

# 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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：宁波银行股份有限公司

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。

基金托管人宁波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.....                              | 5  |
| 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.....              | 10 |
| 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.....                | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 11 |
| 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....               | 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）.....                      | 12 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 12 |
| 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 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.....                    | 38 |
| 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.....       | 38 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 39 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 39 |
| 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.....      | 39 |
| 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.....   | 39 |
| 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.....   | 40 |

|      |                                |    |
|------|--------------------------------|----|
| 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 | 40 |
| 7.10 | 本基金投资股指期货的投资政策                 | 40 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明           | 40 |
| 7.12 | 本报告期投资基金情况                     | 40 |
| 7.13 | 投资组合报告附注                       | 41 |
| §8   | 基金份额持有人信息                      | 42 |
| 8.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构              | 42 |
| 8.2  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况           | 43 |
| 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   | 43 |
| 8.4  | 发起式基金发起资金持有份额情况                | 44 |
| §9   | 开放式基金份额变动                      | 44 |
| §10  | 重大事件揭示                         | 44 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议                    | 44 |
| 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    | 45 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼         | 45 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变                      | 45 |
| 10.5 | 本报告期持有的基金发生的重大影响事件             | 45 |
| 10.6 | 为基金进行审计的会计师事务所情况               | 45 |
| 10.7 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况       | 45 |
| 10.8 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况              | 45 |
| 10.9 | 其他重大事件                         | 46 |
| §11  | 影响投资者决策的其他重要信息                 | 47 |
| 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  | 47 |
| 11.2 | 影响投资者决策的其他重要信息                 | 48 |
| §12  | 备查文件目录                         | 48 |
| 12.1 | 备查文件目录                         | 48 |
| 12.2 | 存放地点                           | 48 |
| 12.3 | 查阅方式                           | 48 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                                  |                            |
|-----------------|----------------------------------|----------------------------|
| 基金名称            | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF） |                            |
| 基金简称            | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）        |                            |
| 基金主代码           | 013337                           |                            |
| 交易代码            | 013337                           |                            |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                           |                            |
| 基金合同生效日         | 2021 年 12 月 8 日                  |                            |
| 基金管理人           | 创金合信基金管理有限公司                     |                            |
| 基金托管人           | 宁波银行股份有限公司                       |                            |
| 报告期末基金份额总额      | 12,406,308.92 份                  |                            |
| 基金合同存续期         | 不定期                              |                            |
| 下属分级基金的基金简称     | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A       | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码     | 013337                           | 013338                     |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 6,967,708.43 份                   | 5,438,600.49 份             |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金通过大类资产配置与基金优选策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的持续稳健增值。  |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略。本基金将通过目标风险策略，以获取持续稳健的投资收益为目标，以固定收益类资产为主进行长期资产配置。同时综合考虑宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，评估基金、股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，形成对大类资产预期收益及风险的判断，在一定范围内持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。</p> <p>2、基金投资策略。本基金通过定量分析与定性分析相结合的方式，对基金公司及其基金做出综合性评价。对基金公司的评价主要考虑平均业绩、管理基金的总规模及增速、投研团队配置与离职率、风控制度与落实情况、公司受到的奖惩情况等维度；对基金的评价主要考虑历史业绩、风险指标、收益稳定性等，各类型采用不同的评价体系，具体如下：（1）债券型、货币市场基金投资策略。债券型基金投资策略将审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，综合考虑债券型基金的运作时间、资产规模、资产配置状况、风险收益指标、历史信用风险事件、费率水平、申购赎回限制、杠杆率、运作周期等因素，结合基金经理的过往业绩表现优选基金，力求投资组合在较低风险和良好流动性的前提下，为投资者获取稳定的投资收益。货币市场基金投资策略以流动性管理以及降低投资组合整体波动率水平为目标，综合考虑货币基金的规模、收益水平、流动性、快速赎回机制等因素。（2）股票型、混合型、指数基金投</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>资策略。普通股票型基金和混合型基金通常采用大类资产配置及主动选股策略，为主动型基金；普通指数型基金、增强指数型基金、ETF 等以被动跟踪指数策略为主，为被动型基金。主动型基金筛选将采用定量分析与定性分析相结合的方式，优选能够持续获取稳定收益、风格稳定的标的进行配置。定量分析关注基金的风险收益指标、业绩表现、择时和择股能力、仓位变动情况、行业配置情况、投资集中度、换手率、重仓证券等指标；定性分析则关注基金经理的投资理念、投资流程、投资风格等因素，以及基金公司的投资决策流程、风控水平、激励机制等。被动型基金筛选则主要考虑基金的指数风格特征、偏离程度、流动性、费率水平等指标，选择适合的标的进行配置。3、股票投资策略。4、固定收益品种投资策略。5、其他。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%  |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金中基金（FOF），理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。</p> <p>本基金除可投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>   |

## 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                                  | 宁波银行股份有限公司               |
| 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                                  | 0574-83895886            |
| 传真      | 0755-25832571                                 | 0574-89103213            |
| 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） | 中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 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    | 中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号      |
| 邮政编码    | 518052  | 315100                   |
| 法定代表人   | 钱龙海   | 陆华裕                      |

## 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、创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）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       | 35,033.87                             |
| 本期利润          | 75,347.28                             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0108                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.06%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.07%                                 |
| 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      | 106,588.50                            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0153                                |
| 期末基金资产净值      | 7,111,183.13                          |
| 期末基金份额净值      | 1.0206                                |
| 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   | 2.06%                                 |

#### 2、创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）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       | 16,335.22                             |
| 本期利润          | 47,640.16                             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0087                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.86%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.87%                                 |
| 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      | 26,745.06                             |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0049                                |
| 期末基金资产净值      | 5,493,992.74                          |
| 期末基金份额净值      | 1.0102                                |

|              |                       |
|--------------|-----------------------|
| 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  | 1.02%                 |

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

创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.15%    | 0.02%       | -0.08%     | 0.10%         | 0.23%  | -0.08% |
| 过去三个月      | 0.90%    | 0.03%       | 0.91%      | 0.14%         | -0.01% | -0.11% |
| 过去六个月      | 1.07%    | 0.04%       | 2.39%      | 0.18%         | -1.32% | -0.14% |
| 过去一年       | 0.81%    | 0.06%       | 0.91%      | 0.18%         | -0.10% | -0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.06%    | 0.08%       | -1.77%     | 0.22%         | 3.83%  | -0.14% |

创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）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      | 0.11%    | 0.02%       | -0.08%     | 0.10%         | 0.19%  | -0.08% |
| 过去三个月      | 0.80%    | 0.03%       | 0.91%      | 0.14%         | -0.11% | -0.11% |
| 过去六个月      | 0.87%    | 0.04%       | 2.39%      | 0.18%         | -1.52% | -0.14% |
| 过去一年       | 0.41%    | 0.06%       | 0.91%      | 0.18%         | -0.50% | -0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.02%    | 0.08%       | -1.77%     | 0.22%         | 2.79%  | -0.14% |

#### 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



创金合信宜久来福3个月持有期混合发起（FOF）A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年12月08日-2024年06月30日)



创金合信宜久来福3个月持有期混合发起（FOF）C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年12月08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 |        |  |
| 尹海影 | 本基金基金经理、FOF 投资一部负责人 | 2022 年 4 月 12 日 | -    | 11     | 尹海影先生，中国国籍，麻省理工大学硕士。2011 年 6 月加入美国摩根斯坦利有限责任公司，任固定收益部多资产交易员、分析师，2013 年 10 月加入美国银行美林证券有限公司，任全球市场部量化交易经理，2015 年 2 月加入美国道富基金管理有限公司，任量化与资产配置研究部助理副总经理、量化与资产配置分析师，2016 年 2 月加入美国富达基金管理有限公司，任全球资产配置部分析师，核心投资团队成员，2017 年 3 月加入广发基金管理有限公司，历任资产配置部投资经理、总经理助理，2020 年 2 月加入创金合信基金管理有限公司，现任 FOF 投资一部负责人、基金经理。 |
| 冯瑞玲 | 本基金基金经理             | 2021 年 12 月 8 日 | -    | 7      | 冯瑞玲女士，中国国籍，中国人民大学硕士。2016 年 7 月加入中意资产管理有限责任公司，历任组合管理部资产配置专员、组合管理分析师，2018 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任量化指数与国际部、FOF 投资一部研究员，现任基金经理。   |

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

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

3、报告截止日至批准送出日期间，自 2024 年 7 月 12 日起尹海影先生离任本基金的基金经理；

4、报告截止日至批准送出日期间，自 2024 年 7 月 12 日起颜彪先生新任本基金的基金经理。

## 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》《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

2024 年上半年整体宏观经济稳步复苏，尤其一季度，在出口、消费结构上都展现出一些亮点，在一季度和二季度分别录得 5.3%和 4.7%的同比增长率。同时，整体结构上仍然面临一些压力，地产销售疲弱为经济总量带来的负面影响还在持续，新旧经济动能转换过程中需要政策组合拳的配合和支持。

一季度，整体宏观经济数据仍处于弱复苏态势，在出口、消费结构上都展现出一些亮点，尤其是出口数据，为宏观经济整体提供了较强支撑。降息降准政策出台对债券市场影响相对直接，影响债券收益率进一步下行，同时保险资管存款新规的变化及银行理财等增量资金配置需求，进一步推升债券市场整体走牛。权益市场并未因政策直接提升信心，并且在衍生品的连锁影响下波动加大，轮动效应进一步加强。二季度，整体宏观经济数据仍处于弱复苏态势，尤其央行在货币总量层面一些“挤水分”的高质量发展政策，减少了资金在金融体系内“空转”的情况，进一步从表观数据显现经济修复动能较弱，债券利率本季度继续下行，波动有所加大。权益市场本季度整体上先高后低，各大宽基指数均有不同程度的下跌，整体风格更加偏向大盘价值和红利。

本产品一季度，伴随着利率下行，在久期结构上配置向哑铃形做了一定倾斜，对债券基金的配置思路和收益风险表现跟踪分析，基金选择层面也做了小幅优选置换，同时阶段性采用了部分债券指数型基金，为组合提供了稳健的收益；权益部分逢高降低配置比例，使得产品整体上更多偏向债性资产的风险收益特征。二季度，逢低逐步配置了转债增强基金，并在季末低价转债资产大幅下跌之前减仓了持有的转债基金，为组合提供了一定程度的收益增厚。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起(FOF)A 基金份额净值为 1.0206 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.07%，同期业绩比较基准收益率为 2.39%；截至本报告期末创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C 基金份额净值为 1.0102 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.87%，同期业绩比较基准收益率为 2.39%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济的复苏仍然是一个缓慢的过程，上半年海外需求较强带来的出口韧性为宏观经济提供了很大支撑，后续随着海外需求热度可能的下降，需要密切关注出口的持续性。同时新质生产力的发展对旧经济动能切换带来的助力也需要在中观层面上投入更多研究和关注。以美国为代表的全球主要发达经济体大概率将进入利率下行通道，为国内的货币政策打开一定操作空间，债券资产我们整体仍将维持中等略偏长久期、高等级信用债配置为主，并及时根据宏观经济的变化情况调整久期和信用结构。权益资产组合当前超低配，未来将根据市场变化，自上而下通过多维度资产配置体系综合考虑胜率和赔率，选择性价比高的方向择机配置。

#### 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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

### § 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，本托管人在创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（以下称“本基金”）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、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 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：创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

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 | 915,842.52          | 454,505.85            |

|           |         |                     |                       |
|-----------|---------|---------------------|-----------------------|
| 结算备付金     |         | -                   | 6,698.33              |
| 存出保证金     |         | 150.80              | 763.21                |
| 交易性金融资产   | 6.4.7.2 | 11,710,518.42       | 12,310,749.14         |
| 其中：股票投资   |         | -                   | -                     |
| 基金投资      |         | 11,101,149.38       | 11,707,609.41         |
| 债券投资      |         | 609,369.04          | 603,139.73            |
| 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     |         | -                   | 6,400.00              |
| 应收股利      |         | 1,992.07            | -                     |
| 应收申购款     |         | 75.40               | 9.92                  |
| 递延所得税资产   |         | -                   | -                     |
| 其他资产      | 6.4.7.5 | 394.43              | 626.48                |
| 资产总计      |         | 12,628,973.64       | 12,779,752.93         |
| 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 |         | -                   | -                     |
| 应付清算款     |         | -                   | -                     |
| 应付赎回款     |         | 8,319.28            | 1,196.09              |
| 应付管理人报酬   |         | 3,424.23            | 7,395.25              |
| 应付托管费     |         | 1,033.09            | 1,630.51              |
| 应付销售服务费   |         | 1,800.13            | 1,892.33              |
| 应付投资顾问费   |         | -                   | -                     |
| 应交税费      |         | -                   | -                     |
| 应付利润      |         | -                   | -                     |
| 递延所得税负债   |         | -                   | -                     |
| 其他负债      | 6.4.7.6 | 9,221.04            | 20,918.46             |
| 负债合计      |         | 23,797.77           | 33,032.64             |
| 净资产：      |         |                     |                       |
| 实收基金      | 6.4.7.7 | 12,406,308.92       | 12,669,186.32         |

|          |         |               |               |
|----------|---------|---------------|---------------|
| 其他综合收益   |         | -             | -             |
| 未分配利润    | 6.4.7.8 | 198,866.95    | 77,533.97     |
| 净资产合计    |         | 12,605,175.87 | 12,746,720.29 |
| 负债和净资产总计 |         | 12,628,973.64 | 12,779,752.93 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A 份额净值 1.0206 元，基金份额总额 6,967,708.43 份；创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C 份额净值 1.0102 元，基金份额总额 5,438,600.49 份；总份额合计 12,406,308.92 份。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

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               |          | 182,686.92                         | 327,546.12                              |
| 1.利息收入                |          | 651.92                             | 2,274.18                                |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.9  | 651.92                             | 2,274.18                                |
| 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            |          | -                                  | -                                       |
| 其他利息收入                |          | -                                  | -                                       |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 107,677.11                         | 131,727.83                              |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.10 | -                                  | -                                       |
| 基金投资收益                | 6.4.7.11 | 83,343.75                          | 16,601.10                               |
| 债券投资收益                | 6.4.7.12 | 4,909.31                           | 1,494.89                                |
| 资产支持证券投资              | 6.4.7.13 | -                                  | -                                       |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14 | -                                  | -                                       |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15 | -                                  | -                                       |
| 股利收益                  | 6.4.7.16 | 19,424.05                          | 113,631.84                              |
| 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） | 6.4.7.17 | 71,618.35                          | 185,529.19                              |

|                     |            |            |            |
|---------------------|------------|------------|------------|
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）   |            | -          | -          |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）   | 6.4.7.18   | 2,739.54   | 8,014.92   |
| 减：二、营业总支出           |            | 59,699.48  | 110,754.86 |
| 1.管理人报酬             | 6.4.10.2.1 | 31,778.94  | 64,350.62  |
| 其中：暂估管理人报酬          |            | -          | -          |
| 2.托管费               | 6.4.10.2.2 | 7,712.25   | 14,857.22  |
| 3.销售服务费             | 6.4.10.2.3 | 10,991.01  | 16,580.03  |
| 4.投资顾问费             |            | -          | -          |
| 5.利息支出              |            | -          | 90.60      |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | -          | 90.60      |
| 6.信用减值损失            | 6.4.7.20   | -          | -          |
| 7.税金及附加             |            | -          | -          |
| 8.其他费用              | 6.4.7.21   | 9,217.28   | 14,876.39  |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 122,987.44 | 216,791.26 |
| 减：所得税费用             |            | -          | -          |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 122,987.44 | 216,791.26 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -          | -          |
| 六、综合收益总额            |            | 122,987.44 | 216,791.26 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

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     | 12,669,186.32                      | -      | 77,533.97  | 12,746,720.29 |
| 加：会计政策变更      | -                                  | -      | -          | -             |
| 前期差错更正        | -                                  | -      | -          | -             |
| 其他            | -                                  | -      | -          | -             |
| 二、本期期初净资产     | 12,669,186.32                      | -      | 77,533.97  | 12,746,720.29 |
| 三、本期增减变动额（减少以 | -262,877.40                        | -      | 121,332.98 | -141,544.42   |



|  |   |        |            |               |
|--|---|--------|------------|---------------|
| “-”号填列)                                  |   |        |            |               |
| (一)、综合收益总额                               | -                                       | -      | 122,987.44 | 122,987.44    |
| (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)      | -262,877.40                             | -      | -1,654.46  | -264,531.86   |
| 其中：1.基金申购款                               | 67,891.91                               | -      | 235.02     | 68,126.93     |
| 2.基金赎回款                                  | -330,769.31                             | -      | -1,889.48  | -332,658.79   |
| (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                                | 12,406,308.92                           | -      | 198,866.95 | 12,605,175.87 |
| 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                                | 23,058,002.43                           | -      | -10,266.34 | 23,047,736.09 |
| 加：会计政策变更                                 | -                                       | -      | -          | -             |
| 前期差错更正                                   | -                                       | -      | -          | -             |
| 其他                                       | -                                       | -      | -          | -             |
| 二、本期期初净资产                                | 23,058,002.43                           | -      | -10,266.34 | 23,047,736.09 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列)                     | -6,394,190.81                           | -      | 171,383.02 | -6,222,807.79 |
| (一)、综合收益总额                               | -                                       | -      | 216,791.26 | 216,791.26    |
| (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)      | -6,394,190.81                           | -      | -45,408.24 | -6,439,599.05 |

|  |               |   |            |               |
|--|---------------|---|------------|---------------|
| 其中：1.基金申购款                               | 89,772.20     | - | 602.51     | 90,374.71     |
| 2.基金赎回款                                  | -6,483,963.01 | - | -46,010.75 | -6,529,973.76 |
| （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                                | 16,663,811.62 | - | 161,116.68 | 16,824,928.30 |

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

创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF) (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[2021]第 2517 号《关于准予创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)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《创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)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 21, 173, 886. 04 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 2100918 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》于 2021 年 12 月 8 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 21, 174, 449. 06 份基金份额, 其中认购资金利息折合 563. 02 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, 基金托管人为宁波银行股份有限公司(以下简称“宁波银行”)。本基金为发起式基金, 发起资金认购部分为 10, 000, 121. 03 份基金份额, 发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。根据《创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)招募说明书》, 本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同, 将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认

购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（包含 ETF、LOF、QDII 基金、公开募集基础设施证券投资基金、商品基金和香港互认基金）的基金份额、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、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、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：本基金投资于证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%，其中投资于股票型基金、混合型基金占基金资产的比例为 0-30%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。本基金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：中债综合全价指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%。

#### 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》、《创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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           | 915,842.52          |
| 等于：本金          | 915,774.91          |
| 加：应计利息         | 67.61               |
| 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             | 915,842.52          |

### 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            | -                   | -          | -             | -          |          |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -          | -             | -          |          |
| 债券            | 交易所市场               | 597,540.00 | 9,249.04      | 609,369.04 | 2,580.00 |
|               | 银行间市场               | -          | -             | -          | -        |
|               | 合计                  | 597,540.00 | 9,249.04      | 609,369.04 | 2,580.00 |
| 资产支持证券        | -                   | -          | -             | -          |          |
| 基金            | 10,833,743.08       | -          | 11,101,149.38 | 267,406.30 |          |
| 其他            | -                   | -          | -             | -          |          |
| 合计            | 11,431,283.08       | 9,249.04   | 11,710,518.42 | 269,986.30 |          |

### 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。

### 6.4.7.4 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------|
| 应收利息  | -                   |
| 其他应收款 | 394.43              |
| 待摊费用  | -                   |
| 合计    | 394.43              |

### 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       | 3.76                |
| 应付证券出借违约金   | -                   |
| 应付交易费用      | -                   |
| 其中：交易所市场    | -                   |

|       |          |
|-------|----------|
| 银行间市场 | -        |
| 应付利息  | -        |
| 预提费用  | 9,217.28 |
| 合计    | 9,221.04 |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）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                       | 7,096,753.63                       | 7,096,753.63 |
| 本期申购                       | 18,805.18                          | 18,805.18    |
| 本期赎回（以“-”号填列）              | -147,850.38                        | -147,850.38  |
| 基金份额折算变动份额                 | -                                  | -            |
| 本期末                        | 6,967,708.43                       | 6,967,708.43 |

| 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）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                       | 5,572,432.69                       | 5,572,432.69 |
| 本期申购                       | 49,086.73                          | 49,086.73    |
| 本期赎回（以“-”号填列）              | -182,918.93                        | -182,918.93  |
| 基金份额折算变动份额                 | -                                  | -            |
| 本期末                        | 5,438,600.49                       | 5,438,600.49 |

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

| 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A |           |           |           |
|----------------------------|-----------|-----------|-----------|
| 项目                         | 已实现部分     | 未实现部分     | 未分配利润合计   |
| 上年度末                       | 72,651.59 | -3,292.63 | 69,358.96 |
| 加：会计政策变更                   | -         | -         | -         |
| 前期差错更正                     | -         | -         | -         |
| 其他                         | -         | -         | -         |
| 本期期初                       | 72,651.59 | -3,292.63 | 69,358.96 |
| 本期利润                       | 35,033.87 | 40,313.41 | 75,347.28 |
| 本期基金份额交易产生的变动数             | -1,096.96 | -134.58   | -1,231.54 |
| 其中：基金申购款                   | 204.30    | 16.81     | 221.11    |
| 基金赎回款                      | -1,301.26 | -151.39   | -1,452.65 |

|         |            |           |            |
|---------|------------|-----------|------------|
| 本期已分配利润 | -          | -         | -          |
| 本期末     | 106,588.50 | 36,886.20 | 143,474.70 |

| 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C |           |           |           |
|----------------------------|-----------|-----------|-----------|
| 项目                         | 已实现部分     | 未实现部分     | 未分配利润合计   |
| 上年度末                       | 10,612.87 | -2,437.86 | 8,175.01  |
| 加：会计政策变更                   | -         | -         | -         |
| 前期差错更正                     | -         | -         | -         |
| 其他                         | -         | -         | -         |
| 本期期初                       | 10,612.87 | -2,437.86 | 8,175.01  |
| 本期利润                       | 16,335.22 | 31,304.94 | 47,640.16 |
| 本期基金份额交易产生的变动数             | -203.03   | -219.89   | -422.92   |
| 其中：基金申购款                   | -104.45   | 118.36    | 13.91     |
| 基金赎回款                      | -98.58    | -338.25   | -436.83   |
| 本期已分配利润                    | -         | -         | -         |
| 本期末                        | 26,745.06 | 28,647.19 | 55,392.25 |

#### 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  | 642.82                             |
| 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 | 4.37                               |
| 其他        | 4.73                               |
| 合计        | 651.92                             |

#### 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

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

| 项目                | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|-------------------|------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额       | 15,814,796.21                      |
| 减：卖出/赎回基金成本总额     | 15,720,193.49                      |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | -                                  |
| 减：交易费用            | 11,258.97                          |
| 基金投资收益            | 83,343.75                          |

#### 6.4.7.12 债券投资收益



### 6.4.7.12.1 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                 | 4,909.31                           |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -                                  |
| 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                           | 4,909.31                           |

### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.13.1 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。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

#### 6.4.7.15.1 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。

#### 6.4.7.15.2 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。

### 6.4.7.16 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   | -                                  |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                  |
| 基金投资产生的股利收益   | 19,424.05                          |
| 合计            | 19,424.05                          |

### 6.4.7.17 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 | 71,618.35                          |

|                        |           |
|------------------------|-----------|
| ——股票投资                 | -         |
| ——债券投资                 | 1,320.00  |
| ——资产支持证券投资             | -         |
| ——基金投资                 | 70,298.35 |
| ——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                     | 71,618.35 |

#### 6.4.7.18 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     | 5.32                               |
| 基金销售服务费返还收入 | 2,734.22                           |
| 合计          | 2,739.54                           |

#### 6.4.7.19 持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------------|------------------------------------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 3,762.57                           |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 21,299.93                          |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 6,396.60                           |

注：1. 上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；

2. 上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

#### 6.4.7.20 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。

#### 6.4.7.21 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    | 9,217.28                           |
| 信息披露费   | -                                  |
| 证券出借违约金 | -                                  |
| 合计      | 9,217.28                           |

#### 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 |
| 宁波银行股份有限公司         | 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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 基金交易

| 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                               | 占当期基金成交总额的比例 | 成交金额                                    | 占当期基金成交总额的比例 |
| 第一创业证券 | 350,729.40                         | 100.00%      | 3,634,364.10                            | 100.00%      |

#### 6.4.10.1.3 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 | -                                  | -            | 499,454.00                              | 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 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 | -                                  | -              | 240,000.00                              | 100.00%        |

#### 6.4.10.1.5 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。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期 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 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 第一创业证券 | 266.55                                  | 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 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 第一创业证券 | 2,762.07                                | 100.00%    | 459.10   | 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   | 31,778.94                          | 64,350.62                               |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 10,215.81                          | 22,198.43                               |

|                   |           |           |
|-------------------|-----------|-----------|
| 应支付基金管理人的<br>净管理费 | 21,563.13 | 42,152.19 |
|-------------------|-----------|-----------|

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 0.4% 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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.4%/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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1<br>月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|--------------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托<br>管费 | 7,712.25                              | 14,857.22                                  |

注：支付基金托管人宁波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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/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<br>各关联方名称 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日      |                                    |          |
|--------------------|---|------------------------------------|----------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                        |                                    |          |
|                    | 创金合信宜久来福 3<br>个月持有期混合发起<br>(FOF) A      | 创金合信宜久来福 3<br>个月持有期混合发起<br>(FOF) C | 合计       |
| 创金合信直销             | -                                       | 9.32                               | 9.32     |
| 宁波银行               | -                                       | 9,973.20                           | 9,973.20 |
| 合计                 | -                                       | 9,982.52                           | 9,982.52 |
| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |                                    |          |
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                        |                                    |          |
|                    | 创金合信宜久来福 3<br>个月持有期混合发起<br>(FOF) A      | 创金合信宜久来福 3<br>个月持有期混合发起<br>(FOF) C | 合计       |
| 创金合信直销             | -                                       | 14.74                              | 14.74    |
| 宁波银行               | -                                       | 9,926.75                           | 9,926.75 |
| 合计                 | -                                       | 9,941.49                           | 9,941.49 |

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：

日 C 类基金份额销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值×0.4%/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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                  | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                            |
|---------------------|------------------------------------|----------------------------|
|                     | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A         | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C |
| 报告期初持有的基金份额         | 5,000,000.00                       | 5,000,000.00               |
| 报告期间申购/买入总份额        | -                                  | -                          |
| 报告期间因拆分变动份额         | -                                  | -                          |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -                                  | -                          |
| 报告期末持有的基金份额         | 5,000,000.00                       | 5,000,000.00               |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 71.76%                             | 91.94%                     |

| 项目                  | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |                            |
|---------------------|---|----------------------------|
|                     | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A              | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C |
| 报告期初持有的基金份额         | 5,000,000.00                            | 5,000,000.00               |
| 报告期间申购/买入总份额        | -                                       | -                          |
| 报告期间因拆分变动份额         | -                                       | -                          |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -                                       | -                          |
| 报告期末持有的基金份额         | 5,000,000.00                            | 5,000,000.00               |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 53.02%                                  | 69.13%                     |

**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   |
| 宁波银行股份有限公司 | 915,842.52                         | 642.82 | 596,311.28                              | 2,210.97 |

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波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****6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有基金管理人创金合信基金所管理的公开募集证券投资基金，成本总额为人民币 2,051,051.16 元，估值总额为人民币 2,164,575.23 元，占本基金资产净值的比例为 17.17%。（2023 年 6 月 30 日：成本总额为人民币 3,229,676.09 元，估值总额为人民币 3,371,767.22 元，占本基金资产净值的比例为 20.04%。）

**6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用**

| 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 |
|----------------------|------------------------------------|---|
| 当期交易基金产生的申购费（元）      | -                                  | -                                       |
| 当期交易基金产生的赎回费（元）      | -                                  | -                                       |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 2,734.22                           | 7,278.60                                |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 4,380.60                           | 9,544.98                                |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 1,255.96                           | 2,598.52                                |

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金（ETF 除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为 0，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记

入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

#### **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**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

###### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

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



### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行宁波银行股份有限公司，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    | 609,369.04          | 603,139.73            |
| 合计     | 609,369.04          | 603,139.73            |

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

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

#### 6.4.13.3.2 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。

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金(ETF 联接基金除外)不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。

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或其他场外交易市场交易，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。本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

##### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

| 本期末 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                  | 915,842.52   | -     | -     | -             | 915,842.52    |
| 存出保证金                 | 150.80       | -     | -     | -             | 150.80        |
| 交易性金融资产               | 609,369.04   | -     | -     | 11,101,149.38 | 11,710,518.42 |
| 应收股利                  | -            | -     | -     | 1,992.07      | 1,992.07      |
| 应收申购款                 | -            | -     | -     | 75.40         | 75.40         |
| 其他资产                  | -            | -     | -     | 394.43        | 394.43        |
| 资产总计                  | 1,525,362.36 | -     | -     | 11,103,611.28 | 12,628,973.64 |
| 负债                    |              |       |       |               |               |
| 应付赎回款                 | -            | -     | -     | 8,319.28      | 8,319.28      |
| 应付管理人报酬               | -            | -     | -     | 3,424.23      | 3,424.23      |
| 应付托管费                 | -            | -     | -     | 1,033.09      | 1,033.09      |
| 应付销售服务费               | -            | -     | -     | 1,800.13      | 1,800.13      |
| 其他负债                  | -            | -     | -     | 9,221.04      | 9,221.04      |
| 负债总计                  | -            | -     | -     | 23,797.77     | 23,797.77     |
| 利率敏感度缺口               | 1,525,362.36 | -     | -     | 11,079,813.51 | 12,605,175.87 |
| 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                  | 454,505.85   | -     | -     | -             | 454,505.85    |
| 结算备付金                 | 6,698.33     | -     | -     | -             | 6,698.33      |
| 存出保证金                 | 763.21       | -     | -     | -             | 763.21        |
| 交易性金融资产               | 603,139.73   | -     | -     | 11,707,609.41 | 12,310,749.14 |
| 应收申购款                 | -            | -     | -     | 9.92          | 9.92          |
| 其他资产                  | -            | -     | -     | 626.48        | 626.48        |
| 应收清算款                 | -            | -     | -     | 6,400.00      | 6,400.00      |
| 资产总计                  | 1,065,107.12 | -     | -     | 11,714,645.81 | 12,779,752.93 |
| 负债                    |              |       |       |               |               |
| 应付赎回款                 | -            | -     | -     | 1,196.09      | 1,196.09      |
| 应付管理人报酬               | -            | -     | -     | 7,395.25      | 7,395.25      |
| 应付托管费                 | -            | -     | -     | 1,630.51      | 1,630.51      |
| 应付销售服务费               | -            | -     | -     | 1,892.33      | 1,892.33      |
| 其他负债                  | -            | -     | -     | 20,918.46     | 20,918.46     |
| 负债总计                  | -            | -     | -     | 33,032.64     | 33,032.64     |
| 利率敏感度缺口               | 1,065,107.12 | -     | -     | 11,681,613.17 | 12,746,720.29 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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  | -111.14                     | -841.78                |
|    | 2.市场利率平行下降 25 个基点  | 111.28                      | 843.40                 |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无外汇风险的敏感性分析。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额以及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  | -                   | -             | -                     | -             |
| 交易性金融资产-基金投资  | 11,101,149.38       | 88.07         | 11,707,609.41         | 91.85         |
| 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  | 11,101,149.38 | 88.07 | 11,707,609.41 | 91.85 |

#### 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%        | 72,657.02                   | 161,565.01             |
| 2.业绩比较基准下降 5% | -72,657.02           | -161,565.01                 |                        |

#### 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          | 11,101,149.38       |
| 第二层次          | 609,369.04          |
| 第三层次          | -                   |
| 合计            | 11,710,518.42       |

###### 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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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、债券和基金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 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              | -             | -            |
|    | 其中：股票             | -             | -            |
| 2  | 基金投资              | 11,101,149.38 | 87.90        |
| 3  | 固定收益投资            | 609,369.04    | 4.83         |
|    | 其中：债券             | 609,369.04    | 4.83         |
|    | 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      | 915,842.52    | 7.25         |
| 8  | 其他资产              | 2,612.70      | 0.02         |
| 9  | 合计                | 12,628,973.64 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金报告期内无买入股票。

##### 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

本基金报告期内无卖出股票。

##### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金报告期内无买卖股票。

#### 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（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 609,369.04 | 4.83         |
| 2  | 央行票据      | -          | -            |
| 3  | 金融债券      | -          | -            |
|    | 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      | -          | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -          | -            |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 609,369.04 | 4.83         |

#### 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（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-------|------------|--------------|
| 1  | 019709 | 23 国债 16 | 6,000 | 609,369.04 | 4.83         |

#### 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

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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

本产品在进行投资运作的过程中，以稳健的投资策略为基础，结合一定的绝对收益策略特征进行管理。产品管理过程中，在注重投资标的收益性的同时，合理地进行风险管理和风险分散。产品在底层基金的筛选中，以基金长期的风险收益特征、卡玛比例等指标作为基础，精选风格稳定或具有一定收益弹性的基金品种，并且关注各基金对应的资产类别的市场风险。产品的战略规划中，权益类资产长期的战略配置比例为 0-18%，不排除在极端市场环境或稳健收益运作需要的情况下，以债券类资产为主要投资资产进行管理的可能性。未来随着权益类资产性价比的提升，组合仍可考虑合适的细分资产方向进行配置。

### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额<br>(份) | 公允价值<br>(元) | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 是否属<br>于基金<br>管理人<br>及管理<br>人关联<br>方所管<br>理的基 |
|----|------|------|------|-------------|-------------|--------------------------|---|
|    |      |      |      |             |             |                          |   |

|    |        |               |            |                  |                  |       | 金 |
|----|--------|---------------|------------|------------------|------------------|-------|---|
| 1  | 005754 | 平安短债 A        | 契约型<br>开放式 | 1,472,68<br>8.34 | 1,783,57<br>2.85 | 14.15 | 否 |
| 2  | 006985 | 兴全恒裕债券 A      | 契约型<br>开放式 | 1,197,02<br>9.11 | 1,364,73<br>2.89 | 10.83 | 否 |
| 3  | 006773 | 国寿安保尊荣中短债债券 A | 契约型<br>开放式 | 1,144,74<br>7.55 | 1,326,30<br>4.51 | 10.52 | 否 |
| 4  | 007829 | 创金合信信用红利债券 C  | 契约型<br>开放式 | 952,707.<br>31   | 1,206,22<br>2.73 | 9.57  | 是 |
| 5  | 005160 | 华泰保兴尊合债券 C    | 契约型<br>开放式 | 868,778.<br>17   | 1,014,47<br>2.27 | 8.05  | 否 |
| 6  | 006824 | 创金合信鑫日享短债债券 A | 契约型<br>开放式 | 780,608.<br>05   | 958,352.<br>50   | 7.60  | 是 |
| 7  | 590009 | 中邮稳定收益债券 A    | 契约型<br>开放式 | 859,633.<br>20   | 955,912.<br>12   | 7.58  | 否 |
| 8  | 003280 | 鹏华丰恒债券 A      | 契约型<br>开放式 | 835,391.<br>90   | 925,447.<br>15   | 7.34  | 否 |
| 9  | 006668 | 华夏中短债债券 A     | 契约型<br>开放式 | 603,772.<br>05   | 693,371.<br>82   | 5.50  | 否 |
| 10 | 006902 | 长盛安鑫中短债 A     | 契约型<br>开放式 | 463,262.<br>28   | 519,919.<br>26   | 4.12  | 否 |
| 11 | 015832 | 永赢宏泰短债 A      | 契约型<br>开放式 | 349,486.<br>21   | 352,841.<br>28   | 2.80  | 否 |

## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，华泰保兴基金管理有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家税务总局上海市浦东新区税务局第三十八税务所处罚的情况。

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

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

### 7.13.2

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。

### 7.13.3 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 | 150.80   |
| 2  | 应收清算款 | -        |
| 3  | 应收股利  | 1,992.07 |
| 4  | 应收利息  | -        |
| 5  | 应收申购款 | 75.40    |
| 6  | 其他应收款 | 394.43   |
| 7  | 待摊费用  | -        |
| 8  | 其他    | -        |
| 9  | 合计    | 2,612.70 |

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.13.6 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<br>(户) | 户均持有的<br>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 |
| 创金合信宜 | 278          | 25,063.70     | 5,000,000.0 | 71.76% | 1,967,708.4 | 28.24% |

|                            |     |           |               |        |              |        |
|----------------------------|-----|-----------|---------------|--------|--------------|--------|
| 久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A      |     |           | 0             |        | 3            |        |
| 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C | 401 | 13,562.59 | 5,000,000.00  | 91.94% | 438,600.49   | 8.06%  |
| 合计                         | 658 | 18,854.57 | 10,000,000.00 | 80.60% | 2,406,308.92 | 19.40% |

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

| 项目               | 份额级别                       | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例 |
|------------------|----------------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A | 74,762.64  | 1.07%    |
|                  | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C | 75,561.84  | 1.39%    |
|                  | 合计                         | 150,324.48 | 1.21%    |

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 | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A | 0~10              |
|                                | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C | 0~10              |
|                                | 合计                         | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A | 0~10              |

|  |                            |      |
|--|----------------------------|------|
|  | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C | 0~10 |
|  | 合计                         | 0~10 |

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,000.00 | 80.60           | 10,000,000.00 | 80.60           | 36 个月      |
| 基金管理人高级管理人员 | 23,691.55     | 0.19            | -             | -               | -          |
| 基金经理等人员     | 69,712.61     | 0.56            | 121.03        | 0.00            | 36 个月      |
| 基金管理人股东     | -             | -               | -             | -               | -          |
| 其他          | -             | -               | -             | -               | -          |
| 合计          | 10,093,404.16 | 81.36           | 10,000,121.03 | 80.61           | 36 个月      |

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C |
|--------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 基金合同生效日(2021 年 12 月 8 日)基金份额总额 | 12,498,684.97              | 8,675,764.09               |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 7,096,753.63               | 5,572,432.69               |
| 本报告期基金总申购份额                    | 18,805.18                  | 49,086.73                  |
| 减：报告期基金总赎回份额                   | 147,850.38                 | 182,918.93                 |
| 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                   | 6,967,708.43               | 5,438,600.49               |

### § 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。

本报告期，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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

## 10.6 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。

## 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.7.1 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。

### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.8.1 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 |    |
| 中金财富证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

|            |   |   |   |        |         |   |
|------------|---|---|---|--------|---------|---|
| 第一创业<br>证券 | 5 | - | - | 266.55 | 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，并能提供全面的信息服。

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。

### 10.8.2 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 |
| 中金财富<br>证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -          | -            |
| 第一创业<br>证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | 350,729.40 | 100.00%      |

### 10.9 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  | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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  | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告 | 公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2024-03-07 |
| 4  | 关于创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发                              | 公司官网、中国证券                | 2024-03-07 |

|    |  |                          |            |
|----|--|--------------------------|------------|
|    | 起式基金中基金（FOF）调整净值披露时间和申购赎回确认时间的公告                         | 报、中国证监会基金电子披露网站          |            |
| 5  | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）(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       | 2024-03-26 |
| 6  | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）(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       | 2024-03-26 |
| 7  | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同（2024 年 3 月修订）       | 公司官网、中国证监会基金电子披露网站       | 2024-03-26 |
| 8  | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议（2024 年 3 月修订）       | 公司官网、中国证监会基金电子披露网站       | 2024-03-26 |
| 9  | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（2024 年 3 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 | 2024-03-26 |
| 10 | 关于创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）降低管理费率、托管费率并修改基金合同等的公告 | 公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2024-03-26 |
| 11 | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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 |
| 12 | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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 |
| 13 | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）(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       | 2024-06-27 |
| 14 | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）(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       | 2024-06-27 |
| 15 | 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（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 | 2024-06-27 |

## § 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% | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额       | 份额占比 |
|       |                |                    |      |      |      |            |      |



|    |   |                        |               |      |      |               |        |
|----|---|------------------------|---------------|------|------|---------------|--------|
|    |   | 的时间区<br>间              |               |      |      |               |        |
| 机构 | 1 | 20240101 -<br>20240630 | 10,000,000.00 | 0.00 | 0.00 | 10,000,000.00 | 80.60% |

**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、《创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》；
- 2、《创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》；
- 3、创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日