

# 创金合信中证 1000 指数增强型发起式 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	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.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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.....	13
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.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信中证 1000 增强	
基金主代码	003646	
交易代码	003646	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 22 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	76,139,769.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信中证 1000 增强 A	创金合信中证 1000 增强 C
下属分级基金的交易代码	003646	003647
报告期末下属分级基金的份 额总额	23,080,218.83 份	53,059,551.04 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田
	联系电话	0755-82820166
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.c om
		秦一楠
		010-66060069
		tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	400-868-0666	95599
传真	0755-25832571	010-68121816
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）	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518052	100031
法定代表人	钱龙海	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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、创金合信中证 1000 增强 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	-5,280,438.14
本期利润	-4,776,761.10
加权平均基金份额本期利润	-0.1680
本期加权平均净值利润率	-10.99%
本期基金份额净值增长率	-6.41%
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	9,658,177.55
期末可供分配基金份额利润	0.4185

期末基金资产净值	38,193,716.77
期末基金份额净值	1.6548
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	65.48%

## 2、创金合信中证 1000 增强 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	-11,496,214.62
本期利润	-10,946,466.94
加权平均基金份额本期利润	-0.1727
本期加权平均净值利润率	-11.46%
本期基金份额净值增长率	-6.50%
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	21,181,224.05
期末可供分配基金份额利润	0.3992
期末基金资产净值	86,704,314.14
期末基金份额净值	1.6341
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	63.41%

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

## 创金合信中证 1000 增强 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	13.58%	1.42%	9.60%	1.24%	3.98%	0.18%
过去三个月	10.31%	1.93%	3.21%	1.95%	7.10%	-0.02%
过去六个月	-6.41%	1.79%	-11.95%	1.78%	5.54%	0.01%
过去一年	6.19%	1.50%	-0.96%	1.51%	7.15%	-0.01%
过去三年	76.04%	1.41%	30.49%	1.44%	45.55%	-0.03%
自基金合同生效起至今	65.48%	1.37%	-16.96%	1.41%	82.44%	-0.04%

## 创金合信中证 1000 增强 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	13.56%	1.41%	9.60%	1.24%	3.96%	0.17%
过去三个月	10.26%	1.93%	3.21%	1.95%	7.05%	-0.02%
过去六个月	-6.50%	1.79%	-11.95%	1.78%	5.45%	0.01%
过去一年	5.97%	1.50%	-0.96%	1.51%	6.93%	-0.01%
过去三年	74.81%	1.41%	30.49%	1.44%	44.32%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	63.41%	1.37%	-16.96%	1.41%	80.37%	-0.04%

### 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

创金合信中证1000增强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

(2016年12月22日-2022年06月30日)



创金合信中证1000增强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

(2016年12月22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		
孙悦	本基金基金经理	2021 年 7 月 9 日	-	4	孙悦先生，中国国籍，北京大学金融学硕士，2017 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，历任量化指数与国际部研究员、投资经理，现任基金经理。
董梁	本基金基金经理、首席量化官兼任量化指数与国际部总监	2019 年 7 月 5 日	-	18	董梁先生，中国香港，美国密歇根大学材料科学博士，2005 年 3 月加入美国巴克莱环球投资(Barclays Global Investors)任高级研究员、基金经理,负责美股量化模型开发及投资工作。2009 年 8 月加入瑞士信贷(Credit-Suisse)任自营交易员,负责港股量化模型开发和投资,以及环球股指期货期权的量化投资。2011 年 1 月加入信达国际任执行董事、基金经理,进行港股投资。2012 年 8 月加入华安基金管理有限公司,任系统化投资部量化投资总监、基金经理。2015 年加入香港启智资产管理有限公司（Zentific Investment Management）任投资部基金经理。2017 年 9 月加入创金合信基金管理有限公司,现任首席量化投资官,兼量化指数与国际部总监、基金经理。

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

2、证券从业年限的含义遵从《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，国内外局势比较复杂。海外方面，俄乌冲突 2 月底爆发，对全球金融市场产生较强冲击，在持续超过 5 个月时间后，进程趋缓，给全球金融市场带来的影响逐渐下降。美国方面，在通胀水平持续超预期的背景下，美联储采用加息的手段进行抑制，美股市场受到影响较大。国内方面，疫情突然爆发，对宏观经济和金融市场造成了比较大的影响，5 月后形势有较大好转，疫情得到了有效控制，企业陆续复工复产，一系列会议和稳增长政策提振了市场信心，股市走出独立行情。大类资产方面，原油价格持续上涨后见顶回落，美元指数上行，黄金高位震荡，美股震荡下跌，A 股触底反弹。国内股市风格方面，成长风格经历大幅回落后，从 4 月底开始反弹。

2022 年上半年，中证 1000 指数触底反弹，行业间收益率分化比较明显。业绩基准指数成份股内，表现最好的几个行业是采掘 13.98%、银行 8.58%、农林牧渔 1.77%，表现最差的

几个行业是休闲服务-24.21%、传媒-23.23%、国防军工-21.89%。风格方面，成份股内价值因子表现较好，动量因子表现较差。

本基金以中证 1000 指数为基准，管理人严格遵守指数增强的限制，坚持以自下而上选股为主进行量化投资，严格约束各个维度上的风险暴露，在有限范围内进行超配或低配，以控制跟踪误差，在此基础上追求超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信中证 1000 增强 A 基金份额净值为 1.6548 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.41%，同期业绩比较基准收益率为-11.95%；截至本报告期末创金合信中证 1000 增强 C 基金份额净值为 1.6341 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.50%，同期业绩比较基准收益率为-11.95%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年下半年，国内经济仍然面临供给冲击、需求收缩、预期转弱等问题，疫情仍然在反复。海外方面，衰退预期升温，美联储加息进程仍然在继续，幅度有望逐渐降低。国内政策方面，主基调是保持战略定力，以稳为主，积极有为，力争实现最好结果。在此背景下，预计 A 股系统性风险不大，将仍然以结构性机会为主，风格和行业的轮动速度加快。市值风格方面，随着中证 1000 股指期货上市，小盘股受到更多投资者的关注，迎来长线配置增量资金，机构在小盘股中的定价能力将逐渐提高。行业板块方面，新能源、军工板块有望继续维持高景气，消费板块在上半年反复受到疫情影响，下半年有望缓慢复苏，房地产、银行板块基本面有望触底。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—创金合信基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，创金合信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，创金合信基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 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：创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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	6,036,845.88	12,464,353.50
结算备付金		2,193,155.38	5,023,852.70
存出保证金		430,951.20	944,177.69
交易性金融资产	6.4.7.2	116,865,028.77	205,174,459.49
其中：股票投资		115,340,305.12	203,747,068.29
基金投资		-	-
债券投资		1,524,723.65	1,427,391.20
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		210,458.61	451,483.07
应收股利		-	-
应收申购款		683,402.41	1,178,859.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	26,947.23
资产总计		126,419,842.25	225,264,133.57
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		309,986.25	494,030.13
应付赎回款		693,565.47	532,659.20
应付管理人报酬		80,975.06	150,379.08
应付托管费		15,182.85	28,196.06
应付销售服务费		14,080.30	27,630.01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.22	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	408,021.19	675,325.58
负债合计		1,521,811.34	1,908,220.06

净资产：			
实收基金	6.4.7.7	76,139,769.87	127,426,489.81
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	48,758,261.04	95,929,423.70
净资产合计		124,898,030.91	223,355,913.51
负债和净资产总计		126,419,842.25	225,264,133.57

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，创金合信中证 1000 增强 A 份额净值 1.6548 元，基金份额总额 23,080,218.83 份；创金合信中证 1000 增强 C 份额净值 1.6341 元，基金份额总额 53,059,551.04 份；总份额合计 76,139,769.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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		-14,857,391.98	5,633,866.49
1.利息收入		46,951.74	27,796.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	46,951.74	9,739.77
债券利息收入		-	18,056.36
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）		-16,041,907.31	3,230,449.43
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-16,561,666.39	2,898,884.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	95,869.01	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-431,287.38	-
股利收益	6.4.7.14	855,177.45	331,564.84
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）	6.4.7.15	1,053,424.72	2,273,752.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	84,138.87	101,868.35
减：二、营业总支出		865,836.06	531,849.32
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	555,356.34	174,092.89
2.托管费	6.4.10.2.2	104,129.36	32,642.46
3.销售服务费	6.4.10.2.3	95,617.60	14,681.02
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		460.37	3,644.08
其中：卖出回购金融资产支出		460.37	3,644.08
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		37.90	-
8.其他费用	6.4.7.18	110,234.49	306,788.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,723,228.04	5,102,017.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,723,228.04	5,102,017.17
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-15,723,228.04	5,102,017.17

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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）	127,426,489.81	-	95,929,423.70	223,355,913.51
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）	127,426,489.81	-	95,929,423.70	223,355,913.51
三、本期增减变	-51,286,719.94	-	-47,171,162.66	-98,457,882.60

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	-15,723,228.04	-15,723,228.04
（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）	-51,286,719.94	-	-31,447,934.62	-82,734,654.56
其中：1.基金申购款	28,070,426.76	-	14,435,260.05	42,505,686.81
2.基金赎回款	-79,357,146.70	-	-45,883,194.67	-125,240,341.37
（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）	76,139,769.87	-	48,758,261.04	124,898,030.91
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）	47,047,380.56	-	19,175,566.43	66,222,946.99
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）	47,047,380.56	-	19,175,566.43	66,222,946.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,754,313.23	-	3,005,389.70	-3,748,923.53
（一）、综合收益总额	-	-	5,102,017.17	5,102,017.17
（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）	-6,754,313.23	-	-2,096,627.47	-8,850,940.70



号填列)				
其中：1.基金申购款	38,782,813.93	-	16,864,992.22	55,647,806.15
2.基金赎回款	-45,537,127.16	-	-18,961,619.69	-64,498,746.85
(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）	40,293,067.33	-	22,180,956.13	62,474,023.46

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

创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1918 号《关于准予创金合信中证 1000 指数增强型发起式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《创金合信中证 1000 指数增强型发起式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 10,115,380.08 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(2016)第 1553 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,115,717.42 份基金份额，其中认购资金利息折合 337.34 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,333.36 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《创金合信中证 1000 指数增强型发起式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《创金合信中证 1000 指数增强型发起式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（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、金融衍生品（包括权证、股指期货等）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 1000 指数收益率 $\times$ 95%+一年期人民币定期存款利率（税后） $\times$ 5%。

#### 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》、《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 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 12,464,353.50 元、5,023,852.70 元、944,177.69 元、26,947.23 元、451,483.07 元和 1,178,859.89 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 12,467,465.08 元、5,026,211.74 元、944,235.99 元、0.00 元、451,483.07 元和 1,178,859.89 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 205,174,459.49 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 205,195,877.80 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、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 494,030.13 元、532,659.20 元、150,379.08 元、28,196.06 元、27,630.01 元、478,989.78 元和 184.90 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、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 494,030.13 元、532,659.20 元、150,379.08 元、28,196.06 元、27,630.01 元、478,989.78 元和 184.90 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	6,036,845.88
等于：本金	6,035,593.36
加：应计利息	1,252.52
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	6,036,845.88

## 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	110,572,887.67	-	115,340,305.12	4,767,417.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	14,488.65	1,524,723.65	1,490.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	14,488.65	1,524,723.65	1,490.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	112,081,632.67	14,488.65	116,865,028.77	4,768,907.45

## 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,483,160.00	-	-	-
--股指期货	2,483,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,483,160.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2209	IC2209	2.00	2,545,600.00	62,440.00
合计				62,440.00
减：可抵销期货暂收款				62,440.00
净额				-

## 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	468.54
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	279,621.30
其中：交易所市场	279,621.30
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	127,931.35
合计	408,021.19

**6.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

创金合信中证 1000 增强 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	31,827,172.69	31,827,172.69
本期申购	9,907,830.07	9,907,830.07
本期赎回（以“-”号填列）	-18,654,783.93	-18,654,783.93
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	23,080,218.83	23,080,218.83

创金合信中证 1000 增强 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	95,599,317.12	95,599,317.12
本期申购	18,162,596.69	18,162,596.69
本期赎回（以“-”号填列）	-60,702,362.77	-60,702,362.77
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	53,059,551.04	53,059,551.04

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

创金合信中证 1000 增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	18,522,859.51	5,923,426.10	24,446,285.61
本期利润	-5,280,438.14	503,677.04	-4,776,761.10
本期基金份额交易产生的变动数	-3,584,243.82	-971,782.75	-4,556,026.57
其中：基金申购款	4,587,211.50	547,954.03	5,135,165.53
基金赎回款	-8,171,455.32	-1,519,736.78	-9,691,192.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,658,177.55	5,455,320.39	15,113,497.94

创金合信中证 1000 增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	53,760,488.34	17,722,649.75	71,483,138.09
本期利润	-11,496,214.62	549,747.68	-10,946,466.94
本期基金份额交易产生的变动数	-21,083,049.67	-5,808,858.38	-26,891,908.05
其中：基金申购款	8,134,737.82	1,165,356.70	9,300,094.52
基金赎回款	-29,217,787.49	-6,974,215.08	-36,192,002.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,181,224.05	12,463,539.05	33,644,763.10

### 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	29,566.66
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	16,464.97
其他	920.11
合计	46,951.74

### 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	-16,561,666.39
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	-16,561,666.39
----	----------------

#### 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	656,200,429.96
减：卖出股票成本总额	671,476,153.99
减：交易费用	1,285,942.36
买卖股票差价收入	-16,561,666.39

#### 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	16,519.89
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	79,349.12
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	95,869.01

##### 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	1,910,623.34
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,797,415.80
减：应计利息总额	33,847.63
减：交易费用	10.79
买卖债券差价收入	79,349.12

#### 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 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 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。

##### 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
期货投资	-431,287.38

**6.4.7.14 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	855,177.45
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	855,177.45

**6.4.7.15 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	1,142,864.72
——股票投资	1,138,579.62
——债券投资	4,285.10
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-89,440.00
——权证投资	-
——期货投资	-89,440.00
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	1,053,424.72

**6.4.7.16 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	83,910.82
转换费收入	228.05
合计	84,138.87

**6.4.7.17 信用减值损失**

本基金本报告期内无信用减值损失。

**6.4.7.18 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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,454.04
指数使用费	20,000.00
合计	110,234.49

#### 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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
第一创业证券股份有限公司	基金管理人的股东、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	成交金额	占当期股票

		成交总额的比例		成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	1,234,694,122.56	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 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	3,552,705.29	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	1,100,000.00	100.00%	-	-

#### 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	521,290.88	100.00%	279,621.30	100.00%
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	555,356.34	174,092.89
其中：支付销售机构的客户维护费	147,350.48	72,263.53

注：支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.8\% / \text{当年天数}。$$

**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	104,129.36	32,642.46

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	创金合信中证 1000 增强 A	创金合信中证 1000 增强 C	合计
创金合信直销	-	44,858.83	44,858.83
第一创业证券	-	688.30	688.30
合计	-	45,547.13	45,547.13
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		
	创金合信中证 1000 增强 A	创金合信中证 1000 增强 C	合计
创金合信直销	-	21.99	21.99
第一创业证券	-	27.95	27.95
合计	-	49.94	49.94

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 0.2% 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 × 0.2% / 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

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本报告期末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
中国农业银行股份有限公司	6,036,845.88	29,566.66	2,389,329.86	6,476.85

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股未上市	38.46	38.46	1,372	52,767.12	52,767.12	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月内（含）	新股未上市	33.65	33.65	1,465	49,297.25	49,297.25	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股未上市	3.82	3.82	10,509	40,144.38	40,144.38	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	41.52	41.52	815	33,838.80	33,838.80	-
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	19.18	32.07	364	6,981.52	11,673.48	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	3.80	6.39	1,708	6,490.40	10,914.12	-
301298	东利机械	2022 年 5 月 27 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	12.68	20.83	492	6,238.56	10,248.36	-
301120	新特电气	2022 年 4 月 11 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	13.73	15.49	647	8,883.31	10,022.03	-
301201	诚达药业	2022 年 1 月 12 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	72.69	71.54	131	9,522.39	9,371.74	-
301160	翔楼新材	2022 年	1-6 个	创业板	31.56	37.66	242	7,637.52	9,113.72	-



		5月25日	月(含)	打新限售						
301130	西点药业	2022年2月16日	1-6个月(含)	创业板打新限售	22.55	37.70	224	5,051.20	8,444.80	-
301112	信邦智能	2022年6月20日	1-6个月(含)	创业板打新限售	27.53	45.04	186	5,120.58	8,377.44	-
301263	泰恩康	2022年3月22日	1-6个月(含)	创业板打新限售	19.93	31.38	253	5,042.29	7,939.14	-
301125	腾亚精工	2022年5月27日	1-6个月(含)	创业板打新限售	22.49	27.42	284	6,387.16	7,787.28	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	1-6个月(含)	创业板打新限售	17.27	14.83	514	8,876.78	7,622.62	-
301163	宏德股份	2022年4月11日	1-6个月(含)	创业板打新限售	26.27	32.33	235	6,173.45	7,597.55	-
301256	华融化学	2022年3月14日	1-6个月(含)	创业板打新限售	8.05	10.08	753	6,061.65	7,590.24	-
301187	欧圣电气	2022年4月13日	1-6个月(含)	创业板打新限售	21.33	22.54	322	6,868.26	7,257.88	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	1-6个月(含)	创业板打新限售	15.37	15.99	395	6,071.15	6,316.05	-
301268	铭利达	2022年3月29日	1-6个月(含)	创业板打新限售	28.50	34.87	174	4,959.00	6,067.38	-
301097	天益医疗	2022年3月25日	1-6个月(含)	创业板打新限售	52.37	47.83	125	6,546.25	5,978.75	-
301153	中科江南	2022年5月10日	1-6个月(含)	创业板打新限售	33.68	43.98	135	4,546.80	5,937.30	-
301139	元道通信	2022年6月30日	1-6个月(含)	创业板打新限售	38.46	38.46	153	5,884.38	5,884.38	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	1-6个月(含)	创业板打新限售	56.88	56.42	101	5,744.88	5,698.42	-

301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	33.65	33.65	163	5,484.95	5,484.95	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	35.68	29.84	178	6,351.04	5,311.52	-
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	39.07	29.87	171	6,680.97	5,107.77	-
301123	奕东电子	2022 年 1 月 14 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	37.23	25.39	201	7,483.23	5,103.39	-
301236	软通动力	2022 年 3 月 8 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	48.59	31.38	156	7,579.52	4,895.28	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	76.56	51.92	92	7,043.52	4,776.64	-
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	33.98	28.96	160	5,436.80	4,633.60	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	39.88	31.09	147	5,862.36	4,570.23	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	3.82	3.82	1,168	4,461.76	4,461.76	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	97.43	87.82	50	4,871.44	4,391.00	-
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	108.0 1	82.76	53	5,724.60	4,386.28	-
301148	嘉戎技术	2022 年 4 月 14 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	38.39	23.90	174	6,679.86	4,158.60	-
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	40.25	30.59	132	5,313.00	4,037.88	-
301151	冠龙节能	2022 年 3 月 30 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	30.82	21.46	183	5,640.06	3,927.18	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	41.52	41.52	91	3,778.32	3,778.32	-

		日		售						
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	55.57	30.03	123	6,835.11	3,693.69	-
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	63.10	39.85	81	5,111.10	3,227.85	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	64.08	37.52	68	4,357.44	2,551.36	-

#### 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代 码	证券名称	成功认 购日	受限期	流通受 限类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 (单 位:张)	期末成本总 额	期末估值总 额	备 注
118008	海优转债	2022 年 6 月 23 日	1 个月 内(含)	新债未 上市	100.0 0	100.0 1	180	18,000.00	18,000.95	-

#### 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农业银行股份有限公司，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	1,506,722.70	1,304,391.20
合计	1,506,722.70	1,304,391.20

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	-	123,000.00
AAA 以下	18,000.95	-
未评级	-	-
合计	18,000.95	123,000.00

未评级债券包括国债、政策性金融债。

### 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综合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见本报告“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	6,036,845.88	-	-	-	6,036,845.88
结算备付金	2,193,155.38	-	-	-	2,193,155.38
存出保证金	430,951.20	-	-	-	430,951.20
交易性金融资产	1,506,722.70	-	18,000.95	115,340,305.12	116,865,028.77
应收申购款	-	-	-	683,402.41	683,402.41
应收清算款	-	-	-	210,458.61	210,458.61
资产总计	10,167,675.16	-	18,000.95	116,234,166.14	126,419,842.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	693,565.47	693,565.47
应付管理人报酬	-	-	-	80,975.06	80,975.06
应付托管费	-	-	-	15,182.85	15,182.85
应付销售服务费	-	-	-	14,080.30	14,080.30
应交税费	-	-	-	0.22	0.22

应付清算款	-	-	-	309,986.25	309,986.25
其他负债	-	-	-	408,021.19	408,021.19
负债总计	-	-	-	1,521,811.34	1,521,811.34
利率敏感度缺口	10,167,675.16	-	18,000.95	114,712,354.80	124,898,030.91
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	12,464,353.50	-	-	-	12,464,353.50
结算备付金	5,023,852.70	-	-	-	5,023,852.70
存出保证金	944,177.69	-	-	-	944,177.69
交易性金融资产	1,304,391.20	-	123,000.00	203,747,068.29	205,174,459.49
应收利息	-	-	-	26,947.23	26,947.23
应收申购款	-	-	-	1,178,859.89	1,178,859.89
应收证券清算款	-	-	-	451,483.07	451,483.07
资产总计	19,736,775.09	-	123,000.00	205,404,358.48	225,264,133.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	532,659.20	532,659.20
应付管理人报酬	-	-	-	150,379.08	150,379.08
应付托管费	-	-	-	28,196.06	28,196.06
应付销售服务费	-	-	-	27,630.01	27,630.01
应付交易费用	-	-	-	478,989.78	478,989.78
应付证券清算款	-	-	-	494,030.13	494,030.13
其他负债	-	-	-	196,335.80	196,335.80
负债总计	-	-	-	1,908,220.06	1,908,220.06
利率敏感度缺口	19,736,775.09	-	123,000.00	203,496,138.42	223,355,913.51

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	-1,994.75	-996.27
2.市场利率平行下降相关风险变量的变动 25 个基点	2,002.31	999.47	

#### 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	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	115,340,305.12	92.35	203,747,068.29	91.22
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	115,340,305.12	92.35	203,747,068.29	91.22

#### 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%	5,693,197.46	9,626,030.24
	2.业绩比较基准下降 5%	-5,693,197.46	-9,626,030.24

#### 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	114,914,112.17
第二层次	1,720,380.61
第三层次	230,535.99
合计	116,865,028.77

##### 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 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	115,340,305.12	91.24
	其中：股票	115,340,305.12	91.24
2	固定收益投资	1,524,723.65	1.21
	其中：债券	1,524,723.65	1.21
	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	8,230,001.26	6.51
7	其他资产	1,324,812.22	1.05
8	合计	126,419,842.25	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 期末指数投资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	2,482,631.00	1.99
C	制造业	74,168,409.42	59.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,537,580.20	2.03
E	建筑业	995,730.00	0.80
F	批发和零售业	1,649,280.50	1.32
G	交通运输、仓储和邮政业	2,892,150.74	2.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,768,050.13	8.62
J	金融业	1,854,763.80	1.49
K	房地产业	801,450.00	0.64
L	租赁和商务服务业	2,553,037.62	2.04
M	科学研究和技术服务业	238,253.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	1,035,454.80	0.83
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	171,738.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	102,148,529.21	81.79

### 7.2.2 期末积极投资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	9,645,719.64	7.72
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	7,939.14	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,441,585.96	1.95
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	356,047.23	0.29
M	科学研究和技术服务业	10,914.12	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	633,433.62	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	54,782.20	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	41,354.00	0.03
	合计	13,191,775.91	10.56

### 7.2.3 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资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	002405	四维图新	130,100	1,960,607.00	1.57
2	002850	科达利	11,100	1,764,900.00	1.41

3	601677	明泰铝业	73,405	1,747,039.00	1.40
4	002472	双环传动	53,800	1,712,992.00	1.37
5	002597	金禾实业	37,900	1,642,207.00	1.31
6	002585	双星新材	89,600	1,620,864.00	1.30
7	000423	东阿阿胶	43,600	1,611,020.00	1.29
8	603713	密尔克卫	11,735	1,604,174.50	1.28
9	300777	中简科技	33,100	1,595,420.00	1.28
10	300767	震安科技	26,900	1,565,042.00	1.25
11	002176	江特电机	62,000	1,552,480.00	1.24
12	300457	赢合科技	54,600	1,551,186.00	1.24
13	002436	兴森科技	136,438	1,537,656.26	1.23
14	688388	嘉元科技	17,971	1,525,198.77	1.22
15	601222	林洋能源	182,600	1,524,710.00	1.22
16	300593	新雷能	36,602	1,519,349.02	1.22
17	300395	菲利华	33,300	1,498,500.00	1.20
18	002484	江海股份	64,200	1,498,428.00	1.20
19	300662	科锐国际	28,700	1,489,243.00	1.19
20	002645	华宏科技	68,000	1,483,760.00	1.19
21	300748	金力永磁	40,100	1,475,680.00	1.18
22	688278	特宝生物	49,649	1,463,652.52	1.17
23	600850	电科数字	77,760	1,451,001.60	1.16
24	300855	图南股份	32,900	1,374,891.00	1.10
25	002741	光华科技	68,216	1,359,544.88	1.09
26	300604	长川科技	29,300	1,322,895.00	1.06
27	603610	麒盛科技	91,736	1,239,353.36	0.99
28	603236	移远通信	9,220	1,232,345.20	0.99
29	000811	冰轮环境	117,500	1,225,525.00	0.98
30	000567	海德股份	80,730	1,194,804.00	0.96
31	688166	博瑞医药	48,701	1,176,129.15	0.94
32	603979	金诚信	60,300	1,164,393.00	0.93
33	600873	梅花生物	103,200	1,164,096.00	0.93
34	002929	润建股份	30,800	1,105,720.00	0.89
35	300768	迪普科技	67,850	1,095,777.50	0.88
36	688508	芯朋微	13,100	975,950.00	0.78
37	002091	江苏国泰	90,054	968,080.50	0.78
38	300762	上海瀚讯	85,740	954,286.20	0.76
39	000683	远兴能源	89,100	936,441.00	0.75
40	688516	奥特维	3,478	928,452.10	0.74
41	603128	华贸物流	91,680	919,550.40	0.74
42	000875	吉电股份	131,900	916,705.00	0.73
43	300682	朗新科技	35,600	896,764.00	0.72
44	600452	涪陵电力	74,820	868,660.20	0.70
45	000989	九芝堂	95,200	866,320.00	0.69

46	300373	扬杰科技	12,100	862,125.00	0.69
47	300035	中科电气	29,200	816,140.00	0.65
48	600641	万业企业	41,100	801,450.00	0.64
49	000682	东方电子	119,100	793,206.00	0.64
50	300055	万邦达	83,800	784,368.00	0.63
51	002738	中矿资源	7,900	731,619.00	0.59
52	002274	华昌化工	74,600	726,604.00	0.58
53	002344	海宁皮城	146,200	682,754.00	0.55
54	300151	昌红科技	35,800	676,620.00	0.54
55	300709	精研科技	22,816	675,125.44	0.54
56	688200	华峰测控	1,893	674,665.20	0.54
57	002541	鸿路钢构	18,730	625,582.00	0.50
58	601208	东材科技	48,400	625,328.00	0.50
59	300171	东富龙	18,400	623,944.00	0.50
60	002258	利尔化学	25,580	604,199.60	0.48
61	300369	绿盟科技	55,900	588,068.00	0.47
62	300765	新诺威	41,200	587,924.00	0.47
63	600363	联创光电	25,800	579,468.00	0.46
64	688399	硕世生物	4,986	568,503.72	0.46
65	603606	东方电缆	7,200	551,520.00	0.44
66	688116	天奈科技	3,226	546,742.48	0.44
67	002643	万润股份	26,100	544,446.00	0.44
68	603306	华懋科技	16,000	542,400.00	0.43
69	300083	创世纪	45,400	522,100.00	0.42
70	002192	融捷股份	3,100	476,470.00	0.38
71	603105	芯能科技	42,300	472,914.00	0.38
72	300034	钢研高纳	10,800	455,544.00	0.36
73	601619	嘉泽新能	107,200	439,520.00	0.35
74	300829	金丹科技	13,300	431,186.00	0.35
75	688680	海优新材	2,139	425,019.30	0.34
76	002023	海特高新	41,300	422,499.00	0.34
77	600389	江山股份	5,900	358,307.00	0.29
78	002724	海洋王	28,300	351,769.00	0.28
79	300857	协创数据	17,000	348,330.00	0.28
80	600114	东睦股份	43,400	346,332.00	0.28
81	688301	奕瑞科技	732	346,265.28	0.28
82	002025	航天电器	4,700	328,154.00	0.26
83	603301	振德医疗	7,800	327,990.00	0.26
84	600812	华北制药	48,500	325,920.00	0.26
85	002573	清新环境	55,800	324,198.00	0.26
86	688586	江航装备	12,069	321,156.09	0.26
87	688608	恒玄科技	2,302	316,755.20	0.25
88	000035	中国天楹	58,600	307,650.00	0.25

89	600711	盛屯矿业	39,200	304,192.00	0.24
90	603596	伯特利	3,600	288,648.00	0.23
91	600057	厦门象屿	32,278	283,723.62	0.23
92	600110	诺德股份	23,800	276,556.00	0.22
93	601666	平煤股份	20,100	273,159.00	0.22
94	000688	国城矿业	16,300	255,747.00	0.20
95	688139	海尔生物	3,328	242,378.24	0.19
96	300054	鼎龙股份	11,300	239,221.00	0.19
97	300487	蓝晓科技	3,900	237,900.00	0.19
98	300109	新开源	14,400	235,008.00	0.19
99	600872	中炬高新	6,700	231,887.00	0.19
100	688001	华兴源创	8,502	231,424.44	0.19
101	300502	新易盛	8,800	230,560.00	0.18
102	300068	南都电源	14,900	228,566.00	0.18
103	600285	羚锐制药	18,000	225,540.00	0.18
104	002558	巨人网络	24,600	225,090.00	0.18
105	603678	火炬电子	4,800	224,688.00	0.18
106	300776	帝尔激光	1,300	224,640.00	0.18
107	600063	皖维高新	29,400	222,852.00	0.18
108	300327	中颖电子	4,400	219,164.00	0.18
109	002839	张家港行	40,420	213,821.80	0.17
110	600179	安通控股	55,600	212,392.00	0.17
111	300398	飞凯材料	9,200	210,312.00	0.17
112	000848	承德露露	21,500	208,120.00	0.17
113	002151	北斗星通	6,300	198,828.00	0.16
114	002043	兔宝宝	17,100	198,360.00	0.16
115	600105	永鼎股份	53,100	191,691.00	0.15
116	002389	航天彩虹	10,400	190,944.00	0.15
117	603599	广信股份	6,780	190,857.00	0.15
118	688066	航天宏图	2,398	188,962.40	0.15
119	002318	久立特材	11,800	188,682.00	0.15
120	600273	嘉化能源	16,900	183,534.00	0.15
121	603129	春风动力	1,600	181,952.00	0.15
122	300633	开立医疗	6,000	180,180.00	0.14
123	603588	高能环境	15,260	175,947.80	0.14
124	002960	青鸟消防	6,400	175,296.00	0.14
125	300747	锐科激光	4,500	175,050.00	0.14
126	002807	江阴银行	37,700	170,781.00	0.14
127	605123	派克新材	1,200	168,864.00	0.14
128	002544	普天科技	7,300	166,075.00	0.13
129	002649	博彦科技	15,800	161,318.00	0.13
130	300101	振芯科技	7,700	158,928.00	0.13
131	300627	华测导航	4,600	158,194.00	0.13

132	603565	中谷物流	9,832	156,033.84	0.12
133	603520	司太立	5,440	152,972.80	0.12
134	300666	江丰电子	2,500	152,500.00	0.12
135	600456	宝钛股份	2,500	148,500.00	0.12
136	002335	科华数据	4,800	148,080.00	0.12
137	600458	时代新材	15,000	147,000.00	0.12
138	600908	无锡银行	25,900	145,817.00	0.12
139	300065	海兰信	11,000	144,100.00	0.12
140	603098	森特股份	3,900	139,854.00	0.11
141	300379	东方通	7,900	139,119.00	0.11
142	002254	泰和新材	8,300	139,025.00	0.11
143	300638	广和通	5,200	137,748.00	0.11
144	600821	金开新能	21,300	137,172.00	0.11
145	300219	鸿利智汇	15,700	136,590.00	0.11
146	300568	星源材质	4,700	136,488.00	0.11
147	300696	爱乐达	3,100	136,245.00	0.11
148	600916	中国黄金	11,600	135,720.00	0.11
149	002332	仙琚制药	13,700	134,534.00	0.11
150	002810	山东赫达	3,600	131,004.00	0.10
151	603323	苏农银行	25,400	129,540.00	0.10
152	300726	宏达电子	2,100	128,457.00	0.10
153	600496	精工钢构	27,600	127,512.00	0.10
154	000917	电广传媒	23,500	124,785.00	0.10
155	600645	中源协和	6,400	124,608.00	0.10
156	300672	国科微	1,500	122,640.00	0.10
157	600993	马应龙	5,200	121,160.00	0.10
158	000034	神州数码	7,900	120,238.00	0.10
159	688339	亿华通	1,216	119,630.08	0.10
160	002759	天际股份	4,300	116,874.00	0.09
161	600682	南京新百	11,600	116,232.00	0.09
162	300674	宇信科技	7,400	116,032.00	0.09
163	688033	天宜上佳	5,454	115,842.96	0.09
164	301035	润丰股份	1,400	115,430.00	0.09
165	600877	声光电科	10,300	115,154.00	0.09
166	300133	华策影视	23,100	115,038.00	0.09
167	603018	华设集团	11,900	113,645.00	0.09
168	601369	陕鼓动力	11,700	112,320.00	0.09
169	002261	拓维信息	17,400	111,534.00	0.09
170	300394	天孚通信	4,100	110,987.00	0.09
171	600172	黄河旋风	11,700	102,024.00	0.08
172	300596	利安隆	2,300	101,453.00	0.08
173	002913	奥士康	3,200	101,280.00	0.08
174	600587	新华医疗	5,000	101,250.00	0.08

175	605168	三人行	900	97,317.00	0.08
176	300131	英唐智控	18,500	96,940.00	0.08
177	000935	四川双马	4,000	96,880.00	0.08
178	300755	华致酒行	2,200	96,470.00	0.08
179	688198	佰仁医疗	785	95,707.20	0.08
180	600211	西藏药业	2,100	87,171.00	0.07
181	300222	科大智能	10,800	87,048.00	0.07
182	603896	寿仙谷	2,230	86,479.40	0.07
183	600742	一汽富维	9,300	86,304.00	0.07
184	300355	蒙草生态	21,500	84,710.00	0.07
185	002190	成飞集成	3,100	84,320.00	0.07
186	300226	上海钢联	3,700	83,805.00	0.07
187	600691	阳煤化工	20,600	83,224.00	0.07
188	601011	宝泰隆	19,800	82,764.00	0.07
189	002283	天润工业	11,700	79,911.00	0.06
190	300525	博思软件	3,700	79,365.00	0.06
191	688158	优刻得	5,459	79,319.27	0.06
192	300382	斯莱克	5,000	78,350.00	0.06
193	301217	铜冠铜箔	5,140	77,984.08	0.06
194	000543	皖能电力	19,500	77,805.00	0.06
195	600391	航发科技	4,000	76,840.00	0.06
196	300409	道氏技术	2,900	75,342.00	0.06
197	002123	梦网科技	6,400	74,496.00	0.06
198	601567	三星医疗	5,600	74,368.00	0.06
199	002556	辉隆股份	6,300	73,710.00	0.06
200	002777	久远银海	5,050	72,619.00	0.06
201	000801	四川九洲	10,600	72,186.00	0.06
202	603959	百利科技	5,900	71,508.00	0.06
203	002545	东方铁塔	6,100	69,418.00	0.06
204	002773	康弘药业	4,600	68,724.00	0.06
205	688233	神工股份	1,221	68,620.20	0.05
206	300702	天宇股份	2,400	68,184.00	0.05
207	300423	昇辉科技	6,100	66,002.00	0.05
208	300123	亚光科技	10,500	65,100.00	0.05
209	002063	远光软件	9,200	64,676.00	0.05
210	603920	世运电路	3,700	64,010.00	0.05
211	300378	鼎捷软件	3,600	59,292.00	0.05
212	300045	华力创通	7,700	59,059.00	0.05
213	300867	圣元环保	2,800	58,576.00	0.05
214	600590	泰豪科技	8,800	57,464.00	0.05
215	300548	博创科技	3,200	57,024.00	0.05
216	300322	硕贝德	6,500	56,940.00	0.05
217	300770	新媒股份	1,500	56,745.00	0.05



218	600715	文投控股	22,500	56,700.00	0.05
219	688699	明微电子	516	55,965.36	0.04
220	601330	绿色动力	7,000	54,810.00	0.04
221	002042	华孚时尚	14,400	54,432.00	0.04
222	002267	陕天然气	7,600	53,124.00	0.04
223	603222	济民医疗	4,260	46,860.00	0.04
224	605090	九丰能源	2,200	44,594.00	0.04
225	301031	中熔电气	300	43,014.00	0.03
226	600378	昊华科技	1,100	42,372.00	0.03
227	300127	银河磁体	2,200	41,998.00	0.03
228	600710	苏美达	7,100	41,890.00	0.03
229	600055	万东医疗	1,700	41,361.00	0.03
230	300326	凯利泰	4,900	40,474.00	0.03
231	300684	中石科技	2,900	40,455.00	0.03
232	000902	新洋丰	2,300	38,847.00	0.03
233	300439	美康生物	3,100	37,634.00	0.03
234	605009	豪悦护理	900	34,992.00	0.03
235	688788	科思科技	727	32,867.67	0.03
236	300634	彩讯股份	2,500	31,750.00	0.03
237	688390	固德威	99	30,987.99	0.02
238	601882	海天精工	1,500	30,915.00	0.02
239	000901	航天科技	3,400	30,906.00	0.02
240	300815	玉禾田	1,700	29,563.00	0.02
241	002498	汉缆股份	6,600	28,050.00	0.02
242	601311	骆驼股份	2,200	24,486.00	0.02
243	603013	亚普股份	1,600	22,352.00	0.02
244	688020	方邦股份	558	21,756.42	0.02
245	600459	贵研铂业	1,100	19,921.00	0.02
246	000676	智度股份	1,800	10,008.00	0.01
247	601918	新集能源	1,700	8,670.00	0.01
248	300725	药石科技	82	8,117.18	0.01
249	688366	昊海生科	53	5,606.34	0.00
250	603279	景津装备	140	4,341.40	0.00
251	300470	中密控股	100	3,529.00	0.00
252	688085	三友医疗	161	3,485.65	0.00
253	603995	甬金股份	100	3,366.00	0.00
254	688050	爱博医疗	3	672.60	0.00

### 7.3.2 期末积极投资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	600563	法拉电子	7,200	1,477,152.00	1.18
2	600131	国网信通	84,400	1,135,180.00	0.91
3	603392	万泰生物	6,400	993,920.00	0.80
4	688159	有方科技	44,274	960,745.80	0.77
5	300656	民德电子	24,645	868,243.35	0.70
6	688590	新致软件	49,242	705,637.86	0.56
7	000977	浪潮信息	24,000	635,520.00	0.51
8	600141	兴发集团	14,400	633,456.00	0.51
9	300614	百川畅银	22,500	566,100.00	0.45
10	002452	长高电新	73,300	475,717.00	0.38
11	300950	德固特	27,750	452,325.00	0.36
12	688613	奥精医疗	14,050	434,707.00	0.35
13	603613	国联股份	4,809	426,077.40	0.34
14	603822	嘉澳环保	8,900	416,431.00	0.33
15	002935	天奥电子	16,000	364,960.00	0.29
16	603300	华铁应急	44,100	351,477.00	0.28
17	688330	宏力达	3,324	285,830.76	0.23
18	300363	博腾股份	2,800	218,372.00	0.17
19	688517	金冠电气	15,998	186,216.72	0.15
20	603867	新化股份	5,400	183,438.00	0.15
21	002003	伟星股份	16,100	152,950.00	0.12
22	603045	福达合金	6,200	97,402.00	0.08
23	300275	梅安森	7,300	96,871.00	0.08
24	603758	秦安股份	7,800	93,132.00	0.07
25	300833	浩洋股份	1,000	87,160.00	0.07
26	688575	亚辉龙	4,016	84,014.72	0.07
27	300661	圣邦股份	350	63,707.00	0.05
28	603081	大丰实业	5,300	59,095.00	0.05
29	301139	元道通信	1,525	58,651.50	0.05
30	301239	普瑞眼科	1,628	54,782.20	0.04
31	301123	奕东电子	2,001	52,173.39	0.04
32	688357	建龙微纳	441	49,586.04	0.04
33	301175	中科环保	11,677	44,606.14	0.04
34	600673	东阳光	4,600	41,354.00	0.03
35	301233	盛帮股份	906	37,617.12	0.03
36	300834	星辉环材	1,227	37,100.73	0.03
37	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.03
38	300218	安利股份	1,500	21,405.00	0.02
39	301201	诚达药业	209	15,081.34	0.01
40	000803	北清环能	900	14,076.00	0.01
41	301116	益客食品	664	13,615.02	0.01
42	301238	瑞泰新材	364	11,673.48	0.01
43	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01

44	301215	中汽股份	1,708	10,914.12	0.01
45	301298	东利机械	492	10,248.36	0.01
46	301120	新特电气	647	10,022.03	0.01
47	301160	翔楼新材	242	9,113.72	0.01
48	301130	西点药业	224	8,444.80	0.01
49	301112	信邦智能	186	8,377.44	0.01
50	301263	泰恩康	253	7,939.14	0.01
51	301125	腾亚精工	284	7,787.28	0.01
52	301163	宏德股份	235	7,597.55	0.01
53	301256	华融化学	753	7,590.24	0.01
54	301187	欧圣电气	322	7,257.88	0.01
55	301137	哈焊华通	395	6,316.05	0.01
56	301268	铭利达	174	6,067.38	0.00
57	301097	天益医疗	125	5,978.75	0.00
58	301153	中科江南	135	5,937.30	0.00
59	301207	华兰疫苗	101	5,698.42	0.00
60	301216	万凯新材	178	5,311.52	0.00
61	301248	杰创智能	171	5,107.77	0.00
62	301236	软通动力	156	4,895.28	0.00
63	301200	大族数控	92	4,776.64	0.00
64	301222	浙江恒威	160	4,633.60	0.00
65	301102	兆讯传媒	147	4,570.23	0.00
66	300854	中兰环保	226	4,492.88	0.00
67	301219	腾远钴业	50	4,391.00	0.00
68	301150	中一科技	53	4,386.28	0.00
69	301148	嘉戎技术	174	4,158.60	0.00
70	301181	标榜股份	132	4,037.88	0.00
71	301151	冠龙节能	183	3,927.18	0.00
72	301110	青木股份	81	3,227.85	0.00
73	301196	唯科科技	76	2,854.24	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688388	嘉元科技	4,288,234.72	1.92
2	603610	麒盛科技	3,882,123.00	1.74
3	601677	明泰铝业	3,878,731.46	1.74
4	000423	东阿阿胶	3,834,235.00	1.72
5	603236	移远通信	3,266,712.00	1.46
6	600873	梅花生物	3,103,786.00	1.39

7	002258	利尔化学	3,038,216.00	1.36
8	002176	江特电机	3,017,255.68	1.35
9	002850	科达利	3,000,182.00	1.34
10	688508	芯朋微	2,944,062.64	1.32
11	603128	华贸物流	2,934,256.40	1.31
12	300682	朗新科技	2,907,203.00	1.30
13	300604	长川科技	2,872,587.00	1.29
14	300750	宁德时代	2,858,029.40	1.28
15	300458	全志科技	2,838,049.10	1.27
16	603659	璞泰来	2,770,362.00	1.24
17	002312	川发龙蟒	2,687,419.00	1.20
18	688301	奕瑞科技	2,672,211.86	1.20
19	002741	光华科技	2,617,498.20	1.17
20	603713	密尔克卫	2,584,393.15	1.16

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	300769	德方纳米	4,597,693.58	2.06
2	688388	嘉元科技	4,494,327.56	2.01
3	300073	当升科技	3,723,939.80	1.67
4	600499	科达制造	3,606,445.00	1.61
5	300568	星源材质	3,562,738.86	1.60
6	300861	美畅股份	3,530,788.00	1.58
7	600123	兰花科创	3,483,572.00	1.56
8	300390	天华超净	3,470,703.20	1.55
9	688122	西部超导	3,408,879.55	1.53
10	300750	宁德时代	3,347,313.00	1.50
11	300604	长川科技	3,225,902.80	1.44
12	000762	西藏矿业	3,185,935.00	1.43
13	002625	光启技术	3,178,772.00	1.42
14	002850	科达利	3,150,769.00	1.41
15	002738	中矿资源	3,071,608.00	1.38
16	002240	盛新锂能	2,948,840.00	1.32
17	300458	全志科技	2,943,018.50	1.32
18	002312	川发龙蟒	2,925,969.00	1.31
19	002497	雅化集团	2,924,070.00	1.31
20	603659	璞泰来	2,857,442.00	1.28

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	581,930,811.20
卖出股票收入（成交）总额	656,200,429.96

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	1,506,722.70	1.21
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）	18,000.95	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,524,723.65	1.22

## 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	14,900	1,506,722.70	1.21
2	118008	海优转债	180	18,000.95	0.01

## 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

本基金投资于股指期货，均以套期保值为目的。本报告期进行了少量的多头套保。

## 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

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

### 7.12.2

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### 7.12.3 报告期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	430,951.20
2	应收清算款	210,458.61
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	683,402.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,324,812.22

### 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

#### 7.12.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信中证 1000 增强 A	4,180	5,521.58	48,322.11	0.21%	23,031,896.72	99.79%
创金合信中证 1000 增强 C	5,358	9,902.87	24,646,163.87	46.45%	28,413,387.17	53.55%
合计	9,380	8,117.25	24,694,485.98	32.43%	51,445,283.89	67.57%

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	创金合信中证 1000 增强 A	93,994.57	0.41%
	创金合信中证 1000 增强 C	18,936.66	0.04%
	合计	112,931.23	0.15%

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	创金合信中证 1000 增强 A	0~10
	创金合信中证 1000 增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信中证 1000 增强 A	0
	创金合信中证 1000 增强 C	0
	合计	0

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	3,099.34	0.00	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	3,099.34	0.00	0.00	0.00	-

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信中证 1000 增强 A	创金合信中证 1000 增强 C
基金合同生效日(2016 年 12 月 22 日)基金份额总额	5,023,647.81	5,092,069.61
本报告期期初基金份额总额	31,827,172.69	95,599,317.12
本报告期基金总申购份额	9,907,830.07	18,162,596.69
减：报告期基金总赎回份额	18,654,783.93	60,702,362.77
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	23,080,218.83	53,059,551.04

### § 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。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

## 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	
金元证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	3	1,234,694,122.56	100.00%	521,290.88	100.00%	-

注：交易单元的选择标准和程序：

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

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

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

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

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

本基金报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
金元证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	3,552,705.29	100.00%	1,100,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信基金管理有限公司 旗下基金 2021 年度第四季度报告提示性公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
2	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 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
3	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 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	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 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部分基金估值调整情况的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-30
6	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、上海证券报、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

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、《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 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