

创金合信量化核心混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 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.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§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遵规守信情况的说明.....	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.....	10
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.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	35
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
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.....	41
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.....	41
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.....	41

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	42
§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
§9 开放式基金份额变动.....	43
§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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	47
§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	创金合信量化核心混合型证券投资基金	
基金简称	创金合信量化核心混合	
基金主代码	004359	
交易代码	004359	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 27 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	15,855,521.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信量化核心混合 A	创金合信量化核心混合 C
下属分级基金的交易代码	004359	004360
报告期末下属分级基金的份 额总额	9,699,460.19 份	6,156,061.18 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的同时，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取定量与定性相结合的方法，运用“自上而下”的资产配置逻辑，形成对大类资产预期收益及风险的判断，进而确定资产配置的具体比例。其中，本基金在进行资产配置决策时将主要考虑宏观经济、政策预期、产业经济、市场情绪、投资者行为等因素。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债综合财富（总值）指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，长期来看，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋
	联系电话	0755-23838944
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfun d.com
客户服务电话	400-868-0666	95588
传真	0755-25832571	010-66105798
注册地址	深圳市前海深港合作区 前湾一路 1 号 A 栋 201	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	
办公地址	深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518000	100140
法定代表人	刘学民	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15 层

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	深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、创金合信量化核心混合 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	6,567,689.41
本期利润	2,800,908.97
加权平均基金份额本期利润	0.2238
本期加权平均净值利润率	12.21%
本期基金份额净值增长率	1.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	8,089,993.82
期末可供分配基金份额利润	0.8341
期末基金资产净值	17,789,454.01
期末基金份额净值	1.8341
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	92.77%
-------------	--------

2、创金合信量化核心混合 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	3,593,151.58
本期利润	502,715.77
加权平均基金份额本期利润	0.0709
本期加权平均净值利润率	4.02%
本期基金份额净值增长率	0.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	4,703,896.89
期末可供分配基金份额利润	0.7641
期末基金资产净值	10,859,958.07
期末基金份额净值	1.7641
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	85.53%

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. 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

创金合信量化核心混合 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	-1.21%	0.76%	-1.57%	0.64%	0.36%	0.12%
过去三个月	4.19%	0.93%	3.07%	0.78%	1.12%	0.15%
过去六个月	1.33%	1.25%	0.78%	1.05%	0.55%	0.20%
过去一年	37.58%	1.24%	20.98%	1.06%	16.60%	0.18%

过去三年	82.92%	1.19%	42.83%	1.09%	40.09%	0.10%
自基金合同生效起至今	92.77%	1.08%	45.13%	0.99%	47.64%	0.09%

创金合信量化核心混合 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	-1.28%	0.76%	-1.57%	0.64%	0.29%	0.12%
过去三个月	3.98%	0.93%	3.07%	0.78%	0.91%	0.15%
过去六个月	0.92%	1.25%	0.78%	1.05%	0.14%	0.20%
过去一年	36.47%	1.24%	20.98%	1.06%	15.49%	0.18%
过去三年	78.32%	1.19%	42.83%	1.09%	35.49%	0.10%
自基金合同生效起至今	85.53%	1.08%	45.13%	0.99%	40.40%	0.09%

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

创金合信量化核心混合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
(2017年03月27日-2021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 3 日获得中国证监会批复，2014 年 7 月 9 日正式注册设立，注册地为深圳市。公司注册资本 2.33 亿元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例 51.0729%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例 21.8884%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%。

公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。

报告期内，本公司共发行 13 只公募基金。截至 2021 年 6 月 30 日，本公司共管理 69 只公募基金，其中混合型产品 19 只、指数型产品 4 只、债券型产品 23 只、股票型产品 22 只、货币型产品 1 只；管理的公募基金规模约 559.29 亿元。

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		
孙悦	本基金	2021 年 2	-	4	孙悦先生，中国国籍，北京大学金融学

	基金经 理	月 26 日			硕士，2017 年 7 月加入创金合信基金管理 有限公司，历任量化指数与国际部研 究员、投资经理，现任基金经理。
王林峰	本基金 基金经 理（已 离任）	2019 年 8 月 20 日	2021 年 2 月 26 日	8	王林峰先生，中山大学硕士，国籍：中 国。2012 年 7 月加入国元证券经纪（香 港）有限公司，担任研究部分析师。2015 年 5 月加入国元资产管理（香港）有限 公司，历任资产管理部研究员、投资经 理。2018 年 10 月加入创金合信基金管 理有限公司，曾任研究员，现任基金经理。
董梁	本基金 基金经 理、首 席量化 投资官 兼任量 化指数 与国际 部总监	2019 年 7 月 5 日	-	17	董梁先生，中国香港，美国密歇根大 学材料科学博士，2005 年 3 月加入美国巴 克莱环球投资(Barclays Global Investors) 任高级研究员、基金经理,负责美股量 化模型开发及投资工作。2009 年 8 月加 入瑞士信贷(Credit-Suisse)任自营交易 员,负责港股量化模型开发和投资,以及 全球股指期货期权的量化投资。2011 年 1 月加入信达国际任执行董事、基金经 理,进行港股投资。2012 年 8 月加入华 安基金管理有限公司,任系统化投资部 量化投资总监、基金经理。2015 年加 入香港启智资产管理有限公司（Zentific Investment Management）任投资部基 金经理。2017 年 9 月加入创金合信基 金管理有限公司,现任首席量化投资官， 兼量化指数与国际部总监、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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关决定。

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

2021 年上半年，全球疫情反弹后回落，疫苗接种率逐渐提升，发达国家经济明显修复，好于发展中国家。多作用因素下，大宗商品价格上行，全球通胀压力升温。随着各国经济活动逐渐恢复正常，未来将逐渐退出宽松的货币政策，6 月美联储议息会议释放边际转鹰信号。国内方面，基本面持续复苏，疫情管控情况良好，疫苗接种率达到较高水平，通胀水平相对稳定，货币政策继续维持稳健。尤其是在其它新兴市场疫情反复的情况下，我国在全球供应链中的地位进一步加强。大类资产方面，大宗商品上涨后回落，原油价格大幅提升，美元指数探底回升，黄金宽幅震荡，美股、A 股震荡上行。

2021 年上半年，沪深 300 指数大幅上涨后回落，二季度维持窄幅震荡走势，行业间收益率分化比较明显。业绩基准指数成份股内，表现最好的几个行业是钢铁 25.73%、电气设备 21.84%、采掘 18.25%，表现最差的几个行业是家用电器-19.17%、商业贸易-17.96%、房地产-15.71%。风格方面，成份股内成长、高流动性因子表现较好，价值因子表现较差。

报告期内模型运行平稳，我们坚持以自下而上选股为主进行量化投资，严格控制各个维度上的风险暴露以限制跟踪误差，在此基础上追求超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信量化核心混合 A 基金份额净值为 1.8341 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.33%，同期业绩比较基准收益率为 0.78%；截至本报告期末创金合信量化核心混合 C 基金份额净值为 1.7641 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.92%，同期业绩比较基准收益率为 0.78%。

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 2021 年下半年，新冠疫情带来的影响将越来越弱，全球经济持续修复，各国逐渐退出宽松货币政策是大概率事件。美联储在本轮操作过程中非常谨慎，市场已逐渐消化缩减 QE 的影响，预计靴子落地后对市场的冲击不大。国内方面，随着经济从疫情中持续修复，增速将边际放缓，下半年有一定经济下行压力。7 月国务院常务会后，央行宣布降准 0.5%，加大对小微企业的支持力度。在货币政策稳健的基调下，本次降准不代表下半年将大幅宽松，但已足够改变市场对于政策收紧的预期，短期对市场情绪有提振作用。长期来看，市场系统性风险不大，仍然以结构性机会为主。

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，本基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 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，本基金托管人在对创金合信量化核心混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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, 创金合信量化核心混合型证券投资基金的管理人——创金合信基金管理有限公司在创金合信量化核心混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对创金合信基金管理有限公司编制和披露的创金合信量化核心混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查, 以上内容真实、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：创金合信量化核心混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	427,948.10	12,688,845.44
结算备付金		608,477.16	1,998,824.93
存出保证金		16,285.49	1,520,049.04
交易性金融资产	6.4.7.2	27,888,027.64	82,271,542.26
其中：股票投资		26,526,960.44	82,271,542.26
基金投资		-	0.00
债券投资		1,361,067.20	0.00
资产支持证券投资		-	0.00
贵金属投资		-	0.00
衍生金融资产	6.4.7.3	-	0.00
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	0.00
应收证券清算款		-	98,309.58
应收利息	6.4.7.5	29,333.57	11,148.73
应收股利		-	0.00

应收申购款		9,440.92	4,895.31
递延所得税资产		-	0.00
其他资产	6.4.7.6	-	0.00
资产总计		28,979,512.88	98,593,615.29
负债和所有者权益		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	0.00
交易性金融负债		-	0.00
衍生金融负债	6.4.7.3	-	0.00
卖出回购金融资产款		200,000.00	0.00
应付证券清算款		1,780.99	26,759.80
应付赎回款		706.96	1,480,883.70
应付管理人报酬		35,759.54	118,652.51
应付托管费		5,959.94	19,775.42
应付销售服务费		7,201.28	13,845.43
应付交易费用	6.4.7.7	26,822.36	125,035.97
应交税费		-	4,312.23
应付利息		20.03	0.00
应付利润		-	0.00
递延所得税负债		-	0.00
其他负债	6.4.7.8	51,849.70	129,000.03
负债合计		330,100.80	1,918,265.09
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	15,855,521.37	53,847,422.32
未分配利润	6.4.7.10	12,793,890.71	42,827,927.88
所有者权益合计		28,649,412.08	96,675,350.20
负债和所有者权益总计		28,979,512.88	98,593,615.29

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，创金合信量化核心混合 A 份额净值 1.8341 元，基金份额总额 9,699,460.19 份；创金合信量化核心混合 C 份额净值 1.7641 元，基金份额总额 6,156,061.18 份；总份额合计 15,855,521.37 份。

6.2 利润表

会计主体：创金合信量化核心混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		4,071,535.87	7,931,298.72
1. 利息收入		24,512.10	101,088.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,722.60	37,838.52
债券利息收入		12,789.50	63,250.27
资产支持证券利息 收入		-	0.00
买入返售金融资产 收入		-	0.00
其他利息收入		-	0.00
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		10,859,936.85	4,927,944.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,818,749.05	4,284,965.27
基金投资收益		-	0.00
债券投资收益	6.4.7.13	-17.65	1,255.75
资产支持证券投资 收益		-	0.00
贵金属投资收益		-	0.00
衍生工具收益	6.4.7.14	-1,147,680.00	-314,938.25
股利收益	6.4.7.15	188,885.45	956,661.81
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-6,857,216.25	2,868,027.08
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	44,303.17	34,238.27
减：二、费用		767,911.13	1,744,761.12

1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	266, 465. 92	792, 139. 99
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	44, 411. 04	132, 023. 32
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	49, 901. 06	148, 532. 98
4. 交易费用	6. 4. 7. 18	342, 925. 98	562, 980. 66
5. 利息支出		2, 591. 44	142. 19
其中：卖出回购金融资产支出		2, 591. 44	142. 19
6. 税金及附加		-	669. 40
7. 其他费用	6. 4. 7. 19	61, 615. 69	108, 272. 58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3, 303, 624. 74	6, 186, 537. 60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3, 303, 624. 74	6, 186, 537. 60

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信量化核心混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	53, 847, 422. 32	42, 827, 927. 88	96, 675, 350. 20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3, 303, 624. 74	3, 303, 624. 74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-37, 991, 900. 95	-33, 337, 661. 91	-71, 329, 562. 86
其中：1. 基金申购款	2, 398, 597. 64	1, 992, 109. 93	4, 390, 707. 57
2. 基金赎回款	-40, 390, 498. 59	-35, 329, 771. 84	-75, 720, 270. 43
四、本期向基金份额	-	-	-

持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	15,855,521.37	12,793,890.71	28,649,412.08
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	87,856,511.89	19,945,923.28	107,802,435.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	6,186,537.60	6,186,537.60
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-8,629,998.07	-1,084,912.00	-9,714,910.07
其中：1. 基金申购款	57,112,954.86	12,222,316.35	69,335,271.21
2. 基金赎回款	-65,742,952.93	-13,307,228.35	-79,050,181.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	79,226,513.82	25,047,548.88	104,274,062.70

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 _____ 沈琼 _____
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

创金合信量化核心混合型证券投资基金(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[2017]5号《关于准予创金合信量化核心混合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《创金合信量化核心混合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801,695,744.90元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第116号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信量化核心混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为801,997,731.79份基金份额,其中认购资金利息折合301,986.89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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《创金合信量化核心混合型证券投资基金招募说明书》,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《创金合信量化核心混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、金融衍生品(包括权证、股指期货、股票期权等)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)。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 80%+中债综合财富(总值)指数收益率 \times 20%。

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

合信量化核心混合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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 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。基金通过沪港通或深港通买卖、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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	427,948.10
定期存款	-
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	-
合计	427,948.10

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,313,137.29	26,526,960.44	1,213,823.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,360,752.95	1,361,067.20
	银行间市场	-	-
	合计	1,360,752.95	1,361,067.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	26,673,890.24	27,888,027.64	1,214,137.40

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	67.65
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,149.74
应收债券利息	27,108.78

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	7.40
合计	29,333.57

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	26,822.36
银行间市场应付交易费用	-
合计	26,822.36

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.01
应付证券出借违约金	-
预提费用	51,849.69
合计	51,849.70

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信量化核心混合 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	41,056,949.59	41,056,949.59
本期申购	1,542,140.34	1,542,140.34
本期赎回 (以“-”号填列)	-32,899,629.74	-32,899,629.74
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	9,699,460.19	9,699,460.19

创金合信量化核心混合 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	12,790,472.73	12,790,472.73
本期申购	856,457.30	856,457.30

本期赎回（以“-”号填列）	-7,490,868.85	-7,490,868.85
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	6,156,061.18	6,156,061.18

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

创金合信量化核心混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	31,672,570.71	1,586,930.94	33,259,501.65
本期利润	6,567,689.41	-3,766,780.44	2,800,908.97
本期基金份额交易产生的变动数	-27,187,931.32	-782,485.48	-27,970,416.80
其中：基金申购款	1,535,931.30	-204,576.53	1,331,354.77
基金赎回款	-28,723,862.62	-577,908.95	-29,301,771.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,052,328.80	-2,962,334.98	8,089,993.82

创金合信量化核心混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,101,933.78	466,492.45	9,568,426.23
本期利润	3,593,151.58	-3,090,435.81	502,715.77
本期基金份额交易产生的变动数	-6,171,435.16	804,190.05	-5,367,245.11
其中：基金申购款	797,887.41	-137,132.25	660,755.16
基金赎回款	-6,969,322.57	941,322.30	-6,028,000.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,523,650.20	-1,819,753.31	4,703,896.89

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,231.33
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	8,335.59
其他	155.68
合计	11,722.60

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	187,468,652.48
减：卖出股票成本总额	175,649,903.43
买卖股票差价收入	11,818,749.05

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	68,955.47
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	67,988.95
减：应收利息总额	984.17
买卖债券差价收入	-17.65

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
期货投资	-1,147,680.00

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	188,885.45
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	188,885.45

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-7,356,776.25
——股票投资	-7,357,090.50
——债券投资	314.25
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2.衍生工具	499,560.00
——权证投资	-
——期货投资	499,560.00
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	-6,857,216.25

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	44,017.45
转换费收入	285.72
合计	44,303.17

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	340,657.67
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
期货市场交易费用	2,268.31
合计	342,925.98

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	23,013.90
证券出借违约金	-
汇划手续费	166.00
账户维护费	18,000.00
查询服务费	600.00
合计	61,615.69

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

本报告期不存在重大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
中国工商银行股份有限公司	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 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

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

本基金于本报告期末及上年度末均无应支付关联方的佣金。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	266,465.92	792,139.99
其中：支付销售机构的客户维护费	105,122.17	189,633.09

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 1.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	44,411.04	132,023.32

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信量化核心混合 A	创金合信量化核心混合 C	合计
创金合信直销	-	3,978.01	3,978.01
第一创业证券	-	-	-
中国工商银行	-	27,934.11	27,934.11
合计	-	31,912.12	31,912.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信量化核心混合 A	创金合信量化核心混合 C	合计
创金合信直销	-	88,924.67	88,924.67
第一创业证券	-	297.26	297.26
中国工商银行	-	34,583.79	34,583.79
合计	-	123,805.72	123,805.72

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 0.8% 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：

$$\text{日 C 类基金份额销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.8\% / \text{当年天数}。$$

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
中国工商银行股份有限公司	427,948.10	3,231.33	2,724,815.28	20,895.56

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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区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区间均无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	196	6,185.76	6,185.76	-

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

截至本报告期 2021 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 200,000.00 元，于 2021 年 7 月 6 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和债券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工商银行，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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,361,067.20	-
合计	1,361,067.20	-

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 2021 年 06 月 30 日，本基金所承担的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(所有者权益)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期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附注 6.4.12。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%。于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.02%。

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。于 2021 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 28,830,701.99 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	427,948.10	-	-	-	427,948.10
结算备付金	608,477.16	-	-	-	608,477.16
存出保证金	16,285.49	-	-	-	16,285.49
交易性金融资产	1,361,067.20	-	-	26,526,960.44	27,888,027.64
应收利息	-	-	-	29,333.57	29,333.57

应收申购款	-	-	-	9,440.92	9,440.92
资产总计	2,413,777.95	-	-	26,565,734.93	28,979,512.88
负债					
卖出回购金融资产款	200,000.00	-	-	-	200,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1,780.99	1,780.99
应付赎回款	-	-	-	706.96	706.96
应付管理人报酬	-	-	-	35,759.54	35,759.54
应付托管费	-	-	-	5,959.94	5,959.94
应付销售服务费	-	-	-	7,201.28	7,201.28
应付交易费用	-	-	-	26,822.36	26,822.36
应付利息	-	-	-	20.03	20.03
其他负债	-	-	-	51,849.70	51,849.70
负债总计	200,000.00	-	-	130,100.80	330,100.80
利率敏感度缺口	2,213,777.95	-	-	26,435,634.13	28,649,412.08
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,688,845.44	-	-	-	12,688,845.44
结算备付金	1,998,824.93	-	-	-	1,998,824.93
存出保证金	1,520,049.04	-	-	-	1,520,049.04
交易性金融资产	-	-	-	82,271,542.26	82,271,542.26
应收证券清算款	-	-	-	98,309.58	98,309.58
应收利息	-	-	-	11,148.73	11,148.73
应收申购款	-	-	-	4,895.31	4,895.31
资产总计	16,207,719.41	-	-	82,385,895.88	98,593,615.29
负债					
应付证券清算款	-	-	-	26,759.80	26,759.80
应付赎回款	-	-	-	1,480,883.70	1,480,883.70
应付管理人报酬	-	-	-	118,652.51	118,652.51
应付托管费	-	-	-	19,775.42	19,775.42
应付销售服务费	-	-	-	13,845.43	13,845.43
应付交易费用	-	-	-	125,035.97	125,035.97
应交税费	-	-	-	4,312.23	4,312.23
其他负债	-	-	-	129,000.03	129,000.03
负债总计	-	-	-	1,918,265.09	1,918,265.09
利率敏感度缺口	16,207,719.41	-	-	80,467,630.79	96,675,350.20

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.75% (2020 年 6 月 30 日：3.36%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 年 6 月 30 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	26,526,960.44	92.59	82,271,542.26	85.10
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	26,526,960.44	92.59	82,271,542.26	85.10

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
1.业绩比较基准上升 5%	1,436,945.66	4,034,665.21
2.业绩比较基准下降 5%	-1,436,945.66	-4,034,665.21

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 26,520,774.68 元，属于第二层次的余额为 1,367,252.96 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 80,169,937.19 元，属于第二层次的余额为 2,101,605.07 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.14.2

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	26,526,960.44	91.54
	其中：股票	26,526,960.44	91.54
2	固定收益投资	1,361,067.20	4.70
	其中：债券	1,361,067.20	4.70
	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	1,036,425.26	3.58
7	其他资产	55,059.98	0.19
8	合计	28,979,512.88	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

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	280,147.40	0.98
B	采矿业	631,035.00	2.20
C	制造业	14,257,604.64	49.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	311,941.36	1.09
E	建筑业	47,313.76	0.17
F	批发和零售业	214,913.40	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	1,039,072.00	3.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	655,740.60	2.29
J	金融业	6,198,857.26	21.64
K	房地产业	826,956.00	2.89
L	租赁和商务服务业	844,860.00	2.95

M	科学研究和技术服务业	591,910.20	2.07
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	583,880.82	2.04
R	文化、体育和娱乐业	42,728.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	26,526,960.44	92.59

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 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	600519	贵州茅台	991	2,038,189.70	7.11
2	600036	招商银行	20,800	1,127,152.00	3.93
3	000858	五粮液	3,232	962,780.48	3.36
4	000333	美的集团	10,203	728,188.11	2.54
5	601012	隆基股份	7,420	659,192.80	2.30
6	002415	海康威视	10,200	657,900.00	2.30
7	601888	中国中免	2,000	600,200.00	2.09
8	603259	药明康德	3,780	591,910.20	2.07
9	000001	平安银行	25,600	579,072.00	2.02
10	600030	中信证券	23,000	573,620.00	2.00
11	002475	立讯精密	11,939	549,194.00	1.92
12	601318	中国平安	8,406	540,337.68	1.89
13	600031	三一重工	18,210	529,364.70	1.85
14	300015	爱尔眼科	7,409	525,890.82	1.84
15	601166	兴业银行	25,000	513,750.00	1.79
16	600309	万华化学	4,700	511,454.00	1.79
17	300059	东方财富	14,848	486,865.92	1.70
18	002230	科大讯飞	6,800	459,544.00	1.60
19	600837	海通证券	38,000	437,000.00	1.53
20	002142	宁波银行	11,000	428,670.00	1.50
21	600919	江苏银行	58,100	412,510.00	1.44
22	601211	国泰君安	23,500	402,790.00	1.41
23	601009	南京银行	36,000	378,720.00	1.32
24	002938	鹏鼎控股	9,800	351,624.00	1.23
25	601138	工业富联	28,200	349,962.00	1.22

26	300760	迈瑞医疗	700	336,035.00	1.17
27	603833	欧派家居	2,300	326,508.00	1.14
28	002271	东方雨虹	5,900	326,388.00	1.14
29	002594	比亚迪	1,300	326,300.00	1.14
30	600048	保利地产	26,900	323,876.00	1.13
31	601088	中国神华	16,200	316,224.00	1.10
32	600548	深高速	35,900	313,048.00	1.09
33	600023	浙能电力	84,400	309,748.00	1.08
34	600176	中国巨石	18,872	292,704.72	1.02
35	001965	招商公路	40,500	292,410.00	1.02
36	603288	海天味业	2,240	288,848.00	1.01
37	000725	京东方 A	45,700	285,168.00	1.00
38	000002	万科 A	11,600	276,196.00	0.96
39	600585	海螺水泥	6,100	250,405.00	0.87
40	000063	中兴通讯	7,500	249,225.00	0.87
41	002027	分众传媒	26,000	244,660.00	0.85
42	300463	迈克生物	5,700	239,913.00	0.84
43	603799	华友钴业	2,000	228,400.00	0.80
44	603790	雅运股份	21,900	224,694.00	0.78
45	600438	通威股份	5,100	220,677.00	0.77
46	002460	赣锋锂业	1,800	217,962.00	0.76
47	002714	牧原股份	3,284	199,732.88	0.70
48	002241	歌尔股份	4,400	188,056.00	0.66
49	002812	恩捷股份	800	187,280.00	0.65
50	002304	洋河股份	900	186,480.00	0.65
51	601225	陕西煤业	15,200	180,120.00	0.63
52	600809	山西汾酒	400	179,200.00	0.63
53	300142	沃森生物	2,900	178,930.00	0.62
54	002371	北方华创	600	166,428.00	0.58
55	000568	泸州老窖	700	165,158.00	0.58
56	300750	宁德时代	300	160,440.00	0.56
57	601628	中国人寿	4,400	149,116.00	0.52
58	603233	大参林	2,740	140,041.40	0.49
59	601899	紫金矿业	13,900	134,691.00	0.47
60	600377	宁沪高速	13,800	134,688.00	0.47
61	002546	新联电子	35,900	133,907.00	0.47
62	002454	松芝股份	23,000	123,970.00	0.43
63	600012	皖通高速	18,700	120,802.00	0.42
64	300482	万孚生物	1,810	117,088.90	0.41
65	600269	赣粤高速	33,100	111,216.00	0.39
66	600665	天地源	32,500	104,650.00	0.37
67	300601	康泰生物	700	104,300.00	0.36
68	300454	深信服	400	103,792.00	0.36

69	600683	京投发展	25,800	96,492.00	0.34
70	603806	福斯特	900	94,617.00	0.33
71	600926	杭州银行	6,100	89,975.00	0.31
72	600436	片仔癀	200	89,660.00	0.31
73	002311	海大集团	1,000	81,600.00	0.28
74	300498	温氏股份	5,596	80,414.52	0.28
75	002049	紫光国微	500	77,095.00	0.27
76	603939	益丰药房	1,300	72,917.00	0.25
77	601799	星宇股份	300	67,716.00	0.24
78	601111	中国国航	8,600	66,908.00	0.23
79	600276	恒瑞医药	922	62,668.34	0.22
80	600362	江西铜业	2,600	58,188.00	0.20
81	300347	泰格医药	300	57,990.00	0.20
82	600958	东方证券	5,600	55,944.00	0.20
83	601002	晋亿实业	11,100	54,390.00	0.19
84	600019	宝钢股份	6,500	49,660.00	0.17
85	600690	海尔智家	1,900	49,229.00	0.17
86	688578	艾利斯	1,453	47,905.41	0.17
87	002179	中航光电	600	47,412.00	0.17
88	300583	赛托生物	2,100	44,625.00	0.16
89	002439	启明星辰	1,500	43,515.00	0.15
90	600196	复星医药	600	43,278.00	0.15
91	601811	新华文轩	4,900	42,728.00	0.15
92	600502	安徽建工	10,600	41,128.00	0.14
93	000876	新希望	2,800	41,076.00	0.14
94	688658	悦康药业	1,752	39,402.48	0.14
95	000661	长春高新	100	38,700.00	0.14
96	300226	上海钢联	600	35,730.00	0.12
97	002755	奥赛康	2,600	35,334.00	0.12
98	300747	锐科激光	300	34,218.00	0.12
99	000726	鲁泰 A	5,300	31,694.00	0.11
100	000100	TCL 科技	4,100	31,365.00	0.11
101	600658	电子城	6,100	25,742.00	0.09
102	600760	中航沈飞	380	22,914.00	0.08
103	002157	正邦科技	1,900	22,705.00	0.08
104	601528	瑞丰银行	1,038	16,161.66	0.06
105	002508	老板电器	300	13,950.00	0.05
106	600741	华域汽车	500	13,135.00	0.05
107	603917	合力科技	1,000	9,220.00	0.03
108	603006	黎明股份	900	7,947.00	0.03
109	000666	经纬纺机	900	7,173.00	0.03
110	605287	德才股份	196	6,185.76	0.02
111	600660	福耀玻璃	100	5,585.00	0.02

112	603171	税友股份	267	5,126.40	0.02
113	600406	国电南瑞	180	4,183.20	0.01
114	300271	华宇软件	200	3,850.00	0.01
115	605011	杭州热电	247	2,193.36	0.01
116	000757	浩物股份	500	1,955.00	0.01

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	600030	中信证券	3,022,368.00	3.13
2	601211	国泰君安	2,462,699.00	2.55
3	000333	美的集团	2,026,679.00	2.10
4	600585	海螺水泥	1,961,304.00	2.03
5	601138	工业富联	1,856,066.00	1.92
6	002415	海康威视	1,817,043.64	1.88
7	600999	招商证券	1,768,720.00	1.83
8	600809	山西汾酒	1,645,082.00	1.70
9	002475	立讯精密	1,614,059.00	1.67
10	300059	东方财富	1,574,153.16	1.63
11	000002	万科A	1,556,252.40	1.61
12	601328	交通银行	1,503,272.00	1.55
13	601668	中国建筑	1,448,246.00	1.50
14	601766	中国中车	1,354,088.00	1.40
15	601919	中远海控	1,336,881.00	1.38
16	601390	中国中铁	1,332,637.00	1.38
17	600018	上港集团	1,312,755.00	1.36
18	601985	中国核电	1,301,130.00	1.35
19	601688	华泰证券	1,262,380.00	1.31
20	603288	海天味业	1,253,268.00	1.30

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	601318	中国平安	4,883,257.00	5.05
2	600519	贵州茅台	3,844,076.00	3.98
3	600036	招商银行	3,175,169.00	3.28
4	601888	中国中免	3,059,376.35	3.16
5	300059	东方财富	3,013,867.03	3.12

6	600887	伊利股份	2,877,677.00	2.98
7	603259	药明康德	2,628,641.44	2.72
8	600030	中信证券	2,431,130.00	2.51
9	000858	五 粮 液	2,406,594.00	2.49
10	600690	海尔智家	2,395,299.98	2.48
11	601166	兴业银行	2,372,239.00	2.45
12	601601	中国太保	2,365,324.10	2.45
13	600276	恒瑞医药	2,199,450.00	2.28
14	600031	三一重工	2,151,283.46	2.23
15	601211	国泰君安	2,074,198.00	2.15
16	601088	中国神华	2,062,711.00	2.13
17	603993	洛阳钼业	1,963,932.00	2.03
18	600048	保利地产	1,926,872.93	1.99
19	600019	宝钢股份	1,859,311.00	1.92
20	000333	美的集团	1,849,619.17	1.91

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	127,262,412.11
卖出股票收入（成交）总额	187,468,652.48

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	1,361,067.20	4.75
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	1,361,067.20	4.75

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	019640	20 国债 10	12,650	1,265,000.00	4.42
2	019649	21 国债 01	960	96,067.20	0.34

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计 (元)					-
股指期货投资本期收益 (元)					-1,147,680.00
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					499,560.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货，均以套期保值为目的。本报告期进行了少量的多头套保。

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 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

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	16,285.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,333.57
5	应收申购款	9,440.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,059.98

7.12.4 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。

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。

§ 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
创金合信量化核心混合 A	658	14,740.82	-	-	9,699,460.19	100.00%
创金合信	882	6,979.66	-	-	6,156,061.1	100.00%

量化核心混合 C					8	
合计	1,495	10,605.70	-	-	15,855,521.37	100.00%

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	创金合信量化核心混合 A	468.30	0.00%
	创金合信量化核心混合 C	0.00	0.00%
	合计	468.30	0.00%

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	创金合信量化核心混合 A	0~10
	创金合信量化核心混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信量化核心混合 A	0
	创金合信量化核心混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信量化核心混合 A	创金合信量化核心混合 C
基金合同生效日(2017年3月27日)基金份额总额	269,241,417.75	532,756,314.04
本报告期期初基金份额总额	41,056,949.59	12,790,472.73
本报告期基金总申购份额	1,542,140.34	856,457.30
减：报告期基金总赎回份额	32,899,629.74	7,490,868.85

本报告期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	9,699,460.19	6,156,061.18

§ 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

创金合信基金管理有限公司监事杨健先生辞任监事职务，2021 年 3 月 3 日，经创金合信基金管理有限公司股东会 2021 年第一次会议审议通过，选举宋明华先生担任公司监事。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	141,876,598.54	45.17%	46,329.74	37.30%	-
东兴证券	2	45,160,300.87	14.38%	14,644.50	11.79%	-
光大证券	2	21,527,835.30	6.85%	9,096.36	7.32%	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	8,957,877.76	2.85%	3,799.71	3.06%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	16,149,635.43	5.14%	6,821.70	5.49%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	23,009,161.50	7.33%	9,737.87	7.84%	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	74,678.37	0.02%	31.87	0.03%	-
安信证券	4	26,354,291.22	8.39%	11,192.99	9.01%	-
太平洋证券	4	31,000,522.71	9.87%	22,544.74	18.15%	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-

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。

本基金报告期内退租中泰证券 2 个交易单元。

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
长江证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	422,126.60	28.20%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	500,000.00	9.43%	-	-
光大证券	19,988.60	1.34%	500,000.00	9.43%	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	69,979.00	4.68%	1,100,000.00	20.75%	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	126,926.00	8.48%	1,400,000.00	26.42%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	14,000.20	0.94%	800,000.00	15.09%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	106,936.50	7.14%	1,000,000.00	18.87%	-	-
安信证券	736,756.30	49.22%	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	创金合信量化核心混合型证券投资基金 2020 年第四季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-22
2	创金合信量化核心混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-27
3	创金合信量化核心混合型证券投资基金 2020 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
4	创金合信量化核心混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-22
5	创金合信基金管理有限公司关于修订公司旗下部分公开募集证券投资基金基金合同有关条款的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-29
6	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-17

§ 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	20210101 - 20210112	29,615,736.03	0.00	29,615,736.03	0.00	0.00%

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

本报告期内,未出现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信量化核心混合型证券投资基金基金合同》;
- 2、《创金合信量化核心混合型证券投资基金托管协议》;
- 3、创金合信量化核心混合型证券投资基金 2021 年中期报告原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15 楼

12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日