

# 创金合信汇选 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2024 年第 3 季度报告

2024 年 09 月 30 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 10 月 24 日

## 目录

§1 重要提示.....	2
§2 基金产品概况.....	2
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	7
4.3 公平交易专项说明.....	7
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析.....	7
4.5 报告期内基金的业绩表现.....	9
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	9
§5 投资组合报告.....	9
5.1 报告期末基金资产组合情况.....	9
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	9
5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	10
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	10
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	10
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明 细.....	10
5.7 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.....	10
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	11
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	11
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	11
5.11 投资组合报告附注.....	11
§6 基金中基金.....	12
6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	12
6.2 当期交易及持有基金产生的费用.....	13
6.3 本期报告持有的基金发生的重大影响事件.....	14
§7 开放式基金份额变动.....	14
§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	14
8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	14
8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	14
§9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况.....	14
§10 影响投资者决策的其他重要信息.....	15
10.1 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.....	15
10.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	15
§11 备查文件目录.....	16
11.1 备查文件目录.....	16
11.2 存放地点.....	16
11.3 查阅方式.....	16

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）
基金主代码	018153
交易代码	018153
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 7 月 25 日
报告期末基金份额总额	10,653,317.88 份
投资目标	本基金以积极的投资风格进行长期资产配置，通过大类资产配置与基金优选策略，力争实现基金资产的持续增值。
投资策略	1、大类资产配置策略。本基金拟投资的资产分为权益类资产、固收类资产两类。权益类资产主要包括股票、股票型基金以及偏股混合型基金等，固收类资产主要包括各类债券、债券型基金、货币市场基金等固收类资产。本基金拟采用战略型资产配置和战术型资产配置相结合的大类资产配置策略，形成对各类资产预期收益及风险的判断，在一定范围内动态优化配置比例。1、战略型资产配置策略：在中长期时间维度内，本基金判断宏观经济发展趋势、政策导向、金融市场发展趋势，结合各类资产的长期收益率、历史波动率、资产之间的相关性、再平衡等因素，在基金合同约定范围内确定战略资产配置的最优比例。2、战术型资产配置策略：在短期时间维度内，本基金通过判断各类资产的估值水平、经济与政策环境边际变化、投资者交易结构等因素，动态评估各类资产的风险收益比与资产间的相关性，抓住相对价值变化和事件驱动带来的投资机会，回避极致分化、交易拥

	<p>挤带来的投资风险，提高组合的风险调整后收益水平。</p> <p>2、基金优选策略：本基金将根据基金产品特征，通过定量与定性分析相结合的方式，对基金公司、基金经理及基金产品做出综合评价。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、管理层稳定性、投研团队配置、风控制度与落实情况、绩效考核机制等维度；对基金经理的评价主要考虑从业年限、投资理念和投资行为的一致性、收益来源及其稳定性等维度；对基金产品的评价主要考虑基金规模、历史业绩、条款设计、持有人结构等。不同类型的基金采用不同的评价体系，具体如下：（1）主动股票型基金、混合型基金：针对受基金经理主动管理影响较大的普通股票型基金和混合型基金，本基金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、保持稳定风格的标的进行配置。定量分析关注基金的风险收益指标、业绩归因、股债配置情况、行业配置情况、持股风格、投资集中度、换手率等指标；定性分析则关注基金经理的从业年限、投资理念和投资行为的一致性等因素，以及基金公司的投研团队、投资决策流程、风控水平、激励机制等因素。（2）主动债券型基金：针对受基金经理主动管理影响较大的债券型基金，本基金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、杠杆率等因素，结合基金经理投资理念、投资行为、收益稳定性等因素，以及基金公司信评团队配置、信用风险控制口径、风险处置能力等因素，力求投资组合在较低风险和良好流动性的前提下，提升产品的基础收益、平滑组合收益波动。（3）货币市场基金：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、赎回机制等因素。（4）指数型基金：针对受基金经理主动管理影响较小的指数型基金，本基金将考虑基金的指数风格特征、偏离程度、流动性、费率水平等因素，选择适合的标的进行配置。（5）商品基金：本基金主要选择具备有效抵御通胀，与其他资产的相关度低的商品进行配置。在子基金的选择上，重点配置跟踪误差较小、流动性较好的产品，并合理控制投资比例及组合风险。</p> <p>3、股票投资策略。（1）个股投资策略。（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、固定收益品种投资策略。（1）债券投资策略。（2）资产支持证券投资策略。（3）可转换债券及可交换债券投资策略。</p> <p>5、其他。</p>
业绩比较基准	<p>中证偏股型基金指数收益率*85%+中证债券型基金指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%</p>
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），</p>

	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）。	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）A	创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）C
下属分级基金的交易代码	018153	018154
报告期末下属分级基金的份额总额	5,388,563.04 份	5,264,754.84 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 7 月 1 日—2024 年 9 月 30 日）	
	创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）A	创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）C
1. 本期已实现收益	-428.00	-4,573.12
2. 本期利润	365,012.69	351,252.16
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0712	0.0667
4. 期末基金资产净值	5,453,766.48	5,303,277.93
5. 期末基金份额净值	1.0121	1.0073

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）A

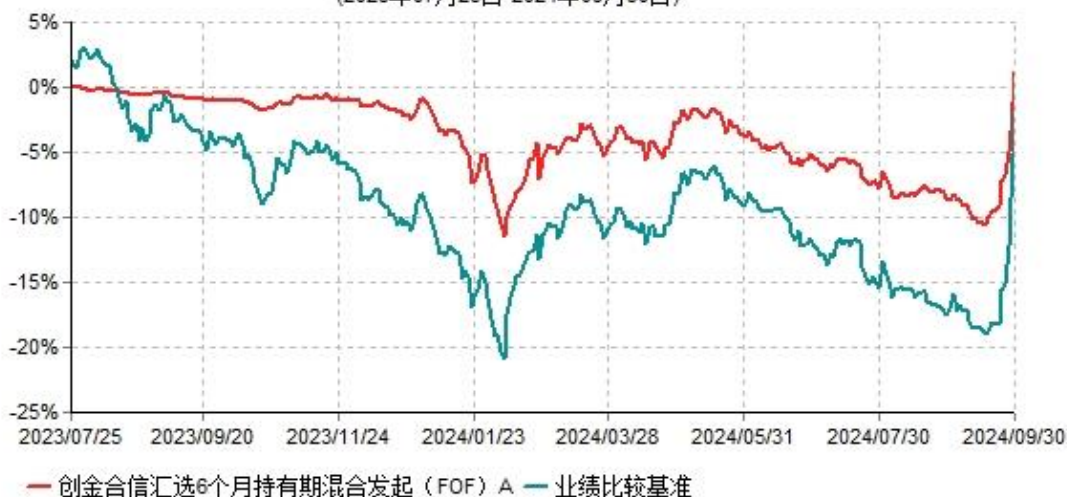
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.20%	0.83%	11.62%	1.42%	-4.42%	-0.59%
过去六个月	5.48%	0.72%	9.67%	1.14%	-4.19%	-0.42%
过去一年	2.19%	0.68%	2.27%	1.07%	-0.08%	-0.39%
自基金合同生效起至今	1.21%	0.62%	-1.79%	1.03%	3.00%	-0.41%

创金合信汇选 6 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
过去三个月	7.09%	0.83%	11.62%	1.42%	-4.53%	-0.59%
过去六个月	5.27%	0.72%	9.67%	1.14%	-4.40%	-0.42%
过去一年	1.78%	0.68%	2.27%	1.07%	-0.49%	-0.39%
自基金合同生效起至今	0.73%	0.62%	-1.79%	1.03%	2.52%	-0.41%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

创金合信汇选6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  
(2023年07月25日-2024年09月30日)



创金合信汇选6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  
(2023年07月25日-2024年09月30日)



注：本基金建仓期为6个月。建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
颜彪	本基金基金经理	2024年8月3日	-	15	颜彪先生，中国国籍，哈尔滨工业大学硕士。2008年6月加入世纪证券有限公司，历任研究所分析师、总裁办公室总裁秘书、资产管理部投资主办人，2016年8月加入财通证券股份有限公司，任投资银行部高级副总监，2017年2月加入信达澳银基金管理有限管理公司，任专户权益投资部投资经理，2020年9月加入创金合信基金管理有限公司，曾任投资经理、基金经理助理，现任基金经理。
冯瑞玲	本基金基金经理	2023年7月25日	-	8	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。
尹海影	本基金基金经理、FOF投资一部负责人（已离任）	2023年7月25日	2024年8月3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。

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 公平交易专项说明

### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

### 一、三季度投资策略与组合管理情况

三季度，本产品基于多资产、多策略和多标的的三层配置框架进行配置，以实现在合理控制投资组合波动风险的前提下，取得长期优异回报。

#### （1）7 月观点与运作情况

7 月，受到基于日元的套息交易快速逆转的影响，海外权益市场普遍下跌。国内居民消费走弱、专项债发行偏慢等因素导致分子端承压明显，A 股震荡下跌，中债市场持续上涨。商品层面，原油受到衰退交易的影响下跌，黄金在美联储降息预期以及国际地缘政治因素影响下继续创下新高。7 月本产品主要维持产品合同约定下的中低权益仓位运作，持仓上以大盘价值、大盘质量风格的基金为主，在市场下跌中控制整体组合回撤。

#### （2）8 月观点与运作情况



8 月，海外权益在美国软着陆+降息预期推动下上涨。国内有效需求不足未有明显变化，A 股震荡下跌，中债市场波动加剧，信用债和利率债先后出现调整。商品层面，中美两国需求放缓，市场对供应过剩担忧加剧，原油继续下跌，而黄金在降息预期以及国际地缘政治因素影响下继续创下新高。本产品在 8 月仍然维持产品合同约定下的中低仓位运作，持仓上维持大盘价值和大盘质量风格。

### （3）9 月观点与运作情况

9 月，美联储降息落地，国内政策发力带动微观预期逆转，A 股快速反弹，中债波动进一步加大，其中部分信用债产品出现流动性风险。商品层面，地缘政治冲突加剧，原油黄金均上涨。9 月中下旬产品增配权益仓位，增加组合弹性。具体结构上，价值风格基金的赔率已经来到历史低位，而质量风格由于较低的交易拥挤和较低的估值水平具备了较高的胜率和赔率，组合减配部分价值风格标的，增配质量风格的标的。9 月末国内政策带动 A 股快速上行，组合进一步提高了权益仓位，增配部分大盘质量风格基金。

## 二、四季度策略展望

四季度，我们预计仍然维持中高仓位运作，以多策略形式配置高性价比的权益风格，叠加部分仓位择时，以实现在合理控制投资组合波动风险的前提下，取得长期优异回报。

后市展望上，国内货币信用方面，货币全面转向宽松，后续财政发力预期充足，信用层面后续有望出现扩张迹象。增长方面，受地产、消费持续拖累，8 月以来基本面弱化趋势较为明显，随着货币宽松+中央财政的发力，增长周期底部有望提前出现。通胀方面，CPI 向上的趋势似乎更为明确，而 PPI 能否完全摆脱通缩区间是向复苏前期过渡的关键因素，未来关注重点仍然是财政政策。具体到大类资产：

（1）A 股而言，四季度波动率预计仍然处于较高水平，后续财政政策的力度会对走势产生较为较大的影响，货币和财政双重发力下我们保持乐观。具体到 A 股风格方面，从胜率和赔率来考虑，当下质量风格处于最优配置位置，由于其估值水平处于较低位置，质量风格的赔率较高，同时当下高动量加中低拥挤的交易环境也具备一定胜率。上半年占优的价值风格当下处于中高胜率和低赔率水平，整体性价比受制于估值水平，我们逢低配置。大小盘风格方面，我们维持看多大盘，当前小盘拥挤度持续处于历史高位，未来的确定性较弱。

（2）港股而言，当前国内外货币政策的宽松叠加后续国内财政政策的预期带来多重利好，我们对港股保持乐观。具体配置结构而言，将高股息和国企标的作为主要配置。

（3）美股而言，美联储进入降息周期，货币信用处于高位回落阶段，软着陆预期加强。同时通胀不断降温，接近联储目标区间，但在货币宽松、劳动力供给、供应链风险等因素干扰下，有二次通胀的概率。当前对美股保持中性观点。

对于本基金组合，四季度将继续按照上述逻辑进行配置，并结合市场情况进行一定的再平衡交易，以平滑净值波动。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信汇选 6 个月持有期混合发起(FOF)A 基金份额净值为 1.0121 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 7.20%，同期业绩比较基准收益率为 11.62%；截至本报告期末创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）C 基金份额净值为 1.0073 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 7.09%，同期业绩比较基准收益率为 11.62%。

#### 4.6 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 投资组合报告

#### 5.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	8,651,391.62	80.24
3	固定收益投资	913,563.86	8.47
	其中：债券	913,563.86	8.47
	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	475,454.78	4.41
8	其他资产	740,916.51	6.87
9	合计	10,781,326.77	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 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。

### 5.2.2 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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.4 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	913,563.86	8.49
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	913,563.86	8.49

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019733	24 国债 02	9,000	913,563.86	8.49

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

### 5.7 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。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

本报告期内，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

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。

### 5.11.1 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,156.27
2	应收清算款	500,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	239,760.24
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	740,916.51

### 5.11.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## § 6 基金中基金

### 6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金 资产净 值比例 (%)	是否属 于基金 管理人 及管理 人关联 方所管 理的基 金
1	017043	汇添富 品质价 值混合	契约型 开放式	972,923. 58	1,131,31 5.54	10.52	否
2	011066	大成高 新技术 产业股 票 C	契约型 开放式	236,085. 10	1,044,18 0.79	9.71	否
3	003579	中金沪 深 300 指数 C	契约型 开放式	570,283. 31	982,484. 09	9.13	否
4	512890	华泰柏 瑞中证 红利低 波动 ETF	契约型 开放式	575,100. 00	648,137. 70	6.03	否
5	011823	易方达 产业升 级混合 C	契约型 开放式	676,414. 33	581,581. 04	5.41	否
6	016374	华泰柏 瑞新金 融地产 C	契约型 开放式	352,274. 99	542,573. 94	5.04	否
7	012709	东方红 中证东 方红红	契约型 开放式	412,473. 19	532,379. 15	4.95	否

		利低波动指数 C					
8	018413	大成竞争优势混合 C	契约型 开放式	271,549. 53	460,873. 86	4.28	否
9	007658	东方红中证竞争力指数 C	契约型 开放式	374,645. 05	440,470. 19	4.09	否
10	006676	宝盈品牌消费股票 C	契约型 开放式	287,590. 60	371,682. 09	3.46	否

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2024-07-01 至 2024-09-30	其中：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
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）	47.16	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	4,928.39	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	17,535.63	-
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	3,205.41	-

注：1. 根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人运用本基金财产申购自身管理的基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法律法规、被投资基金招募说明书约定应当收取，并记入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。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。

2. 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。

### 6.3 本期报告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。

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信汇选 6 个月持有期 混合发起（FOF）A	创金合信汇选 6 个月持有期 混合发起（FOF）C
报告期期初基金份额总额	5,030,228.65	5,266,006.56
报告期期间基金总申购份额	358,335.39	1.10
减：报告期期间基金总赎回 份额	1.00	1,252.82
报告期期间基金拆分变动份 额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	5,388,563.04	5,264,754.84

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	创金合信汇选 6 个月持有期 混合发起（FOF）A	创金合信汇选 6 个月持有期 混合发起（FOF）C
报告期期初管理人持有的本 基金份额	5,000,900.18	5,000,900.00
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本 基金份额	5,000,900.18	5,000,900.00
报告期期末持有的本基金份 额占基金总份额比例（%）	92.81	94.99

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的交易明细。

## § 9 报告期末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	发起份额总数	发起份额占	发起份额承
----	--------	-------	--------	-------	-------

		基金总份额 比例 (%)		基金总份额 比例 (%)	诺持有期限
基金管理人 固有资金	10,001,800.18	93.88	10,001,800.18	93.88	36 个月
基金管理人 高级管理人员	13,087.71	0.12	-	-	-
基金经理等 人员	-	-	-	-	-
基金管理人 股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,014,887.89	94.01	10,001,800.18	93.88	36 个月

## § 10 影响投资者决策的其他重要信息

### 10.1 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	20240701 - 20240930	10,001,800.18	0.00	0.00	10,001,800.18	93.88%

#### 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。

### 10.2 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 9 月 30 日，创金合信基金共管理 99 只公募基金，公募管理规模 1646.07 亿元。

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、《创金合信汇选 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》；
- 2、《创金合信汇选 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》；
- 3、创金合信汇选 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2024 年 3 季度报告原文。

### 11.2 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

### 11.3 查阅方式

[www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2024 年 10 月 24 日