

创金合信添添金1号集合资产管理计划

2024年第2季度报告

2024年06月30日

资产管理人：创金合信基金管理有限公司

资产托管人：交通银行股份有限公司

## 目录

§1 重要提示 .....	3
§2 资产管理计划概况 .....	3
§3 主要财务指标和资产管理计划净值表现 .....	3
3.1 主要财务指标 .....	3
3.2 资产管理计划净值表现 .....	4
§4 管理人报告 .....	4
4.1 投资经理（或投资经理小组）简介 .....	4
4.2 公平交易、异常交易的专项说明 .....	4
§5 投资组合报告 .....	6
5.1 报告期末资产组合情况 .....	6
5.2 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 .....	6
5.3 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	6
5.4 报告期末按合约市值大小排名的前五名期货投资明细 .....	7
5.5 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排名的前五名基金投资明细 .....	7
§6 费用计提方法、计提标准和支付方式 .....	7
§7 其他重大事项 .....	8

## §1 重要提示

本资产托管人根据本资产管理合同规定，已对本报告中的主要财务指标和资产管理计划净值表现、投资组合报告等内容进行复核，认为复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产，但不保证资产一定盈利。

资产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资产管理合同。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日。

## §2 资产管理计划概况

名称	创金合信添添金 1 号集合资产管理计划
简称	创金合信添添金 1 号
代码	3M2529
存续年限	10 年
合同生效日	2023 年 12 月 13 日
报告期末计划份额	4,205,743.49 份
管理人	创金合信基金管理有限公司
托管人	交通银行股份有限公司

## §3 主要财务指标和资产管理计划净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	2024 年 04 月 01 日-2024 年 06 月 30 日
本期已实现收益	26,380.08
本期利润	36,609.99
期末资产净值	4,264,554.84
期末份额净值	1.0140

本期总分红金额	-
---------	---

### 3.2 资产管理计划净值表现

阶段	净值增长率
过去三个月	0.6152%

## §4 管理人报告

### 4.1 投资经理（或投资经理小组）简介

董莹女士，中国国籍，香港城市大学硕士、香港中文大学（深圳）硕士。2013年2月加入宏信证券有限责任公司，先后在固定收益总部、资产管理总部担任高级交易经理。2019年7月加入创金合信基金管理有限公司，曾任研究员，现任投资经理。

### 4.2 公平交易、异常交易的专项说明

#### 4.2.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规，公司制定了《创金合信基金管理有限公司公平交易与异常交易管理制度》，该《制度》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

#### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资风格库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

#### 2、交易执行的内部控制

公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；同时严格限制同一投资组合的当日反向交易，以及严格控制不同投资组合之间可能导致不公平交易和利益输送的同日反

向交易。

### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

### 4、公平交易监控

公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。合规与风险管理部、交易室负责异常交易的日常实时监控，合规与风险管理部于每季度、每半年度和每年度对公司管理的不同投资组合不同时间窗内（如1日内、3日、5日内）同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

#### 4.2.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司参照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工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。本报告期内公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《创金合信基金管理有限公司公平交易与异常交易管理制度》对本报告期同向交易价差进行了专项分析，未发现异常交易情况。

#### 4.2.3 异常交易行为的专项说明

本计划本报告期内未发现异常交易行为。

#### 4.2.4 本报告期关联交易汇报

本报告期与计划发生关联交易的各关联方

与本计划的关系	名称
管理人	创金合信基金管理有限公司及其关联方
托管人	交通银行股份有限公司及其关联方
投资顾问	无

资产管理人秉持勤勉尽责的理念，根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理计划备案办法》等其他

法律法规及合同对于关联交易信息披露的规定，对于本报告期内资产管理计划进行的关联交易进行汇报。重大关联交易是指资产管理人运用计划财产投资于资产管理人、资产托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券以及中国证监会、基金业协会规定的其他重大关联交易情形；本报告期内该资产管理计划未进行关联交易。管理人关联方清单详见附件。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	证券投资基金	3,565,223.22	83.54
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	72,249.58	1.69
7	其他资产	630,000.00	14.76
8	合计	4,267,472.80	100.00

### 5.2 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：本产品本报告期末未持有股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占资产净值比例 (%)
-	-	-	-	-	-

注：本产品本报告期末未持有债券。

## 5.4 报告期末按合约市值大小排名的前五名期货投资明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量(手) (买/卖)	合约市值	公允价值变动
-	-	-	-	-

注：本产品本报告期末未持有期货。

## 5.5 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排名的前五名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金代码	基金名称	数量 (份)	公允价值	占资产净值比例 (%)
1	BZ21146	明淼十号	1,385,052.85	1,511,785.19	35.45
2	BZ18050	民生通惠民汇 20 号	916,743.06	1,106,050.50	25.94
3	BZ22132	民生通惠民汇 62 号	901,158.12	947,387.53	22.22

## §6 费用计提方法、计提标准和支付方式

固定管理费
<p>本计划的年固定管理费率为 0.15%。固定管理费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.15\% \div 365$ <p>H 为每日应计提的固定管理费 E 为前一日的计划财产净值</p> <p>本计划的固定管理费自资产管理计划成立之日起，每日计提，按自然季度支付</p>

托管费
-----

本计划的年托管费率为 0.01%。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.01\% \div 365$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的计划财产净值

本计划的托管费自资产管理计划成立之日起，每日计提，按自然季度支付

## §7 其他重大事项

本报告期内无重大事项。



## 附件：管理人关联方清单

关联法人名称	关联关系
深圳市第一创业债券研究院	公司控股股东控制的企业
深圳第一创业创新资本管理有限公司	控股股东第一创业全资子公司
第一创业证券承销保荐有限责任公司	控股股东第一创业全资子公司
第一创业投资管理有限公司	控股股东第一创业全资子公司
第一创业期货有限责任公司	控股股东第一创业全资子公司
上海市鼎泳能源科技有限公司	控股股东第一创业联营企业
深圳市鲲鹏一创私募股权投资管理有限公司	控股股东第一创业联营企业
北京亦城宏泰科技投资管理有限公司	控股股东第一创业联营企业
广东一创恒健融资租赁有限公司	控股股东第一创业间接控股子公司
中关村顺势一创（北京）私募基金投资管理股份有限公司	控股股东第一创业间接控股子公司
深圳市一新光伏新能源投资合伙企业（有限合伙）	控股股东第一创业间接控股子公司
深圳一创兴晨投资合伙企业（有限合伙）	控股股东第一创业间接控股子公司
北京一创远航投资管理有限公司	控股股东第一创业间接控股子公司
颐创（上海）文化传媒有限公司	控股股东第一创业间接控股子公司
广东恒元创私募基金管理有限公司	控股股东第一创业间接控股子公司

深圳一创新天投资管理有限公司	控股股东第一创业间接控股子公司
广东晟创私募股权投资基金管理有限公司	控股股东第一创业合营企业
深圳元山私募股权投资管理有限公司	控股股东第一创业合营企业
深圳市第一创业公益基金会	控股股东第一创业发起设立的基金会
深圳市金合荣投资合伙企业(有限合伙)	公司董监高控制的企业
深圳市金合同投资合伙企业(有限合伙)	公司董监高控制的企业
深圳市金合华投资合伙企业(有限合伙)	公司董监高控制的企业
深圳市金合中投资合伙企业(有限合伙)	公司董监高控制的企业
深圳市金合兴投资合伙企业(有限合伙)	公司董监高控制的企业
深圳市金合振投资合伙企业(有限合伙)	公司董监高控制的企业
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	公司董监高控制的企业
深圳市创基实业投资有限公司	公司全资子公司
第一创业证券股份有限公司	公司的控股股东
创金合信基金管理有限公司	公司

## 免责声明

本报告并非宣传推介材料，所载内容仅供本资产管理计划客户参考。任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或删改，否则将构成侵权。

投资有风险，请理性选择。资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托资产，但不保证本资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。本资产管理计划的过往业绩及净值高低并不预示其未来业绩表现，管理人管理的其他投资组合的业绩也不构成本资产管理计划业绩表现的保证。本资产管理计划的具体情况以法律文件为准，请仔细阅读。



创金合信基金管理有限公司

地址：中国广东省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

邮编：518000

客服电话：400-868-0666

传真：0755-25832571

公司网站：[www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com)

电子邮箱：[cjkf@cjhxfund.com](mailto:cjkf@cjhxfund.com)