

# 创金合信怡久回报债券型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 27 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

## 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.....	5
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.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
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.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	12
§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.....	14
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	38
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	44

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	44
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	44
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12	投资组合报告附注	45
§8	基金份额持有人信息	46
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	47
§9	开放式基金份额变动	47
§10	重大事件揭示	47
10.1	基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4	基金投资策略的改变	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8	其他重大事件	49
§11	影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	51
§12	备查文件目录	51
12.1	备查文件目录	51
12.2	存放地点	51
12.3	查阅方式	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信怡久回报债券型证券投资基金	
基金简称	创金合信怡久回报债券	
基金主代码	016801	
交易代码	016801	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 12 月 15 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	54,588,285.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信怡久回报债券 A	创金合信怡久回报债券 C
下属分级基金的交易代码	016801	016802
报告期末下属分级基金的份 额总额	23,382,476.28 份	31,205,809.01 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力争为投资者提供长期稳定的投资回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略。本基金综合考虑宏观经济、政策及产业趋势、市场利率、流动性水平及资产估值等因素，以定性与定量分析相结合的方式，合理评估债券、股票和现金等资产的投资价值及风险收益特征，在对整体风险水平进行有效控制的基础上，制定本基金的资产配置比例。</p> <p>2、债券投资策略。（1）久期配置策略。（2）期限结构配置策略。（3）债券类别配置策略。（4）信用类债券投资策略。对于信用类债券（含资产支持证券，下同），基金管理人将利用行业和公司的信用研究力量，对所投资的信用品种进行详细的分析及风险评估，依据不同信用债发行主体所处行业未来发展前景以及自身在行业内的竞争能力，对不同发行主体的债券进行内部评级分类。在实际投资中，投资人员还将结合个券流动性、到期收益率、税收因素、市场偏好等多方面因素进行个券选择，以平衡信用债投资的风险与收益。本基金所投资的信用债的信用评级在 AA+及以上（有债项评级的以债项评级为准，无债项评级的以主体评级为准，短期融资券、超短期融资券参照主体评级），其中本基金投资于信用评级为 AA+的信用债占信用债资产的比例为 0-50%，投资于信用评级为 AAA 的信用债占信用债资产的比例为 50%-100%。上述信用评级为债项评级，短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级，本基金投资的信用债若无债项评级的，参照主体信用评级。本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级，评级机构以基金管理人选定为准。基金持有信用债期</p>

	<p>间, 如果其信用等级下降、基金规模变动、变现信用债支付赎回款项等使得投资比例不再符合上述约定, 应在评级报告发布之日或不再符合上述约定之日起 3 个月内调整至符合约定。(5) 跨市场套利策略。(6) 回购放大策略。(7) 可转换债券和可交换债券投资策略。</p> <p>3、股票投资策略。(1) A 股投资策略。本基金的权益类投资以实现绝对收益为目标, 严格控制权益类投资组合下跌风险。(2) 港股通标的股票投资策略。(3) 存托凭证的投资策略。</p> <p>4、国债期货投资策略。为更好地管理投资组合的利率风险、改善组合的风险收益特性、优化资产期限配置结构, 本基金将根据风险管理的原则, 以套期保值为主要目的, 在风险可控的前提下, 参与国债期货的投资。</p> <p>5、信用衍生品投资策略。本基金按照风险管理原则, 以风险对冲为目的, 参与信用衍生品交易。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略, 审慎开展信用衍生品投资, 合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。同时, 本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理, 合理分散交易对手方、创设机构的集中度, 对交易对手方、创设机构的财务状况、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。</p>
业绩比较基准	中债新综合财富(总值)指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*8%+中证港股通综合指数收益率*2%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金, 长期来看, 其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金, 低于混合型基金和股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票, 需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	创金合信基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田
	联系电话	0755-82820166
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com
客户服务电话	400-868-0666	95528
传真	0755-25832571	021-63602540
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)	上海市中山东一路 12 号
办公地址	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码	518052	200126

法定代表人	钱龙海	张为忠
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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、创金合信怡久回报债券 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	266,162.06
本期利润	24,346.45
加权平均基金份额本期利润	0.0009
本期加权平均净值利润率	0.09%
本期基金份额净值增长率	0.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	689,736.62
期末可供分配基金份额利润	0.0295
期末基金资产净值	24,072,212.90
期末基金份额净值	1.0295
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.95%

#### 2、创金合信怡久回报债券 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	108,908.47
本期利润	-66,918.43
加权平均基金份额本期利润	-0.0134
本期加权平均净值利润率	-1.31%
本期基金份额净值增长率	-0.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	659,507.34
期末可供分配基金份额利润	0.0211
期末基金资产净值	31,865,316.35
期末基金份额净值	1.0211
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.11%

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

创金合信怡久回报债券 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	-1.03%	0.13%	0.47%	0.05%	-1.50%	0.08%
过去三个月	-0.09%	0.19%	1.57%	0.08%	-1.66%	0.11%
过去六个月	0.32%	0.28%	3.63%	0.09%	-3.31%	0.19%
过去一年	1.07%	0.22%	4.42%	0.09%	-3.35%	0.13%
自基金合同生效起至今	2.95%	0.19%	7.03%	0.09%	-4.08%	0.10%

创金合信怡久回报债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.07%	0.13%	0.47%	0.05%	-1.54%	0.08%
过去三个月	-0.31%	0.19%	1.57%	0.08%	-1.88%	0.11%
过去六个月	-0.01%	0.28%	3.63%	0.09%	-3.64%	0.19%
过去一年	0.43%	0.22%	4.42%	0.09%	-3.99%	0.13%
自基金合同生效起至今	2.11%	0.19%	7.03%	0.09%	-4.92%	0.10%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基

## 准收益率变动的比较

创金合信怡久回报债券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  
(2022年12月15日-2024年06月30日)



创金合信怡久回报债券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  
(2022年12月15日-2024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 2 日获得中国证监会核准设立的批复，2014 年 7 月 9 日成立，注册地为深圳市。目前创金合信基金注册资本为 26,096 万元人民币，第一创业证券股份有限公司出资比例为 51.072961%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）

出资比例为 23.287094%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.47195%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.160791%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 3.490956%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 3.969957%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.910331%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.63596%。

创金合信基金始终坚持“客户利益至上”，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		
刘润哲	本基金基金经理、稳固收益部负责人	2022 年 12 月 22 日	-	12	刘润哲先生，中国国籍，硕士。2011 年 9 月加入美林银行（Merrill Lynch），任投资顾问，2012 年 9 月加入中国人寿保险股份有限公司，任精算部主管，2016 年 1 月加入中国民生银行股份有限公司，任资产管理部投资经理，2022 年 5 月加入创金合信基金管理有限公司，现任稳固收益部负责人、基金经理。
黄弢	本基金基金经理、权益投研总部、行业投资研究部、风格策略投资部、稳健收益投资部负责人	2022 年 12 月 15 日	-	21	黄弢先生，中国国籍，清华大学硕士。2002 年 7 月加入长城基金管理有限公司，任市场部渠道主管，2005 年 11 月加入海富通基金管理有限公司，任市场部南方区总经理，2008 年 2 月加入深圳市鼎诺投资管理有限公司，任公司执行总裁，2017 年 5 月加入北京和聚投资管理有限公司，任首席策略师，2018 年 4 月加入上海禾驹投资管理中心（有限合伙），任首席策略师，2020 年 2 月加入创金合信基金管理有限公司，现任权益投研总部负责人、兼任行业投资研究部、风格策略投资部和稳健收益投资部负责人、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

国内经济在上半年更多的会体现为去年的延续，内生经济修复动能不足，叠加一定的价格风险，1-3月份高频数据已经出现了阶段性好转，3月PMI升至荣枯线以上，但进入二季度经济基本面逐渐有所转弱，近期数据显示制造业景气度不佳，消费品价格下滑，消费需求回落，同时地产大环境仍然偏弱，6月一线城市销售成为难得的亮点，但房价、地产投资、开工、竣工等指标仍无起色。5月份一系列政策出台后，目前处于边走边看效果的节奏，从政策相对强弱关系看，货币化投放>解决地产企业流动性危机>降低贷款利率>首付比例/购房条件等其他政策，当前政策力度马上扭转房价下跌预期不太现实，后续如果成交/房价数据下滑，可对后续进一步增量政策予以期待。市场在经历了1月至2月风险偏好的快速下杀后伴随经济面转好出现超跌反弹，5月份上半月在政策刺激预期下，指数都出现明显涨幅，市场阶段性有偏热/投机倾向，后续在基本面跟踪验证中，高频数据出现持续放缓，市场开始担心二季度的制造业景气度更多是一轮小级别补库周期，叠加海外关税+制裁风险，市场同步回落。产品一季度产品主要配置于贵金属、整车及汽车零部件、AIGC及衍生方向、消费电子、半导体、公路、军工、大众消费品等；二季度减配铜、煤、aipc及衍生、大众消费品，增配水电、黄金、半导体设备、化工。全年维度看好科技、有色金属及

高股息的投资机会。债券方面，整体上半年延续震荡下行趋势，基本面压力和流动性合理充裕的预期会对中期利率走势形成支撑，但需关注资金面扰动、政策预期以及介入操作等带来可能的市场风险因素，整体判断为短多长空，固收组合整体维持中性偏低久期，保持一定杠杆套息水平。上半年债券牛市行情是对基本面情况的一种客观定价，但近期交易成分中资金推动的定价占比因素明显提升，需对市场的反身性保持警惕。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信怡久回报债券 A 基金份额净值为 1.0295 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.32%，同期业绩比较基准收益率为 3.63%；截至本报告期末创金合信怡久回报债券 C 基金份额净值为 1.0211 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.01%，同期业绩比较基准收益率为 3.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面，2024 年国内外两个方向都处于复杂且充满挑战的状态。美国在经历了快速加息周期后，今年的主要方向将进入降息周期，但由于本身美国经济的韧性以及美联储的预期管理方式，整体降息的节奏的变化对大宗商品以及风险资产的定价会造成较大的波动。此外美国 2024 年进入大选年，在脱钩的大背景下，大选年地缘政治和贸易摩擦有进一步升级的风险，在组合配置中将予以关注。国内目前房地产整体系统性风险已得到了较大程度的控制，LPR 等政策利率的下调以及其他相关政策会适当缓解房价下降的压力，但房价及衍生行业景气程度仍处于下行通道中；制造业普遍仍存在一定的供给过剩压力，这是 21 年在国际供需格局错配下进一步加深的产业后遗症，整体需要时间以及拓展加深贸易出口方来进行消化，同时有望看到类似供给侧改革的宏观政策加速出清的过程。

今年 7 月三中全会召开，是对中期政治经济脉络影响比较深远的一次会议，除了明确了全面深化改革、构建高质量发展体制机制等重要内容以外，在这个会议上也提到了将坚定不移地完成全年经济工作任务的短期目标，反映了政策制定者也对经济趋势提升了关注。上半年从数据反应的经济增长成色上看不太乐观，在一季度制造业和出口相对景气的情况下，二季度经济数据出现了下滑，下半年压力有可能会更大，可以预料到下半年经济上的逆周期调节节奏和力度上会比上半年有所加强，这里面中央财政可能是目前最有效的加码途径之一。最近另一件对资本市场影响较大的宏观因素是日元加息，我们倾向于把它作为一个中期的变量理解，而不是作为一次性的冲击考虑。虽然波动来源于资金负债端，AI、科技行业景气度和海外宏观基本面并未确定性地发生明显转向，但作为全球资本的主要杠杆负债来源，全球 carry trade 体量在过去持续性的上涨中增加到了非常高的水平，本次日元回流的影响幅度很有可能超过预期，造成短时间内市场的剧烈波动，对应的对市场中相关存在映射关系的标的需要谨慎对待。

#### 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

截至本财务报告批准报出日，本基金已出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千元的情形，该情形发生的时间范围为 2024 年 4 月 2 日起至 2024 年 6 月 25 日。

自 2024 年 6 月 14 日至 2024 年 6 月 30 日，基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对创金合信怡久回报债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：创金合信怡久回报债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	4,644,977.83	630,535.53
结算备付金		120,741.60	231,745.25
存出保证金		13,773.08	8,546.57
交易性金融资产	6.4.7.2	53,287,431.31	74,889,226.20
其中：股票投资		6,813,501.73	8,129,193.88
基金投资		-	-
债券投资		46,473,929.58	66,760,032.32
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		1,037,795.72	-
应收股利		131.72	-
应收申购款		5,000,000.00	3,095,228.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		64,104,851.26	78,855,281.98
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		3,500,000.00	3,599,670.56
应付清算款		4,615,182.04	319,823.14
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		11,734.03	16,741.35
应付托管费		2,346.81	3,348.29
应付销售服务费		1,435.21	1,678.56
应付投资顾问费		-	-
应交税费		261.45	1,660.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	36,362.47	121,056.39
负债合计		8,167,322.01	4,063,979.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	54,588,285.29	73,065,884.79
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,349,243.96	1,725,418.08
净资产合计		55,937,529.25	74,791,302.87
负债和净资产总计		64,104,851.26	78,855,281.98

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，创金合信怡久回报债券 A 份额净值 1.0295 元，基金份额总额 23,382,476.28 份；创金合信怡久回报债券 C 份额净值 1.0211 元，基金份额总额 31,205,809.01 份；总份额合计 54,588,285.29 份。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信怡久回报债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		125,474.66	1,393,754.65
1.利息收入		9,591.86	14,313.30
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,113.15	6,004.36
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		6,478.71	8,308.94
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		533,406.67	1,643,038.05
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-192,764.49	256,204.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	685,443.18	1,337,391.62
资产支持证券投资 收益	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	40,727.98	49,442.10
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	-417,642.51	-272,002.19
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	118.64	8,405.49
减：二、营业总支出		168,046.64	359,245.98
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	76,655.16	147,311.18
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	15,331.08	29,462.24
3.销售服务费	6.4.10.2.3	8,991.57	5,954.72
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		38,941.08	95,364.84
其中：卖出回购金融资产 支出		38,941.08	95,364.84
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		546.61	1,837.45
8.其他费用	6.4.7.19	27,581.14	79,315.55
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-42,571.98	1,034,508.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		-42,571.98	1,034,508.67
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-42,571.98	1,034,508.67

### 6.3 净资产变动表

会计主体：创金合信怡久回报债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	73,065,884.79	-	1,725,418.08	74,791,302.87
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	73,065,884.79	-	1,725,418.08	74,791,302.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,477,599.50	-	-376,174.12	-18,853,773.62
（一）、综合收益总额	-	-	-42,571.98	-42,571.98
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-18,477,599.50	-	-333,602.14	-18,811,201.64
其中：1.基金申购款	57,266,193.59	-	1,311,678.29	58,577,871.88
2.基金赎回款	-75,743,793.09	-	-1,645,280.43	-77,389,073.52
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	54,588,285.29	-	1,349,243.96	55,937,529.25
项目	上年度可比期间 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	74,100,757.75	-	209,302.53	74,310,060.28
加：会计政策变更	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	74,100,757.75	-	209,302.53	74,310,060.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,824,024.75	-	1,060,529.03	-2,763,495.72
（一）、综合收益总额	-	-	1,034,508.67	1,034,508.67
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-3,824,024.75	-	26,020.36	-3,798,004.39
其中：1.基金申购款	34,830,138.58	-	521,513.09	35,351,651.67
2.基金赎回款	-38,654,163.33	-	-495,492.73	-39,149,656.06
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	70,276,733.00	-	1,269,831.56	71,546,564.56

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

创金合信怡久回报债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]2107号《关于准予创金合信怡久回报债券型证券投资基金注册的批复》核准,由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证

券投资基金法》和《创金合信怡久回报债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 321,514,853.78 元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2200208 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信怡久回报债券型证券投资基金基金合同》于 2022 年 12 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 321,586,215.87 份基金份额，其中认购资金利息折合 71,362.09 份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“上海浦东发展银行”)。

根据《创金合信怡久回报债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据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。在投资人申购时收取申购费用，但不从本类别资产中计提销售服务费的基金份额，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《创金合信怡久回报债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票)、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、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(含可分离交易可转债)、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、信用衍生品以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)。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%，其中投资于港股通标的股票占股票资产的 0-50%。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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中债新综合财富(总值)指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×8%+中证港股通综合指数收益率×2%。

#### 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》、《创金合信怡久回报债券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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	4,644,977.83
等于：本金	4,644,558.49
加：应计利息	419.34

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	4,644,977.83

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	7,221,724.07	-	6,813,501.73	-408,222.34	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	28,489,410.35	467,951.65	28,871,772.85	-85,589.15
	银行间市场	17,182,274.33	342,156.73	17,602,156.73	77,725.67
	合计	45,671,684.68	810,108.38	46,473,929.58	-7,863.48
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	52,893,408.75	810,108.38	53,287,431.31	-416,085.82	

#### 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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	21,287.65
其中：交易所市场	19,190.05
银行间市场	2,097.60
应付利息	-
预提费用	15,074.82
合计	36,362.47

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信怡久回报债券 A		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,989,784.85	35,989,784.85
本期申购	66,628.39	66,628.39
本期赎回（以“-”号填列）	-12,673,936.96	-12,673,936.96
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	23,382,476.28	23,382,476.28

创金合信怡久回报债券 C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,076,099.94	37,076,099.94
本期申购	57,199,565.20	57,199,565.20
本期赎回（以“-”号填列）	-63,069,856.13	-63,069,856.13
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	31,205,809.01	31,205,809.01

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

创金合信怡久回报债券 A
--------------

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,073,458.25	-132,259.83	941,198.42
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,073,458.25	-132,259.83	941,198.42
本期利润	266,162.06	-241,815.61	24,346.45
本期基金份额交易产生的变动数	-382,958.05	107,149.80	-275,808.25
其中：基金申购款	1,401.95	543.31	1,945.26
基金赎回款	-384,360.00	106,606.49	-277,753.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	956,662.26	-266,925.64	689,736.62

创金合信怡久回报债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	920,531.77	-136,312.11	784,219.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	920,531.77	-136,312.11	784,219.66
本期利润	108,908.47	-175,826.90	-66,918.43
本期基金份额交易产生的变动数	-16,025.06	-41,768.83	-57,793.89
其中：基金申购款	1,398,803.34	-89,070.31	1,309,733.03
基金赎回款	-1,414,828.40	47,301.48	-1,367,526.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,013,415.18	-353,907.84	659,507.34

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,557.78
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	1,460.34
其他	95.03
合计	3,113.15

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-192,764.49
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	-192,764.49

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	31,677,648.60
减：卖出股票成本总额	31,800,622.55
减：交易费用	69,790.54
买卖股票差价收入	-192,764.49

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	407,766.28
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	277,676.90
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	685,443.18

##### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	98,214,531.98
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	96,527,660.61
减：应计利息总额	1,405,703.95
减：交易费用	3,490.52
买卖债券差价收入	277,676.90

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	40,727.98
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	40,727.98

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-417,642.51
——股票投资	-259,262.60
——债券投资	-158,379.91
——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	-417,642.51

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	118.64
合计	118.64

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	10,190.54
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,206.32
账户维护费	13,726.61
查询服务费	457.67
合计	27,581.14

### 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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	62,421,841.60	100.00%	49,919,788.16	100.00%

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	83,992,815.87	100.00%	21,648,347.11	100.00%

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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
第一创业证券股份有限公司	99,660,000.00	100.00%	165,400,000.00	100.00%

## 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	占期末应付佣金总量的比例
第一创业证券股份有限公司	46,460.41	100.00%	19,190.05	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	占期末应付佣金总量的比例
第一创业证券股份有限公司	36,568.82	100.00%	23,118.53	100.00%

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	76,655.16	147,311.18
其中：应支付销售机构的客户维护费	20,799.66	35,770.63
应支付基金管理人的净管理费	55,855.50	111,540.55

注：支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.5\% / \text{当年天数}。$$

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	15,331.08	29,462.24

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

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

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	创金合信怡久回报债券 A	创金合信怡久回报债券 C	合计
当期发生的基金应支付的销售服务费	-	-	-
创金合信直销	-	828.60	828.60
浦发银行	-	15.97	15.97
合计	-	844.57	844.57
获得销售服务费的	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信怡久回报债券 A	创金合信怡久回报债券 C	合计
创金合信直销	-	883.78	883.78
浦发银行	-	1,297.23	1,297.23
合计	-	2,181.01	2,181.01

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

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银	4,644,977.83	1,557.78	353,348.02	1,612.62

行股份有限公司				
---------	--	--	--	--

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业存款利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 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/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌开 盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
H02007	碧桂园	2024 年 4 月 3 日	重大事项停牌	0.44	尚未复牌	-	54,000	41,780.64	23,903.09	-

##### 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

截至本报告期 2024 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,500,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的金融工具风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、合规与风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行上海浦东发展银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所（场内）进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,942,308.58	3,469,412.24
合计	2,942,308.58	3,469,412.24

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

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	23,935,703.30	34,873,051.93
AAA 以下	2,197,529.36	12,422,541.22
未评级	17,398,388.34	15,995,026.93
合计	43,531,621.00	63,290,620.08

未评级债券包括国债、政策性金融债以及无第三方评级机构债项评级的其他债券。

#### 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 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 3,500,240.70 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,644,977.83	-	-	-	4,644,977.83
结算备付金	120,741.60	-	-	-	120,741.60
存出保证金	13,773.08	-	-	-	13,773.08
交易性金融资产	7,136,054.37	39,337,875.21	-	6,813,501.73	53,287,431.31
应收股利	-	-	-	131.72	131.72
应收申购款	-	-	-	5,000,000.00	5,000,000.00
应收清算款	-	-	-	1,037,795.72	1,037,795.72
资产总计	11,915,546.88	39,337,875.21	-	12,851,429.17	64,104,851.26
负债					
卖出回购金融资产款	3,500,000.00	-	-	-	3,500,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	11,734.03	11,734.03
应付托管费	-	-	-	2,346.81	2,346.81
应付销售服务费	-	-	-	1,435.21	1,435.21
应交税费	-	-	-	261.45	261.45
应付清算款	-	-	-	4,615,182.04	4,615,182.04
其他负债	-	-	-	36,362.47	36,362.47
负债总计	3,500,000.00	-	-	4,667,322.01	8,167,322.01
利率敏感度缺口	8,415,546.88	39,337,875.21	-	8,184,107.16	55,937,529.25
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	630,535.53	-	-	-	630,535.53
结算备付金	231,745.25	-	-	-	231,745.25
存出保证金	8,546.57	-	-	-	8,546.57
交易性金融资产	20,924,447.50	45,835,584.82	-	8,129,193.88	74,889,226.20
应收申购款	-	-	-	3,095,228.43	3,095,228.43
资产总计	21,795,274.85	45,835,584.82	-	11,224,422.31	78,855,281.98

负债					
卖出回购金融资产款	3,599,670.56	-	-	-	3,599,670.56
应付管理人报酬	-	-	-	16,741.35	16,741.35
应付托管费	-	-	-	3,348.29	3,348.29
应付销售服务费	-	-	-	1,678.56	1,678.56
应交税费	-	-	-	1,660.82	1,660.82
应付清算款	-	-	-	319,823.14	319,823.14
其他负债	-	-	-	121,056.39	121,056.39
负债总计	3,599,670.56	-	-	464,308.55	4,063,979.11
利率敏感度缺口	18,195,604.29	45,835,584.82	-	10,760,113.76	74,791,302.87

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-196,129.48	-241,856.60
2.市场利率平行下降25个基点	197,132.91	243,321.94	

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	1,132,161.28	-	-	-	1,132,161.28
应收股利	-	131.72	-	-	-	131.72
资产合计	-	1,132,293.00	-	-	-	1,132,293.00
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-

资产负债表外 外汇风险敞口 净额	-	1,132,293.00	-	-	-	1,132,293.00
------------------------	---	--------------	---	---	---	--------------

项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	1,027,348.09	-	-	-	1,027,348.09
资产合计	-	1,027,348.09	-	-	-	1,027,348.09
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口 净额	-	1,027,348.09	-	-	-	1,027,348.09

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	56,614.65	51,367.40
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-56,614.65	-51,367.40

#### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	6,813,501.73	12.18	8,129,193.88	10.87
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	6,813,501.73	12.18	8,129,193.88	10.87

## 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准上升 5%	576,490.38	451,373.49
	2.业绩比较基准下降 5%	-576,490.38	-451,373.49

## 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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	6,955,260.23
第二层次	46,332,171.08
第三层次	-

合计	53,287,431.31
----	---------------

#### 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 2024 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(2023 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、卖出回购金融资产和其他金融负债，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 2024 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	6,813,501.73	10.63
	其中：股票	6,813,501.73	10.63
2	固定收益投资	46,473,929.58	72.50
	其中：债券	46,473,929.58	72.50
	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	4,765,719.43	7.43
7	其他资产	6,051,700.52	9.44

8	合计	64,104,851.26	100.00
---	----	---------------	--------

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,132,161.28 元，占净值比为 2.02%。

## 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	488,625.00	0.87
B	采矿业	406,027.00	0.73
C	制造业	3,951,981.47	7.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	177,871.00	0.32
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,273.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	62,308.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	86,009.54	0.15
J	金融业	3,003.00	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	123,018.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	74,587.44	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	218,209.00	0.39
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	87,428.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	5,681,340.45	10.16

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
原材料	379,930.43	0.68
非日常生活消费品	437,648.31	0.78
能源	98,432.54	0.18
金融	86,376.03	0.15
信息技术	105,870.88	0.19
房地产	23,903.09	0.04
合计	1,132,161.28	2.02

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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	600547	山东黄金	10,400	284,752.00	0.51
1	H01787	山东黄金	22,000	312,027.04	0.56
2	600323	瀚蓝环境	10,400	217,360.00	0.39
3	605296	神农集团	6,000	210,900.00	0.38
4	600309	万华化学	2,600	210,236.00	0.38
5	300972	万辰集团	9,500	200,735.00	0.36
6	002594	比亚迪	800	200,200.00	0.36
7	002353	杰瑞股份	5,400	189,432.00	0.34
8	600585	海螺水泥	5,100	120,309.00	0.22
8	H00914	海螺水泥	4,000	67,903.39	0.12
9	H02333	长城汽车	16,000	175,818.68	0.31
10	300750	宁德时代	900	162,027.00	0.29
11	000100	TCL 科技	36,900	159,408.00	0.28
12	688059	华锐精密	3,494	158,557.72	0.28
13	600019	宝钢股份	20,600	136,990.00	0.24
14	000625	长安汽车	10,100	135,643.00	0.24
15	000338	潍柴动力	8,200	133,168.00	0.24
16	002371	北方华创	400	127,956.00	0.23
17	002840	华统股份	7,500	124,425.00	0.22
18	300661	圣邦股份	1,500	124,170.00	0.22
19	002027	分众传媒	20,300	123,018.00	0.22
20	000708	中信特钢	8,100	109,917.00	0.20
21	601127	赛力斯	1,200	109,344.00	0.20
22	H03800	协鑫科技	100,000	105,870.88	0.19
23	002039	黔源电力	5,900	103,840.00	0.19
24	601233	桐昆股份	6,500	103,740.00	0.19
25	H01088	中国神华	3,000	98,432.54	0.18
26	000933	神火股份	4,800	97,104.00	0.17
27	000333	美的集团	1,500	96,750.00	0.17
28	002050	三花智控	5,000	95,400.00	0.17
29	H09863	零跑汽车	3,900	95,393.31	0.17
30	002276	万马股份	12,700	91,059.00	0.16
31	300193	佳士科技	12,000	89,040.00	0.16
32	H09896	名创优品	2,600	88,867.65	0.16
33	688041	海光信息	1,263	88,814.16	0.16
34	601966	玲珑轮胎	4,800	88,176.00	0.16
35	600977	中国电影	7,700	82,852.00	0.15

36	603067	振华股份	6,600	76,956.00	0.14
37	002714	牧原股份	1,700	74,120.00	0.13
38	001286	陕西能源	6,300	72,639.00	0.13
39	600961	株冶集团	7,300	68,912.00	0.12
40	300413	芒果超媒	3,100	64,790.00	0.12
41	H02318	中国平安	2,000	64,617.74	0.12
42	688301	奕瑞科技	552	63,606.96	0.11
43	603193	润本股份	3,100	57,009.00	0.10
44	300415	伊之密	2,700	56,106.00	0.10
45	601369	陕鼓动力	6,900	55,338.00	0.10
46	000932	华菱钢铁	12,200	54,046.00	0.10
47	688472	阿特斯	5,060	51,510.80	0.09
48	H02015	理想汽车— W	700	44,912.98	0.08
49	301035	润丰股份	1,000	44,540.00	0.08
50	688696	极米科技	550	42,482.00	0.08
51	000975	山金国际	2,600	42,354.00	0.08
52	002568	百润股份	2,500	42,075.00	0.08
53	601899	紫金矿业	2,300	40,411.00	0.07
54	600782	新钢股份	12,000	39,840.00	0.07
55	600428	中远海特	6,100	37,332.00	0.07
56	688019	安集科技	293	36,859.40	0.07
57	000729	燕京啤酒	3,600	31,788.00	0.06
58	301080	百普赛斯	900	31,500.00	0.06
59	600096	云天化	1,600	31,072.00	0.06
60	603529	爱玛科技	1,100	30,063.00	0.05
61	301257	普蕊斯	910	25,707.50	0.05
62	603197	保隆科技	800	25,200.00	0.05
63	600026	中远海能	1,600	24,976.00	0.04
64	601336	新华保险	100	3,003.00	0.01
64	H01336	新华保险	1,600	21,758.29	0.04
65	H02007	碧桂园	54,000	23,903.09	0.04
66	601666	平煤股份	2,000	22,400.00	0.04
67	002837	英维克	1,000	21,390.00	0.04
68	002597	金禾实业	1,000	19,890.00	0.04
69	301018	申菱环境	1,000	19,440.00	0.03
70	002541	鸿路钢构	1,100	18,667.00	0.03
71	688389	普门科技	1,051	17,089.26	0.03
72	H02285	泉峰控股	1,000	16,610.78	0.03
73	600123	兰花科创	1,800	16,110.00	0.03
74	603833	欧派家居	300	16,068.00	0.03
75	H00175	吉利汽车	2,000	16,044.91	0.03
76	603259	药明康德	300	11,757.00	0.02

77	300893	松原股份	400	11,428.00	0.02
78	002985	北摩高科	500	11,015.00	0.02
79	000629	钒钛股份	3,900	9,750.00	0.02
80	688052	纳芯微	93	9,558.54	0.02
81	002149	西部材料	600	8,376.00	0.01
82	002245	蔚蓝锂芯	1,000	7,750.00	0.01
83	002558	巨人网络	700	6,608.00	0.01
84	300122	智飞生物	200	5,606.00	0.01
85	300604	长川科技	200	5,434.00	0.01
86	300454	深信服	100	5,053.00	0.01
87	300679	电连技术	100	4,023.00	0.01
88	688308	欧科亿	172	3,340.24	0.01
89	300558	贝达药业	100	3,255.00	0.01
90	600584	长电科技	100	3,171.00	0.01
91	603477	巨星农牧	100	2,870.00	0.01
92	002739	万达电影	200	2,418.00	0.00
93	301381	赛维时代	100	2,273.00	0.00
94	688668	鼎通科技	57	2,239.53	0.00
95	300364	中文在线	100	2,158.00	0.00
96	688265	南模生物	90	1,875.60	0.00
97	603712	七一二	100	1,819.00	0.00
98	605277	新亚电子	120	1,550.40	0.00
99	601226	华电重工	300	1,470.00	0.00
100	601890	亚星锚链	200	1,410.00	0.00
101	600863	内蒙华电	300	1,392.00	0.00
102	300416	苏试试验	100	1,286.00	0.00
103	688046	药康生物	97	991.34	0.00
104	601827	三峰环境	100	849.00	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	600961	株冶集团	785,388.00	1.05
2	002840	华统股份	737,950.00	0.99
3	300972	万辰集团	573,038.00	0.77
4	601966	玲珑轮胎	546,764.00	0.73
5	605296	神农集团	542,872.80	0.73
6	002555	三七互娱	504,683.00	0.67
7	600975	新五丰	500,163.00	0.67
8	000550	江铃汽车	474,021.00	0.63

9	600547	山东黄金	469,383.00	0.63
10	002594	比亚迪	443,976.00	0.59
11	688301	奕瑞科技	435,412.40	0.58
12	600418	江淮汽车	428,719.00	0.57
13	H01787	山东黄金	335,896.57	0.45
14	600900	长江电力	330,440.00	0.44
15	603193	润本股份	316,310.00	0.42
16	300750	宁德时代	313,034.00	0.42
17	603259	药明康德	309,133.00	0.41
18	688059	华锐精密	309,132.01	0.41
19	688389	普门科技	304,620.44	0.41
20	600585	海螺水泥	294,990.00	0.39

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	002840	华统股份	1,082,127.00	1.45
2	H00175	吉利汽车	856,076.81	1.14
3	600961	株冶集团	791,250.00	1.06
4	002555	三七互娱	553,214.00	0.74
5	000550	江铃汽车	541,592.00	0.72
6	600975	新五丰	492,580.00	0.66
7	601899	紫金矿业	491,244.00	0.66
8	601966	玲珑轮胎	455,033.00	0.61
9	600418	江淮汽车	447,699.00	0.60
10	600489	中金黄金	397,821.00	0.53
11	688301	奕瑞科技	394,870.40	0.53
12	002156	通富微电	356,788.00	0.48
13	605296	神农集团	344,793.00	0.46
14	600900	长江电力	341,306.00	0.46
15	002985	北摩高科	338,873.00	0.45
16	300972	万辰集团	336,903.00	0.45
17	002324	普利特	329,377.00	0.44
18	002011	盾安环境	311,858.00	0.42
19	600026	中远海能	304,405.00	0.41
20	002594	比亚迪	303,076.00	0.41

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	30,744,193.00
卖出股票收入（成交）总额	31,677,648.60

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	19,297,834.62	34.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	23,903,662.76	42.73
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	3,106,770.61	5.55
7	可转债（可交换债）	165,661.59	0.30
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	46,473,929.58	83.08

## 7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	230017	23 付息国债 17	100,000	10,284,196.72	18.39
2	019736	24 国债 05	60,000	6,071,329.32	10.85
3	115618	23 海通 13	45,000	4,646,831.42	8.31
4	148430	23 申证 04	45,000	4,637,292.90	8.29
5	188363	21 中证 10	40,000	4,234,101.04	7.57

## 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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持有国债期货合约。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货合约。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，海通证券股份有限公司出现在报告编制日前一年内被中国证券监督管理委员会立案调查的情况；中国光大银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚的情况；中国银河证券股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到中国人民银行处罚的情况；中信证券股份有限公司出现在报告编制日前一年内被中国证券监督管理委员会立案调查的情况。

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

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

### 7.12.2

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### 7.12.3 报告期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	13,773.08
2	应收清算款	1,037,795.72
3	应收股利	131.72
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,000,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	6,051,700.52

#### 7.12.4 报告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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110085	通 22 转债	93,074.97	0.17
2	113516	苏农转债	72,586.62	0.13

#### 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。

#### 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，投资组合报告中数字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
创金合信怡久回报债券 A	264	88,569.99	22,942,955.12	98.12%	439,521.16	1.88%
创金合信怡久回报债券 C	130	240,044.68	24,431,750.97	78.29%	6,774,058.04	21.71%
合计	367	148,741.92	47,374,706.09	86.79%	7,213,579.20	13.21%

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	占基金总份额比例
----	------	--------	----------

		(份)	
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信怡久回报债券 A	389,613.66	1.67%
	创金合信怡久回报债券 C	90,356.29	0.29%
	合计	479,969.95	0.88%

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	创金合信怡久回报债券 A	0~10
	创金合信怡久回报债券 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信怡久回报债券 A	10~50
	创金合信怡久回报债券 C	0~10
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信怡久回报债券 A	创金合信怡久回报债券 C
基金合同生效日(2022 年 12 月 15 日)基金份额总额	64,447,766.25	257,138,449.62
本报告期期初基金份额总额	35,989,784.85	37,076,099.94
本报告期基金总申购份额	66,628.39	57,199,565.20
减：报告期基金总赎回份额	12,673,936.96	63,069,856.13
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	23,382,476.28	31,205,809.01

## § 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

2024 年 7 月 1 日起，宋明华先生担任公司监事会主席；

2024 年 7 月 1 日起，郑晓敏女士担任公司职工监事。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	4	62,421,841.60	100.00%	46,460.41	100.00%	-

注：交易单元的选择标准和程序：

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

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

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

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

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

本基金报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	83,992,815.87	100.00%	99,660,000.00	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	创金合信怡久回报债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-19
2	创金合信基金管理有限公司关于旗下所有基金产品在直销柜台实施费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-30
3	创金合信怡久回报债券型证券投资基金 2023 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-28
4	创金合信基金管理有限公司关于创金合信怡久	公司官网、中国证券	2024-04-02

	回报债券型证券投资基金份额净值精度调整的公告	报、中国证监会基金电子披露网站	
5	创金合信怡久回报债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
6	创金合信怡久回报债券型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28
7	创金合信怡久回报债券型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28
8	创金合信怡久回报债券型证券投资基金(2024 年 6 月)招募说明书(更新)	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28

## § 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	20240101 - 20240630	19,999,900.00	0.00	0.00	19,999,900.00	36.64%
机构	2	20240104 - 20240104	10,329,562.22	0.00	10,329,562.22	0.00	0.00%
机构	3	20240104 - 20240114	9,999,000.00	0.00	9,999,000.00	0.00	0.00%
机构	4	20240625 - 20240625	0.00	9,766,578.77	0.00	9,766,578.77	17.89%

#### 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，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 家合伙企业出资设立。创金合信基金成立以来坚持以客户为中心，倡导合伙文化，致力于为客户提供优质的产品和服务。截至 2024 年 6 月 30 日，创金合信基金共管理 99 只公募基金，公募管理规模 1615.63 亿元。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信怡久回报债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信怡久回报债券型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信怡久回报债券型证券投资基金 2024 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

2024 年 8 月 29 日