期末	5,223,577.61	453,870.77	5,677,448.38

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,014.44
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	704.38
其他	36.27
合计	13,755.09

### 6.4.7.10 股票投资收益

#### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期无股票投资收益。

### 6.4.7.11 债券投资收益

#### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	17,716,226.49
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	584,562.26
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	18,300,788.75

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,073,187,015.57
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,059,320,895.66
减：应计利息总额	13,238,560.07
减：交易费用	42,997.58
买卖债券差价收入	584,562.26

### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	678,207.64
——股票投资	-
——债券投资	678,207.64
——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	678,207.64

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	103,969.21
转换费收入	2,345.48
合计	106,314.69

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	30,744.66

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	18,789.90
账户维护费	17,700.00
查询服务费	900.00
合计	127,641.93

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期末及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,696,051.42	625,793.07
其中：支付销售机构的客户维护费	483,842.46	246,039.60

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 0.3% 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 × 0.3% / 当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	565,350.44	208,597.62

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	创金合信恒利超短债债券 A	创金合信恒利超短债债券 C	创金合信恒利超短债债券 E	合计
创金合信直销	-	26,549.86	3,427.35	29,977.21
第一创业证券	-	24,913.60	-	24,913.60

中国工商银行	-	51,943.56	-	51,943.56
合计	-	103,407.02	3,427.35	106,834.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	创金合信恒利超短债债券 A	创金合信恒利超短债债券 C	创金合信恒利超短债债券 E	合计
创金合信直销	-	16,105.60	1,210.22	17,315.82
第一创业证券	-	44,387.03	-	44,387.03
中国工商银行	-	37,893.26	-	37,893.26
合计	-	98,385.89	1,210.22	99,596.11

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 0.35% 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：

日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.35% / 当年天数。

支付基金销售机构的销售服务费按 E 类基金份额前一日基金资产净值 0.35% 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：

日 E 类基金份额销售服务费 = 前一日 E 类基金份额基金资产净值 × 0.35% / 当年天数。

自 2021 年 5 月 26 日起，本基金 E 类份额销售服务费由 0.35% 调整为 0.10%，详情可见于 2021 年 5 月 24 日披露的《创金合信基金管理有限公司关于开展创金合信恒利超短债债券型证券投资基金 E 类份额销售服务费优惠活动的公告》。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	创金合信恒利超短债 债券 A	创金合信恒利超短债 债券 C	创金合信恒利超短债 债券 E
报告期初持有的基金份额	18.76	-	-
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	18.76	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	-	-

项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	创金合信恒利超短债 债券 A	创金合信恒利超短债 债券 C	创金合信恒利超短债 债券 E
报告期初持有的基金份额	18.76	-	-
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	18.76	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	-	-

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

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日



	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	3,743,685.94	13,014.44	3,514,277.04	6,749.12

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业存款利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

金额单位：人民币元

创金合信恒利超短债债券 A

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2022 年 6 月 24 日	-	2022 年 6 月 24 日	0.300	38,073,700.67	22,325,140.85	60,398,841.52	-
合计	-	-	-	0.300	38,073,700.67	22,325,140.85	60,398,841.52	-

创金合信恒利超短债债券 C

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2022 年 6 月 24 日	-	2022 年 6 月 24 日	0.300	9,502,256.44	1,437,609.07	10,939,865.51	-
合计	-	-	-	0.300	9,502,256.44	1,437,609.07	10,939,865.51	-

创金合信恒利超短债债券 E

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2022 年	-	2022 年	0.300	1,104,1	337,176	1,441,3	-

	6月24日		6月24日		55.68	.34	32.02	
合计	-	-	-	0.300	1,104,155.68	337,176.34	1,441,332.02	-

#### 6.4.12 期末（2022 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 296,250,309.23 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
012105164	21 中兵投资 SCP002	2022 年 7 月 1 日	101.84	600,000	61,106,133.70
012280007	22 深业 SCP001	2022 年 7 月 4 日	101.34	397,000	40,231,035.90
012281441	22 中石化 SCP007	2022 年 7 月 4 日	100.40	700,000	70,281,342.47
012281774	22 晋陵投资 SCP002	2022 年 7 月 1 日	100.29	380,000	38,109,208.88
102000376	20 宣城国资 MTN001	2022 年 7 月 1 日	101.85	453,000	46,139,569.10
200003	20 付息国债 03	2022 年 7 月 1 日	100.92	300,000	30,277,249.32
220201	22 国开 01	2022 年 7 月 1 日	101.06	100,000	10,105,769.86
合计	-	-	-	2,930,000	296,250,309.23

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所（场内）进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	61,096,917.81	20,137,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	1,766,244,501.42	262,451,000.00
合计	1,827,341,419.23	282,588,000.00

未评级债券包括国债、政策性金融债、超短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	357,430,259.44	46,593,600.20
AAA 以下	801,020,618.07	207,761,792.40
未评级	50,518,298.63	20,028,000.00
合计	1,208,969,176.14	274,383,392.60

未评级债券包括国债、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 266,034,447.77 元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,743,685.94	-	-	-	3,743,685.94
结算备付金	365,256.89	-	-	-	365,256.89
存出保证金	8,464.75	-	-	-	8,464.75
交易性金融资产	2,832,353,058.41	193,959,386.28	9,998,150.68	-	3,036,310,595.37
买入返售金融资产	50,000,000.00	-	-	-	50,000,000.00
应收申购款	-	-	-	6,974,944.13	6,974,944.13
应收清算款	-	-	-	101,679.59	101,679.59
资产总计	2,886,470,465.99	193,959,386.28	9,998,150.68	7,076,623.72	3,097,504,626.67
负债					
卖出回购金融资产款	266,005,202.14	-	-	-	266,005,202.14
应付赎回款	-	-	-	56,858.66	56,858.66
应付管理人报酬	-	-	-	634,820.96	634,820.96
应付托管费	-	-	-	211,606.98	211,606.98
应付销售服务费	-	-	-	124,031.88	124,031.88
应交税费	-	-	-	176,541.70	176,541.70
其他负债	-	-	-	149,140.09	149,140.09
负债总计	266,005,202.14	-	-	1,353,000.27	267,358,202.41
利率敏感度缺口	2,620,465,263.85	193,959,386.28	9,998,150.68	5,723,623.45	2,830,146,424.26
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,052,808.77	-	-	-	3,052,808.77
结算备付金	11,044.17	-	-	-	11,044.17
存出保证金	3,786.31	-	-	-	3,786.31
交易性金融资产	529,474,050.00	26,061,100.00	1,436,242.60	-	556,971,392.60
应收利息	-	-	-	9,263,112.16	9,263,112.16
应收申购款	-	-	-	3,388,613.98	3,388,613.98
资产总计	532,541,689.25	26,061,100.00	1,436,242.60	12,651,726.14	572,690,757.99
负债					
卖出回购金融资产款	96,513,116.76	-	-	-	96,513,116.76
应付管理人报酬	-	-	-	126,018.05	126,018.05
应付托管费	-	-	-	42,005.98	42,005.98

应付销售服务费	-	-	-	78,959.67	78,959.67
应付交易费用	-	-	-	23,562.87	23,562.87
应交税费	-	-	-	41,227.67	41,227.67
应付利息	-	-	-	44,093.49	44,093.49
其他负债	-	-	-	182,000.00	182,000.00
负债总计	96,513,116.76	-	-	537,867.73	97,050,984.49
利率敏感度缺口	436,028,572.49	26,061,100.00	1,436,242.60	12,113,858.41	475,639,773.50

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	1.市场利率平行上升相关风险变量的变动25个基点	-3,694,311.36	-882,014.67
2.市场利率平行下降相关风险变量的变动25个基点	3,712,768.34	886,900.92	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无外汇风险的敏感性分析。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金本报告期末及上年度末无其他价格风险敞口。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无其他价格风险的敏感性分析。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	3,036,310,595.37
第三层次	-
合计	3,036,310,595.37

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明



于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	3,036,310,595.37	98.02
	其中：债券	3,036,310,595.37	98.02
	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	50,000,000.00	1.61
	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	4,108,942.83	0.13
7	其他资产	7,085,088.47	0.23
8	合计	3,097,504,626.67	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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金报告期内无买入股票。

### 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

本基金报告期内无卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金报告期内无买卖股票。

## 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	174,200,558.72	6.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	25,217,495.88	0.89
	其中：政策性金融债	20,103,920.54	0.71
4	企业债券	138,655,350.94	4.90
5	企业短期融资券	1,683,555,238.60	59.49
6	中期票据	1,014,681,951.23	35.85
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,036,310,595.37	107.28

## 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	019666	22 国债 01	1,000,000	101,122,328.77	3.57
2	012281332	22 临港控股 SCP003	1,000,000	100,574,843.84	3.55
3	012281441	22 中石化 SCP007	700,000	70,281,342.47	2.48
4	042100346	21 甬城投 CP001	600,000	61,438,865.75	2.17
5	012105164	21 中兵投资 SCP002	600,000	61,106,133.70	2.16

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

## 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

本基金本报告期末持有国债期货合约。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货合约。

## 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

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

### 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	8,464.75
2	应收清算款	101,679.59
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	6,974,944.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,085,088.47

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## § 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
创金合信恒利超短债债券 A	7,959	266,695.76	2,030,880,006.33	95.68%	91,751,538.19	4.32%
创金合信恒利超短债债券 C	200,024	1,731.03	16,612,275.09	4.80%	329,634,445.72	95.20%
创金合信恒利超短债债券 E	3,081	15,366.80	9,788,088.03	20.67%	37,557,026.18	79.33%
合计	210,393	11,959.63	2,057,280,369.45	81.76%	458,943,010.09	18.24%

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	创金合信恒利超短债	402,441.96	0.02%

人员持有本基金	债券 A		
	创金合信恒利超短债债券 C	958,430.30	0.28%
	创金合信恒利超短债债券 E	13,937.44	0.03%
	合计	1,374,809.70	0.05%

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	创金合信恒利超短债债券 A	0~10
	创金合信恒利超短债债券 C	0~10
	创金合信恒利超短债债券 E	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信恒利超短债债券 A	0
	创金合信恒利超短债债券 C	0
	创金合信恒利超短债债券 E	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信恒利超短债债券 A	创金合信恒利超短债债券 C	创金合信恒利超短债债券 E
基金合同生效日 (2018 年 8 月 2 日)基金份额总额	125,370,922.05	177,557,799.52	-
本报告期期初基金份额总额	154,927,624.84	212,017,232.51	53,258,651.96
本报告期基金总申购份额	2,096,142,312.56	362,317,648.50	353,202,828.88
减：报告期基金总赎回份额	128,438,392.88	228,088,160.20	359,116,366.63
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	2,122,631,544.52	346,246,720.81	47,345,114.21

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金的基金托管人未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-

东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方 财富证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	4	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-

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。

本基金报告期内退租中金财富 2 个交易单元、中信证券 2 个交易单元，新增五矿证券 2 个交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	229,669,789.69	79.79%	95,900,000.00	100.00%	-	-



五矿证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	58,183,200.00	20.21%	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 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	创金合信恒利超短债债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
2	创金合信基金管理有限公司 旗下基金 2021 年度第四季度报告提示性公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
3	创金合信恒利超短债债券型证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-08
4	创金合信恒利超短债债券型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-09
5	创金合信恒利超短债债券型证券投资基金 (2022 年 3 月) 招募说明书 (更新)	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-09
6	创金合信恒利超短债债券型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-09
7	创金合信恒利超短债债券型证券投资基金(E 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-09
8	创金合信恒利超短债债券型证券投资基金 2021 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-30
9	创金合信恒利超短债债券型证券投资基金	公司官网、中国证监	2022-04-21

	2022 年第 1 季度报告	会基金电子披露网站	
10	创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金转换业务规则说明的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-10
11	创金合信恒利超短债债券型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）、大额转换转入业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-17
12	创金合信恒利超短债债券型证券投资基金分红公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-22
13	创金合信恒利超短债债券型证券投资基金恢复大额申购（含定期定额投资）、大额转换转入业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-24

## § 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

本基金本报告期未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

创金合信基金成立于 2014 年 7 月，是第一家成立时即实现员工持股的基金公司。股东由第一创业证券股份有限公司、以及经营管理层和核心员工持股的 7 家投资合伙企业构成。秉承“以客户为中心”的文化理念，创金合信基金迅速构建起独特的服务优势和核心竞争力，并在客户数量和规模上取得快速突破。截至 2022 年 6 月 30 日，创金合信基金共管理 84 只公募基金，公募管理规模 1027.19 亿元。2022 年 7 月，创金合信基金荣获证券时报第十七届“明星基金公司成长奖”。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信恒利超短债债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信恒利超短债债券型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信恒利超短债债券型证券投资基金 2022 年中期报告原文。

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

创金合信基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日