

# 创金合信消费主题股票型证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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遵规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	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.....	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	40
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信消费主题股票型证券投资基金	
基金简称	创金合信消费主题股票	
基金主代码	003190	
交易代码	003190	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 10 月 11 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	120,801,259.57 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信消费主题股票 A	创金合信消费主题股票 C
下属分级基金的交易代码	003190	003191
报告期末下属分级基金的份 额总额	16,674,425.22 份	104,126,834.35 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于消费主题相关的优质上市公司，在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争取得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采取自上而下的资产配置思路，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益、风险水平及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的具体分配比例。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率*90%+人民币活期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	创金合信基金管理有限 公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田
	联系电话	0755-82820166
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.c om
客户服务电话	400-868-0666	95555

传真	0755-25832571	0755-83195201
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）	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	518052	518040
法定代表人	钱龙海	缪建民

## 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、创金合信消费主题股票 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	1,129,932.75
本期利润	-6,379,929.09
加权平均基金份额本期利润	-0.1812
本期加权平均净值利润率	-7.30%
本期基金份额净值增长率	-8.65%
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	9,486,870.19
期末可供分配基金份额利润	0.5689
期末基金资产净值	37,299,474.51
期末基金份额净值	2.2369
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	123.62%
-------------	---------

## 2、创金合信消费主题股票 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	195,160.16
本期利润	-23,878,160.86
加权平均基金份额本期利润	-0.2088
本期加权平均净值利润率	-8.73%
本期基金份额净值增长率	-8.96%
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	50,235,083.52
期末可供分配基金份额利润	0.4824
期末基金资产净值	224,966,499.67
期末基金份额净值	2.1605
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	115.86%

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

## 创金合信消费主题股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.15%	1.16%	3.60%	1.07%	-3.45%	0.09%
过去三个月	-13.11%	0.97%	-8.07%	0.92%	-5.04%	0.05%
过去六个月	-8.65%	1.06%	-6.20%	0.97%	-2.45%	0.09%
过去一年	-18.66%	1.30%	-17.88%	1.14%	-0.78%	0.16%
过去三年	4.36%	1.70%	0.93%	1.40%	3.43%	0.30%
自基金合同生效起至今	123.62%	1.63%	52.64%	1.41%	70.98%	0.22%

## 创金合信消费主题股票 C

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

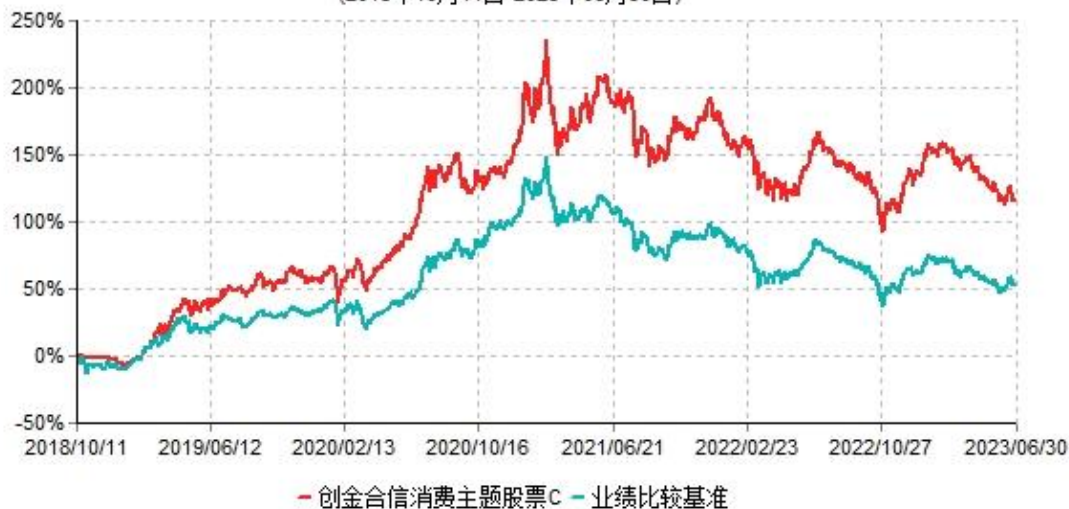
	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	0.09%	1.16%	3.60%	1.07%	-3.51%	0.09%
过去三个月	-13.26%	0.97%	-8.07%	0.92%	-5.19%	0.05%
过去六个月	-8.96%	1.06%	-6.20%	0.97%	-2.76%	0.09%
过去一年	-19.23%	1.30%	-17.88%	1.14%	-1.35%	0.16%
过去三年	2.19%	1.70%	0.93%	1.40%	1.26%	0.30%
自基金合同生效起至今	115.86%	1.63%	52.64%	1.41%	63.22%	0.22%

### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

创金合信消费主题股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年10月11日-2023年06月30日)



创金合信消费主题股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年10月11日-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		
陈建军	本基金基金经理	2019 年 5 月 30 日	-	9	陈建军女士，中国国籍，硕士。2009 年 1 月加入茂业国际控股有限公司，任投资者关系部信息披露经理，2013 年 7 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，任研究部研究员，2015 年 6 月加入第一创业证券股份有限公司，历任资产管理部、资产管理运营部投资主办，2019 年 4 月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。

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

2、证券从业年限的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集

证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(2011年修订)》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度消费板块整体处于继续回调中，各子板块均难幸免，市场较弱。再加上 CPI 和 PPI 持续下降，就业数据以及出生人口数据也不太乐观，引发了市场的担忧。与此同时，人民币持续贬值也是消费白马被杀估值的直接宏观因素。

站在悲观角度看问题永远都是悲观，但事物发展总存在两面性。所谓穷则变，变则通，极蹇而后成解。本着见微知著，二季度我们做了较多草根调研，并且也整理了较多消费终端数据，我们认为在不受疫情困扰的大背景下，终端消费是在缓慢复苏的。而很多业绩基本面稳健的消费白马股价经历了市场泥沙俱下的“洗礼”，再考虑到今明年的增长，估值又变得更便宜。基于以上，我们在 5 月份开始逐渐加仓消费，方向主要是在白酒和部分消费医疗。

养殖行业因为猪价持续低迷再次进入深度亏损，市场主流观点认为深度亏损就会去化，所以可以加仓养殖板块，并且未来出栏成长性越高的越具有行业阿尔法，我们对此主流观点持深度保留意见。在全行业资产负债率极高的背景下，深度亏损、出栏增速以及猪价反转存在不可能三角，对于股价已反映较多的标的反而认为风险巨大，一季度我们大幅减仓生猪板块，当前暂时并不考虑再布局。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信消费主题股票 A 基金份额净值为 2.2369 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.65%，同期业绩比较基准收益率为-6.20%；截至本报告期末创金合信消费主题股票 C 基金份额净值为 2.1605 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.96%，同期业绩比较基准收益率为-6.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对国内终端消费复苏趋势比较有信心，下半年总体情况将好于上半年。同时考虑到上半年人民币贬值，下半年出口将有可能超预期。而在消费和出口都向好的预期下，我们认为人民币汇率下半年将有变化，届时将对消费板块的估值有提振作用。

#### 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

## 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

## 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：创金合信消费主题股票型证券投资基金

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	47,899,353.70	36,472,266.22
结算备付金		1,188,139.61	21,715,190.35
存出保证金		124,621.88	112,722.49
交易性金融资产	6.4.7.2	212,785,953.47	312,138,509.08
其中：股票投资		212,785,953.47	312,138,509.08
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		1,626,742.50	-
应收股利		-	-
应收申购款		132,616.75	454,109.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		263,757,427.91	370,892,797.71
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		-	8,962,287.31
应付赎回款		59,821.13	223,061.62
应付管理人报酬		376,007.84	456,981.79
应付托管费		50,134.39	60,930.89
应付销售服务费		140,024.48	159,220.17
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	865,465.89	869,349.63
负债合计		1,491,453.73	10,731,831.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	127,800,778.67	159,109,922.74
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	134,465,195.51	201,051,043.56
净资产合计		262,265,974.18	360,160,966.30
负债和净资产总计		263,757,427.91	370,892,797.71

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，创金合信消费主题股票 A 份额净值 2.2369 元，基金份额总额 16,674,425.22 份；创金合信消费主题股票 C 份额净值 2.1605 元，基金份额总额 104,126,834.35 份；总份额合计 120,801,259.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信消费主题股票型证券投资基金

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	上年度可比期间 2022 年
----	-----	--------------------	----------------

		2023 年 6 月 30 日	1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-26,169,318.98	-6,286,874.39
1.利息收入		135,678.26	59,122.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	135,678.26	59,122.13
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）		5,166,036.09	-20,607,982.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,795,011.98	-22,493,908.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	3,371,024.11	1,885,925.57
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-31,583,182.86	14,050,819.17
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	112,149.53	211,167.25
减：二、营业总支出		4,088,770.97	2,822,206.43
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,687,562.16	1,819,117.42
2.托管费	6.4.10.2.2	358,341.60	242,548.99
3.销售服务费	6.4.10.2.3	950,806.81	667,330.72
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		-	-
8.其他费用	6.4.7.19	92,060.40	93,209.30

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-30,258,089.95	-9,109,080.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-30,258,089.95	-9,109,080.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-30,258,089.95	-9,109,080.82

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：创金合信消费主题股票型证券投资基金

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）	159,109,922.74	-	201,051,043.56	360,160,966.30
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）	159,109,922.74	-	201,051,043.56	360,160,966.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-31,309,144.07	-	-66,585,848.05	-97,894,992.12
（一）、综合收益总额	-	-	-30,258,089.95	-30,258,089.95
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-31,309,144.07	-	-36,327,758.10	-67,636,902.17
其中：1.基金申购款	38,981,767.69	-	51,592,478.00	90,574,245.69
2.基金赎回款	-70,290,911.76	-	-87,920,236.10	-158,211,147.86
（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)	127,800,778.67	-	134,465,195.51	262,265,974.18
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)	110,810,263.17	-	179,185,153.49	289,995,416.66
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)	110,810,263.17	-	179,185,153.49	289,995,416.66
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,761,516.38	-	-19,623,793.05	-27,385,309.43
(一)、综合收益总额	-	-	-9,109,080.82	-9,109,080.82
(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)	-7,761,516.38	-	-10,514,712.23	-18,276,228.61
其中: 1.基金申购款	53,281,820.44	-	69,162,072.84	122,443,893.28
2.基金赎回款	-61,043,336.82	-	-79,676,785.07	-140,720,121.89
(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)	103,048,746.79	-	159,561,360.44	262,610,107.23

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

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

根据《创金合信消费主题股票型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信消费主题股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板以及其他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、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单等)、金融衍生品(包括权证、股指期货、股票期权等)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：中证内地消费主题指数收益率×90%+人民币活期存款利率(税后)×10%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 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[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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	47,899,353.70
等于：本金	47,896,137.95

加：应计利息	3,215.75
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	47,899,353.70

#### 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	224,814,028.98	-	212,785,953.47	-12,028,075.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	224,814,028.98	-	212,785,953.47	-12,028,075.51

#### 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	3.81
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	781,159.52
其中：交易所市场	781,159.52
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	865,465.89

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信消费主题股票 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	38,448,742.91	40,397,795.83
本期申购	5,103,969.14	5,362,687.71
本期赎回（以“-”号填列）	-26,878,286.83	-28,240,808.81
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	16,674,425.22	17,519,674.73

创金合信消费主题股票 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	112,087,138.59	118,712,126.91
本期申购	31,742,918.26	33,619,079.98
本期赎回（以“-”号填列）	-39,703,222.50	-42,050,102.95
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	104,126,834.35	110,281,103.94

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

创金合信消费主题股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,358,710.66	32,393,729.13	53,752,439.79

本期利润	1,129,932.75	-7,509,861.84	-6,379,929.09
本期基金份额交易产生的变动数	-13,001,773.22	-14,590,937.70	-27,592,710.92
其中：基金申购款	3,285,882.27	4,352,204.00	7,638,086.27
基金赎回款	-16,287,655.49	-18,943,141.70	-35,230,797.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,486,870.19	10,292,929.59	19,779,799.78

创金合信消费主题股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	53,512,990.44	93,785,613.33	147,298,603.77
本期利润	195,160.16	-24,073,321.02	-23,878,160.86
本期基金份额交易产生的变动数	-3,473,067.08	-5,261,980.10	-8,735,047.18
其中：基金申购款	17,827,828.68	26,126,563.05	43,954,391.73
基金赎回款	-21,300,895.76	-31,388,543.15	-52,689,438.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,235,083.52	64,450,312.21	114,685,395.73

#### 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	76,895.45
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	57,765.41
其他	1,017.40
合计	135,678.26

#### 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	1,795,011.98
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,795,011.98

##### 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	1,028,726,107.44

减：卖出股票成本总额	1,024,325,999.74
减：交易费用	2,605,095.72
买卖股票差价收入	1,795,011.98

#### 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

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 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	3,371,024.11
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	3,371,024.11

#### 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	-31,583,182.86
——股票投资	-31,583,182.86
——债券投资	-
——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	-31,583,182.86

#### 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	100,015.49
转换费收入	12,134.04
合计	112,149.53

#### 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	7,757.84
合计	92,060.40

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	-	-	238,472,864.30	20.17%

###### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	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	-	-	-	-
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	172,752.73	24.15%	-	-

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 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	2,687,562.16	1,819,117.42
其中：支付销售机构的客户维护费	751,173.22	738,333.57

注：支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

### 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	358,341.60	242,548.99

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

### 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		
	创金合信消费主题股票 A	创金合信消费主题股票 C	合计
创金合信直销	-	208,642.42	208,642.42
招商银行	-	30,853.93	30,853.93

合计	-	239,496.35	239,496.35
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		
	创金合信消费主题股票 A	创金合信消费主题股票 C	合计
创金合信直销	-	21,122.64	21,122.64
招商银行	-	40,022.56	40,022.56
合计	-	61,145.20	61,145.20

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.7% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日 C 类基金份额销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.7\% / \text{当年天数}。$$

#### 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
招商银行股份有限公司	47,899,353.70	76,895.45	24,271,802.05	52,142.80

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

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

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
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	4,442	118,512.56	118,512.56	-
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	-
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	-
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	2,394	61,813.08	61,813.08	-

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	-
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	409	9,652.40	26,450.03	-
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	1,538	17,071.80	26,207.52	-
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	-
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	320	21,529.60	20,937.60	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	5.69	5.41	3,864	21,986.16	20,904.24	-
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	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	135.8 0	120.4 1	149	20,234.20	17,941.09	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	152.3 8	135.9 7	122	18,590.36	16,588.34	-
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	518	16,752.12	16,503.48	-
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	-
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	382	10,214.68	15,539.76	-
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	693	18,572.40	15,467.76	-
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	418	19,294.88	14,930.96	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限	75.00	90.76	164	12,300.00	14,884.64	-

		日		售						
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	-
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	374	13,520.10	14,260.62	-
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	380	15,196.20	13,949.80	-
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	-
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	581	12,299.77	13,653.50	-
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	-
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	494	13,179.92	13,179.92	-
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	-
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	421	16,052.73	13,063.63	-
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	767	12,456.08	13,000.65	-
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	671	14,037.32	12,856.36	-
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	861	9,625.98	12,561.99	-
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	-
688334	西高院	2023 年	1-6 个	科创板	14.16	16.21	757	10,719.12	12,270.97	-

		6月9日	月(含)	打新限售						
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	480	14,505.60	12,240.00	-
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	878	13,003.18	12,054.94	-
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6月13日	1-6个月(含)	创业板打新限售	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688352	硕中科技	2023年4月11日	1-6个月(含)	科创板打新限售	12.10	12.07	957	11,579.70	11,550.99	-
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	93	15,470.28	11,356.23	-
688581	安杰思	2023年5月12日	1-6个月(含)	科创板打新限售	125.80	118.03	96	12,076.80	11,330.88	-
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	-
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	890	9,505.20	10,982.60	-
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	205	8,952.35	10,875.25	-
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	544	13,736.00	10,711.36	-
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	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	11.88	21.02	478	5,678.64	10,047.56	-
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	313	8,344.58	9,859.50	-
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	385	11,650.10	9,752.05	-
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	-
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	176	15,339.87	9,370.24	-
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	-
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	-
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	217	8,476.02	8,541.12	-
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	338	10,647.38	8,483.80	-
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	280	9,517.20	8,257.20	-
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	-
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	95	11,958.60	8,245.05	-
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	274	6,926.72	8,184.38	-



		日		售						
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	-
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	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	6.58	7.58	985	6,481.30	7,466.30	-
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	-
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	209	7,106.00	7,300.37	-
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	-
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	267	6,893.94	6,893.94	-
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	266	6,559.56	5,987.66	-
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	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	11.66	12.26	376	4,384.16	4,609.76	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	10.36	11.84	372	3,853.92	4,404.48	-
001328	登康口腔	2023 年	1-6 个	新股锁	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-

		3月29日	月(含)	定						
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	-
603125	常青科技	2023年3月30日	1-6个月(含)	新股锁定	25.98	24.53	125	3,247.50	3,066.25	-
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招商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所（场内）进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### **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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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时间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	47,899,353.70	-	-	-	47,899,353.70
结算备付金	1,188,139.61	-	-	-	1,188,139.61
存出保证金	124,621.88	-	-	-	124,621.88
交易性金融资产	-	-	-	212,785,953.47	212,785,953.47
应收申购款	-	-	-	132,616.75	132,616.75
应收清算款	-	-	-	1,626,742.50	1,626,742.50
资产总计	49,212,115.19	-	-	214,545,312.72	263,757,427.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	59,821.13	59,821.13
应付管理人报酬	-	-	-	376,007.84	376,007.84
应付托管费	-	-	-	50,134.39	50,134.39
应付销售服务费	-	-	-	140,024.48	140,024.48
其他负债	-	-	-	865,465.89	865,465.89
负债总计	-	-	-	1,491,453.73	1,491,453.73
利率敏感度缺口	49,212,115.19	-	-	213,053,858.99	262,265,974.18
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	36,472,266.22	-	-	-	36,472,266.22
结算备付金	21,715,190.35	-	-	-	21,715,190.35
存出保证金	112,722.49	-	-	-	112,722.49
交易性金融资产	-	-	-	312,138,509.08	312,138,509.08
应收申购款	-	-	-	454,109.57	454,109.57
资产总计	58,300,179.06	-	-	312,592,618.65	370,892,797.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	223,061.62	223,061.62
应付管理人报酬	-	-	-	456,981.79	456,981.79
应付托管费	-	-	-	60,930.89	60,930.89
应付销售服务费	-	-	-	159,220.17	159,220.17
应付清算款	-	-	-	8,962,287.31	8,962,287.31
其他负债	-	-	-	869,349.63	869,349.63
负债总计	-	-	-	10,731,831.41	10,731,831.41
利率敏感度缺口	58,300,179.06	-	-	301,860,787.24	360,160,966.30

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

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

#### 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	212,785,953.47	81.13	312,138,509.08	86.67
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	212,785,953.47	81.13	312,138,509.08	86.67

##### 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）      上年度末（2022 年 12 月）

		30 日 )	月 31 日 )
	1.业绩比较基准上升 5%	10,596,740.48	17,184,785.62
	2.业绩比较基准下降 5%	-10,596,740.48	-17,184,785.62

#### 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

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	211,363,475.10
第二层次	570,274.00
第三层次	852,204.37
合计	212,785,953.47

###### 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	212,785,953.47	80.67
	其中：股票	212,785,953.47	80.67
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	49,087,493.31	18.61
7	其他资产	1,883,981.13	0.71
8	合计	263,757,427.91	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	1,264.50	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	211,565,683.75	80.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	31,111.90	0.01
F	批发和零售业	93,121.47	0.04
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	758,479.69	0.29
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	35,118.62	0.01

N	水利、环境和公共设施管理业	241,943.21	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	212,785,953.47	81.13

### 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	600519	贵州茅台	14,000	23,674,000.00	9.03
2	002304	洋河股份	166,739	21,901,167.65	8.35
3	603198	迎驾贡酒	308,137	19,659,140.60	7.50
4	000858	五粮液	112,651	18,426,324.07	7.03
5	603369	今世缘	347,537	18,349,953.60	7.00
6	600809	山西汾酒	89,519	16,567,281.33	6.32
7	600298	安琪酵母	401,495	14,538,133.95	5.54
8	600211	西藏药业	224,325	13,324,905.00	5.08
9	000568	泸州老窖	51,052	10,698,967.64	4.08
10	000596	古井贡酒	35,007	8,660,031.66	3.30
11	600887	伊利股份	296,000	8,382,720.00	3.20
12	603589	口子窖	146,300	7,219,905.00	2.75
13	603919	金徽酒	254,400	5,973,312.00	2.28
14	300673	佩蒂股份	360,400	5,045,600.00	1.92
15	600702	舍得酒业	35,510	4,401,464.50	1.68
16	603609	禾丰股份	352,600	3,208,660.00	1.22
17	000848	承德露露	296,600	2,624,910.00	1.00

18	002507	涪陵榨菜	127,500	2,334,525.00	0.89
19	300871	回盛生物	139,950	2,306,376.00	0.88
20	688329	艾隆科技	24,603	797,137.20	0.30
21	000888	峨眉山 A	19,100	218,886.00	0.08
22	688576	西山科技	1,482	195,310.07	0.07
23	688244	永信至诚	2,229	172,524.60	0.07
24	688458	美芯晟	1,637	156,543.05	0.06
25	301382	蜂助手	4,080	155,284.80	0.06
26	688484	南芯科技	3,799	154,812.60	0.06
27	688552	航天南湖	5,802	145,692.59	0.06
28	301395	C 仁信	4,936	131,692.48	0.05
29	688523	航天环宇	4,717	125,405.25	0.05
30	301332	德尔玛	8,775	124,903.07	0.05
31	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.04
32	688543	国科军工	2,047	114,303.55	0.04
33	301488	N 豪恩	2,618	104,144.04	0.04
34	688570	天玛智控	3,842	101,846.53	0.04
35	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.04
36	301323	新莱福	2,163	92,705.62	0.04
37	688376	美埃科技	2,295	90,629.55	0.03
38	688479	友车科技	2,793	87,341.31	0.03
39	688623	二元科技	947	86,518.29	0.03
40	301359	东南电子	3,271	83,345.08	0.03
41	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.03
42	301170	锡南科技	2,090	77,273.57	0.03
43	301388	欣灵电气	2,851	76,549.35	0.03
44	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.03
45	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.03
46	301202	朗威股份	2,661	68,707.02	0.03
47	301376	致欧科技	2,655	62,606.96	0.02
48	688361	中科飞测	817	60,318.11	0.02
49	688435	英方软件	656	49,882.24	0.02
50	601065	江盐集团	3,718	49,341.26	0.02
51	001328	登康口腔	1,445	46,323.05	0.02
52	688387	信科移动	5,131	42,843.85	0.02
53	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
54	603125	常青科技	1,245	34,930.25	0.01
55	301153	中科江南	457	34,256.72	0.01
56	301269	华大九天	253	31,078.52	0.01
57	001360	南矿集团	1,762	30,163.44	0.01
58	688503	聚和材料	280	27,300.00	0.01
59	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.01
60	688472	阿特斯	1,538	26,207.52	0.01

61	001367	海森药业	549	24,687.92	0.01
62	301165	锐捷网络	398	24,564.56	0.01
63	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
64	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.01
65	688469	中芯集成	4,346	23,637.18	0.01
66	301120	新特电气	1,548	23,560.56	0.01
67	688291	金橙子	726	22,985.16	0.01
68	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
69	688581	安杰思	179	21,497.55	0.01
70	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.01
71	301310	鑫宏业	320	20,937.60	0.01
72	300896	爱美客	46	20,467.70	0.01
73	688426	康为世纪	625	18,875.00	0.01
74	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
75	688531	日联科技	122	16,588.34	0.01
76	301307	美利信	518	16,503.48	0.01
77	688562	航天软件	726	16,197.06	0.01
78	688582	芯动联科	393	16,055.11	0.01
79	301303	真兰仪表	693	15,467.76	0.01
80	688593	新相微	1,006	15,042.94	0.01
81	301383	天键股份	418	14,930.96	0.01
82	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
83	688146	中船特气	374	14,260.62	0.01
84	688512	慧智微	735	14,179.88	0.01
85	301379	天山电子	507	14,160.51	0.01
86	301377	鼎泰高科	606	13,938.00	0.01
87	301387	光大同创	307	13,925.52	0.01
88	688629	华丰科技	740	13,904.76	0.01
89	301330	熵基科技	377	13,489.06	0.01
90	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.01
91	301280	珠城科技	368	13,159.68	0.01
92	301335	天元宠物	549	13,088.16	0.00
93	301291	C 明阳电	421	13,063.63	0.00
94	301408	华人健康	767	13,000.65	0.00
95	301295	C 美硕	346	12,776.28	0.00
96	301095	广立微	154	12,728.10	0.00
97	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
98	688334	西高院	757	12,270.97	0.00
99	301262	海看股份	480	12,240.00	0.00
100	301366	一博科技	268	11,644.60	0.00
101	301363	美好医疗	263	11,569.37	0.00
102	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
103	688352	硕中科技	957	11,550.99	0.00

104	301386	未来电器	476	11,460.26	0.00
105	688507	索辰科技	93	11,356.23	0.00
106	301327	华宝新能	142	11,233.62	0.00
107	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
108	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
109	688620	安凯微	890	10,982.60	0.00
110	301305	朗坤环境	544	10,711.36	0.00
111	688433	华曙高科	336	10,641.50	0.00
112	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
113	301338	凯格精机	270	10,503.00	0.00
114	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
115	301313	凡拓数创	247	10,455.51	0.00
116	603392	万泰生物	153	10,215.81	0.00
117	301389	隆扬电子	557	10,126.26	0.00
118	001287	中电港	478	10,047.56	0.00
119	301097	天益医疗	209	9,996.47	0.00
120	301195	北路智控	210	9,777.60	0.00
121	301187	欧圣电气	520	9,604.40	0.00
122	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
123	301322	绿通科技	176	9,370.24	0.00
124	688535	华海诚科	178	9,287.24	0.00
125	301248	杰创智能	417	9,286.59	0.00
126	688631	莱斯信息	300	9,030.94	0.00
127	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
128	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
129	301163	宏德股份	277	8,739.35	0.00
130	301171	易点天下	384	8,486.40	0.00
131	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
132	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
133	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
134	301265	华新环保	678	7,878.36	0.00
135	301227	森鹰窗业	284	7,875.32	0.00
136	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
137	301326	捷邦科技	200	7,606.00	0.00
138	301176	逸豪新材	439	7,542.02	0.00
139	601061	中信金属	985	7,466.30	0.00
140	002567	唐人神	1,100	7,315.00	0.00
141	688314	康拓医疗	194	7,263.36	0.00
142	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
143	301100	风光股份	337	6,962.42	0.00
144	301319	唯特偶	115	6,882.75	0.00
145	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
146	002821	凯莱英	44	5,185.84	0.00

147	301276	嘉曼服饰	201	5,125.50	0.00
148	601133	柏诚股份	376	4,609.76	0.00
149	301309	万得凯	151	4,158.54	0.00
150	002159	三特索道	200	3,638.00	0.00
151	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
152	688356	键凯科技	25	2,663.75	0.00
153	600690	海尔智家	74	1,737.52	0.00
154	688613	奥精医疗	64	1,554.56	0.00
155	002714	牧原股份	30	1,264.50	0.00
156	605081	太和水	65	967.85	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	600298	安琪酵母	68,658,186.73	19.06
2	600211	西藏药业	43,368,312.48	12.04
3	002714	牧原股份	42,230,474.11	11.73
4	002567	唐人神	37,773,387.02	10.49
5	600809	山西汾酒	37,009,574.83	10.28
6	300871	回盛生物	35,982,729.54	9.99
7	603369	今世缘	35,785,010.00	9.94
8	603198	迎驾贡酒	35,467,619.06	9.85
9	601888	中国中免	32,300,929.98	8.97
10	002100	天康生物	32,178,707.25	8.93
11	000596	古井贡酒	31,940,585.01	8.87
12	000999	华润三九	30,956,930.17	8.60
13	002304	洋河股份	30,914,026.00	8.58
14	300673	佩蒂股份	29,412,081.75	8.17
15	600702	舍得酒业	27,480,747.10	7.63
16	600690	海尔智家	26,524,681.51	7.36
17	603589	口子窖	22,342,666.58	6.20
18	603919	金徽酒	19,342,096.00	5.37
19	300482	万孚生物	17,974,890.05	4.99
20	000858	五粮液	17,912,579.00	4.97
21	603609	禾丰股份	16,217,653.97	4.50
22	002507	涪陵榨菜	14,369,050.45	3.99
23	601088	中国神华	14,185,774.55	3.94
24	002299	圣农发展	13,972,177.00	3.88
25	300957	贝泰妮	12,925,030.89	3.59
26	688314	康拓医疗	12,371,003.62	3.43

27	600887	伊利股份	11,471,373.00	3.19
28	600884	杉杉股份	10,925,829.68	3.03
29	600519	贵州茅台	10,469,779.98	2.91
30	300896	爱美客	10,057,328.78	2.79
31	605081	太和水	9,551,873.05	2.65
32	000848	承德露露	9,036,060.50	2.51
33	600779	水井坊	8,261,817.00	2.29
34	600993	马应龙	7,828,399.00	2.17

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	002714	牧原股份	63,532,036.68	17.64
2	600298	安琪酵母	54,306,118.86	15.08
3	002567	唐人神	46,274,421.10	12.85
4	600702	舍得酒业	41,558,092.00	11.54
5	603198	迎驾贡酒	40,613,735.12	11.28
6	601888	中国中免	39,994,315.40	11.10
7	300871	回盛生物	36,542,933.15	10.15
8	002304	洋河股份	34,257,370.14	9.51
9	000999	华润三九	34,133,954.00	9.48
10	600809	山西汾酒	33,053,793.60	9.18
11	002100	天康生物	32,493,711.00	9.02
12	600211	西藏药业	31,337,859.00	8.70
13	000858	五粮液	29,138,428.00	8.09
14	300957	贝泰妮	26,605,212.86	7.39
15	600690	海尔智家	26,588,363.07	7.38
16	000596	古井贡酒	26,141,530.00	7.26
17	000568	泸州老窖	24,186,395.00	6.72
18	300673	佩蒂股份	22,383,672.00	6.21
19	603369	今世缘	21,664,863.00	6.02
20	300482	万孚生物	18,369,309.82	5.10
21	300896	爱美客	18,061,403.00	5.01
22	600519	贵州茅台	17,502,698.00	4.86
23	688314	康拓医疗	15,358,287.24	4.26
24	601088	中国神华	14,288,489.00	3.97
25	002299	圣农发展	13,815,330.00	3.84
26	603589	口子窖	13,683,424.00	3.80
27	603919	金徽酒	13,005,679.00	3.61
28	603609	禾丰股份	12,197,602.00	3.39
29	000661	长春高新	12,194,894.00	3.39

30	002507	涪陵榨菜	12,085,294.60	3.36
31	600884	杉杉股份	11,108,269.00	3.08
32	688161	威高骨科	10,936,926.00	3.04
33	002821	凯莱英	10,078,620.90	2.80
34	601390	中国中铁	8,300,027.00	2.30
35	603392	万泰生物	8,173,510.23	2.27
36	605081	太和水	8,136,578.25	2.26
37	600779	水井坊	8,053,792.00	2.24
38	600993	马应龙	7,830,929.00	2.17

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	956,556,626.99
卖出股票收入（成交）总额	1,028,726,107.44

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。



## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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	124,621.88
2	应收清算款	1,626,742.50
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	132,616.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,883,981.13

### 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
创金合信消 费主题股票 A	8,087	2,061.88	282,918.69	1.70%	16,391,506. 53	98.30%
创金合信消 费主题股票 C	26,556	3,921.03	51,704,254. 65	49.66%	52,422,579. 70	50.34%
合计	34,023	3,550.58	51,987,173. 34	43.04%	68,814,086. 23	56.96%

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	创金合信消费主题股 票 A	546,707.15	3.28%
	创金合信消费主题股 票 C	29,233.96	0.03%
	合计	575,941.11	0.48%

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	创金合信消费主题股票 A	0~10
	创金合信消费主题股票 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放 式基金	创金合信消费主题股票 A	10~50
	创金合信消费主题股票 C	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信消费主题股票 A	创金合信消费主题股票 C
基金合同生效日(2018 年 10 月 11 日)基金份额总额	39,034.53	208,441.93
本报告期期初基金份额总额	38,448,742.91	112,087,138.59
本报告期基金总申购份额	5,103,969.14	31,742,918.26
减：报告期基金总赎回份额	26,878,286.83	39,703,222.50
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	16,674,425.22	104,126,834.35

## § 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

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 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	
英大证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	1,496,151,278.60	75.73%	1,087,125.12	76.67%	-
光大证券	2	84,272,822.71	4.27%	78,025.26	5.50%	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	69,461,639.73	3.52%	50,518.03	3.56%	-
民生证券	2	211,829,058.19	10.72%	153,777.93	10.84%	-
招商证券	2	113,863,217.67	5.76%	48,563.03	3.42%	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	4	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序：

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

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

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

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

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

本基金报告期内退租中投证券 2 个交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
英大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信消费主题股票型证券投资基金 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	创金合信消费主题股票型证券投资基金 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	创金合信消费主题股票型证券投资基金 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

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	20230101 - 20230108, 20230116 - 20230409, 20230516 - 20230630	30,889,652.88	0.00	0.00	30,889,652.88	25.57%

#### 产品特有风险

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

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

2、大额赎回风险

(1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险;

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

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

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

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

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

创金合信基金成立于 2014 年 7 月,是第一家成立时即实现员工持股的基金公司。股东由第一创业证券股份有限公司、以及经营管理层和核心员工持股的 7 家投资合伙企业构成。秉承“以客户为中心”的文化理念,创金合信基金迅速构建起独特的服务优势和核心竞争力,并在客户数量和规模上取得快速突破。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、《创金合信消费主题股票型证券投资基金基金合同》;
- 2、《创金合信消费主题股票型证券投资基金托管协议》;
- 3、创金合信消费主题股票型证券投资基金 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.cjxfund.com](http://www.cjxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日