

# 创金合信金融地产精选股票型证券投资 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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.....                                | 7  |
| 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合规守信情况的说明.....              | 8  |
| 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.....             | 9  |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 10 |
| 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.....       | 10 |
| §5 托管人报告.....                                | 10 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 10 |
| 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..... | 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.....      | 11 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）.....                      | 11 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 11 |
| 6.2 利润表.....                                 | 12 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表.....                        | 14 |
| 6.4 报表附注.....                                | 16 |
| §7 投资组合报告.....                               | 37 |
| 7.1 报告期末基金资产组合情况.....                        | 37 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 37 |
| 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.....     | 38 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 39 |
| 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..... | 41 |
| 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.....   | 41 |
| 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.....    | 41 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                 | 41 |
| 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 .....           | 44 |
| 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.....                         | 47 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 47 |
| 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 ..... | 47 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 48 |
| §12 备查文件目录.....                          | 48 |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 48 |
| 12.2 存放地点.....                           | 48 |
| 12.3 查阅方式.....                           | 48 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                     |                 |
|-----------------|---------------------|-----------------|
| 基金名称            | 创金合信金融地产精选股票型证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 创金合信金融地产股票          |                 |
| 基金主代码           | 003232              |                 |
| 交易代码            | 003232              |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |                 |
| 基金合同生效日         | 2018 年 10 月 11 日    |                 |
| 基金管理人           | 创金合信基金管理有限公司        |                 |
| 基金托管人           | 中国邮政储蓄银行股份有限公司      |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 27,169,102.26 份     |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 创金合信金融地产股票 A        | 创金合信金融地产股票 C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 003232              | 003233          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 11,869,777.44 份     | 15,299,324.82 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                 |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金通过对金融地产行业进行研究和分析，精选行业内具有核心竞争优势和持续成长潜力的上市公司，力争取得超越业绩比较基准的收益。                                                                  |
| 投资策略   | 本基金采取自上而下的资产配置思路，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益、风险水平及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的具体分配比例。 |
| 业绩比较基准 | 中证金融地产指数收益率*90%+人民币活期存款利率（税后）*10%                                                                                               |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。                                                                                  |

### 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  | 中国邮政储蓄银行股份有限公司           |
| 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  | 95580                    |
| 传真      | 0755-25832571 | 010-68858120             |

|       |                                         |                |
|-------|-----------------------------------------|----------------|
| 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） | 北京市西城区金融大街3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    | 北京市西城区金融大街3号A座 |
| 邮政编码  | 518052                                  | 100808         |
| 法定代表人 | 钱龙海                                     | 刘建军            |

## 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、创金合信金融地产股票 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       | -746,785.96                           |
| 本期利润          | -1,961,828.18                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1524                               |
| 本期加权平均净值利润率   | -14.94%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | -12.04%                               |
| 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      | 655,638.26                            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0552                                |
| 期末基金资产净值      | 12,097,715.30                         |
| 期末基金份额净值      | 1.0192                                |

|              |                       |
|--------------|-----------------------|
| 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  | 1.93%                 |

## 2、创金合信金融地产股票 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       | -646,216.05                           |
| 本期利润          | -1,661,945.38                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1589                               |
| 本期加权平均净值利润率   | -15.95%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | -12.35%                               |
| 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      | 594,762.30                            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0389                                |
| 期末基金资产净值      | 15,184,953.11                         |
| 期末基金份额净值      | 0.9925                                |
| 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   | -0.80%                                |

注：1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 期末可供分配利润是采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

## 创金合信金融地产股票 A

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|-------|
| 过去一个月          | 8.21%        | 1.79%               | 5.60%              | 1.21%                     | 2.61%  | 0.58% |
| 过去三个月          | 1.16%        | 1.68%               | -2.12%             | 1.26%                     | 3.28%  | 0.42% |
| 过去六个月          | -12.04%      | 1.76%               | -6.75%             | 1.36%                     | -5.29% | 0.40% |
| 过去一年           | -12.17%      | 1.71%               | -12.12%            | 1.24%                     | -0.05% | 0.47% |
| 过去三年           | 4.79%        | 1.57%               | -14.15%            | 1.23%                     | 18.94% | 0.34% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 1.93%        | 1.66%               | 2.93%              | 1.28%                     | -1.00% | 0.38% |

## 创金合信金融地产股票 C

| 阶段 | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标 | 业绩比较<br>基准收益 | 业绩比较<br>基准收益 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------------|--------------|--------------|--------------|-----|-----|
|----|--------------|--------------|--------------|--------------|-----|-----|

|                |         | 准差②   | 率③      | 率标准差<br>④ |        |       |
|----------------|---------|-------|---------|-----------|--------|-------|
| 过去一个月          | 8.14%   | 1.79% | 5.60%   | 1.21%     | 2.54%  | 0.58% |
| 过去三个月          | 0.98%   | 1.68% | -2.12%  | 1.26%     | 3.10%  | 0.42% |
| 过去六个月          | -12.35% | 1.76% | -6.75%  | 1.36%     | -5.60% | 0.40% |
| 过去一年           | -12.78% | 1.71% | -12.12% | 1.24%     | -0.66% | 0.47% |
| 过去三年           | 2.48%   | 1.57% | -14.15% | 1.23%     | 16.63% | 0.34% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -0.80%  | 1.67% | 2.93%   | 1.28%     | -3.73% | 0.39% |

### 3.2.2 自基金转型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

创金合信金融地产股票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  
(2018年10月11日-2022年06月30日)



创金合信金融地产股票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10月11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 |        |                                                                                                                           |
| 李葵 | 本基金基金经理 | 2018 年 10 月 11 日 | -    | 10     | 李葵女士，中国国籍，上海交通大学硕士，2012 年 4 月加入兴业证券股份有限公司研究所，担任地产行业研究员，主要从事地产行业跟踪和股票推荐等工作，2015 年 6 月加创金合信基金管理有限公司，历任研究部研究员、基金经理助理，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。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十二条规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人会在十个交易日内进行调整。

## 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

目前地产市场经历了长达一年的大幅萎缩，可以说金融板块都或多或少受到了地产销售下滑的影响。市场对于银行的资产质量，地产公司的负债情况和非银金融机构地产相关业务的风险的担忧，都体现在目前较为低迷的金融地产的股价之中。

当然我们也看到了政策方面的一些努力，但目前仍未见到销售的明显复苏。但目前的预期可能已经较为悲观。金融地产相关标的的估值水平都移动到了历史极低估值水平，我们认为其中部分优质标的，具备较好的投资价值。

我们目前超配了财富管理的相关标的和保险板块标的。我们认为这两个板块目前估值都处于极低水平，随着市场情绪的修复和基本面的逐步改善，板块存在投资机会。同时我们超配了部分国有地产个股。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信金融地产股票 A 基金份额净值为 1.0192 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.04%，同期业绩比较基准收益率为-6.75%；截至本报告期末创金合信金融地产股票 C 基金份额净值为 0.9925 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.35%，同期业绩比较基准收益率为-6.75%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一季度及二季度起始，受美联储加息、俄乌战争及上海疫情等因素影响，市场出现大幅下跌。而二季度以来，上海疫情好转，同时地产政策方面迎来了标志性的事件，5 月 15 日人民银行、银保监会通知，下调首套住房商业性个人住房贷款利率下限至不低于相应 LPR 减 20 个基点，二套住房商业房贷维持现行规定不变。随后，央行将五年期贷款市场报价利率 (LPR) 从 4.60% 下调至 4.45%，同时维持一年期 LPR 在 3.70% 不变。地产销售在 6 月份小幅反弹，但随着 7 月停贷事件的影响，地产销售再次大幅下行。7 月社融明显低于市场预期，可见受地产的影响，整体信用扩张较为不易。

在地产基本面较难扭转的情况下，市场对于流动性宽松预期大幅提升，成长股在此环境下相对占优。

目前的行情总是让人不禁回忆起 2013-2014 年的市场，券商板块由于资产变重，使得其在目前环境下的弹性低于以往。

#### 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

截至本财务报告批准报出日，本基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

## § 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在创金合信金融地产精选股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及

其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。报告期内,本基金未实施利润分配。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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：创金合信金融地产精选股票型证券投资基金

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 | 925,247.46          | 482,375.18            |
| 结算备付金    |         | 35,835.16           | 91,089.82             |
| 存出保证金    |         | 18,814.95           | 29,214.93             |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 21,515,184.23       | 29,295,148.20         |
| 其中：股票投资  |         | 21,198,182.25       | 28,117,859.30         |
| 基金投资     |         | -                   | -                     |
| 债券投资     |         | 317,001.98          | 1,177,288.90          |
| 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 | -                   | -                     |
| 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     |         | -                   | 34,280.02             |
| 应收股利      |         | -                   | -                     |
| 应收申购款     |         | 5,593,808.13        | 60,112.43             |
| 递延所得税资产   |         | -                   | -                     |
| 其他资产      | 6.4.7.5 | -                   | 28,722.61             |
| 资产总计      |         | 28,088,889.93       | 30,020,943.19         |
| 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 |         | -                   | -                     |
| 应付清算款     |         | 538,382.36          | -                     |
| 应付赎回款     |         | 161,884.35          | 133,184.47            |
| 应付管理人报酬   |         | 26,347.59           | 38,579.59             |
| 应付托管费     |         | 3,513.01            | 5,143.93              |
| 应付销售服务费   |         | 5,480.72            | 8,172.02              |
| 应付投资顾问费   |         | -                   | -                     |
| 应交税费      |         | -                   | -                     |
| 应付利润      |         | -                   | -                     |
| 递延所得税负债   |         | -                   | -                     |
| 其他负债      | 6.4.7.6 | 70,613.49           | 75,666.34             |
| 负债合计      |         | 806,221.52          | 260,746.35            |
| 净资产：      |         |                     |                       |
| 实收基金      | 6.4.7.7 | 24,905,340.44       | 23,814,755.60         |
| 其他综合收益    |         | -                   | -                     |
| 未分配利润     | 6.4.7.8 | 2,377,327.97        | 5,945,441.24          |
| 净资产合计     |         | 27,282,668.41       | 29,760,196.84         |
| 负债和净资产总计  |         | 28,088,889.93       | 30,020,943.19         |

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，创金合信金融地产股票 A 份额净值 1.0192 元，基金份额总额 11,869,777.44 份；创金合信金融地产股票 C 份额净值 0.9925 元，基金份额总额 15,299,324.82 份；总份额合计 27,169,102.26 份。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信金融地产精选股票型证券投资基金

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<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年<br>1 月 1 日至 2021 年 6 月<br>30 日 |
|-------------------------------|------------|---------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入                       |            | -3,353,638.57                         | 454,763.25                                    |
| 1.利息收入                        |            | 4,063.78                              | 8,755.74                                      |
| 其中：存款利息收入                     | 6.4.7.9    | 4,063.78                              | 4,583.86                                      |
| 债券利息收入                        |            | -                                     | 4,171.88                                      |
| 资产支持证券利息收入                    |            | -                                     | -                                             |
| 买入返售金融资产收入                    |            | -                                     | -                                             |
| 证券出借利息收入                      |            | -                                     | -                                             |
| 其他利息收入                        |            | -                                     | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）              |            | -1,176,685.66                         | 1,800,862.39                                  |
| 其中：股票投资收益                     | 6.4.7.10   | -1,263,067.21                         | 1,458,485.58                                  |
| 基金投资收益                        |            | -                                     | -                                             |
| 债券投资收益                        | 6.4.7.11   | 4,348.37                              | 29,370.56                                     |
| 资产支持证券投资                      | 6.4.7.12   | -                                     | -                                             |
| 收益                            |            |                                       |                                               |
| 贵金属投资收益                       | 6.4.7.13   | -                                     | -                                             |
| 衍生工具收益                        | 6.4.7.14   | -                                     | -                                             |
| 股利收益                          | 6.4.7.15   | 82,033.18                             | 313,006.25                                    |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认产生的<br>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   | -2,230,771.55                         | -1,489,094.67                                 |
| 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   | 49,754.86                             | 134,239.79                                    |
| 减：二、营业总支出                     |            | 270,134.99                            | 389,692.05                                    |
| 1.管理人报酬                       | 6.4.10.2.1 | 176,310.11                            | 155,277.27                                    |
| 2.托管费                         | 6.4.10.2.2 | 23,508.01                             | 20,703.65                                     |
| 3.销售服务费                       | 6.4.10.2.3 | 36,371.11                             | 37,298.39                                     |
| 4.投资顾问费                       |            | -                                     | -                                             |
| 5.利息支出                        |            | -                                     | -                                             |
| 其中：卖出回购金融资产支出                 |            | -                                     | -                                             |
| 6.信用减值损失                      | 6.4.7.18   | -                                     | -                                             |

|                     |          |               |            |
|---------------------|----------|---------------|------------|
| 7.税金及附加             |          | -             | 0.02       |
| 8.其他费用              | 6.4.7.19 | 33,945.76     | 176,412.72 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | -3,623,773.56 | 65,071.20  |
| 减：所得税费用             |          | -             | -          |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | -3,623,773.56 | 65,071.20  |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -             | -          |
| 六、综合收益总额            |          | -3,623,773.56 | 65,071.20  |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：创金合信金融地产精选股票型证券投资基金

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）                     | 23,814,755.60                      | -      | 5,945,441.24  | 29,760,196.84  |
| 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）                     | 23,814,755.60                      | -      | 5,945,441.24  | 29,760,196.84  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | 1,090,584.84                       | -      | -3,568,113.27 | -2,477,528.43  |
| （一）、综合收益总额                          | -                                  | -      | -3,623,773.56 | -3,623,773.56  |
| （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） | 1,090,584.84                       | -      | 55,660.29     | 1,146,245.13   |
| 其中：1.基金申购款                          | 17,531,352.47                      | -      | 1,626,610.57  | 19,157,963.04  |
| 2.基金赎回款                             | -16,440,767.63                     | -      | -1,570,950.28 | -18,011,717.91 |
| （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）                          | 24,905,340.44                           | -      | 2,377,327.97   | 27,282,668.41  |
| 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）                          | 17,993,922.53                           | -      | 5,049,027.74   | 23,042,950.27  |
| 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）                          | 17,993,922.53                           | -      | 5,049,027.74   | 23,042,950.27  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 819,123.67                              | -      | -264,539.47    | 554,584.20     |
| （一）、综合收益总额                               | -                                       | -      | 65,071.20      | 65,071.20      |
| （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）      | 819,123.67                              | -      | -329,610.67    | 489,513.00     |
| 其中：1.基金申购款                               | 35,837,255.08                           | -      | 11,058,907.31  | 46,896,162.39  |
| 2.基金赎回款                                  | -35,018,131.41                          | -      | -11,388,517.98 | -46,406,649.39 |
| （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                                  | 18,813,046.20                           | -      | 4,784,488.27   | 23,597,534.47  |



|          |  |  |  |  |
|----------|--|--|--|--|
| 资产（基金净值） |  |  |  |  |
|----------|--|--|--|--|

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

创金合信金融地产精选股票型证券投资基金是由原创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“创金合信鑫价值混合基金”)转型而来。根据原创金合信鑫价值混合基金基金份额持有人大会以通讯方式审议通过的《关于创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，创金合信鑫价值混合基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司于 2018 年 9 月 27 日发布了《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。根据《关于创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称“中国邮政储蓄银行”)协商一致，自 2018 年 10 月 11 日起，原创金合信鑫价值混合基金名称变更为创金合信金融地产精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金基金合同》于同日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行。

根据《创金合信金融地产精选股票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 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 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《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板以及其他中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、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、货币市场工具(含同业存单等)、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监

会相关规定)。本基金的业绩比较基准为: 中证金融地产指数收益率 $\times$ 90%+人民币活期存款利率(税后) $\times$ 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》、《创金合信金融地产精选股票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合同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、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 482,375.18 元、91,089.82 元、29,214.93 元、28,722.61 元、34,280.02 元和 60,112.43 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、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 482,496.95 元、91,134.92 元、29,229.34 元、0.00 元、34,280.02 元和 60,112.43 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 29,295,148.20 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 29,323,689.53 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 133,184.47 元、38,579.59 元、5,143.93 元、8,172.02 元、35,653.77 元和 12.57 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 133,184.47 元、38,579.59 元、5,143.93 元、8,172.02 元、35,653.77 元和 12.57 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[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。

(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/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 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------|
| 活期存款           | 925,247.46          |
| 等于：本金          | 925,055.70          |
| 加：应计利息         | 191.76              |
| 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             | 925,247.46          |

### 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            | 20,193,554.17       | -          | 21,198,182.25 | 1,004,628.08 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -          | -             | -            |
| 债券            | 交易所市场               | 301,459.40 | 3,969.48      | 317,001.98   |
|               | 银行间市场               | -          | -             | -            |
|               | 合计                  | 301,459.40 | 3,969.48      | 317,001.98   |
| 资产支持证券        | -                   | -          | -             | -            |

|    |               |          |               |              |
|----|---------------|----------|---------------|--------------|
| 基金 | -             | -        | -             | -            |
| 其他 | -             | -        | -             | -            |
| 合计 | 20,495,013.57 | 3,969.48 | 21,515,184.23 | 1,016,201.18 |

### 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

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 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       | 274.60              |
| 应付证券出借违约金   | -                   |
| 应付交易费用      | 36,393.13           |
| 其中：交易所市场    | 36,393.13           |
| 银行间市场       | -                   |
| 应付利息        | -                   |
| 预提费用        | 33,945.76           |
| 合计          | 70,613.49           |

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 创金合信金融地产股票 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          | 14,156,497.52                      | 13,045,117.71 |
| 本期申购          | 2,976,675.65                       | 2,742,992.55  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5,263,395.73                      | -4,850,169.82 |
| 基金份额折算变动份额    | -                                  | -             |
| 本期末           | 11,869,777.44                      | 10,937,940.44 |

| 创金合信金融地产股票 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          | 11,796,489.27                      | 10,769,637.89  |
| 本期申购          | 16,198,462.61                      | 14,788,359.92  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -12,695,627.06                     | -11,590,597.81 |
| 基金份额折算变动份额    | -                                  | -              |
| 本期末           | 15,299,324.82                      | 13,967,400.00  |

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

| 创金合信金融地产股票 A   |              |               |               |
|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 本期期初           | 1,584,228.27 | 1,773,744.30  | 3,357,972.57  |
| 本期利润           | -746,785.96  | -1,215,042.22 | -1,961,828.18 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -181,804.05  | -54,565.48    | -236,369.53   |
| 其中：基金申购款       | 203,487.20   | 69,873.18     | 273,360.38    |
| 基金赎回款          | -385,291.25  | -124,438.66   | -509,729.91   |
| 本期已分配利润        | -            | -             | -             |
| 本期末            | 655,638.26   | 504,136.60    | 1,159,774.86  |

| 创金合信金融地产股票 C   |              |               |               |
|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 本期期初           | 1,151,864.70 | 1,435,603.97  | 2,587,468.67  |
| 本期利润           | -646,216.05  | -1,015,729.33 | -1,661,945.38 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 89,113.65    | 202,916.17    | 292,029.82    |
| 其中：基金申购款       | 854,172.12   | 499,078.07    | 1,353,250.19  |
| 基金赎回款          | -765,058.47  | -296,161.90   | -1,061,220.37 |
| 本期已分配利润        | -            | -             | -             |
| 本期末            | 594,762.30   | 622,790.81    | 1,217,553.11  |

#### 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  | 3,377.04                           |
| 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 | 488.37                             |
| 其他        | 198.37                             |



|    |          |
|----|----------|
| 合计 | 4,063.78 |
|----|----------|

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -1,263,067.21                      |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                                  |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                                  |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                                  |
| 合计               | -1,263,067.21                      |

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 53,265,082.68                      |
| 减：卖出股票成本总额 | 54,391,710.53                      |
| 减：交易费用     | 136,439.36                         |
| 买卖股票差价收入   | -1,263,067.21                      |

#### 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                  | 11,262.65                          |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -6,914.28                          |
| 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                            | 4,348.37                           |

##### 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   | 2,095,618.70                       |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,036,820.30                       |
| 减：应计利息总额                | 65,710.60                          |
| 减：交易费用                  | 2.08                               |
| 买卖债券差价收入                | -6,914.28                          |

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

**6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 82,033.18                          |
| 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            | 82,033.18                          |

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | -2,230,771.55                      |
| ——股票投资                 | -2,244,349.25                      |
| ——债券投资                 | 13,577.70                          |
| ——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                     | -2,230,771.55                      |

**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 | 44,577.03                          |

|       |           |
|-------|-----------|
| 转换费收入 | 5,177.83  |
| 合计    | 49,754.86 |

#### 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    | 19,835.79                          |
| 信息披露费   | 14,109.97                          |
| 证券出借违约金 | -                                  |
| 合计      | 33,945.76                          |

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |              | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |              |
|--------------|------------------------------------|--------------|-----------------------------------------|--------------|
|              | 成交金额                               | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额                                    | 占当期股票成交总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 16,297,954.63                      | 15.86%       | -                                       | -            |

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |              | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |              |
|--------------|------------------------------------|--------------|-----------------------------------------|--------------|
|              | 成交金额                               | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额                                    | 占当期债券成交总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 1,796,470.90                       | 88.02%       | -                                       | -            |

#### 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日      |            |          |              |
|--------------|-----------------------------------------|------------|----------|--------------|
|              | 当期佣金                                    | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 11,918.11                               | 16.01%     | 6,048.66 | 16.62%       |
| 关联方名称        | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |            |          |              |
|              | 当期佣金                                    | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | -                                       | -          | -        | -            |

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

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

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------------------|-----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 176,310.11                         | 155,277.27                              |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 60,663.17                          | 59,027.13                               |

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 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 | 23,508.01                          | 20,703.65                               |

注：支付基金托管人中国邮政储蓄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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 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                        |              |          |
|                | 创金合信金融地产股票 A                            | 创金合信金融地产股票 C | 合计       |
|                | -                                       | 665.96       | 665.96   |
| 合计             | -                                       | 665.96       | 665.96   |
| 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                        |              |          |
|                | 创金合信金融地产股票 A                            | 创金合信金融地产股票 C | 合计       |
|                | -                                       | 3,082.05     | 3,082.05 |
| 合计             | -                                       | 3,082.05     | 3,082.05 |

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：

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 × 0.7% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                  | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |              |
|---------------------|------------------------------------|--------------|
|                     | 创金合信金融地产股票 A                       | 创金合信金融地产股票 C |
| 报告期初持有的基金份额         | -                                  | -            |
| 报告期间申购/买入总份额        | -                                  | -            |
| 报告期间因拆分变动份额         | -                                  | -            |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -                                  | -            |
| 报告期末持有的基金份额         | -                                  | -            |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | -                                  | -            |

| 项目             | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |              |
|----------------|-----------------------------------------|--------------|
|                | 创金合信金融地产股票 A                            | 创金合信金融地产股票 C |
| 报告期初持有的基金份额    | 2,890,605.53                            | 2,891,326.02 |
| 报告期间申购/买入总份额   | -                                       | -            |
| 报告期间因拆分变动份额    | -                                       | -            |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 2,890,605.53                            | 2,891,326.02 |
| 报告期末持有的基金份额    | 0.00                                    | 0.00         |
| 报告期末持有的基金份额占   | 0.00%                                   | 0.00%        |

|         |  |  |
|---------|--|--|
| 基金总份额比例 |  |  |
|---------|--|--|

#### 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   |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 925,247.46                         | 3,377.04 | 1,101,196.81                            | 3,558.25 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

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邮政储蓄银行股份有限公司，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    | -                   | -                     |
| A-1 以下 | -                   | -                     |
| 未评级    | 268,346.02          | 919,183.80            |
| 合计     | 268,346.02          | 919,183.80            |

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    | 48,655.96           | -                     |
| AAA 以下 | -                   | -                     |
| 未评级    | -                   | 258,105.10            |
| 合计     | 48,655.96           | 258,105.10            |

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，本基金所承担的金融负债的合约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 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                  | 925,247.46   | -     | -         | -             | 925,247.46    |
| 结算备付金                 | 35,835.16    | -     | -         | -             | 35,835.16     |
| 存出保证金                 | 18,814.95    | -     | -         | -             | 18,814.95     |
| 交易性金融资产               | 268,346.02   | -     | 48,655.96 | 21,198,182.25 | 21,515,184.23 |
| 应收申购款                 | -            | -     | -         | 5,593,808.13  | 5,593,808.13  |
| 资产总计                  | 1,248,243.59 | -     | 48,655.96 | 26,791,990.38 | 28,088,889.93 |
| 负债                    |              |       |           |               |               |
| 应付赎回款                 | -            | -     | -         | 161,884.35    | 161,884.35    |
| 应付管理人报酬               | -            | -     | -         | 26,347.59     | 26,347.59     |
| 应付托管费                 | -            | -     | -         | 3,513.01      | 3,513.01      |
| 应付销售服务费               | -            | -     | -         | 5,480.72      | 5,480.72      |
| 应付清算款                 | -            | -     | -         | 538,382.36    | 538,382.36    |
| 其他负债                  | -            | -     | -         | 70,613.49     | 70,613.49     |
| 负债总计                  | -            | -     | -         | 806,221.52    | 806,221.52    |
| 利率敏感度缺口               | 1,248,243.59 | -     | 48,655.96 | 25,985,768.86 | 27,282,668.41 |
| 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                  | 482,375.18   | -     | -         | -             | 482,375.18    |
| 结算备付金                 | 91,089.82    | -     | -         | -             | 91,089.82     |
| 存出保证金                 | 29,214.93    | -     | -         | -             | 29,214.93     |
| 交易性金融资产               | 1,177,288.90 | -     | -         | 28,117,859.30 | 29,295,148.20 |
| 应收利息                  | -            | -     | -         | 28,722.61     | 28,722.61     |
| 应收申购款                 | -            | -     | -         | 60,112.43     | 60,112.43     |
| 应收证券清算款               | -            | -     | -         | 34,280.02     | 34,280.02     |
| 资产总计                  | 1,779,968.83 | -     | -         | 28,240,974.36 | 30,020,943.19 |
| 负债                    |              |       |           |               |               |
| 应付赎回款                 | -            | -     | -         | 133,184.47    | 133,184.47    |
| 应付管理人报酬               | -            | -     | -         | 38,579.59     | 38,579.59     |
| 应付托管费                 | -            | -     | -         | 5,143.93      | 5,143.93      |
| 应付销售服务费               | -            | -     | -         | 8,172.02      | 8,172.02      |
| 应付交易费用                | -            | -     | -         | 35,653.77     | 35,653.77     |

|         |              |   |   |               |               |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 其他负债    | -            | - | - | 40,012.57     | 40,012.57     |
| 负债总计    | -            | - | - | 260,746.35    | 260,746.35    |
| 利率敏感度缺口 | 1,779,968.83 | - | - | 27,980,228.01 | 29,760,196.84 |

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

| 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 | -216.16                     | -304.33                |
|    | 2.市场利率平行下降相关风险变量的变动 25 个基点 | 216.87                      | 305.21                 |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无外汇风险的敏感性分析。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |       | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |       |
|----|---------------------|-------|-----------------------|-------|
|    | 公允价值                | 占基金资产 | 公允价值                  | 占基金资产 |

|               |               | 净值比例<br>(%) |               | 净值比例(%) |
|---------------|---------------|-------------|---------------|---------|
| 交易性金融资产-股票投资  | 21,198,182.25 | 77.70       | 28,117,859.30 | 94.48   |
| 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            | 21,198,182.25 | 77.70       | 28,117,859.30 | 94.48   |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|----------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动            | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                      | 本期末（2022 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
|    | 1.业绩比较基准上升 5%        | 1,315,347.21                | 1,974,857.85           |
|    | 2.业绩比较基准下降 5%        | -1,315,347.21               | -1,974,857.85          |

#### 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。

##### 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          | 21,246,838.21       |
| 第二层次          | 268,346.02          |
| 第三层次          | -                   |
| 合计            | 21,515,184.23       |

###### 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              | 21,198,182.25 | 75.47        |
|    | 其中：股票             | 21,198,182.25 | 75.47        |
| 2  | 固定收益投资            | 317,001.98    | 1.13         |
|    | 其中：债券             | 317,001.98    | 1.13         |
|    | 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      | 961,082.62    | 3.42         |
| 7  | 其他资产              | 5,612,623.08  | 19.98        |
| 8  | 合计                | 28,088,889.93 | 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              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 12,566.85     | 0.05         |
| 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  | 426,692.00    | 1.56         |
| J  | 金融业              | 19,562,373.40 | 71.70        |
| K  | 房地产业             | 1,196,550.00  | 4.39         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| 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               | 21,198,182.25 | 77.70        |

## 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  | 300059 | 东方财富 | 93,727  | 2,380,665.80 | 8.73         |
| 2  | 000776 | 广发证券 | 107,400 | 2,008,380.00 | 7.36         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 44,200  | 1,865,240.00 | 6.84         |
| 4  | 002142 | 宁波银行 | 51,470  | 1,843,140.70 | 6.76         |
| 5  | 601628 | 中国人寿 | 54,400  | 1,690,752.00 | 6.20         |
| 6  | 600030 | 中信证券 | 71,215  | 1,542,516.90 | 5.65         |
| 7  | 601601 | 中国太保 | 56,300  | 1,324,739.00 | 4.86         |
| 8  | 600048 | 保利发展 | 68,300  | 1,192,518.00 | 4.37         |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 9  | 300033 | 同花顺  | 10,700 | 1,028,805.00 | 3.77 |
| 10 | 002945 | 华林证券 | 66,100 | 1,008,025.00 | 3.69 |
| 11 | 601838 | 成都银行 | 57,400 | 951,692.00   | 3.49 |
| 12 | 601456 | 国联证券 | 69,200 | 849,084.00   | 3.11 |
| 13 | 600958 | 东方证券 | 68,800 | 702,448.00   | 2.57 |
| 14 | 601336 | 新华保险 | 21,100 | 679,209.00   | 2.49 |
| 15 | 002939 | 长城证券 | 65,300 | 663,448.00   | 2.43 |
| 16 | 601066 | 中信建投 | 17,100 | 494,361.00   | 1.81 |
| 17 | 600570 | 恒生电子 | 9,800  | 426,692.00   | 1.56 |
| 18 | 601318 | 中国平安 | 4,800  | 224,112.00   | 0.82 |
| 19 | 601995 | 中金公司 | 4,700  | 209,103.00   | 0.77 |
| 20 | 600926 | 杭州银行 | 5,200  | 77,896.00    | 0.29 |
| 21 | 601009 | 南京银行 | 1,800  | 18,756.00    | 0.07 |
| 22 | 601089 | 福元医药 | 597    | 12,566.85    | 0.05 |
| 23 | 600383 | 金地集团 | 300    | 4,032.00     | 0.01 |

## 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  | 600958 | 东方证券 | 3,326,849.72 | 11.18          |
| 2  | 000001 | 平安银行 | 3,212,100.00 | 10.79          |
| 3  | 600383 | 金地集团 | 3,029,301.77 | 10.18          |
| 4  | 300033 | 同花顺  | 2,912,186.00 | 9.79           |
| 5  | 600048 | 保利发展 | 2,730,586.00 | 9.18           |
| 6  | 601155 | 新城控股 | 2,604,449.00 | 8.75           |
| 7  | 601838 | 成都银行 | 2,564,652.00 | 8.62           |
| 8  | 000776 | 广发证券 | 2,329,826.00 | 7.83           |
| 9  | 002939 | 长城证券 | 2,220,305.00 | 7.46           |
| 10 | 601009 | 南京银行 | 2,167,310.00 | 7.28           |
| 11 | 601601 | 中国太保 | 1,859,443.00 | 6.25           |
| 12 | 601628 | 中国人寿 | 1,754,976.00 | 5.90           |
| 13 | 000002 | 万科 A | 1,743,597.00 | 5.86           |
| 14 | 002945 | 华林证券 | 1,444,108.00 | 4.85           |
| 15 | 600926 | 杭州银行 | 1,392,709.00 | 4.68           |
| 16 | 002271 | 东方雨虹 | 1,201,209.00 | 4.04           |
| 17 | 601066 | 中信建投 | 1,166,164.00 | 3.92           |
| 18 | 601166 | 兴业银行 | 1,084,043.00 | 3.64           |
| 19 | 600519 | 贵州茅台 | 1,061,488.00 | 3.57           |
| 20 | 601456 | 国联证券 | 962,112.00   | 3.23           |
| 21 | 601995 | 中金公司 | 841,604.00   | 2.83           |



|    |        |       |            |      |
|----|--------|-------|------------|------|
| 22 | 601318 | 中国平安  | 748,638.00 | 2.52 |
| 23 | 600325 | 华发股份  | 699,463.00 | 2.35 |
| 24 | 601336 | 新华保险  | 668,588.00 | 2.25 |
| 25 | 001979 | 招商蛇口  | 659,602.00 | 2.22 |
| 26 | 600030 | 中信证券  | 632,111.45 | 2.12 |
| 27 | 002049 | 紫光国微  | 625,481.00 | 2.10 |
| 28 | 000069 | 华侨城 A | 621,231.00 | 2.09 |

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  | 000001 | 平安银行  | 4,490,144.00 | 15.09          |
| 2  | 300033 | 同花顺   | 4,298,521.85 | 14.44          |
| 3  | 600958 | 东方证券  | 4,288,621.00 | 14.41          |
| 4  | 002939 | 长城证券  | 3,869,302.00 | 13.00          |
| 5  | 600048 | 保利发展  | 3,258,774.36 | 10.95          |
| 6  | 600383 | 金地集团  | 2,847,752.00 | 9.57           |
| 7  | 000776 | 广发证券  | 2,492,684.00 | 8.38           |
| 8  | 601155 | 新城控股  | 2,387,665.00 | 8.02           |
| 9  | 601009 | 南京银行  | 2,285,440.00 | 7.68           |
| 10 | 000002 | 万科 A  | 1,709,480.00 | 5.74           |
| 11 | 600030 | 中信证券  | 1,619,690.00 | 5.44           |
| 12 | 601838 | 成都银行  | 1,606,531.00 | 5.40           |
| 13 | 601688 | 华泰证券  | 1,576,557.00 | 5.30           |
| 14 | 600570 | 恒生电子  | 1,438,119.92 | 4.83           |
| 15 | 600926 | 杭州银行  | 1,305,711.00 | 4.39           |
| 16 | 002271 | 东方雨虹  | 1,181,696.00 | 3.97           |
| 17 | 600519 | 贵州茅台  | 1,069,863.00 | 3.59           |
| 18 | 601166 | 兴业银行  | 981,431.00   | 3.30           |
| 19 | 002142 | 宁波银行  | 801,486.00   | 2.69           |
| 20 | 300803 | 指南针   | 714,013.00   | 2.40           |
| 21 | 000069 | 华侨城 A | 675,625.00   | 2.27           |
| 22 | 601995 | 中金公司  | 669,446.00   | 2.25           |
| 23 | 600036 | 招商银行  | 662,505.00   | 2.23           |
| 24 | 600325 | 华发股份  | 659,332.00   | 2.22           |
| 25 | 002049 | 紫光国微  | 649,423.00   | 2.18           |
| 26 | 601066 | 中信建投  | 643,426.00   | 2.16           |

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 | 49,716,382.73 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 53,265,082.68 |

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      | 268,346.02 | 0.98         |
| 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） | 48,655.96  | 0.18         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 317,001.98 | 1.16         |

## 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  | 019664 | 21 国债 16 | 2,640 | 268,346.02 | 0.98         |
| 2  | 113055 | 成银转债     | 370   | 48,655.96  | 0.18         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

2021 年 11 月 30 日，广发证券股份有限公司（下称“广发证券”，股票代码：000776.SZ）收到国家外汇管理局广东省分局的行政处罚决定书（粤汇处〔2021〕12 号），因违反规定办理资本项目资金收付、违反规定开立 B 股资金帐户、违反规定办理 B 股资金非本人提款业务、违反规定串用外汇账户四项事由，违反《中华人民共和国外汇管理条例》第四十七条、第四十八条，国家外汇管理局广东省分局责令改正，给予警告，并处罚款人民币 94 万元。

本基金投研人员分析认为，广发证券经营状况整体处于稳健发展状态，以上处罚发生后并未对公司日常经营造成影响。以上 94 万元罚款仅影响广发证券公司 EPS 为 0.0001 元，对业绩影响极为有限。经过研究分析，该违规行为情节轻微，不影响企业正常经营，也不影响企业投资价值。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对广发证券进行了投资。

2021 年 11 月 22 日，中信证券股份有限公司（下称：“中信证券”，股票代码：600036.SH）收到国家外汇管理局深圳市分局行政处罚决定（深外管检〔2021〕44 号），因 QDII 超额度汇出，国际收支统计漏申报，B 股客户非同名账户取款等事项，违反《合格境内投资者境外证券投资外汇管理规定》第六条、《国际收支统计申报办法》第七条、第十条等法规，被国家外汇管理局深圳市分局责令改正，警告，没收违法所得 81 万元人民币，处以罚款 101 万元人民币。

本基金投研人员分析认为，中信证券是证券行业龙头企业，经营状况整体处于稳健发展状态，以上处罚发生后并未对公司日常经营造成影响。以上共计 182 万元的没收违法所得及罚款对中信证券当年 EPS 影响极小，对业绩影响有限。经过研究分析，该违规行为情节轻微，不影响企业正常经营，也不影响企业投资价值。经过研究分析，该违规行为情节轻微，不影响企业正常经营，也不影响企业投资价值。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对中信证券进行了投资。

2022 年 3 月 21 日，招商银行股份有限公司（下称“招商银行”，股票代码：600030.SH）收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定（银保监罚决字〔2022〕21 号），因招商银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在多项违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则之规定，并对公司处以罚款 300 万元。

本基金投研人员分析认为，以上处罚未对公司日常经营造成影响，公司 2022 年一季报显示，公司 2022 年一季度经营平稳，地产方面风险可控。经分析，300 万元人民币的罚款对招商银行公司当年 EPS 影响较小，对业绩影响有限。招商银行目前估值处于历史较低水平，维持持有评级。经过研究分析，该违规行为对于企业正常经营影响较小，对于企业投资价值的影响较小。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对招商银行进行了投资。

### 7.12.2

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### 7.12.3 报告期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额（元）        |
|----|-------|--------------|
| 1  | 存出保证金 | 18,814.95    |
| 2  | 应收清算款 | -            |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 5,593,808.13 |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 5,612,623.08 |

### 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。

## § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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 |
| 创金合信金融地产股票 A | 3,319        | 3,576.31      | 4,156,481.25 | 35.02% | 7,713,296.19  | 64.98% |
| 创金合信金融地产股票 C | 3,003        | 5,094.68      | 5,640,513.04 | 36.87% | 9,658,811.78  | 63.13% |
| 合计           | 6,160        | 4,410.57      | 9,796,994.29 | 36.06% | 17,372,107.97 | 63.94% |

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 | 创金合信金融地产股票 A | 160,896.64 | 1.36%    |
|                  | 创金合信金融地产股票 C | 21,190.16  | 0.14%    |
|                  | 合计           | 182,086.80 | 0.67%    |

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 | 创金合信金融地产股票 A | 0~10              |
|                                | 创金合信金融地产股票 C | 0~10              |
|                                | 合计           | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 创金合信金融地产股票 A | 0                 |
|                                | 创金合信金融地产股票 C | 0                 |
|                                | 合计           | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                              | 创金合信金融地产股票 A  | 创金合信金融地产股票 C  |
|---------------------------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日(2018 年 10 月 11 日)基金份额总额 | 1,297,530.56  | 278,367.82    |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 14,156,497.52 | 11,796,489.27 |
| 本报告期基金总申购份额                     | 2,976,675.65  | 16,198,462.61 |
| 减：报告期基金总赎回份额                    | 5,263,395.73  | 12,695,627.06 |
| 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                    | 11,869,777.44 | 15,299,324.82 |

## § 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 |    |
| 万联证券     | 1      | 30,974,314.78 | 30.15%       | 22,118.14 | 29.71%     | -  |
| 长江证券     | 2      | 22,473,676.08 | 21.88%       | 16,379.69 | 22.00%     | -  |
| 第一创业证券   | 2      | 16,297,954.63 | 15.86%       | 11,918.11 | 16.01%     | -  |
| 广发证券     | 2      | 26,518,931.76 | 25.81%       | 19,309.03 | 25.93%     | -  |
| 西藏东方财富证券 | 2      | 6,464,575.92  | 6.29%        | 4,727.45  | 6.35%      | -  |
| 中泰证券     | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |

注：交易单元的选择标准和程序：

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

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

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

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

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东方财富证券 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 |
| 万联证券     | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长江证券     | 200,353.00   | 9.82%        | -      | -              | -    | -            |
| 第一创业证券   | 1,796,470.90 | 88.02%       | -      | -              | -    | -            |
| 广发证券     | 44,070.40    | 2.16%        | -      | -              | -    | -            |
| 西藏东方财富证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|---|

## 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  | 创金合信金融地产精选股票型证券投资基金 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  | 创金合信金融地产精选股票型证券投资基金 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 |
| 4  | 创金合信金融地产精选股票型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告   | 公司官网、中国证监会基金电子披露网站       | 2022-04-21 |
| 5  | 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 影响投资者决策的其他重要信息

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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                          |      |              |      | 报告期末持有基金情况   |        |
|-------|----------------|--------------------------|------|--------------|------|--------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额         | 赎回份额 | 持有份额         | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 20220630 - 20220630      | 0.00 | 5,634,789.87 | 0.00 | 5,634,789.87 | 20.74% |

#### 产品特有风险

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

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

2、大额赎回风险

(1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险;

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

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

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

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



## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信金融地产精选股票型证券投资基金 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.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日