

创金合信竞争优势混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	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.....	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.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	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.....	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.....	41
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	50
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.....	50

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信竞争优势混合型证券投资基金	
基金简称	创金合信竞争优势混合	
基金主代码	011206	
交易代码	011206	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 25 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,433,027,798.59 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信竞争优势混合 A	创金合信竞争优势混合 C
下属分级基金的交易代码	011206	011207
报告期末下属分级基金的份 额总额	1,163,219,363.57 份	269,808,435.02 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极的主动管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<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。</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；（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>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	创金合信基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田
		朱萍

	联系电话	0755-82820166	021-31888888
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400-868-0666	95528
传真		0755-25832571	021-63602540
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）	上海市中山东一路12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	上海市博成路1388号浦银中心A栋
邮政编码		518052	200126
法定代表人		钱龙海	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

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、创金合信竞争优势混合 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日)
本期已实现收益	-12,845,311.21
本期利润	-6,092,866.18
加权平均基金份额本期利润	-0.0051
本期加权平均净值利润率	-0.67%
本期基金份额净值增长率	-0.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-305,064,205.13

期末可供分配基金份额利润	-0.2623
期末基金资产净值	858,155,158.44
期末基金份额净值	0.7377
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-26.23%

2、创金合信竞争优势混合 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,322,800.07
本期利润	-1,524,847.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0055
本期加权平均净值利润率	-0.73%
本期基金份额净值增长率	-0.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-72,687,446.69
期末可供分配基金份额利润	-0.2694
期末基金资产净值	197,120,988.33
期末基金份额净值	0.7306
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-26.94%

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

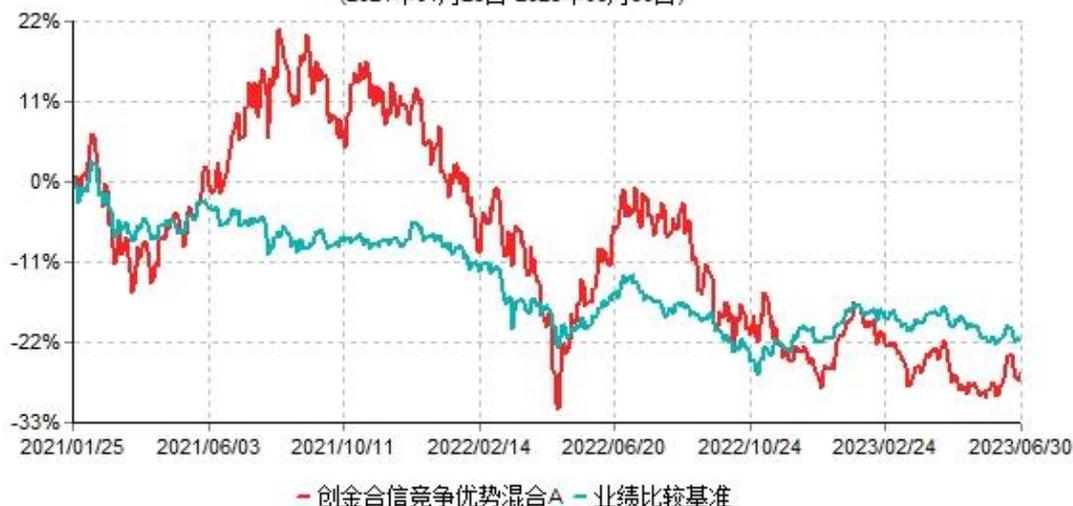
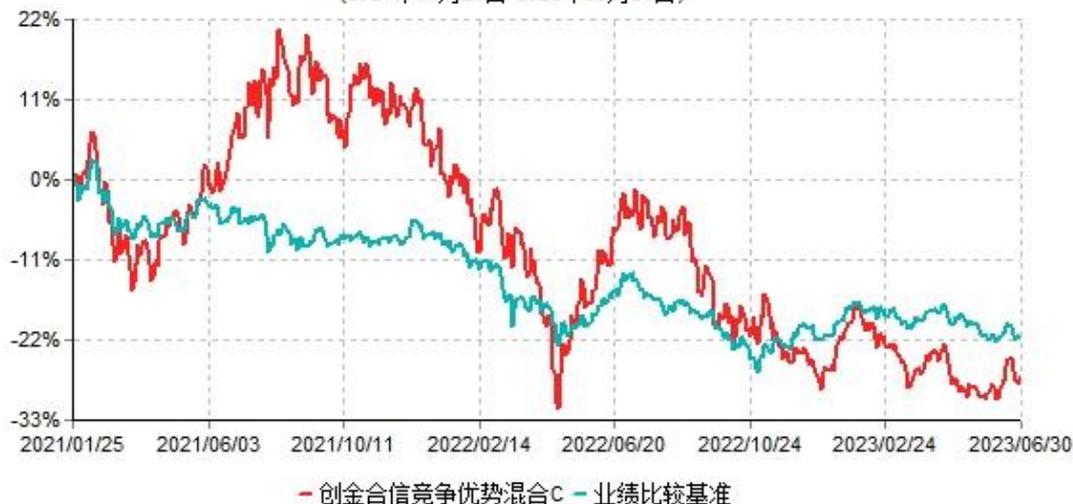
创金合信竞争优势混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.35%	1.19%	0.88%	0.61%	2.47%	0.58%
过去三个月	-2.43%	1.12%	-3.32%	0.58%	0.89%	0.54%
过去六个月	-0.81%	1.10%	-0.08%	0.59%	-0.73%	0.51%
过去一年	-23.84%	1.46%	-9.67%	0.69%	-14.17%	0.77%
自基金合同生效起至今	-26.23%	1.75%	-21.41%	0.81%	-4.82%	0.94%

创金合信竞争优势混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	3.32%	1.19%	0.88%	0.61%	2.44%	0.58%
过去三个月	-2.52%	1.12%	-3.32%	0.58%	0.80%	0.54%
过去六个月	-0.99%	1.10%	-0.08%	0.59%	-0.91%	0.51%
过去一年	-24.14%	1.46%	-9.67%	0.69%	-14.47%	0.77%
自基金合同 生效起至今	-26.94%	1.75%	-21.41%	0.81%	-5.53%	0.94%

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

创金合信竞争优势混合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
(2021年01月25日-2023年06月30日)创金合信竞争优势混合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
(2021年01月25日-2023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 26,096 万元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例 51.072961%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例 23.287094%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.47195%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.160791%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例 3.490956%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例 3.969957%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.910331%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.63596%。

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		
龚超	本基金基金经理	2023 年 4 月 7 日	-	11	龚超先生，中国国籍，上海财经大学硕士。2011 年 6 月加入浙商证券股份有限公司，任研究所化工行业研究员，2015 年 6 月加入创金合信基金管理有限公司，任研究部研究员、基金经理助理，2018 年 8 月加入第一创业证券股份有限公司，任资产管理运营部投资主办，2021 年 3 月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。
李葵	本基金基金经理	2023 年 4 月 7 日	-	11	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，任研究所地产行业研究员，2015 年 6 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任研究部研究员、基金经理助理，现任基金经理。
李游	本基金基金经理	2021 年 1 月 25 日	-	15	李游先生，中国国籍，中南财经政法大学硕士。2007 年 7 月加入五矿期货有限公司，任研究部研究员，2011 年 9 月加入华创证券有限责任公司，任研究所研究员，2013 年 6 月加入第一创业证券股

					份有限公司，任资产管理部研究员，2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，曾任研究部行业研究员，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

报告期内本基金减少了新能源的持仓，增加了 AI 的持仓，维持顺周期行业的持仓权重。报告期内新能源内部结构也有较大的调整，减少了光伏持仓，增加了电动车和户储的持仓；报告期内本基金进一步减少了光伏一体化组件的配置，主要因为一体化组件公司受益于前期硅料价格的大跌、海运费降低以及美国出货增加，单瓦盈利非常高，但随着多晶硅价格触底以及明年光伏装机增速的大概率放缓，以及竞争的加剧，今年年底至 2024 年，一体化组件公司单瓦盈利有环比向下的可能；报告期内本基金增加了电动车行业的配置，随着二

季度碳酸锂价格企稳，中游产业链开始补库存，叠加电动车销量增速加快，下半年行业有望迎来反弹；报告期内本基金增加了少量户用储能行业的持仓，经过半年的去库存，欧洲户储去库存接近尾声，行业可以开始密切关注。报告期内本基金维持顺周期行业的配置，若下半年出台刺激政策，顺周期行业有望迎来阶段性反弹的机会；顺周期行业持仓结构有较大变化，减少了建材、化工和有色的配置，增加了消费、金融和煤炭的配置；报告期内本基金增加了 AI 行业的配置，AI 产业趋势非常明确，市场很快达成了共识，只是结构上有所调整，减少了预期较为充分的算力端的配置，增加了包括机器人在内的应用端的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信竞争优势混合 A 基金份额净值为 0.7377 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.81%，同期业绩比较基准收益率为-0.08%；截至本报告期末创金合信竞争优势混合 C 基金份额净值为 0.7306 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.99%，同期业绩比较基准收益率为-0.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年 A 股市场整体表现不佳，主要因为国内经济复苏低于预期，市场的悲观预期不断加剧，而美国经济表现超预期，人民币贬值导致资金外流，A 股业绩和估值都承受了较大的压力。就具体行业来看，上半年市场还是有明显的结构性机会，主要是人工智能相关行业。展望下半年，预计上半年的利空因素会反转，7 月政治局会议明确了刺激经济的决心，预期在一系列举措之下，下半年国内经济复苏会明显强于上半年，而美国加息已经接近尾声，下半年人民币汇率会稳定回升，外资也大概率会净流入，下半年 A 股市场表现会明显强于上半年。行业配置上可以更加均衡，顺周期和新兴产业都有机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对创金合信竞争优势混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对创金合信竞争优势混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由创金合信基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：创金合信竞争优势混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	62,615,156.58	20,606,919.90
结算备付金		1,335,740.13	2,747,387.85
存出保证金		253,372.79	268,897.07
交易性金融资产	6.4.7.2	1,015,151,639.41	1,090,568,011.34
其中：股票投资		975,048,360.72	1,040,764,714.64
基金投资		-	-
债券投资		40,103,278.69	49,803,296.70
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		378,936.09	472,825.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,079,734,845.00	1,114,664,041.72
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		21,444,447.16	-
应付赎回款		776,307.00	425,934.45
应付管理人报酬		697,277.77	766,199.17
应付托管费		87,159.73	95,774.88
应付销售服务费		65,338.89	71,777.47
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	1,388,167.68	1,378,849.88
负债合计		24,458,698.23	2,738,535.85
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	1,433,027,798.59	1,497,335,233.70
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-377,751,651.82	-385,409,727.83
净资产合计		1,055,276,146.77	1,111,925,505.87
负债和净资产总计		1,079,734,845.00	1,114,664,041.72

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，创金合信竞争优势混合 A 份额净值 0.7377 元，基金份额总额 1,163,219,363.57 份；创金合信竞争优势混合 C 份额净值 0.7306 元，基金份额总额 269,808,435.02 份；总份额合计 1,433,027,798.59 份。

6.2 利润表

会计主体：创金合信竞争优势混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,119,282.93	-171,072,582.03
1.利息收入		85,995.07	124,733.10
其中：存款利息收入	6.4.7.9	85,995.07	124,733.10
债券利息收入		-	-
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）		-10,846,868.96	-131,212,431.65
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-19,063,836.95	-139,277,406.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,157,769.69	2,334,002.59
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	7,059,198.30	5,730,972.27
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	6.4.7.16	8,550,397.75	-40,337,955.51

失以“-”号填列)			
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	91,193.21	353,072.03
减:二、营业总支出		5,498,430.60	7,004,649.32
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	4,424,916.90	5,658,859.02
2.托管费	6.4.10.2.2	553,114.58	707,357.37
3.销售服务费	6.4.10.2.3	412,424.64	526,022.60
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		3.27	4.88
8.其他费用	6.4.7.19	107,971.21	112,405.45
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-7,617,713.53	-178,077,231.35
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-7,617,713.53	-178,077,231.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-7,617,713.53	-178,077,231.35

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体:创金合信竞争优势混合型证券投资基金

本报告期:2023年1月1日至2023年6月30日

单位:人民币元

项目	本期2023年1月1日至2023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)	1,497,335,233.70	-	-385,409,727.83	1,111,925,505.87
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)	1,497,335,233.70	-	-385,409,727.83	1,111,925,505.87
三、本期增减变动额(减少以“-”	-64,307,435.11	-	7,658,076.01	-56,649,359.10

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-7,617,713.53	-7,617,713.53
(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)	-64,307,435.11	-	15,275,789.54	-49,031,645.57
其中: 1.基金申购款	105,375,415.02	-	-25,874,930.96	79,500,484.06
2.基金赎回款	-169,682,850.13	-	41,150,720.50	-128,532,129.63
(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)	1,433,027,798.59	-	-377,751,651.82	1,055,276,146.77
项目	上年度可比期间 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)	1,612,009,438.91	-	121,156,237.02	1,733,165,675.93
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)	1,612,009,438.91	-	121,156,237.02	1,733,165,675.93
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-83,254,222.57	-	-170,654,217.55	-253,908,440.12
(一)、综合收益总额	-	-	-178,077,231.35	-178,077,231.35
(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)	-83,254,222.57	-	7,423,013.80	-75,831,208.77

其中：1.基金申购款	241,221,704.15	-	-24,394,382.72	216,827,321.43
2.基金赎回款	-324,475,926.72	-	31,817,396.52	-292,658,530.20
(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）	1,528,755,216.34	-	-49,497,980.53	1,479,257,235.81

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

创金合信竞争优势混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]2848号《关于准予创金合信竞争优势混合型证券投资基金注册的批复》核准募集。本基金由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《创金合信竞争优势混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2021年1月25日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为3,054,971,579.79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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)。

本基金于2021年1月5日至2021年1月29日募集,募集期间净认购资金人民币3,054,971,579.79元,认购资金在募集期间产生的利息人民币552,406.08元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计3,055,523,985.87份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振验字第2100101号验资报告。

根据《创金合信竞争优势混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据所收取费用的差异,将基金份额分为不同的类别。收取前端认购费、前端申购费,但不计提销售服务费的基金份额类别为A类基金份额;不收取认购费、申购费,而是从本类别基金资产中计提

销售服务费的基金份额类别为 C 类。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额 分别设置代码。由于基金费用不同，本基金不同类别的基金份额将分别计算并公告各类基金份额的基金份额净值，计算公式如下：T 日某类基金份额的基金份额净值=T 日该类基金份额的基金资产净值 / T 日该类基金份额的基金份额余额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《创金合信竞争优势混合型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《创金合信竞争优势混合型证券投资基金招募说明书》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、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、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金股票投资占基金资产的比例为 50% - 95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《创金合信竞争优势混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 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

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。

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 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

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

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入, 暂不征收企业所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	62,615,156.58
等于: 本金	62,610,176.91
加: 应计利息	4,979.67
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	62,615,156.58

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	987,901,297.44	-	975,048,360.72	-12,852,936.72	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	40,030,720.00	103,278.69	40,103,278.69	-30,720.00
	合计	40,030,720.00	103,278.69	40,103,278.69	-30,720.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,027,932,017.44	103,278.69	1,015,151,639.41	-12,883,656.72	

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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	106.70
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,288,349.55
其中：交易所市场	1,285,799.55
银行间市场	2,550.00
应付利息	-
预提费用	99,711.43
合计	1,388,167.68

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信竞争优势混合 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,214,898,335.37	1,214,898,335.37
本期申购	76,158,347.72	76,158,347.72
本期赎回（以“-”号填列）	-127,837,319.52	-127,837,319.52
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	1,163,219,363.57	1,163,219,363.57

创金合信竞争优势混合 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	282,436,898.33	282,436,898.33
本期申购	29,217,067.30	29,217,067.30
本期赎回（以“-”号填列）	-41,845,530.61	-41,845,530.61
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	269,808,435.02	269,808,435.02

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

创金合信竞争优势混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-212,791,002.29	-98,604,971.88	-311,395,974.17
本期利润	-12,845,311.21	6,752,445.03	-6,092,866.18

本期基金份额交易产生的变动数	9,695,769.67	2,728,865.55	12,424,635.22
其中：基金申购款	-14,222,521.63	-4,307,466.68	-18,529,988.31
基金赎回款	23,918,291.30	7,036,332.23	30,954,623.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-215,940,543.83	-89,123,661.30	-305,064,205.13

创金合信竞争优势混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-51,287,040.90	-22,726,712.76	-74,013,753.66
本期利润	-3,322,800.07	1,797,952.72	-1,524,847.35
本期基金份额交易产生的变动数	2,404,112.91	447,041.41	2,851,154.32
其中：基金申购款	-5,677,462.04	-1,667,480.61	-7,344,942.65
基金赎回款	8,081,574.95	2,114,522.02	10,196,096.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-52,205,728.06	-20,481,718.63	-72,687,446.69

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	68,136.87
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	15,898.41
其他	1,959.79
合计	85,995.07

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-19,063,836.95
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	-19,063,836.95

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,541,947,239.05
减：卖出股票成本总额	1,557,043,765.56

减：交易费用	3,967,310.44
买卖股票差价收入	-19,063,836.95

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	391,276.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	766,493.29
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	1,157,769.69

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	335,589,271.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	333,816,220.00
减：应计利息总额	1,002,160.77
减：交易费用	4,397.55
买卖债券差价收入	766,493.29

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,059,198.30
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	7,059,198.30

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	8,550,397.75
——股票投资	8,579,217.75
——债券投资	-28,820.00
——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	8,550,397.75

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	91,154.55
转换费收入	38.66
合计	91,193.21

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	35,704.06
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,759.78
账户维护费	9,000.00
合计	107,971.21

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
上海浦东发展银行股份有限公司	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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期末及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,424,916.90	5,658,859.02
其中：支付销售机构的客户维护费	1,799,265.26	2,295,470.71

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	553,114.58	707,357.37

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信竞争优势混合 A	创金合信竞争优势混合 C	合计
创金合信直销	-	1,595.02	1,595.02
第一创业证券	-	797.59	797.59
合计	-	2,392.61	2,392.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	创金合信竞争优势混合 A	创金合信竞争优势混合 C	合计
创金合信直销	-	1,793.80	1,793.80
第一创业证券	-	955.42	955.42
合计	-	2,749.22	2,749.22

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日 C 类基金份额销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.4\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
上海浦东发展银行股份有限公司	62,615,156.58	68,136.87	59,681,445.91	106,258.74

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展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（2023 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
688435	英方软件	2023 年 1 月 12 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	38.66	73.03	2,728	105,464.48	199,225.84	-
688486	龙迅股份	2023 年 2 月 10 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	64.76	105.13	1,887	122,202.12	198,380.31	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1 个月内（含）	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月内（含）	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	11.10	17.04	4,487	49,805.70	76,458.48	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内（含）	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内（含）	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
688469	中芯集成	2023 年	1-6 个	科创板	5.69	5.41	10,971	62,424.99	59,353.11	-

		4月28日	月(含)	打新限售						
688361	中科飞测	2023年5月12日	1-6个月(含)	科创板打新限售	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023年3月24日	1-6个月(含)	科创板打新限售	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688146	中船特气	2023年4月13日	1-6个月(含)	科创板打新限售	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	1-6个月(含)	创业板打新限售	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	1-6个月(含)	科创板打新限售	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	1-6个月(含)	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	1-6个月(含)	新股锁定	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023年5月30日	1-6个月(含)	科创板打新限售	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688352	颀中科技	2023年4月11日	1-6个月(含)	科创板打新限售	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	1-6个月(含)	科创板打新限售	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	1-6个月(含)	创业板打新限售	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	1-6个月(含)	科创板打新限售	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	1-6个月(含)	创业板打新限售	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	1-6个月(含)	创业板打新限售	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-

688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	6.58	7.58	2,953	19,430.74	22,383.74	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	131.1 1	53.24	391	34,219.71	20,816.84	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	125.8 0	118.0 3	163	20,505.40	19,238.89	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301383	天键股份	2023 年 5 月 31 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	125.8 8	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-

		日		售						
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
301387	光大同创	2023 年 4 月 10 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301315	威士顿	2023 年	1-6 个	创业板	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-

		6月13日	月(含)	打新限售						
688523	航天环宇	2023年5月26日	1-6个月(含)	科创板打新限售	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	1-6个月(含)	创业板打新限售	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	1-6个月(含)	创业板打新限售	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	1-6个月(含)	创业板打新限售	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1-6个月(含)	创业板打新限售	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	1-6个月(含)	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	1-6个月(含)	科创板打新限售	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023年5月4日	1-6个月(含)	科创板打新限售	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	1-6个月(含)	创业板打新限售	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	1-6个月(含)	创业板打新限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301386	未来电器	2023年3月21日	1-6个月(含)	创业板打新限售	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱福	2023年5月29日	1-6个月(含)	创业板打新限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023年6月20日	1-6个月(含)	科创板打新限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	1-6个月(含)	创业板打新限售	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-

301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-

		日								
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

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上海浦东发展银行股份有限公司，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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	40,103,278.69	49,803,296.70
合计	40,103,278.69	49,803,296.70

未评级债券包括国债、政策性金融债、超短期融资券以及无第三方评级机构短期债项评级的其他债券。

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

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末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 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即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 2023 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	62,615,156.58	-	-	-	62,615,156.58
结算备付金	1,335,740.13	-	-	-	1,335,740.13
存出保证金	253,372.79	-	-	-	253,372.79
交易性金融资产	40,103,278.69	-	-	975,048,360.72	1,015,151,639.41
应收申购款	-	-	-	378,936.09	378,936.09
资产总计	104,307,548.19	-	-	975,427,296.81	1,079,734,845.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	776,307.00	776,307.00
应付管理人报酬	-	-	-	697,277.77	697,277.77
应付托管费	-	-	-	87,159.73	87,159.73
应付销售服务费	-	-	-	65,338.89	65,338.89
应付清算款	-	-	-	21,444,447.16	21,444,447.16
其他负债	-	-	-	1,388,167.68	1,388,167.68
负债总计	-	-	-	24,458,698.23	24,458,698.23
利率敏感度缺口	104,307,548.19	-	-	950,968,598.58	1,055,276,146.77
上年度末 2022 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	20,606,919.90	-	-	-	20,606,919.90
结算备付金	2,747,387.85	-	-	-	2,747,387.85
存出保证金	268,897.07	-	-	-	268,897.07
交易性金融资产	49,803,296.70	-	-	1,040,764,714.64	1,090,568,011.34
应收申购款	-	-	-	472,825.56	472,825.56
资产总计	73,426,501.52	-	-	1,041,237,540.20	1,114,664,041.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	425,934.45	425,934.45
应付管理人报酬	-	-	-	766,199.17	766,199.17
应付托管费	-	-	-	95,774.88	95,774.88
应付销售服务费	-	-	-	71,777.47	71,777.47
其他负债	-	-	-	1,378,849.88	1,378,849.88
负债总计	-	-	-	2,738,535.85	2,738,535.85
利率敏感度缺口	73,426,501.52	-	-	1,038,499,004.35	1,111,925,505.87

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-86,396.06	-24,789.70
	2.市场利率平行下降25个基点	86,769.90	24,814.38

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	975,048,360.72	92.40	1,040,764,714.64	93.60
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	975,048,360.72	92.40	1,040,764,714.64	93.60
----	----------------	-------	------------------	-------

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1.业绩比较基准上升 5%	68,409,392.99	61,634,086.40
2.业绩比较基准下降 5%	-68,409,392.99	-61,634,086.40	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	972,775,135.24
第二层次	40,690,791.67
第三层次	1,685,712.50
合计	1,015,151,639.41

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，确定相关股票和债券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 2023 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(2022 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 2023 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	975,048,360.72	90.30
	其中：股票	975,048,360.72	90.30
2	固定收益投资	40,103,278.69	3.71
	其中：债券	40,103,278.69	3.71
	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	63,950,896.71	5.92
7	其他资产	632,308.88	0.06
8	合计	1,079,734,845.00	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	45,835,622.49	4.34
C	制造业	817,538,122.74	77.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,779,528.47	0.74

E	建筑业	2,898,319.66	0.27
F	批发和零售业	3,034,060.69	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	6,631,470.00	0.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,217,483.81	7.60
J	金融业	5,994,576.00	0.57
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,774,303.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	180,760.49	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	306,944.41	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	278,316.96	0.03
R	文化、体育和娱乐业	1,578,852.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	975,048,360.72	92.40

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	300750	宁德时代	407,811	93,303,078.69	8.84
2	002812	恩捷股份	681,302	65,643,447.70	6.22
3	002129	TCL 中环	1,273,525	42,281,030.00	4.01
4	002459	晶澳科技	693,911	28,936,088.70	2.74
5	002738	中矿资源	533,760	27,189,734.40	2.58
6	002709	天赐材料	654,108	26,942,708.52	2.55
7	002463	沪电股份	1,277,400	26,748,756.00	2.53
8	603338	浙江鼎力	465,668	26,082,064.68	2.47
9	002050	三花智控	760,700	23,018,782.00	2.18

				0	
10	601899	紫金矿业	1,968,000	22,376,160.0 0	2.12
11	688111	金山办公	45,081	21,288,149.8 2	2.02
12	002271	东方雨虹	670,401	18,275,131.2 6	1.73
13	601138	工业富联	696,300	17,546,760.0 0	1.66
14	603799	华友钴业	373,899	17,165,703.0 9	1.63
15	600438	通威股份	495,200	16,990,312.0 0	1.61
16	002230	科大讯飞	228,400	15,522,064.0 0	1.47
17	688256	寒武纪	80,845	15,198,860.0 0	1.44
18	300502	新易盛	218,740	14,867,757.8 0	1.41
19	603993	洛阳钼业	2,540,353	13,540,081.4 9	1.28
20	002850	科达利	101,855	13,470,323.7 5	1.28
21	600176	中国巨石	904,700	12,810,552.0 0	1.21
22	688599	天合光能	299,372	12,756,240.9 2	1.21
23	601100	恒立液压	198,000	12,737,340.0 0	1.21
24	688036	传音控股	83,432	12,264,504.0 0	1.16
25	688041	海光信息	174,152	11,889,357.04	1.13
26	002756	永兴材料	179,083	11,212,386.63	1.06
27	001301	尚太科技	196,600	11,070,546.00	1.05
28	002601	龙佰集团	637,300	10,515,450.0 0	1.00
29	300474	景嘉微	116,200	10,456,838.0 0	0.99
30	601012	隆基绿能	349,800	10,028,766.0 0	0.95
31	603019	中科曙光	189,000	9,620,100.00	0.91
32	688018	乐鑫科技	72,674	9,434,538.68	0.89
33	002920	德赛西威	59,000	9,192,790.00	0.87

34	688223	晶科能源	613,863	8,630,913.78	0.82
35	688099	晶晨股份	102,011	8,601,567.52	0.82
36	688608	恒玄科技	69,557	8,418,483.71	0.80
37	300458	全志科技	300,640	8,192,440.00	0.78
38	300308	中际旭创	53,476	7,885,036.20	0.75
39	601689	拓普集团	94,200	7,601,940.00	0.72
40	002156	通富微电	320,300	7,238,780.00	0.69
41	300769	德方纳米	63,720	7,023,855.60	0.67
42	603806	福斯特	184,560	6,863,786.40	0.65
43	300054	鼎龙股份	275,311	6,808,441.03	0.65
44	300274	阳光电源	57,303	6,683,248.89	0.63
45	000988	华工科技	173,300	6,587,133.00	0.62
46	603728	鸣志电器	81,500	6,544,450.00	0.62
47	300408	三环集团	220,000	6,457,000.00	0.61
48	300033	同花顺	34,200	5,994,576.00	0.57
49	600309	万华化学	64,100	5,630,544.00	0.53
50	002472	双环传动	147,400	5,350,620.00	0.51
51	000938	紫光股份	166,800	5,312,580.00	0.50
52	000157	中联重科	770,200	5,198,850.00	0.49
53	002859	洁美科技	185,406	5,135,746.20	0.49
54	600031	三一重工	306,800	5,102,084.00	0.48
55	002138	顺络电子	211,400	5,054,574.00	0.48
56	688326	经纬恒润	34,943	5,045,419.77	0.48
57	601360	三六零	388,800	4,875,552.00	0.46
58	601088	中国神华	158,000	4,858,500.00	0.46
59	600584	长电科技	154,500	4,815,765.00	0.46
60	002318	久立特材	272,100	4,633,863.00	0.44
61	601898	中煤能源	481,900	4,067,236.00	0.39
62	600519	贵州茅台	2,300	3,889,300.00	0.37
63	000933	神火股份	292,400	3,801,200.00	0.36
64	002984	森麒麟	110,400	3,473,184.00	0.33
65	688032	禾迈股份	8,810	3,128,871.50	0.30
66	688677	海泰新光	54,504	3,092,556.96	0.29
67	601000	唐山港	856,400	3,023,092.00	0.29
68	002648	卫星化学	197,200	2,950,112.00	0.28
69	688798	艾为电子	49,713	2,940,523.95	0.28
70	600426	华鲁恒升	92,800	2,842,464.00	0.27
71	601888	中国中免	25,100	2,774,303.00	0.26
72	601636	旗滨集团	320,700	2,764,434.00	0.26
73	600674	川投能源	162,300	2,442,615.00	0.23
74	600900	长江电力	109,900	2,424,394.00	0.23
75	000568	泸州老窖	11,400	2,389,098.00	0.23
76	688017	绿的谐波	13,542	2,199,220.80	0.21

77	600546	山煤国际	148,700	2,151,689.00	0.20
78	000708	中信特钢	130,800	2,071,872.00	0.20
79	000429	粤高速 A	262,900	2,061,136.00	0.20
80	002444	巨星科技	93,700	2,050,156.00	0.19
81	300763	锦浪科技	19,100	1,988,310.00	0.19
82	688516	奥特维	10,403	1,959,925.20	0.19
83	688348	昱能科技	10,326	1,939,532.58	0.18
84	002913	奥士康	50,000	1,909,000.00	0.18
85	688049	炬芯科技	47,235	1,738,248.00	0.16
86	603369	今世缘	32,900	1,737,120.00	0.16
87	600745	闻泰科技	35,400	1,731,060.00	0.16
88	002643	万润股份	98,300	1,711,403.00	0.16
89	000425	徐工机械	244,200	1,653,234.00	0.16
90	601186	中国铁建	161,800	1,593,730.00	0.15
91	300364	中文在线	88,600	1,578,852.00	0.15
92	603179	新泉股份	35,400	1,553,706.00	0.15
93	600886	国投电力	122,700	1,552,155.00	0.15
94	600377	宁沪高速	157,400	1,547,242.00	0.15
95	603313	梦百合	149,400	1,498,482.00	0.14
96	002624	完美世界	88,276	1,490,981.64	0.14
97	600132	重庆啤酒	15,600	1,437,696.00	0.14
98	002865	钧达股份	9,100	1,388,023.00	0.13
99	600941	中国移动	14,500	1,352,850.00	0.13
100	601390	中国中铁	155,800	1,180,964.00	0.11
101	600750	江中药业	47,900	1,050,447.00	0.10
102	300037	新宙邦	18,900	980,721.00	0.09
103	600025	华能水电	135,900	968,967.00	0.09
104	688535	华海诚科	15,616	953,012.18	0.09
105	301269	华大九天	7,500	921,300.00	0.09
106	000860	顺鑫农业	27,200	916,368.00	0.09
107	688475	萤石网络	20,526	879,744.36	0.08
108	688361	中科飞测	8,303	673,991.49	0.06
109	688469	中芯集成	109,705	619,174.89	0.06
110	603063	禾望电气	19,100	587,325.00	0.06
111	688531	日联科技	3,460	509,505.76	0.05
112	601225	陕西煤业	27,900	507,501.00	0.05
113	002422	科伦药业	16,600	492,688.00	0.05
114	600985	淮北矿业	42,200	486,144.00	0.05
115	300842	帝科股份	5,300	484,632.00	0.05
116	600285	羚锐制药	30,100	483,406.00	0.05
117	688146	中船特气	10,101	422,147.43	0.04
118	688484	南芯科技	10,071	410,399.28	0.04
119	688160	步科股份	4,826	402,971.00	0.04

120	001286	陕西能源	37,667	391,397.47	0.04
121	301291	C 明阳电	12,054	391,066.98	0.04
122	001287	中电港	13,860	375,661.44	0.04
123	688576	西山科技	2,395	315,642.70	0.03
124	688432	有研硅	20,044	314,490.36	0.03
125	688352	颀中科技	23,609	314,070.39	0.03
126	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.03
127	688507	索辰科技	2,213	287,192.75	0.03
128	301310	鑫宏业	4,089	280,239.27	0.03
129	301293	三博脑科	3,324	278,316.96	0.03
130	601061	中信金属	29,530	255,729.80	0.02
131	301303	真兰仪表	10,574	241,150.32	0.02
132	688552	航天南湖	9,556	239,960.00	0.02
133	688570	天玛智控	8,837	234,259.64	0.02
134	301307	美利信	6,865	230,766.00	0.02
135	688543	国科军工	4,094	228,607.10	0.02
136	301322	绿通科技	3,905	218,127.94	0.02
137	688458	美芯晟	2,206	210,955.41	0.02
138	688435	英方软件	2,728	199,225.84	0.02
139	688581	安杰思	1,629	198,809.23	0.02
140	688486	龙迅股份	1,887	198,380.31	0.02
141	688562	航天软件	7,254	195,390.66	0.02
142	301262	海看股份	6,917	190,389.75	0.02
143	301317	鑫磊股份	6,936	186,571.14	0.02
144	301383	天键股份	4,925	183,366.76	0.02
145	688623	二元科技	1,776	162,256.88	0.02
146	688593	新相微	9,584	161,565.56	0.02
147	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.02
148	301332	德尔玛	11,211	159,576.87	0.02
149	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.01
150	301305	朗坤环境	7,523	155,710.27	0.01
151	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.01
152	301382	蜂助手	4,080	155,284.80	0.01
153	301408	华人健康	8,784	152,129.85	0.01
154	301419	阿莱德	3,292	150,811.36	0.01
155	301387	光大同创	3,070	150,224.31	0.01
156	688512	慧智微	7,209	147,986.20	0.01
157	688698	伟创电气	3,654	146,086.92	0.01
158	300660	江苏雷利	3,700	141,340.00	0.01
159	688433	华曙高科	4,171	140,769.00	0.01
160	301395	C 仁信	5,196	138,629.28	0.01
161	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.01
162	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.01

163	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.01
164	688523	航天环宇	4,717	125,405.25	0.01
165	301141	中科磁业	2,617	119,750.28	0.01
166	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.01
167	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
168	601065	江盐集团	8,748	116,094.39	0.01
169	301429	森泰股份	4,989	112,367.08	0.01
170	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01
171	301488	N 豪恩	2,618	104,144.04	0.01
172	688479	友车科技	3,318	103,760.10	0.01
173	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.01
174	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.01
175	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.01
176	301323	新莱福	2,277	97,593.33	0.01
177	601133	柏诚股份	6,632	97,123.52	0.01
178	301386	未来电器	3,776	94,554.26	0.01
179	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.01
180	301373	凌玮科技	2,764	89,376.38	0.01
181	301281	科源制药	3,366	88,363.72	0.01
182	301157	华塑科技	1,498	83,481.42	0.01
183	301295	C 美硕	2,146	81,770.28	0.01
184	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.01
185	301203	国泰环保	2,243	79,964.22	0.01
186	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
187	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.01
188	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
189	688472	阿特斯	4,487	76,458.48	0.01
190	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
191	688480	赛恩斯	2,302	71,269.92	0.01
192	001380	华纬科技	1,694	54,899.76	0.01
193	001328	登康口腔	1,445	46,323.05	0.00
194	603125	常青科技	1,596	44,779.00	0.00
195	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.00
196	001360	南矿集团	1,762	30,163.44	0.00
197	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.00
198	001367	海森药业	549	24,687.92	0.00
199	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.00
200	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
201	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	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	002129	TCL 中环	43,554,614.25	3.92
2	002463	沪电股份	33,198,987.20	2.99
3	002738	中矿资源	31,197,101.26	2.81
4	300769	德方纳米	27,195,396.74	2.45
5	603338	浙江鼎力	27,075,091.68	2.43
6	001301	尚太科技	26,791,095.00	2.41
7	002459	晶澳科技	25,376,996.47	2.28
8	601012	隆基绿能	25,299,983.00	2.28
9	688111	金山办公	24,306,352.40	2.19
10	002460	赣锋锂业	23,948,256.20	2.15
11	603993	洛阳钼业	23,810,370.49	2.14
12	002756	永兴材料	22,876,404.55	2.06
13	002050	三花智控	22,024,049.70	1.98
14	002466	天齐锂业	21,105,815.81	1.90
15	688041	海光信息	19,788,088.22	1.78
16	002812	恩捷股份	19,344,613.40	1.74
17	000157	中联重科	19,251,775.00	1.73
18	688032	禾迈股份	17,549,044.80	1.58
19	600563	法拉电子	17,538,346.00	1.58
20	300502	新易盛	17,372,713.00	1.56

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	601012	隆基绿能	68,474,309.48	6.16
2	300274	阳光电源	64,319,704.36	5.78
3	002459	晶澳科技	63,872,865.00	5.74
4	688599	天合光能	62,310,313.19	5.60
5	300763	锦浪科技	29,760,054.30	2.68
6	600309	万华化学	23,554,998.00	2.12
7	002460	赣锋锂业	22,814,991.00	2.05
8	688498	源杰科技	22,760,830.84	2.05
9	600031	三一重工	22,608,805.00	2.03
10	300769	德方纳米	19,834,918.00	1.78
11	002466	天齐锂业	19,746,529.25	1.78
12	300750	宁德时代	19,626,581.00	1.77
13	000301	东方盛虹	17,615,479.28	1.58
14	002791	坚朗五金	17,017,623.00	1.53

15	000786	北新建材	16,944,630.00	1.52
16	600563	法拉电子	16,758,440.00	1.51
17	000100	TCL 科技	16,518,563.00	1.49
18	601636	旗滨集团	16,327,386.00	1.47
19	300308	中际旭创	16,293,034.00	1.47
20	002812	恩捷股份	16,212,676.44	1.46

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	1,482,748,193.89
卖出股票收入（成交）总额	1,541,947,239.05

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,103,278.69	3.80
	其中：政策性金融债	40,103,278.69	3.80
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,103,278.69	3.80

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	230206	23 国开 06	400,000	40,103,278.69	3.80

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，中矿资源集团股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到海淀消防救援支队处罚的情况。

除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	253,372.79
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	378,936.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	632,308.88

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 (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
创金合信竞争优势混合 A	118,366	9,827.31	995,079.92	0.09%	1,162,224,283.65	99.91%
创金合信竞争优势混合 C	16,456	16,395.75	-	-	269,808,435.02	100.00%
合计	132,861	10,785.92	995,079.92	0.07%	1,432,032,718.67	99.93%

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	创金合信竞争优势混合 A	247,585.63	0.02%
	创金合信竞争优势混合 C	118,956.53	0.04%

	合计	366,542.16	0.03%
--	----	------------	-------

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	创金合信竞争优势混合 A	0~10
	创金合信竞争优势混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信竞争优势混合 A	0~10
	创金合信竞争优势混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信竞争优势混合 A	创金合信竞争优势混合 C
基金合同生效日(2021 年 1 月 25 日)基金份额总额	2,502,779,359.50	552,744,626.37
本报告期期初基金份额总额	1,214,898,335.37	282,436,898.33
本报告期基金总申购份额	76,158,347.72	29,217,067.30
减：报告期基金总赎回份额	127,837,319.52	41,845,530.61
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	1,163,219,363.57	269,808,435.02

§ 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未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	1,225,140,851.79	40.70%	889,056.50	40.69%	-
湘财证券	2	985,156,987.99	32.73%	714,869.58	32.71%	-
浙商证券	2	799,873,713.76	26.57%	581,224.39	26.60%	-

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
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	5,410,701.13	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	创金合信竞争优势混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
2	创金合信基金管理有限公司关于调整“特定投资群体”的客户适用范围的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-15
3	创金合信基金管理有限公司关于面向特定投资群体通过直销中心认购、申购（含定期定额投资）及转换转入旗下所有基金实施费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-09
4	创金合信竞争优势混合型证券投资基金 2022 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
5	创金合信竞争优势混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-08
6	创金合信竞争优势混合型证券投资基金（2023 年 4 月）招募说明书（更新）	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-11
7	创金合信竞争优势混合型证券投资基金(A 类)	公司官网、中国证监	2023-04-11

	份额)基金产品资料概要更新	会基金电子披露网站	
8	创金合信竞争优势混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-11
9	创金合信竞争优势混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21

§ 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

本基金本报告期末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。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 2023 年 6 月 30 日，创金合信基金共管理 95 只公募基金，公募管理规模 1161.93 亿元。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信竞争优势混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信竞争优势混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信竞争优势混合型证券投资基金 2023 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

创金合信基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日