

# 华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:华创证券有限责任公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月30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01月01日起至06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 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	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	53

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	54
§9 开放式基金份额变动 .....	55
§10 重大事件揭示 .....	55
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
§12 备查文件目录 .....	58
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划	
基金简称	华创证券创享一年持有期	
基金主代码	970104	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年12月24日	
基金管理人	华创证券有限责任公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	101,278,147.78份	
基金合同存续期	本基金自本资产管理合同生效日起存续不得超过3年。	
下属分级基金的基金简称	华创证券创享一年持有期A	华创证券创享一年持有期B
下属分级基金的交易代码	970103	970104
报告期末下属分级基金的份额总额	53,749,015.31份	47,529,132.47份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，在控制集合计划资产净值波动的基础上，力争实现集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	本集合计划将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在股票、债券和银行存款等资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。具体策略：大类资产配置策略、债券组合管理策略、股票投资策略、国债期货投资策略。

业绩比较基准	中债综合财富(1-3年)指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+中证500指数收益率*10%。
风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益率低于股票型集合计划和混合型集合计划，高于货币市场集合计划。

### 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		华创证券有限责任公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	韦婷婷	阮晶
	联系电话	010-66500926	021-50193019
	电子邮箱	weitingting@hczq.com	ruanjing_sh@citicbank.com
客户服务电话		95513	95558
传真		010-66500934	021-58776103
注册地址		贵州省贵阳市云岩区中华北路216号	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-40层
办公地址		北京市西城区锦什坊街26号恒奥中心C座3A	上海市浦东新区世博馆路138号
邮政编码		100033	200126
法定代表人		陶永泽	方合英

### 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.hczq.com
基金中期报告备置地点	基金管理人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号
会计师事务所	大华会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市海淀区西四环中路16号院7号楼12层

## §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

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	华创证券创享一年 持有期A	华创证券创享一年 持有期B
本期已实现收益	134,759.05	230,012.58
本期利润	1,711,777.63	2,300,144.60
加权平均基金份额本期利润	0.0274	0.0208
本期加权平均净值利润率	1.71%	2.07%
本期基金份额净值增长率	1.90%	1.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	32,133,542.51	476,316.66
期末可供分配基金份额利润	0.5978	0.0100
期末基金资产净值	86,317,677.67	48,005,449.13
期末基金份额净值	1.6059	1.0100
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.18%	1.00%

注：1、本基金合同生效为2021年12月24日；

2、所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；

3、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；

4、对期末可供分配利润，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；

5、表中的“期末”指报告期最后一日，即2023年6月30日。

## 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

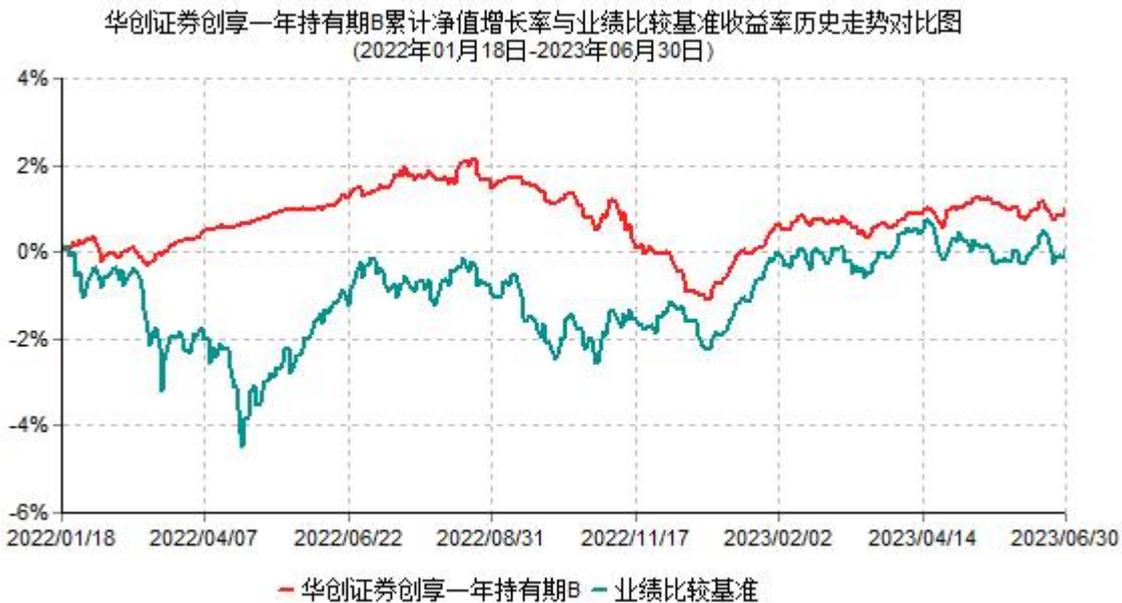
华创证券创享一年持有期A

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	0.09%	0.11%	0.31%	0.17%	-0.22%	-0.06%
过去三个月	0.49%	0.09%	-0.09%	0.16%	0.58%	-0.07%
过去六个月	1.90%	0.09%	1.92%	0.16%	-0.02%	-0.07%
过去一年	0.27%	0.11%	0.36%	0.18%	-0.09%	-0.07%
自基金合同生效起至今	2.18%	0.10%	-0.16%	0.23%	2.34%	-0.13%

华创证券创享一年持有期B

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	0.04%	0.11%	0.31%	0.17%	-0.27%	-0.06%
过去三个月	0.34%	0.09%	-0.09%	0.16%	0.43%	-0.07%
过去六个月	1.60%	0.09%	1.92%	0.16%	-0.32%	-0.07%
过去一年	-0.33%	0.11%	0.36%	0.18%	-0.69%	-0.07%
自基金合同生效起至今	1.00%	0.10%	0.07%	0.23%	0.93%	-0.13%

### 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



## §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

华创证券有限责任公司成立于2002年，拥有全证券业务牌照、实施多业务综合经营的全国性综合金融服务机构。公司已构建起横跨场内场外多层次资本市场，公募与私募相互结合，标准与非标准业务互为补充，一体化的综合金融服务架构和多元化的互联网

金融生态体系，以差异化和特色化的产品和服务，满足客户多样化的“投资融资与财富管理”需求。

2011年4月18日，中国证监会以“关于核准华创证券有限责任公司证券资产管理业务的批复”（证监许可（2011）571号）核准公司开展证券资产管理业务。业务类型全面，客户覆盖广泛，形成以资管计划为核心工具，以场内投资、同业存款、资产权益转让、股票质押式回购、资产证券化、新三板投资、定向增发和非标债权投融资等为基础业务的产品与服务体系。华创证券根据《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》的要求，截至2021年12月24日完成旗下大集合产品华创证券创享一年持有期集合资产管理计划的公募化改造。

#### 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		
肖帅	投资经理	2021-12-24	-	7年	肖帅女士，证券执业编号S0360120040012，已取得基金从业资格，证书编号：A20190703006421，中国科学院大学管理学院硕士，7年投资交易经验。2013年6月-2015年5月任职于包商银行股份有限公司资产管理部，从事理财产品的资产配置及投资交易工作，2015年6月加入华创证券有限责任公司，任固定收益投资经理，无兼职机构。最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

注：1、本基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

- 3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；
- 4、本基金投资经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 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

债券方面，2023年一季度，债市收益率曲线平坦化上行，其中短端利率在资金利率往政策利率回归的情况下，上行幅度最大；长端在弱复苏背景下，保持区间震荡，10年国债相较2022年末上行1bp；进入4月后，受宏观经济下行、预期减弱等影响，债券市场走强，长短端利率均出现明显下行。6月中旬央行公开市场操作利率下调，打开了市场对于宽货币的预期，债券市场也跟随下行，10年国债收益率最低下行至2.62%附近，之后在止盈盘及“宽信用”预期的扰动下，10年期国债收益率在2.65%-2.7%的区间震荡。

股市方面，上半年A股市场经历了两个阶段，主要以农历新年做为分界点。年前国内防疫政策放开，叠加地产政策松绑，市场对于经济复苏的预期比较乐观，进而A股由底部开始全面上涨。年后市场对于经济复苏的预期，逐步回归到弱现实的基本面，A股主要板块呈现逐步回调态势。与此同时，在宏观经济弱复苏的背景下，市场出现了人工智能、“中特估”两个强主题，相关股票出现大幅上涨。

股票方面，本基金基于对市场的判断，上半年维持中等仓位，个券方面，主要选择估值较低的标的进行参与。债券方面，账户主要以中高等级信用债持有为主，获取稳定的票息收入。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末华创证券创享一年持有期A基金份额净值为1.6059元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.90%，同期业绩比较基准收益率为1.92%；截至报告期末华创证券创享一年持有期B基金份额净值为1.0100元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.60%，同期业绩比较基准收益率为1.92%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济方面，6月制造业PMI中生产和新订单分项均有一定的回升，企业主动去库存最快的时期可能已经过去。若后续稳增长政策有所落地且效果逐渐显现，7-8月基本面可能环比改善。虽然中期而言，居民部门信用扩张乏力，房地产市场处于向新发展模式过度的过程中；但我们预计，在市场对经济预期已经较弱的情况下，三季度经济继续下滑的可能行偏小。对应到权益方面，目前顺周期板块已经回归到了较低估值水平，我们一方面认为股价继续大幅下跌的风险不大，另一方面股价上涨也缺乏逻辑支撑，后续更多体现为一些结构性机会。但中长期来看，当下的权益市场状况，为未来股市反转提供了较好的基础，我们将密切跟踪基本面和市场预期，当有指标出现较大改善时，可以加大相关板块的配置。

下半年本基金债券部分仍将以中高等级信用债为主，保持一定的杠杆水平，以获取稳定的票息收益为主；权益部分将根据市场情况，利用自上而下与自下而上相结合的资产配置方式，优化个股持仓。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定及集合计划合同约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查本基金资产净值和本基金份额申购、赎回价格。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行收益分配。

#### 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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金2023年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人认为，华创证券有限责任公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2023年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	735,004.67	1,387,206.54
结算备付金		2,362,945.37	1,355,136.16
存出保证金		24,700.83	62,965.62
交易性金融资产	6.4.7.2	169,228,232.70	300,570,028.51
其中：股票投资		13,769,183.69	20,960,074.00
基金投资		-	-
债券投资		155,459,049.01	279,609,954.51
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		201.00	200.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		172,351,084.57	303,375,536.83
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		37,412,212.71	13,004,461.15
应付清算款		12,230.96	556,286.43
应付赎回款		183,544.91	-
应付管理人报酬		182,206.90	394,449.72
应付托管费		19,880.25	37,162.72
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		45,716.74	90,861.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	172,165.30	196,561.78
负债合计		38,027,957.77	14,279,783.19
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	101,278,147.78	243,464,020.37
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	33,044,979.02	45,631,733.27
净资产合计		134,323,126.80	289,095,753.64
负债和净资产总计		172,351,084.57	303,375,536.83

注：报告截止日2023年06月30日,基金份额净值134,323,126.80元，基金份额总额101,278,147.78份，其中华创证券创享一年持有期A基金份额净值86,317,677.67元，基金份额总额53,749,015.31份。华创证券创享一年持有期B基金份额净值48,005,449.13元，基金份额总额47,529,132.47份。

## 6.2 利润表

会计主体：华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		5,484,207.40	5,915,427.06
1.利息收入		41,661.09	210,324.76

其中：存款利息收入	6.4.7.8	31,288.04	74,131.03
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		10,373.05	136,193.73
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,795,395.71	6,211,706.54
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-482,758.02	-768,718.12
基金投资收益	6.4.7.10	-	-
债券投资收益	6.4.7.11	2,126,823.09	6,923,744.66
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
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	151,330.64	56,680.00
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	3,647,150.60	-506,604.24
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		1,472,285.17	931,199.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	926,816.99	573,571.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	52,502.15	85,563.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		351,310.63	126,542.80
其中：卖出回购金融资产支出		351,310.63	126,542.80
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		13,492.41	13,781.04
8. 其他费用	6.4.7.19	128,162.99	131,740.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,011,922.23	4,984,227.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,011,922.23	4,984,227.63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,011,922.23	4,984,227.63

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06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）	243,464,020.37	-	45,631,733.27	289,095,753.64
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）	243,464,020.37	-	45,631,733.27	289,095,753.64

值)				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-142,185,872.59	-	-12,586,754.25	-154,772,626.84
（一）、综合收益总额	-	-	4,011,922.23	4,011,922.23
（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）	-142,185,872.59	-	-16,598,676.48	-158,784,549.07
其中：1.基金申购款	1,299,000.26	-	7,467.74	1,306,468.00
2.基金赎回款	-143,484,872.85	-	-16,606,144.22	-160,091,017.07
（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）	101,278,147.78	-	33,044,979.02	134,323,126.80
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06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）	215,451,132.07	-	124,564,188.64	340,015,320.71

值)				
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）	215,451,132.07	-	124,564,188.64	340,015,320.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	58,950,499.80	-	-47,729,175.13	11,221,324.67
（一）、综合收益总额	-	-	4,984,227.63	4,984,227.63
（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）	58,950,499.80	-	-52,713,402.76	6,237,097.04
其中：1.基金申购款	149,976,270.35	-	330,634.48	150,306,904.83
2.基金赎回款	-91,025,770.55	-	-53,044,037.24	-144,069,807.79
（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）	274,401,631.87	-	76,835,013.51	351,236,645.38
-----------------	----------------	---	---------------	----------------

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：

陶永泽

梁云

陈声

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

华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划由华创银杏低风险套利集合资产管理计划变更而来。华创银杏低风险套利集合资产管理计划的集合计划管理人为华创证券有限责任公司，集合计划托管人为中信银行股份有限公司。华创银杏低风险套利集合资产管理计划自2013年5月22日起开始募集，于2013年5月28日结束募集工作，于2013年5月31日正式成立，并于2013年7月8日取得中国证券业协会《关于华创证券有限责任公司发起设立华创银杏低风险套利集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]688号）。

根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告[2018]39号）的规定，华创银杏低风险套利集合资产管理计划参照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律法规及中国证监会的规定进行变更，并将名称变更为“华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划”。自2021年12月24日起，《华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《华创银杏低风险套利集合资产管理合同》同日起失效。

华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划存续期自基金合同生效日起，不得超过3年。本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货、股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的80%，本集合计划投资于股票资产的比例不超过集合计划资产的20%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，

本集合计划持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，集合计划管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的业绩比较基准为中债综合财富(1-3年)指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*10%+中证500指数收益率\*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颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表系在持续经营假设的基础上编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表按照7.4.2所述的编制基础编制，真实、完整地反映了按该编制基础列报的本基金本报告期末的财务状况以及本报告期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一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为 2023年1月1日至2023年6月30日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1、金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项，暂无金融

资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。本基金目前持有的分类为以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。其他金融资产划分为贷款和应收款项。

## 2、金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。其他金融负债主要包括各类应付款项。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；贷款和应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足以下条件之一的金融资产，予以最终确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果

该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的，同时本基金计划以净结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额总额所对应的金额。申购、赎回及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日确认。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算确认。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占计划净值比例计算的金额。损益平准金于计划申购确认日或计划赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额，并扣除适用情况下代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率

后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

资产支持证券利息收入按证券票面价值与预期收益率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

公允价值变动净收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日每万份收益计提红利基金红利收入；其他类型基金于除权日按基金管理公司公布的收益分配方案计算确认。

分红收益按宣告的分红比例计算的金额确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

投资交易时发生的交易费用于交易日确认并作为基金费用计入当期损益。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《资产管理合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

3、集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位该类集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本集合计划各类集合计划份额收取管理费和业绩报酬的情况不同，各集合计划份额类别对应的可供分配利润将有所不同，同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不影响投资者利益的情况下，集合计划管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上集合计划收益分配原则，此项调整不需要召开集合计划份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介和集合计划管理人网站公告。

#### **6.4.4.12 外币交易**

本基金无外币交易。

#### **6.4.4.13 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则并参照中国证监会允许的证券投资基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金参照中国证监会公告 [2017] 13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况参照《关于发布中基协 (AMAC)

基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

本基金目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

1、根据财政部和国家税务总局2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，2018年1月1日起，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，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(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照资管产品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。

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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

4、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、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税。

## 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06月30日
活期存款	735,004.67
等于：本金	734,901.12
加：应计利息	103.55
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	735,004.67

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2023年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		15,370,543.40	-	13,769,183.69	-1,601,359.71
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	67,819,903.39	859,475.30	68,263,205.10	-416,173.59
	银行间市场	85,676,982.00	1,173,543.91	87,195,843.91	345,318.00
	合计	153,496,885.39	2,033,019.21	155,459,049.01	-70,855.59
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		168,867,428.79	2,033,019.21	169,228,232.70	-1,672,215.30

### 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。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 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买入返售金融资产期末余额。

#### 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 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	90,961.24
其中：交易所市场	85,316.05
银行间市场	5,645.19
应付利息	-
预提费用	76,404.06
预提费用-账户维护费	4,800.00
合计	172,165.30

#### 6.4.7.6 实收基金

##### 6.4.7.6.1 华创证券创享一年持有期A

金额单位：人民币元

项目 (华创证券创享一年持有期A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	80,907,101.56	80,907,101.56
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-27,158,086.25	-27,158,086.25
本期末	53,749,015.31	53,749,015.31

##### 6.4.7.6.2 华创证券创享一年持有期B

金额单位：人民币元

项目 (华创证券创享一年持有期B)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	162,556,918.81	162,556,918.81
本期申购	1,299,000.26	1,299,000.26
本期赎回（以“-”号填列）	-116,326,786.60	-116,326,786.60
本期末	47,529,132.47	47,529,132.47

### 6.4.7.7 未分配利润

#### 6.4.7.7.1 华创证券创享一年持有期A

单位：人民币元

项目 (华创证券创享一年持有期A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	47,694,830.31	-1,099,695.61	46,595,134.70
本期利润	134,759.05	1,577,018.58	1,711,777.63
本期基金份额交易产生的变动数	-15,696,046.85	-42,203.12	-15,738,249.97
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-15,696,046.85	-42,203.12	-15,738,249.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,133,542.51	435,119.85	32,568,662.36

#### 6.4.7.7.2 华创证券创享一年持有期B

单位：人民币元

项目 (华创证券创享一年持有期B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,305,854.47	-3,269,255.90	-963,401.43
本期利润	230,012.58	2,070,132.02	2,300,144.60
本期基金份额交易产生的变动数	-1,753,705.68	893,279.17	-860,426.51
其中：基金申购款	20,336.39	-12,868.65	7,467.74
基金赎回款	-1,774,042.07	906,147.82	-867,894.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	782,161.37	-305,844.71	476,316.66

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	16,914.59
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	14,038.12
其他	335.33
合计	31,288.04

#### 6.4.7.9 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01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	32,822,212.28
减：卖出股票成本总额	33,224,021.53
减：交易费用	80,948.77
买卖股票差价收入	-482,758.02

#### 6.4.7.10 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 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01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	3,956,892.73
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,830,069.64
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	2,126,823.09

### 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01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	377,166,737.39
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	370,494,082.88
减：应计利息总额	8,485,933.97
减：交易费用	16,790.18
买卖债券差价收入	-1,830,069.64

### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益赎回差价收入。

### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益申购差价收入。

### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
----	-------------------------------

股票投资产生的股利收益	151,330.64
基金投资产生的股利收益	-
合计	151,330.64

#### 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01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	3,647,150.60
——股票投资	-522,434.78
——债券投资	4,169,585.38
——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	3,647,150.60

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 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01月01日至2023年06月30日

审计费用	12,396.69
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	7,667.09
帐户维护费	32,100.00
其他	9,000.00
TA服务费	7,491.84
合计	128,162.99

#### 6.4.7.20 分部报告

本基金本报告期内无分部报告。

#### 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，本基金无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无需要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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

##### 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
华创证券有限责任公司	基金管理人
中信银行股份有限公司	基金托管人

#### 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01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06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
华创证券 有限责任 公司	59,394,839.59	100.00%	56,579,793.05	100.00%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
华创证券 有限责任 公司	131,603,666.09	100.00%	730,619,269.39	100.00%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券回 购成交总额的 比例	成交金额	占当期债券回 购成交总额的 比例
华创证券 有限责任 公司	2,086,160,000.00	100.00%	2,381,600,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 基金交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的基金交易。

#### 6.4.10.1.6 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01月01日至2023年06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
华创证券有限责任公司	77,664.27	100.00%	85,316.05	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06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
华创证券有限责任公司	139,747.37	100.00%	220,314.57	100.00%

#### 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01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	926,816.99	573,571.04
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1、支付基金管理人华创证券的管理人报酬按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日计提并按季支付。其计算公式为：每日应计提的集合计划管理费=前一日的基金资产净值×每类份额的年管理费率÷当年天数。其中，A类份额的年管理费率为0.2%，B类份额的年管理费率为0.8%。

2、其中当期发生的基金应支付管理费为542,661.76元，已实现业绩报酬为384,155.23元。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日至2023年06月30日	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	52,502.15	85,563.68

注：支付基金托管人中信银行的托管人报酬按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日计提并按季支付。其计算公式为：每日应计提的集合计划托管费=前一日的基金资产净值×0.05%÷当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

#### 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

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生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 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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，没有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 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01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	734,901.12	16,914.59	1,302,917.91	44,647.45

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本报告期内本基金未发生利润分配情况。

#### 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
012380296	23苏州高新SC P003	2023-07-04	101.12	57,000	5,763,771.29
102380996	23衡阳城投MT N002	2023-07-04	101.22	100,000	10,121,505.46
合计				157,000	15,885,276.75

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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

###### 1、风险管理政策

公司风险管理的目标是：保证经营的合法合规及公司内部规章制度的贯彻执行，保障客户及公司资产的安全完整，防范各类风险，使公司各类风险可控可测可承受。

公司风险管理工作的原则是：（1）全面性：风险管理针对公司面临的所有风险类别，覆盖公司及子公司的所有业务、部门和人员，渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节，确保风险管理无空白或漏洞。（2）合规性：风险管理战略必须符合国家有关法律法规、中国证监会和公司章程的有关规定，需与公司的经营规模、业务范围、风险

状况及公司所处的环境相适应，并与公司的长期发展目标保持一致。（3）制衡性：公司部门和岗位的设置需权责分明、相互制衡，有冲突职务需相对分离。（4）及时性：在风险发生或发现时及时进行风险管理，讲究时效。风险管理策略及方法根据公司经营战略、经营方针等内部环境的变化和国家法律法规等外部环境的改变及时进行完善。（5）独立性：公司建立具有独立性的风险控制体系，风险管理部门根据公司的授权独立开展风险管理工作。

公司将风险管理文化建设作为公司发展战略的组成部分，培育和塑造“居安思危、坚守底线、全面管理”的风险管理理念，并融于企业文化建设的全过程中，在相关政策和制度文件中明确规定风险管理文化的建设要求和内容，在各层面营造风险管理文化的氛围。

## 2、风险管理组织架构

公司风险管理的组织架构由五个层级和三道防线构成，五个层级分别为：董事会、经理层（执行委员会）、风险管理职能部门、相关业务管理支持部门、业务部门及分支机构及子公司。

三道防线分别为：相关业务管理支持部门、业务部门及分支机构为第一道防线，负责事前与事中的自我防范；风险管理部、合规与法律事务部等风险管理职能部门为第二道防线，负责事前与事中的风险管理及事后的风险处置；稽核审计部为第三道防线，执行事后的独立监督与评价职责。

## 3、对风险实行分类管理

公司风险管理覆盖各部门、分支机构开展的各项业务，对各业务进行风险识别、评估与监测。公司设置专门部门并配备专门人员对各业务进行风险识别、评估和监测；建立了与开展业务复杂程度相匹配的监控系统，实现覆盖各种风险类型、各类业务条线、各个部门、分支机构的风险识别、评估与监测。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致计划资产损失和收益变化的风险。本基金管理人制定了公司的信用风险管理机制、信用风险的管理流程、研究与调研相结合的信用风险管控方式，并通过对投资品种与交易对手的准入、集中度等措施降低投资品种和交易对手违约带来的损失程度，建立内部评级管理体系，根据内部评级实行差异化信用风险控制，定期开展信用排查，及时跟踪风险变化，防范信用风险。

本基金的银行存款存放于中信银行，该行为本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	75,360,567.85	181,499,158.08
AAA以下	72,718,738.66	77,758,538.90
未评级	7,379,742.50	20,352,257.53
合计	155,459,049.01	279,609,954.51

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。流动性风险一般存在两种形式：资产变现风险和现金流风险。

#### (1) 资产变现风险

资产变现风险是指由于基金持有的某个券种的头寸相对于市场正常的交易量过大，或由于停牌造成交易无法在当前的市场价格下成交。本基金管理人应用定量方法对各持仓品种的变现能力进行测算和分析，以对资产变现风险进行管理。

#### (2) 现金流风险

现金流风险是指基金因现金流不足导致无法应对正常基金支付义务的风险。本基金管理人对基金每日净赎回比例进行测算和分析，以对该风险进行跟踪和管理。此外，本基金管理人建立了现金头寸控制机制，以确保赎回款项的及时支付。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等，受市场利率变动影响较小。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年0 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	735,004.67	-	-	-	735,004.67
结算备付金	2,362,945.37	-	-	-	2,362,945.37
存出保证金	24,700.83	-	-	-	24,700.83
交易性	49,952,997.52	105,506,051.49	-	13,769,183.69	169,228,232.70

华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划 2023 年中期报告

金融资产					
应收申购款	-	-	-	201.00	201.00
资产总计	53,075,648.39	105,506,051.49	-	13,769,384.69	172,351,084.57
负债					
卖出回购金融资产款	37,412,212.71	-	-	-	37,412,212.71
应付清算款	-	-	-	12,230.96	12,230.96
应付赎回款	-	-	-	183,544.91	183,544.91
应付管理人报酬	-	-	-	182,206.90	182,206.90
应付托管费	-	-	-	19,880.25	19,880.25
应交税费	-	-	-	45,716.74	45,716.74
其他负债	-	-	-	172,165.30	172,165.30
负债总计	37,412,212.71	-	-	615,745.06	38,027,957.77
利率敏感度缺口	15,663,435.68	105,506,051.49	-	13,153,639.63	134,323,126.80
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	1,387,206.54	-	-	-	1,387,206.54
结算备付金	1,355,136.16	-	-	-	1,355,136.16
存出保证金	62,965.62	-	-	-	62,965.62
交易性金融资产	66,798,442.73	212,125,664.93	685,846.85	20,960,074.00	300,570,028.51
应收申购款	-	-	-	200.00	200.00

资产总计	69,603,751.05	212,125,664.93	685,846.85	20,960,274.00	303,375,536.83
负债					
卖出回购金融资产款	13,004,461.15	-	-	-	13,004,461.15
应付清算款	-	-	-	556,286.43	556,286.43
应付管理人报酬	-	-	-	394,449.72	394,449.72
应付托管费	-	-	-	37,162.72	37,162.72
应交税费	-	-	-	90,861.39	90,861.39
其他负债	-	-	-	196,561.78	196,561.78
负债总计	13,004,461.15	-	-	1,275,322.04	14,279,783.19
利率敏感度缺口	56,599,289.90	212,125,664.93	685,846.85	19,684,951.96	289,095,753.64

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 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06月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率下降25个基点	555,969.75	1,339,944.43
	市场利率上升25个基点	-551,609.90	-1,326,520.74

#### 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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的债券等资产损失的可能性。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

#### 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06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	13,769,183.69	10.25	20,960,074.00	7.25
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	13,769,183.69	10.25	20,960,074.00	7.25

#### 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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	21,677,421.90	32,520,932.07
第二层次	147,550,810.80	268,049,096.44
第三层次	-	-
合计	169,228,232.70	300,570,028.51

注：按公允价值三个层次列示了以公允价值计量的金融资产于2023年6月30日的账面价值。于2023年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币21,677,421.90元，属于第二层次的余额为人民币147,550,810.80元，无属于第三层次的余额。

##### 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证券，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，本基金分别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证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截止报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 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资产和负债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相差很小。

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	13,769,183.69	7.99
	其中：股票	13,769,183.69	7.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	155,459,049.01	90.20
	其中：债券	155,459,049.01	90.20
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,097,950.04	1.80
8	其他各项资产	24,901.83	0.01
9	合计	172,351,084.57	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

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	210,750.00	0.16
B	采矿业	578,500.00	0.43
C	制造业	12,148,969.69	9.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	183,300.00	0.14

G	交通运输、仓储和邮政业	289,064.00	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	265,800.00	0.20
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	92,800.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	13,769,183.69	10.25

### 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投资组合。

### 7.3 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	603387	基蛋生物	190,000	2,449,100.00	1.82
2	603658	安图生物	20,000	1,034,600.00	0.77
3	600887	伊利股份	35,000	991,200.00	0.74
4	002446	盛路通信	80,000	756,000.00	0.56
5	603609	禾丰股份	60,000	546,000.00	0.41
6	603733	仙鹤股份	20,000	417,000.00	0.31
7	000661	长春高新	3,000	408,900.00	0.30
8	300068	南都电源	20,000	387,200.00	0.29

9	301296	新巨丰	20,000	337,600.00	0.25
10	601958	金钼股份	30,000	334,500.00	0.25
11	002487	大金重工	10,000	308,400.00	0.23
12	600487	亨通光电	20,000	293,200.00	0.22
13	688063	派能科技	1,467	290,832.75	0.22
14	603871	嘉友国际	18,400	289,064.00	0.22
15	300073	当升科技	5,000	251,650.00	0.19
16	002155	湖南黄金	20,000	244,000.00	0.18
17	600211	西藏药业	4,000	237,600.00	0.18
18	000400	许继电气	10,000	230,500.00	0.17
19	300171	东富龙	10,000	227,500.00	0.17
20	002444	巨星科技	10,000	218,800.00	0.16
21	002865	钧达股份	1,398	213,236.94	0.16
22	002714	牧原股份	5,000	210,750.00	0.16
23	300973	立高食品	3,000	205,260.00	0.15
24	600809	山西汾酒	1,000	185,070.00	0.14
25	600298	安琪酵母	5,000	181,050.00	0.13
26	000915	华特达因	5,000	176,450.00	0.13
27	603811	诚意药业	14,000	174,020.00	0.13
28	000858	五粮液	1,000	163,570.00	0.12
29	002371	北方华创	500	158,825.00	0.12
30	600584	长电科技	5,000	155,850.00	0.12
31	601818	光大银行	50,000	153,500.00	0.11
32	300595	欧普康视	5,000	150,950.00	0.11
33	300083	创世纪	20,000	146,200.00	0.11
34	300673	佩蒂股份	10,000	140,000.00	0.10
35	688680	海优新材	1,000	121,820.00	0.09
36	600966	博汇纸业	20,000	118,400.00	0.09
37	002597	金禾实业	5,000	118,000.00	0.09
38	300432	富临精工	10,000	116,200.00	0.09
39	600861	北京城乡	5,000	116,000.00	0.09

40	000001	平安银行	10,000	112,300.00	0.08
41	000568	泸州老窖	500	104,785.00	0.08
42	001330	博纳影业	10,000	92,800.00	0.07
43	002121	科陆电子	10,000	73,300.00	0.05
44	000950	重药控股	10,000	67,300.00	0.05
45	002532	天山铝业	10,000	59,900.00	0.04

## 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	603387	基蛋生物	2,397,892.00	0.83
2	002446	盛路通信	1,640,546.00	0.57
3	000661	长春高新	902,190.00	0.31
4	601318	中国平安	724,911.00	0.25
5	603733	仙鹤股份	699,355.00	0.24
6	688063	派能科技	654,535.40	0.23
7	002402	和而泰	649,200.00	0.22
8	002444	巨星科技	613,371.00	0.21
9	002155	湖南黄金	598,339.00	0.21
10	601012	隆基绿能	487,872.00	0.17
11	300068	南都电源	474,301.00	0.16
12	600887	伊利股份	470,200.00	0.16
13	300463	迈克生物	379,200.00	0.13
14	000625	长安汽车	378,200.00	0.13
15	301296	新巨丰	370,800.00	0.13
16	002487	大金重工	364,400.00	0.13
17	601186	中国铁建	359,600.00	0.12
18	601668	中国建筑	359,200.00	0.12
19	002645	华宏科技	357,659.00	0.12

20	601238	广汽集团	344,100.00	0.12
----	--------	------	------------	------

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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	300750	宁德时代	1,920,500.00	0.66
2	600487	亨通光电	1,914,013.00	0.66
3	300274	阳光电源	1,811,015.00	0.63
4	601958	金钼股份	1,593,114.00	0.55
5	002446	盛路通信	1,030,697.00	0.36
6	300122	智飞生物	930,150.00	0.32
7	600585	海螺水泥	855,900.00	0.30
8	601369	陕鼓动力	840,000.00	0.29
9	300443	金雷股份	835,012.00	0.29
10	601318	中国平安	778,002.00	0.27
11	300294	博雅生物	759,934.00	0.26
12	002155	湖南黄金	700,700.00	0.24
13	002402	和而泰	677,548.00	0.23
14	300014	亿纬锂能	673,250.00	0.23
15	688007	光峰科技	591,087.47	0.20
16	300073	当升科技	581,000.00	0.20
17	603612	索通发展	564,000.00	0.20
18	002572	索菲亚	515,700.00	0.18
19	002487	大金重工	456,979.50	0.16
20	002557	洽洽食品	444,100.00	0.15

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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	26,555,566.00
卖出股票收入（成交）总额	32,822,212.28

注：1、“买入股票成本总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用；

2、“卖出股票收入总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）扣除增值税及附加税后填列，不考虑交易费用。

### 7.5 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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	7,379,742.50	5.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,090,027.40	7.51
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	76,171,056.71	56.71
5	企业短期融资券	10,111,879.45	7.53
6	中期票据	43,798,104.74	32.61
7	可转债(可交换债)	7,908,238.21	5.89
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	155,459,049.01	115.74

### 7.6 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	占基金资产净值比例(%)
1	1980083	19宜宾翠屏债	200,000	12,565,032.79	9.35
2	152420	20天长债	150,000	12,278,386.03	9.14
3	2180050	21抚高新	100,000	10,392,657.53	7.74
4	175020	20延长Y1	100,000	10,352,575.34	7.71
5	2180157	21岳阳交投01	100,000	10,328,169.40	7.69

### 7.7 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 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

本基金本报告期末无股指期货投资。

### 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

本集合计划参与国债期货投资用于管理债券组合的久期、流动性和风险水平，以套期保值为主要目的。本集合计划构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金本报告期末投资前十名股票中未发生超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	24,700.83
2	应收清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	201.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,901.83

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113052	兴业转债	2,847,987.40	2.12
2	113616	韦尔转债	1,164,041.10	0.87
3	113053	隆22转债	1,071,539.73	0.80
4	113043	财通转债	1,066,300.11	0.79
5	127005	长证转债	539,041.10	0.40
6	113013	国君转债	524,385.62	0.39
7	110073	国投转债	324,546.58	0.24
8	110079	杭银转债	230,032.05	0.17
9	127038	国微转债	140,364.52	0.10

#### 7.12.5 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中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华创证券创享一年持有期A	499	107,713.46	0.00	0.00%	53,749,015.31	100.00%
华创证券创享一年持有期B	2,329	20,407.53	2.00	0.00%	47,529,130.47	100.00%
合计	2,828	35,812.64	2.00	0.00%	101,278,145.78	100.00%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，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）；

2、户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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	华创证券创享一年持有期A	0.00	0.00
	华创证券创享一年持有期B	28,846.14	0.06%
	合计	28,846.14	0.03%

注：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

报告期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理未持有本开放式基金。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	华创证券创享一年持有期A	华创证券创享一年持有期B
基金合同生效日(2021年12月24日)基金份额总额	275,369,830.69	-
本报告期期初基金份额总额	80,907,101.56	162,556,918.81
本报告期基金总申购份额	-	1,299,000.26
减：本报告期基金总赎回份额	27,158,086.25	116,326,786.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	53,749,015.31	47,529,132.47

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金无基金份额持有人大会决议。

### 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

本报告期内，基金管理人经研究决定调整部分高级管理人员工作分工，由周伟先生分管公司资管业务部。基金托管人的专门基金托管部门负责人调整为徐超先生。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内基金管理人涉及资产管理业务的涉讼包括：

本基金管理人代表旗下“华创证券润金1号定向资产管理计划”与被告湖北同济堂投资控股有限公司签订协议，向被告融出资金共计37500.00万元。因被告违约，本基金管理人向贵州省贵阳市中级人民法院起诉，法院于2023年6月20日出具民事判决书。该案件产生的风险及后果均由“华创证券润金1号定向资产管理计划”委托人及委托财产承担，预计对本基金正常运作无实质影响。

本基金管理人代表旗下“华创恒丰86号定向资产管理计划”进行合肥美的电冰箱有限公司诉信托侵权责任纠纷案，2022年4月13日合肥市中级人民法院出具判决后，本基金管理人已进行上诉，目前已开庭审理中。该案件产生的风险及后果均由“华创恒丰86号定向资产管理计划”委托人及委托财产承担，预计对本基金正常运作无实质影响。

本基金管理人代表旗下“华创证券华东3号定向资产管理计划”与被告新沂必康新医药产业综合体投资有限公司债权确认纠纷案，华创证券向陕西省延安市中级人民法院起诉，请求确认债权44,519.85万元及相关权益。法院于2022年12月2日出具《受理案件通知书》，本案尚未开庭审理。该案件产生的风险及后果均由“华创证券华东3号定向资产管理计划”委托人及委托财产承担，预计对本基金正常运作无实质影响。

本报告期内，未发生涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未有重大变化。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请大华会计师事务所为本基金提供审计服务，未改聘会计师事务所。

#### 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，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

##### 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，本基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 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	
华创证券	2	59,394,839.59	100.00%	77,664.27	100.00%	-

##### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华创证券	131,603,666.09	100.00%	2,086,160,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划2022年第四季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20
2	华创证券创享一年持有期集合资产管理计划招募说明书及产品概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023-02-24
3	关于华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划B类份额增加珠海盈米基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-08
4	华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划2022年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-30
5	华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划2023年第一季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-24
6	华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划2023年开放日常申购、赎回业务公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-03
7	华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划2023年开放日常申购、赎回业务公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-21

8	关于华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划 B 类份额增加上海好买基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-16
---	--	--------------	------------

## §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

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 资产管理合同、托管协议、招募说明书；
2. 定期报告，包括集合计划季度报告、中期报告和年度报告；
3. 集合计划份额净值；
4. 集合计划销售机构及联系方式；
5. 其他重要资料。

### 12.2 存放地点

北京市西城区锦什坊街26号恒奥中心C座3A华创证券

### 12.3 查阅方式

本招募说明书存放在集合计划管理人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；投资人可按工本费购买复印件，但应以正本为准。

投资者还可以直接登录集合计划管理人的网站查阅和下载招募说明书。

管理人网站[网址：[www.hczq.com](http://www.hczq.com)] [客服电话：95513]

华创证券有限责任公司  
二〇二三年八月三十一日