

# 创金合信动态平衡混合型发起式证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 年 09 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：广发证券股份有限公司

送出日期：2022 年 10 月 25 日

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示.....                                      | 2  |
| §2 基金产品概况.....                                    | 2  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现.....                             | 4  |
| 3.1 主要财务指标.....                                   | 4  |
| 3.2 基金净值表现.....                                   | 4  |
| §4 管理人报告.....                                     | 5  |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....                          | 5  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....                   | 6  |
| 4.3 公平交易专项说明.....                                 | 6  |
| 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析.....                          | 6  |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现.....                              | 7  |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....                    | 7  |
| §5 投资组合报告.....                                    | 7  |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况.....                             | 7  |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                         | 8  |
| 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细.....         | 8  |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....                       | 9  |
| 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....         | 9  |
| 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明<br>细..... | 9  |
| 5.7 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.....        | 10 |
| 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....         | 10 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....                     | 10 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....                    | 10 |
| 5.11 投资组合报告附注.....                                | 10 |
| §6 开放式基金份额变动.....                                 | 11 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....                        | 11 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....                         | 11 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....                     | 12 |
| §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况.....                       | 12 |
| §9 影响投资者决策的其他重要信息.....                            | 12 |
| 9.1 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.....           | 12 |
| 9.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                           | 13 |
| §10 备查文件目录.....                                   | 13 |
| 10.1 备查文件目录.....                                  | 13 |
| 10.2 存放地点.....                                    | 13 |
| 10.3 查阅方式.....                                    | 13 |

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 创金合信动态平衡混合发起   |
| 基金主代码      | 015200   |
| 交易代码       | 015200   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2022 年 5 月 6 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 36,331,834.88 份  |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略       | <p>本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，将围绕资产配置比例、行业配置比例以及个股投资比例进行动态优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。在股票、债券、货币等资产的配置比例上，本基金采用相对平衡的配置策略，股票投资占基金资产的比例上限为 70%、下限为 30%。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将采取定量与定性相结合的方法，并通过“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，形成对大类资产预期收益及风险的判断，持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。具体策略方面：（1）立足于宏观经济基本面和细分资产的研究，把握资产内在关系并进行优选配置，将资产定价核心宏观因素、估值和基本面信息相结合，寻找并坚定持有当前环境下的优秀资产；（2）综合评估股票、债券、</p> |

|             |   |                |
|-------------|---|----------------|
|             | <p>货币等资产类别的风险收益特征，对各类资产在经济周期不同阶段呈现的规律性进行分析总结；（3）充分结合宏观经济周期及运行趋势、资金供求状况、细分资产估值水平、市场情绪等，分析并形成对细分资产走势的模拟和预期，寻找最优的配置结构和再平衡机制。</p> <p>在资产配置中，本基金主要考虑：（1）宏观经济指标，包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据、金融政策等，以判断经济波动对市场的影响；（2）微观经济指标，包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期；（3）市场方面指标，包括股票及债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金供求关系及其变化等；（4）政策因素，与证券市场密切相关的各种政策出台对市场的影响等。</p> <p>2、股票投资策略：（1）行业选择策略。在行业选择方面，本基金综合考量行业发展趋势、行业景气度以及行业竞争格局及其变化，不定期动态调整本基金的行业配置比例。判断企业未来的投资价值须建立在对行业大趋势的深刻理解之上，企业价值的成长空间与其所处行业的发展趋势息息相关。本基金进行行业分析的重点在于判断行业的发展趋势和景气周期，厘清行业变革的动力，掌握行业竞争格局及其变化。（2）个股投资策略。本基金将主要遵循“自下而上”的分析框架，采用定性分析和定量分析相结合的方法，精选基本面向好，估值合理的上市公司股票构建股票组合并持续动态调整。（3）港股通标的股票投资策略。本基金将采用“自下而上”的个股精选策略，结合公司基本面、相关行业发展前景、香港市场资金面和投资者行为等因素，精选符合本基金投资目标的港股通标的股票。（4）存托凭证的投资策略。本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</p> <p>3、固定收益品种投资策略：（1）债券投资策略。（2）资产支持证券投资策略。（3）可转换债券及可交换债券投资策略。</p> <p>4、衍生产品投资策略：（1）股指期货、股票期权合约投资策略。（2）国债期货投资策略。（3）信用衍生品投资策略。</p> <p>5、其他。</p> |                |
| 业绩比较基准      | 中证 800 指数收益率*40%+中证港股通综合指数收益率*10%+人民币活期存款利率(税后)*50%   |                |
| 风险收益特征      | <p>本基金为混合型基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金除可投资 A 股外，还可通过港股通机制投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>  |                |
| 基金管理人       | 创金合信基金管理有限公司  |                |
| 基金托管人       | 广发证券股份有限公司  |                |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信动态平衡混合发起 A  | 创金合信动态平衡混合发起 C |

|                 |                 |                 |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 下属分级基金的交易代码     | 015200          | 015201          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 14,980,715.36 份 | 21,351,119.52 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期（2022 年 7 月 1 日—2022 年 9 月 30 日） |                   |
|----------------|-------------------------------------|-------------------|
|                | 创金合信动态平衡混合发起<br>A                   | 创金合信动态平衡混合发起<br>C |
| 1.本期已实现收益      | 245,389.34                          | 315,777.23        |
| 2.本期利润         | -427,343.39                         | -648,376.73       |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0326                             | -0.0359           |
| 4.期末基金资产净值     | 16,193,850.44                       | 23,033,865.36     |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0810                              | 1.0788            |

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

创金合信动态平衡混合发起 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -2.13%   | 0.86%       | -7.68%     | 0.45%         | 5.55%  | 0.41% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.10%    | 0.85%       | -2.60%     | 0.51%         | 10.70% | 0.34% |

创金合信动态平衡混合发起 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -2.26%   | 0.85%       | -7.68%     | 0.45%         | 5.42%  | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.88%    | 0.85%       | -2.60%     | 0.51%         | 10.48% | 0.34% |

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



注：1、本基金合同于 2022 年 5 月 6 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。

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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|------|--------|----|
|    |    | 任职日期        | 离任日期 |        |    |
|    |    |             |      |        |    |

|     |         |                |   |    |  |
|-----|---------|----------------|---|----|--|
| 王浩冰 | 本基金基金经理 | 2022 年 5 月 6 日 | - | 10 | 王浩冰先生，中国国籍，华盛顿大学硕士，2012 年 7 月加入中信证券股份有限公司研究部，任高级经理，2015 年 6 月加入华商基金管理有限公司研究发展部，任行业研究员，2017 年 9 月加入华泰资产管理有限公司权益投资部，任投资经理助理，2018 年 7 月加入中庚基金管理有限公司，历任投资研究部投资经理助理、投资顾问部任投资经理，2020 年 11 月加入创金合信基金管理有限公司风格策略投资部任研究员，现任基金经理。 |
|-----|---------|----------------|---|----|--|

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

2、证券从业年限的含义遵从《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合规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年三季度，A 股整体震荡下行。7 月初至 8 月中旬，由于楼市保交付压力较大使得市场对整体经济预期较低，且流动性处于相对充裕的状态；在此期间，高景气度的成长板块涨幅较大，如机械、电新、电子、通信、军工等；而与经济相关性较大的社服、食品饮料、建材等跌幅居前。8 月中旬之后，由于海外流动性收紧影响，成长板块下跌较多，如电新、电子、汽车、机械等；而价值板块则韧性较强，如煤炭、石化、银行、地产等。

2022 年三季度，我们仍秉持着独立、审慎、进取的投资理念，在宏观环境快速变化的市场中，配置估值合理的成长股。在操作上，我们重点配置于以下领域：1) 泛基建产业链：如 TMT 基础硬件、风电、医疗设备等板块；2) CPI 上行及消费复苏产业链：如食品饮料、农业、医药等板块。3) 景气成长领域：如军工、机械、计算机、电子等板块。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信动态平衡混合发起 A 基金份额净值为 1.0810 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.13%，同期业绩比较基准收益率为-7.68%；截至本报告期末创金合信动态平衡混合发起 C 基金份额净值为 1.0788 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.26%，同期业绩比较基准收益率为-7.68%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 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              | 25,625,425.32 | 63.98        |
|    | 其中：股票             | 25,625,425.32 | 63.98        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 12,112,222.41 | 30.24        |
|    | 其中：债券             | 12,112,222.41 | 30.24        |
|    | 资产支持证券            | -             | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -             | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,306,526.06  | 3.26         |



|   |      |               |        |
|---|------|---------------|--------|
| 8 | 其他资产 | 1,006,605.27  | 2.51   |
| 9 | 合计   | 40,050,779.06 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 216,848.53 元，占净值比为 0.55%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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              | 1,967,532.00  | 5.02         |
| C  | 制造业              | 21,222,475.79 | 54.10        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | 156,128.00    | 0.40         |
| 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  | 116,964.00    | 0.30         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,569,900.00  | 4.00         |
| 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          | 375,577.00    | 0.96         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 25,408,576.79 | 64.77        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|------------|--------------|
| 通讯业务 | 216,848.53 | 0.55         |
| 合计   | 216,848.53 | 0.55         |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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  | 000975 | 银泰黄金 | 150,000 | 1,929,000.00 | 4.92         |
| 2  | 603301 | 振德医疗 | 37,100  | 1,632,029.00 | 4.16         |
| 3  | 300416 | 苏试试验 | 52,330  | 1,569,900.00 | 4.00         |
| 4  | 300721 | 怡达股份 | 31,900  | 1,569,480.00 | 4.00         |
| 5  | 000938 | 紫光股份 | 77,000  | 1,221,220.00 | 3.11         |
| 6  | 300871 | 回盛生物 | 45,700  | 1,205,566.00 | 3.07         |
| 7  | 300101 | 振芯科技 | 44,600  | 1,155,140.00 | 2.94         |
| 8  | 002304 | 洋河股份 | 6,600   | 1,043,790.00 | 2.66         |
| 9  | 603369 | 今世缘  | 22,700  | 1,041,476.00 | 2.65         |
| 10 | 001215 | 千味央厨 | 20,400  | 1,040,196.00 | 2.65         |

#### 5.4 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      | 8,424,835.97  | 21.48        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | 3,687,386.44  | 9.40         |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 12,112,222.41 | 30.88        |

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 | 23,000 | 2,337,297.81 | 5.96         |
| 2  | 019629 | 20 国债 03 | 22,000 | 2,232,312.88 | 5.69         |
| 3  | 019674 | 22 国债 09 | 21,000 | 2,119,427.01 | 5.40         |
| 4  | 175279 | 20 中财 G2 | 18,000 | 1,881,373.32 | 4.80         |
| 5  | 152322 | 19 蓉产 01 | 17,000 | 1,806,013.12 | 4.60         |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

## 5.7 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。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额（元）     |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | 34,291.53 |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 2 | 应收清算款 | 89,186.46    |
| 3 | 应收股利  | -            |
| 4 | 应收利息  | -            |
| 5 | 应收申购款 | 883,127.28   |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 其他    | -            |
| 8 | 合计    | 1,006,605.27 |

#### 5.11.4 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。

#### 5.11.5 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 创金合信动态平衡混合发起<br>A | 创金合信动态平衡混合发起<br>C |
|-------------------------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 11,336,795.39     | 16,495,843.85     |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 6,487,678.37      | 12,470,760.27     |
| 减：报告期期间基金总赎回<br>份额            | 2,843,758.40      | 7,615,484.60      |
| 报告期期间基金拆分变动份<br>额（份额减少以“-”填列） | -                 | -                 |
| 报告期期末基金份额总额                   | 14,980,715.36     | 21,351,119.52     |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目                   | 创金合信动态平衡混合发起<br>A | 创金合信动态平衡混合发起<br>C |
|----------------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期初管理人持有的本<br>基金份额 | 5,001,575.31      | 5,001,575.00      |
| 报告期期间买入/申购总份额        | -                 | -                 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额        | -                 | -                 |
| 报告期期末管理人持有的本<br>基金份额 | 5,001,575.31      | 5,001,575.00      |
| 报告期期末持有的本基金份         | 33.39             | 23.43             |

|               |  |  |
|---------------|--|--|
| 额占基金总份额比例 (%) |  |  |
|---------------|--|--|

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的交易明细。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|------------------|---------------|------------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,003,150.31 | 27.53            | 10,003,150.31 | 27.53            | 36 个月      |
| 基金管理人高级管理人员 | 21,013.41     | 0.06             | 21,013.41     | 0.06             | 36 个月      |
| 基金经理等人员     | -             | -                | -             | -                | -          |
| 基金管理人股东     | -             | -                | -             | -                | -          |
| 其他          | -             | -                | -             | -                | -          |
| 合计          | 10,024,163.72 | 27.59            | 10,024,163.72 | 27.59            | 36 个月      |

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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              | 20220701 - 20220930     | 10,003,150.31 | 0.00 | 0.00 | 10,003,150.31 | 27.53% |

#### 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。

## 9.2 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。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”。截至 2022 年 9 月 30 日,创金合信基金共管理 89 只公募基金,公募管理规模 1039.08 亿元。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、《创金合信动态平衡混合型发起式证券投资基金基金合同》;
- 2、《创金合信动态平衡混合型发起式证券投资基金托管协议》;
- 3、创金合信动态平衡混合型发起式证券投资基金 2022 年 3 季度报告原文。

### 10.2 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

### 10.3 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 10 月 25 日