

# 创金合信港股通量化股票型证券投资 基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 3 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。本年度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 2022 年 3 月 28 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。

本报告财务资料已经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2021 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告.....	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 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.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53

8.6	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 .....	54
8.7	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 .....	54
8.8	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 .....	54
8.9	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 .....	54
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	54
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	54
8.12	投资组合报告附注 .....	55
§9	基金份额持有人信息 .....	55
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
9.3	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的情况 .....	56
§10	开放式基金份额变动 .....	57
§11	重大事件揭示 .....	57
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	57
11.2	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 .....	57
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
11.4	基金投资策略的改变 .....	57
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	58
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
11.8	其他重大事件 .....	60
§12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
12.1	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 .....	61
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
§13	备查文件目录 .....	62
13.1	备查文件目录 .....	62
13.2	存放地点 .....	62
13.3	查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信港股通量化股票型证券投资基金	
基金简称	创金合信港股通量化股票	
基金主代码	007354	
交易代码	007354	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 11 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	546,467,317.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信港股通量化股票 A	创金合信港股通量化股票 C
下属分级基金的交易代码	007354	007357
报告期末下属分级基金的份 额总额	510,344,115.51 份	36,123,202.30 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的同时，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。本基金股票投资组合的构建以多因子模型为基础框架，并根据预先设定的风险预算、交易成本、投资限制等实际情况的需要进行组合优化。即，本基金股票组合的构建包括多因子模型和投资组合优化两个部分。
业绩比较基准	MSCI 港股通指数收益率（经估值汇率调整）×90%+银行人民币活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金主要投资港股通标的股票，除需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，还需承担汇率风险以及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。

### 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
		郭明

	联系电话	0755-23838944	010-66105799
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	custody@icbc.com.cn
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室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市西城区复兴门内大街55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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518052	100140
法定代表人		钱龙海	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	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金年度报告备置地点	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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

##### 1、创金合信港股通量化股票 A

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 1 月 11 日-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-81,496,636.82
本期利润	-114,122,747.26
加权平均基金份额本期利润	-0.1931
本期加权平均净值利润率	-20.76%
本期基金份额净值增长率	-20.16%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	-102,886,353.12
期末可供分配基金份额利润	-0.2016
期末基金资产净值	407,457,762.39
期末基金份额净值	0.7984
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-20.16%

##### 2、创金合信港股通量化股票 C

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 1 月 11 日-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-4,966,309.26
本期利润	-6,663,966.55
加权平均基金份额本期利润	-0.2065
本期加权平均净值利润率	-22.51%
本期基金份额净值增长率	-20.78%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	-7,505,034.67
期末可供分配基金份额利润	-0.2078
期末基金资产净值	28,618,167.63
期末基金份额净值	0.7922
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-20.78%

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。

4. 本基金合同生效日为 2021 年 1 月 11 日，截至报告期末，本基金成立不满一年。合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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

创金合信港股通量化股票 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	-8.30%	0.91%	-3.77%	0.92%	-4.53%	-0.01%
过去六个月	-16.09%	1.20%	-15.62%	1.21%	-0.47%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-20.16%	1.26%	-13.06%	1.24%	-7.10%	0.02%

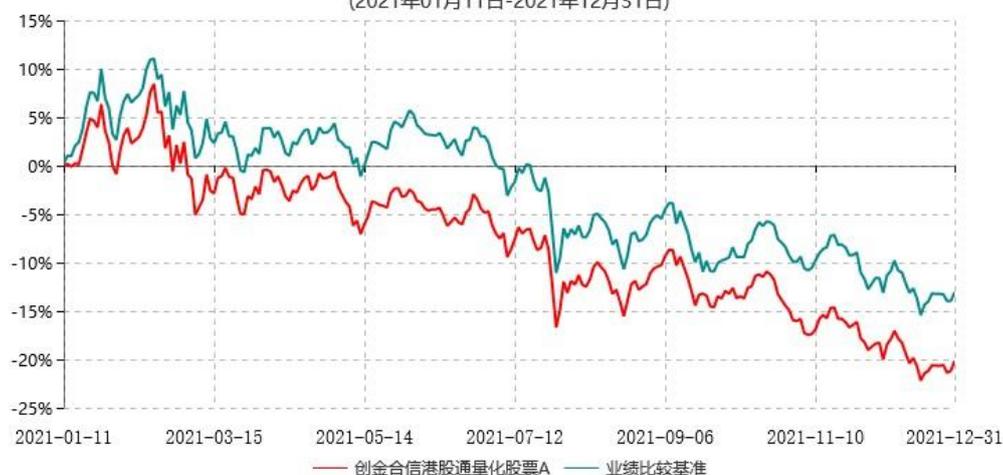
创金合信港股通量化股票 C

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	-8.49%	0.91%	-3.77%	0.92%	-4.72%	-0.01%
过去六个月	-16.43%	1.20%	-15.62%	1.21%	-0.81%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-20.78%	1.26%	-13.06%	1.24%	-7.72%	0.02%

#### 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

创金合信港股通量化股票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01月11日-2021年12月31日)

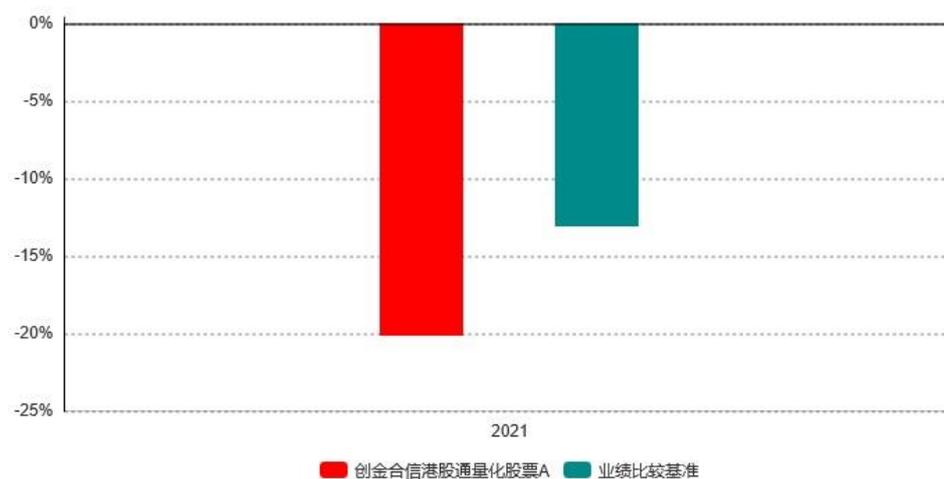


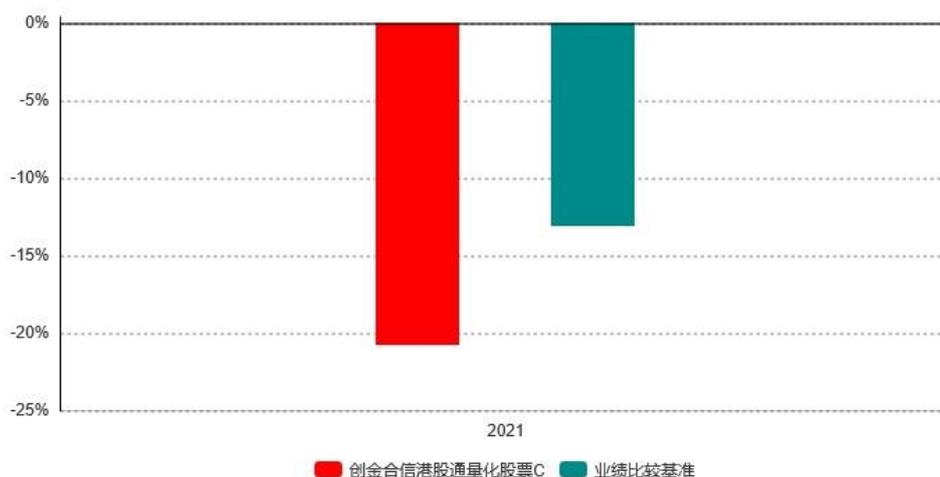


注：1、本基金合同于 2021 年 1 月 11 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本基金于 2021 年 1 月 11 日成立，截至本报告期末成立未满 1 年，故本报告期净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2021 年 1 月 11 日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

## § 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。

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。股东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 家投资合伙企业构成。秉承“以客户为中心”的文化理念，创金合信基金迅速构建起独特的服务优势和核心竞争

力，并在客户数量和规模上取得快速突破。截至 2021 年 12 月 31 日，创金合信基金共管理 79 只公募基金，公募管理规模 829 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	本基金基金经理	2021 年 1 月 19 日	-	4	孙悦先生，中国国籍，北京大学金融学硕士，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。
董梁	本基金基金经理、首席量化官兼任量化指数与国际部总监	2021 年 1 月 11 日	-	18	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,以及环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》的相关规定。

#### 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 公平交易制度和控制方法

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

#### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

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

#### 2、交易执行的内部控制

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

#### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

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

#### 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易室负责异常交易的日常实时监控，合规与风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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，全球仍然持续受到新冠疫情的影响，病毒的不断变异使经济复苏的不确定性增强。在通胀持续高企的背景下，美联储货币政策开始转向，正式开启了缩减购债，2022年加息的预期大大增强。国内方面，经济下行压力较大，企业盈利增速边际放缓。政策方面，12月份中央经济会议提出着力稳定宏观经济大盘，保持社会大局稳定，货币政策灵活适度，财政政策提升效能。大类资产方面，原油价格、美元指数大幅上涨，黄金窄幅区间震荡，美股、A股震荡上行。

2021年，MSCI 港股通指数震荡下行，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能源 27.76%、公用事业 23.24%、工业 11.11%，表现最差的几个行业是医疗保健-31.66%、信息技术-20.25%、房地产-19.34%。风格方面，成份股内红利因子表现较好，beta 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港股通量化股票 A 基金份额净值为 0.7984 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-20.16%，同期业绩比较基准收益率为-13.06%；截至本报告期末创金合信港股通量化股票 C 基金份额净值为 0.7922 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-20.78%，同期业绩比较基准收益率为-13.06%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年，受多方面因素影响，港股市场的下跌比较超预期，部分公司的估值已经处于历史上比较低的水平。其中很重要的因素是流动性、监管政策和投资者信心，基本属于外部因素，而企业的基本面仍然是稳健的。短期内，部分行业的投资逻辑被外部因素破坏了，但长期来看，行业仍然会向前发展，竞争能力强的企业终究会找到新的增长点。展望 2022

年，随着外部制约因素的消退和企业基本面好转，投资者对于港股市场的信心也会逐渐修复。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人的主要内部监察稽核工作如下：

(1) 开展全面自查工作，排查各项业务活动中存在的问题或潜在的风险隐患，制定整改计划，并督促按计划完成整改；

(2) 开展公司专项稽核工作，了解合规风险现状、发现薄弱环节，并持续督导改进；

(3) 强化合规法务工作。严格审核公司业务、产品及其合同等法律文件，解读最新的法律法规，发布合规提示或警示，举办合规培训；

(4) 建立健全全面风险管理体系。加强权限管理，健全事前、事中和事后的风险管理体系；

(5) 完善信息披露工作。建立统一规范信息披露流程，明确各部门信息披露的职责分工，及时履行信息披露工作；

(6) 加强关联交易管理。修订《关联交易管理制度》，严格履行关联交易决策审批程序；

(7) 建立内幕交易防控机制。修订了《内幕交易防控管理办法》，定期开展关于防止内幕交易的合规培训，严防内幕信息传递和内幕交易发生；

(8) 建立健全公平交易与异常交易管理机制。严格按照法律法规以及公司《公平交易与异常交易管理制度》的要求，对所管理的不同投资组合之间发生的同向交易和反向交易进行监控，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；

(9) 完善员工投资行为管理机制，规范员工的证券投资行为。

本基金管理人将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人—创金合信基金管理有限公司在本基金的投资运作、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 托管人对本年度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本基金 2021 年年度报告中财务指标、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 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2202334 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	创金合信港股通量化股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的创金合信港股通量化股票型证券投资基金(以下简称“创金合信港股通量化股票基金”)财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2021 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了创金合信港股通量化股票基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于创金合信港股通量化股票基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>创金合信港股通量化股票基金管理人创金合信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)对其他信息负责。其他信息包括创金合信港股通量化股票基金 2021 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p>

	<p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估创金合信港股通量化股票基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非创金合信港股通量化股票基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督创金合信港股通量化股票基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对创金合信港股通量化股票基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致创金合信港股通量化股票基金不能持续经营。</p>

	(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	叶云晖	刘西茜
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层	
审计报告日期	2022 年 3 月 24 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：创金合信港股通量化股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	41,499,234.47
结算备付金		-
存出保证金		400,317.81
交易性金融资产	7.4.7.2	396,149,843.75
其中：股票投资		390,696,208.15
基金投资		-
债券投资		5,453,635.60
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	94,183.12
应收股利		221,982.49
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		438,365,561.64
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-

卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		83.93
应付赎回款		1,124,170.02
应付管理人报酬		555,505.91
应付托管费		92,584.32
应付销售服务费		18,915.52
应付交易费用	7.4.7.7	324,825.60
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	173,546.32
负债合计		2,289,631.62
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	546,467,317.81
未分配利润	7.4.7.10	-110,391,387.79
所有者权益合计		436,075,930.02
负债和所有者权益总计		438,365,561.64

注：1. 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，创金合信港股通量化股票 A 份额净值 0.7984 元，基金份额总额 510,344,115.51 份；创金合信港股通量化股票 C 份额净值 0.7922 元，基金份额总额 36,123,202.30 份；总份额合计 546,467,317.81 份；

2. 本财务报表的实际报告期间为 2021 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效不满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 7.2 利润表

会计主体：创金合信港股通量化股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		-101,787,860.35
1.利息收入		482,665.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	280,350.58
债券利息收入		202,314.95
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		-
证券出借利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-69,817,135.46
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-79,965,919.56
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-37,630.60
资产支持证券投资收 益	7.4.7.13.2	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	10,186,414.70
3.公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	7.4.7.17	-34,323,767.73
4.汇兑收益(损失以“-”号 填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填 列)	7.4.7.18	1,870,377.31
减:二、费用		18,998,853.46
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	8,470,091.91
2.托管费	7.4.10.2.2	1,411,681.96
3.销售服务费	7.4.10.2.3	230,587.32
4.交易费用	7.4.7.19	8,702,153.80
5.利息支出		7,506.47
其中:卖出回购金融资产支出		7,506.47
6.税金及附加		-
7.其他费用	7.4.7.20	176,832.00
三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)		-120,786,713.81
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		-120,786,713.81

注:本财务报表的实际报告期间为 2021 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效不满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:创金合信港股通量化股票型证券投资基金

本报告期:2021 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 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)	709,969,495.13	-	709,969,495.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-120,786,713.81	-120,786,713.81
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)	-163,502,177.32	10,395,326.02	-153,106,851.30
其中：1.基金申购款	448,712,192.52	-18,113,116.38	430,599,076.14
2.基金赎回款	-612,214,369.84	28,508,442.40	-583,705,927.44
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)	546,467,317.81	-110,391,387.79	436,075,930.02

注：本财务报表的实际报告期间为 2021 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效不满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

创金合信港股通量化股票型证券投资基金(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”)2019 年 3 月 13 日证监许可[2019]378 号文《关于准予创金合信港股通量化股票型证券投资基金注册的批复》核准募集。本基金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》及其配套规则和《创金合信港股通量化股票型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2021 年 1 月 11 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 709,969,495.13 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“工商银行”)。

本基金于 2020 年 11 月 18 日至 2021 年 1 月 6 日募集，募集期间净认购资金人民币 709,849,061.58 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 120,433.55 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 709,969,495.13 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了毕马威华振验字第 2100091 号验资报告。

根据《创金合信港股通量化股票型证券投资基金招募说明书》，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。收取前端认购费、前端申购费，但不计提销售服务费的基金份额类别为 A 类基金份额；不收取认购费、申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用不同，本基金不同类别的基金份额将分别计算并公告各类基金份额的基金份额净值，计算公式如下：T 日某类基金份额的基金份额净值 = T 日该类基金份额的基金资产净值 / T 日该类基金份额的基金份额余额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《创金合信港股通量化股票型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《创金合信港股通量化股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、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、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具(含同业存单)、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，且投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金将持有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；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、股票期权、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：MSCI 港股通指数收益率(经估值汇率调整)×90%+银行人民币活期存款利率(税后)×10%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况、自 2021 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2021 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

-本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

-本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本以及应收利息的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(a) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(b) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(c) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(d) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；

(e) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(f) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号)、财税[2014]81号文《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[2016]127号文《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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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]140 号文《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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司(“挂牌公司”)取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。对于基金通过沪港通/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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	41,499,234.47
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	41,499,234.47

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	425,003,074.68	390,696,208.15	-34,306,866.53
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,470,536.80	5,453,635.60
	银行间市场	-	-
	合计	5,470,536.80	5,453,635.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	430,473,611.48	396,149,843.75	-34,323,767.73

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

**7.4.7.4.1 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。

**7.4.7.4.2 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。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,586.75
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	57.99
应收债券利息	89,538.27
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	0.11
合计	94,183.12

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	324,640.60
银行间市场应付交易费用	185.00
合计	324,825.60

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	546.32
应付证券出借违约金	-
预提费用	173,000.00
合计	173,546.32

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

创金合信港股通量化股票 A		
项目	本期 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	681,716,371.41	681,716,371.41
本期申购	404,614,623.64	404,614,623.64
本期赎回（以“-”号填列）	-575,986,879.54	-575,986,879.54
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	510,344,115.51	510,344,115.51

创金合信港股通量化股票 C		
项目	本期 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	28,253,123.72	28,253,123.72
本期申购	44,097,568.88	44,097,568.88
本期赎回（以“-”号填列）	-36,227,490.30	-36,227,490.30
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	36,123,202.30	36,123,202.30

注：1. 申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

2. 本基金自 2020 年 11 月 18 日至 2021 年 1 月 6 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 709,849,061.58 元，其中 A 类基金募集有效净认购资金为 681,597,942.35 元，其中 C 类基金募集有效净认购资金为 28,251,119.23 元。根据《创金合信港股通量化股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 120,433.55 元，在本基金成立后，折算为 120,433.55 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

创金合信港股通量化股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-81,496,636.82	-32,626,110.44	-114,122,747.26
本期基金份额交易产生的变动数	5,366,968.62	5,869,425.52	11,236,394.14
其中：基金申购款	-12,720,503.80	-2,639,892.77	-15,360,396.57
基金赎回款	18,087,472.42	8,509,318.29	26,596,790.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-76,129,668.20	-26,756,684.92	-102,886,353.12

创金合信港股通量化股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-4,966,309.26	-1,697,657.29	-6,663,966.55
本期基金份额交易产生的变动数	-653,065.37	-188,002.75	-841,068.12
其中：基金申购款	-2,031,630.52	-721,089.29	-2,752,719.81
基金赎回款	1,378,565.15	533,086.54	1,911,651.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,619,374.63	-1,885,660.04	-7,505,034.67

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	230,561.58
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	17,635.02
其他	32,153.98
合计	280,350.58

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-79,965,919.56
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-79,965,919.56

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,334,737,426.56
减：卖出股票成本总额	2,414,703,346.12
买卖股票差价收入	-79,965,919.56

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无股票赎回差价收入。

**7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无股票申购差价收入。

**7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入**

本基金本报告期无证券出借差价收入。

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 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 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	26,702,910.31
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	26,414,666.60
减：应收利息总额	325,874.31
买卖债券差价收入	-37,630.60

**7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 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。

**7.4.7.15.2 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。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	10,186,414.70
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	10,186,414.70

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-34,323,767.73
——股票投资	-34,306,866.53
——债券投资	-16,901.20
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-34,323,767.73

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,870,377.31
合计	1,870,377.31

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	8,701,783.80
银行间市场交易费用	370.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	8,702,153.80

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	53,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
汇划手续费	432.00
账户维护费	3,000.00

其他费用	400.00
合计	176,832.00

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 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。

## 7.4.9 关联方关系

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

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
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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	219,677,556.02	4.25%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 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
第一创业证券股份有限公司	87,871.32	4.25%	-	-

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,470,091.91
其中：支付销售机构的客户维护费	3,358,782.30

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,411,681.96

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.3 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 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	创金合信港股通量化 股票 A	创金合信港股通量化 股票 C	合计
创金合信直销	-	3,863.12	3,863.12
第一创业证券	-	31.19	31.19
合计	-	3,894.31	3,894.31

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：

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.5.2 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

本报告期末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 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 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	41,499,234.47	230,561.58

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。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的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。

**7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 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。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
H01333	中国忠旺	2021 年 12 月 13 日	重大事项停牌	1.37	尚未复牌	-	453,600	719,792.56	623,050.44	-

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 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。

**7.4.12.3.2 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。

**7.4.12.4 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。

**7.4.13 金融工具风险及管理****7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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中国工商银行股份有限公司，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。

##### 7.4.13.2.1 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 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	5,453,635.60
合计	5,453,635.60

未评级债券包括国债、政策性金融债、超短期融资券。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 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 12 月 31 日，本基金所承担的金融负债的合约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。

##### 7.4.13.3.1 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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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

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

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

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

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	41,499,234.47	-	-	-	41,499,234.47
存出保证金	400,317.81	-	-	-	400,317.81
交易性金融资产	5,453,635.60	-	-	390,696,208.15	396,149,843.75

应收股利	-	-	-	221,982.49	221,982.49
应收利息	-	-	-	94,183.12	94,183.12
资产总计	47,353,187.88	-	-	391,012,373.76	438,365,561.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,124,170.02	1,124,170.02
应付管理人报酬	-	-	-	555,505.91	555,505.91
应付托管费	-	-	-	92,584.32	92,584.32
应付销售服务费	-	-	-	18,915.52	18,915.52
应付交易费用	-	-	-	324,825.60	324,825.60
应付证券清算款	-	-	-	83.93	83.93
其他负债	-	-	-	173,546.32	173,546.32
负债总计	-	-	-	2,289,631.62	2,289,631.62
利率敏感度缺口	47,353,187.88	-	-	388,722,742.14	436,075,930.02

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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（2021年12月31日）
	1.市场利率平行上升相关风险变量的变动 25 个基点	-4,165.94
	2.市场利率平行下降相关风险变量的变动 25 个基点	4,179.31

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产						
交易性金	-	390,696,20	-	-	-	390,696,20

融资产		8.15				8.15
应收股利	-	221,982.49	-	-	-	221,982.49
资产合计	-	390,918,19 0.64	-	-	-	390,918,19 0.64
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	390,918,19 0.64	-	-	-	390,918,19 0.64

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值5%	19,545,909.53
	2. 所有外币相对人民币贬值5%	-19,545,909.53

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	390,696,208.15	89.59
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	390,696,208.15	89.59

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日）
	1.业绩比较基准上升 5%	20,365,039.85
	2.业绩比较基准下降 5%	-20,365,039.85

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 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 12 月 31 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 390,073,157.71 元，属于第二层次的余额为 6,076,686.04 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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

## (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。

## 7.4.14.2

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。本基金将按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日(即 2022 年 1 月 1 日)未终止确认的金融工具的分类和计量(含减值)进行追溯调整。本基金将不调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益或其他综合收益。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	390,696,208.15	89.13
	其中：股票	390,696,208.15	89.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,453,635.60	1.24
	其中：债券	5,453,635.60	1.24
	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	41,499,234.47	9.47
8	其他资产	716,483.42	0.16
9	合计	438,365,561.64	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 390,696,208.15 元，占净值比为 89.59%。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	4,931,708.41	1.13
非日常生活消费品	55,515,988.50	12.73
日常消费品	19,016,678.99	4.36
能源	13,765,285.30	3.16
金融	120,755,697.31	27.69
医疗保健	21,011,915.40	4.82
工业	24,809,591.11	5.69
信息技术	16,702,527.77	3.83
电信服务	66,026,225.78	15.14
公用事业	13,766,070.20	3.16
地产业	34,394,519.38	7.89
合计	390,696,208.15	89.59

以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 8.3 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

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	H00700	腾讯控股	98,872	36,926,682.92	8.47
2	H00005	汇丰控股	692,710	26,562,269.74	6.09
3	H03690	美团-W	109,519	20,182,932.33	4.63
4	H01299	友邦保险	259,927	16,703,782.37	3.83
5	H00941	中国移动	325,732	12,463,705.01	2.86
6	H03968	招商银行	226,000	11,188,283.68	2.57

7	H03988	中国银行	4,856,000	11,156,446.34	2.56
8	H02331	李宁	149,000	10,397,541.84	2.38
9	H02269	药明生物	123,853	9,371,817.79	2.15
10	H00388	香港交易所	22,511	8,381,634.09	1.92
11	H00939	建设银行	1,879,352	8,297,414.25	1.90
12	H01288	农业银行	3,414,000	7,480,647.55	1.72
13	H06030	中信证券	405,500	6,746,773.88	1.55
14	H01658	邮储银行	1,473,000	6,587,656.66	1.51
15	H00083	信和置业	816,000	6,478,139.14	1.49
16	H02013	微盟集团	1,003,000	6,470,216.59	1.48
17	H06049	保利物业	118,200	5,924,051.62	1.36
18	H00728	中国电信	2,770,708	5,889,860.24	1.35
19	H01919	中远海控	461,500	5,705,114.69	1.31
20	H02359	药明康德	50,772	5,604,010.27	1.29
21	H06098	碧桂园服务	141,000	5,383,650.72	1.23
22	H06618	京东健康	102,350	5,142,219.57	1.18
23	H01888	建滔积层板	428,000	4,640,108.93	1.06
24	H00857	中国石油股份	1,584,000	4,493,922.05	1.03
25	H00868	信义玻璃	281,476	4,487,628.16	1.03
26	H00552	中国通信服务	1,431,105	4,446,271.50	1.02
27	H02318	中国平安	87,674	4,024,959.03	0.92
28	H01193	华润燃气	106,000	3,817,619.68	0.88
29	H06886	HTSC	358,600	3,805,623.85	0.87
30	H06969	思摩尔国际	114,000	3,704,954.40	0.85
31	H01618	中国中冶	2,189,000	3,561,555.54	0.82
32	H02669	中海物业	520,000	3,516,007.04	0.81
33	H03908	中金公司	197,200	3,466,460.48	0.79
34	H03328	交通银行	885,000	3,408,042.96	0.78
35	H01052	越秀交通基建	898,000	3,392,026.18	0.78
36	H02678	天虹纺织	402,500	3,389,565.20	0.78
37	H00688	中国海外发展	224,500	3,388,355.15	0.78
38	H01929	周大福	293,200	3,360,878.89	0.77
39	H01093	石药集团	476,000	3,296,334.27	0.76
40	H00883	中国海洋石油	499,000	3,276,098.67	0.75
41	H02020	安踏体育	34,200	3,268,748.45	0.75
42	H00788	中国铁塔	4,272,000	3,003,796.99	0.69
43	H01211	比亚迪股份	13,500	2,942,624.16	0.67

44	H01811	中广核新能源	440,000	2,935,511.04	0.67
45	H00386	中国石油化工股份	986,000	2,926,337.57	0.67
46	H06066	中信建投证券	388,500	2,709,448.73	0.62
47	H00916	龙源电力	181,000	2,693,337.92	0.62
48	H01030	新城发展	612,000	2,636,956.22	0.60
49	H01458	周黑鸭	540,500	2,598,447.26	0.60
50	H03606	福耀玻璃	78,400	2,583,223.55	0.59
51	H01186	中国铁建	605,500	2,524,789.68	0.58
52	H06690	海尔智家	90,230	2,430,788.98	0.56
53	H09633	农夫山泉	57,000	2,397,734.64	0.55
54	H02319	蒙牛乳业	66,000	2,385,102.72	0.55
55	H02382	舜宇光学科技	11,800	2,379,117.89	0.55
56	H06869	长飞光纤光缆	224,500	2,375,152.53	0.54
57	H00921	海信家电	284,000	2,147,835.20	0.49
58	H01238	宝龙地产	586,000	1,954,783.49	0.45
59	H03319	雅生活服务	171,500	1,864,904.72	0.43
60	H01378	中国宏桥	267,500	1,799,966.84	0.41
61	H02202	万科企业	118,700	1,760,471.04	0.40
62	H02380	中国电力	399,000	1,712,667.60	0.39
63	H01083	港华燃气	292,000	1,618,651.78	0.37
64	H06826	昊海生物科技	38,100	1,604,253.84	0.37
65	H01171	兖州煤业股份	126,000	1,596,772.80	0.37
66	H02400	心动公司	47,200	1,524,333.44	0.35
67	H01610	中粮家佳康	609,000	1,478,817.65	0.34
68	H01308	海丰国际	64,000	1,475,604.48	0.34
69	H01800	中国交通建设	425,000	1,473,315.20	0.34
70	H01088	中国神华	98,500	1,472,154.21	0.34
71	H00493	国美零售	2,520,000	1,359,832.32	0.31
72	H00772	阅文集团	30,200	1,209,884.48	0.28
73	H00817	中国金茂	592,000	1,166,486.27	0.27
74	H03613	同仁堂国药	106,000	1,163,052.35	0.27
75	H02333	长城汽车	53,000	1,161,319.04	0.27
76	H00751	创维集团	254,000	1,133,880.38	0.26
77	H03323	中国建材	134,000	1,047,378.30	0.24
78	H01836	九兴控股	114,500	882,791.34	0.20

79	H02068	中铝国际	410,000	794,461.92	0.18
80	H03996	中国能源建设	714,000	770,571.65	0.18
81	H00241	阿里健康	120,000	646,558.08	0.15
82	H01333	中国忠旺	453,600	623,050.44	0.14
83	H00777	网龙	37,500	561,691.20	0.13
84	H01071	华电国际电力股份	186,000	517,050.24	0.12
85	H00267	中信股份	81,000	509,937.12	0.12
86	H02600	中国铝业	144,000	507,435.26	0.12
87	H02362	金川国际	442,000	491,475.71	0.11
88	H01810	小米集团—W	28,493	440,292.07	0.10
89	H03888	金山软件	14,200	397,639.76	0.09
90	H00914	海螺水泥	12,000	382,146.24	0.09
91	H03347	泰格医药	4,700	380,429.28	0.09
92	H09666	金科服务	11,500	319,211.48	0.07
93	H03813	宝胜国际	294,000	274,026.82	0.06
94	H00836	华润电力	12,000	256,072.32	0.06
95	H09923	移卡	11,200	236,253.70	0.05
96	H00135	昆仑能源	36,000	215,159.62	0.05
97	H00151	中国旺旺	25,000	146,350.40	0.03
98	H02343	太平洋航运	49,000	114,578.46	0.03
99	H01772	赣锋锂业	800	80,255.62	0.02
100	H02126	药明巨诺—B	6,000	65,931.26	0.02
101	H00867	康哲药业	4,000	42,580.61	0.01
102	H01918	融创中国	156	1,502.49	0.00
103	H01157	中联重科	2	8.03	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	H00700	腾讯控股	95,919,790.75	22.00
2	H03690	美团—W	86,027,154.04	19.73
3	H01299	友邦保险	68,863,724.21	15.79
4	H02318	中国平安	57,387,102.30	13.16
5	H00005	汇丰控股	51,999,987.61	11.92
6	H00388	香港交易所	44,124,416.52	10.12
7	H01810	小米集团—W	40,320,671.09	9.25

8	H00939	建设银行	38,948,162.95	8.93
9	H02269	药明生物	34,821,362.94	7.99
10	H01211	比亚迪股份	29,222,283.52	6.70
11	H02359	药明康德	28,811,218.21	6.61
12	H00941	中国移动	28,636,982.06	6.57
13	H00992	联想集团	28,587,080.54	6.56
14	H06618	京东健康	28,551,806.89	6.55
15	H03988	中国银行	28,364,389.95	6.50
16	H00909	明源云	28,342,897.41	6.50
17	H00669	创科实业	27,819,400.50	6.38
18	H00857	中国石油股份	26,996,814.87	6.19
19	H00728	中国电信	26,732,947.00	6.13
20	H03968	招商银行	26,602,352.08	6.10
21	H09633	农夫山泉	25,940,140.73	5.95
22	H00868	信义玻璃	25,870,060.88	5.93
23	H02202	万科企业	25,623,889.49	5.88
24	H06049	保利物业	25,105,008.07	5.76
25	H02331	李宁	25,068,830.34	5.75
26	H00241	阿里健康	24,274,965.83	5.57
27	H00384	中国燃气	23,636,214.96	5.42
28	H06098	碧桂园服务	23,370,846.53	5.36
29	H01060	阿里影业	23,193,451.92	5.32
30	H06969	思摩尔国际	23,031,970.25	5.28
31	H02013	微盟集团	22,477,140.65	5.15
32	H00762	中国联通	21,879,849.63	5.02
33	H00552	中国通信服务	21,789,754.66	5.00
34	H01088	中国神华	21,396,678.05	4.91
35	H06690	海尔智家	21,091,050.32	4.84
36	H02020	安踏体育	20,901,149.78	4.79
37	H00788	中国铁塔	20,243,774.42	4.64
38	H01919	中远海控	20,073,109.73	4.60
39	H02628	中国人寿	18,455,770.49	4.23
40	H01772	赣锋锂业	18,418,234.68	4.22
41	H06666	恒大物业	17,660,581.11	4.05
42	H01308	海丰国际	17,563,401.03	4.03
43	H01658	邮储银行	16,782,114.01	3.85
44	H03888	金山软件	16,600,429.34	3.81
45	H01288	农业银行	16,099,843.61	3.69
46	H06066	中信建投证券	16,000,873.90	3.67
47	H01109	华润置地	15,636,351.14	3.59
48	H00175	吉利汽车	15,565,705.12	3.57
49	H03328	交通银行	15,564,978.82	3.57
50	H02382	舜宇光学科技	14,823,676.96	3.40

51	H02357	中航科工	14,758,534.59	3.38
52	H01083	港华燃气	14,710,418.47	3.37
53	H01918	融创中国	14,609,022.60	3.35
54	H00136	恒腾网络	14,517,806.81	3.33
55	H03908	中金公司	14,327,999.97	3.29
56	H02899	紫金矿业	13,780,386.00	3.16
57	H00883	中国海洋石油	13,614,850.08	3.12
58	H00968	信义光能	13,400,816.49	3.07
59	H02601	中国太保	13,272,014.08	3.04
60	H00004	九龙仓集团	13,244,243.86	3.04
61	H01882	海天国际	13,158,195.81	3.02
62	H03347	泰格医药	13,104,651.98	3.01
63	H01093	石药集团	13,062,834.86	3.00
64	H00916	龙源电力	12,972,459.92	2.97
65	H06185	康希诺生物-B	12,821,597.95	2.94
66	H06030	中信证券	12,794,134.60	2.93
67	H00019	太古股份公司A	12,779,573.67	2.93
68	H06186	中国飞鹤	12,726,575.95	2.92
69	H03319	雅生活服务	12,685,781.92	2.91
70	H00323	马鞍山钢铁股份	12,603,789.47	2.89
71	H02333	长城汽车	12,584,287.60	2.89
72	H00336	华宝国际	12,288,709.13	2.82
73	H03606	福耀玻璃	12,099,788.80	2.77
74	H00836	华润电力	12,069,026.54	2.77
75	H03377	远洋集团	12,036,105.99	2.76
76	H01773	天立教育	11,763,065.32	2.70
77	H01896	猫眼娱乐	11,625,518.44	2.67
78	H00003	香港中华煤气	11,616,037.96	2.66
79	H02380	中国电力	11,615,801.55	2.66
80	H00777	网龙	11,382,080.52	2.61
81	H00267	中信股份	11,339,878.52	2.60
82	H01579	颐海国际	11,066,876.17	2.54
83	H06099	招商证券	10,688,373.83	2.45
84	H00144	招商局港口	10,585,185.08	2.43
85	H00347	鞍钢股份	10,380,834.00	2.38
86	H02400	心动公司	10,326,650.81	2.37
87	H01691	J S 环球生活	10,297,559.28	2.36
88	H00302	中手游	10,227,066.15	2.35
89	H01186	中国铁建	10,144,414.23	2.33
90	H00799	IGG	10,142,583.77	2.33
91	H02678	天虹纺织	10,074,162.51	2.31
92	H06886	HTSC	10,020,903.23	2.30
93	H00489	东风集团股份	9,972,549.07	2.29

94	H02319	蒙牛乳业	9,916,640.24	2.27
95	H01811	中广核新能源	9,843,838.11	2.26
96	H09966	康宁杰瑞制药一 B	9,767,897.44	2.24
97	H01378	中国宏桥	9,738,989.58	2.23
98	H03320	华润医药	9,702,004.62	2.22
99	H00981	中芯国际	9,475,059.10	2.17
100	H02600	中国铝业	9,380,313.64	2.15
101	H00598	中国外运	9,373,306.07	2.15
102	H00285	比亚迪电子	9,188,550.17	2.11
103	H06881	中国银河	9,184,303.34	2.11
104	H00881	中升控股	9,125,020.00	2.09
105	H02688	新奥能源	9,042,896.18	2.07
106	H06862	海底捞	8,924,730.70	2.05
107	H03323	中国建材	8,924,242.24	2.05

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产 净值比例（%）
1	H03690	美团-W	55,538,919.23	12.74
2	H02318	中国平安	45,309,381.76	10.39
3	H01299	友邦保险	45,297,785.16	10.39
4	H00700	腾讯控股	44,463,844.31	10.20
5	H00388	香港交易所	36,029,659.26	8.26
6	H01810	小米集团-W	33,629,392.23	7.71
7	H00669	创科实业	28,123,273.97	6.45
8	H00939	建设银行	28,103,069.83	6.44
9	H00909	明源云	27,628,269.35	6.34
10	H00005	汇丰控股	27,487,310.61	6.30
11	H00992	联想集团	27,024,287.00	6.20
12	H01211	比亚迪股份	26,916,125.87	6.17
13	H01060	阿里影业	25,378,368.12	5.82
14	H00857	中国石油股份	24,018,133.85	5.51
15	H02359	药明康德	24,008,640.81	5.51
16	H02269	药明生物	24,002,810.22	5.50
17	H00384	中国燃气	23,226,857.99	5.33
18	H00728	中国电信	21,907,359.86	5.02
19	H01088	中国神华	21,897,527.95	5.02
20	H00241	阿里健康	21,669,898.45	4.97
21	H00868	信义玻璃	21,291,356.64	4.88
22	H00762	中国联通	20,666,585.19	4.74

23	H02202	万科企业	20,628,297.48	4.73
24	H06618	京东健康	20,392,438.76	4.68
25	H01772	赣锋锂业	20,377,621.08	4.67
26	H06049	保利物业	20,286,607.88	4.65
27	H09633	农夫山泉	19,575,757.63	4.49
28	H06969	思摩尔国际	18,824,029.53	4.32
29	H06690	海尔智家	18,045,854.78	4.14
30	H03988	中国银行	17,992,381.54	4.13
31	H01308	海丰国际	17,734,417.37	4.07
32	H02628	中国人寿	17,705,187.27	4.06
33	H00552	中国通信服务	17,205,724.47	3.95
34	H02020	安踏体育	17,125,167.73	3.93
35	H00941	中国移动	16,641,778.42	3.82
36	H01109	华润置地	16,445,943.01	3.77
37	H03968	招商银行	16,227,524.96	3.72
38	H00788	中国铁塔	16,054,720.52	3.68
39	H06098	碧桂园服务	15,844,477.16	3.63
40	H03888	金山软件	15,774,115.05	3.62
41	H02899	紫金矿业	15,677,375.84	3.60
42	H06185	康希诺生物-B	14,583,311.07	3.34
43	H02357	中航科工	14,250,393.38	3.27
44	H01919	中远海控	13,836,484.73	3.17
45	H00004	九龙仓集团	13,738,267.70	3.15
46	H02380	中国电力	13,673,497.15	3.14
47	H02331	李宁	13,615,388.40	3.12
48	H06666	恒大物业	13,534,172.23	3.10
49	H00323	马鞍山钢铁股份	12,953,832.44	2.97
50	H01918	融创中国	12,871,749.27	2.95
51	H02013	微盟集团	12,814,699.13	2.94
52	H01083	港华燃气	12,812,455.09	2.94
53	H01882	海天国际	12,678,602.83	2.91
54	H00836	华润电力	12,625,205.39	2.90
55	H06066	中信建投证券	12,581,772.24	2.89
56	H02382	舜宇光学科技	12,579,654.08	2.88
57	H03328	交通银行	12,343,387.23	2.83
58	H01896	猫眼娱乐	11,963,482.20	2.74
59	H00003	香港中华煤气	11,831,051.76	2.71
60	H00019	太古股份公司 A	11,792,763.19	2.70
61	H03347	泰格医药	11,771,565.90	2.70
62	H00175	吉利汽车	11,663,275.58	2.67
63	H02601	中国太保	11,476,268.29	2.63
64	H03377	远洋集团	11,387,202.06	2.61
65	H06186	中国飞鹤	11,262,807.60	2.58

66	H03908	中金公司	11,244,563.59	2.58
67	H00136	恒腾网络	11,056,682.69	2.54
68	H00267	中信股份	10,912,945.60	2.50
69	H00302	中手游	10,847,251.73	2.49
70	H00777	网龙	10,793,449.80	2.48
71	H00916	龙源电力	10,772,128.80	2.47
72	H00144	招商局港口	10,557,269.47	2.42
73	H01658	邮储银行	10,496,956.60	2.41
74	H00489	东风集团股份	10,471,051.78	2.40
75	H01691	J S 环球生活	10,408,138.87	2.39
76	H00883	中国海洋石油	10,286,214.33	2.36
77	H09966	康宁杰瑞制药一 B	10,215,434.01	2.34
78	H00347	鞍钢股份	10,064,945.15	2.31
79	H02333	长城汽车	9,987,399.34	2.29
80	H00881	中升控股	9,913,257.17	2.27
81	H00336	华宝国际	9,841,102.96	2.26
82	H00968	信义光能	9,804,277.73	2.25
83	H02688	新奥能源	9,537,508.34	2.19
84	H00981	中芯国际	9,314,266.79	2.14
85	H00598	中国外运	9,194,745.98	2.11
86	H01316	耐世特	8,978,179.03	2.06
87	H03606	福耀玻璃	8,850,432.67	2.03
88	H00763	中兴通讯	8,816,201.74	2.02
89	H00799	IGG	8,787,226.72	2.02
90	H02600	中国铝业	8,766,919.76	2.01
91	H01093	石药集团	8,749,299.70	2.01

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。

### 8.4.3 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	2,839,706,420.80
卖出股票收入（成交）总额	2,334,737,426.56

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。

### 8.5 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	5,453,635.60	1.25
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	5,453,635.60	1.25

## 8.6 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	019654	21 国债 06	54,520	5,453,635.60	1.25

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

2021 年 3 月 12 日，腾讯控股有限公司（以下简称“腾讯控股”，股票代码：00700）由于违反《反垄断法》，被国家市场监督管理总局处以 50 万元人民币罚款的行政处罚。

创金合信港股通量化基金是一只基于量化模型选股、运用优化器来建仓的基金。经过量化模型的综合评估，本基金基金经理我们认为此事件的影响已经反映在股价之中，腾讯控股符合基金合同和公司投资管理制度我们的投资标准，因此继续持有此股票。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	400,317.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	221,982.49
4	应收利息	94,183.12
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	716,483.42

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 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
创金合信港股通量化股票 A	93,210	5,475.21	-	-	510,344,115.51	100.00%
创金合信港股通量化股票 C	5,323	6,786.25	-	-	36,123,202.30	100.00%
合计	97,580	5,600.20	-	-	546,467,317.81	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）。

## 9.2 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	创金合信港股通量化股票 A	158,884.23	0.03%
	创金合信港股通量化股票 C	3,394.85	0.01%
	合计	162,279.08	0.03%

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）。

## 9.3 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的情况

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	创金合信港股通量化股票 A	0~10
	创金合信港股通量化股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信港股通量化股票 A	0
	创金合信港股通量化股票 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信港股通 量化股票 A	创金合信港股 通量化股票 C
基金合同生效日(2021 年 1 月 11 日)基金份额总额	681,716,371.41	28,253,123.72
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	404,614,623.64	44,097,568.88
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	575,986,879.54	36,227,490.30
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	510,344,115.51	36,123,202.30

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

1、自 2021 年 10 月 29 日起，刘学民先生不再担任创金合信基金管理有限公司董事长、法定代表人，钱龙海先生担任创金合信基金管理有限公司董事长、法定代表人；

2、自 2021 年 10 月 29 日起，屈媪女士担任创金合信基金管理有限公司董事；

3、自 2021 年 3 月 3 日起，杨健先生不再担任创金合信基金管理有限公司非职工代表监事，宋明华先生担任创金合信基金管理有限公司非职工代表监事。

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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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更换会计师事务所,本年度支付给毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 53,000.00 元,该审计机构连续提供审计服务的年限为 1 年。

### 11.6 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,本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未发生受到监管部门稽查或处罚的情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
第一创业证券	2	219,677,556.02	4.25%	87,871.32	4.25%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	4,954,766,291.34	95.75%	1,981,906.35	95.75%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	4	-	-	-	-	-
太平洋证 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。

本基金在报告期内成立，交易单元均于本期内新增。

### 11.7.2 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
第一创业 证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	9,214,114.50	51.50%	4,000,000.00	48.78%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

证券						
国信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	8,675,778.90	48.50%	4,200,000.00	51.22%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	创金合信港股通量化股票型证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-12
2	创金合信港股通量化股票型证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-20
3	创金合信港股通量化股票型证券投资基金开放日常申购、赎回及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	2021-01-22

		电子披露网站	
4	创金合信基金管理有限公司关于创金合信港股通量化股票型证券投资基金 2021 年非港股通交易日暂停申购及赎回业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-06
5	创金合信港股通量化股票型证券投资基金 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
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、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-17
7	创金合信港股通量化股票型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-07-20
8	创金合信基金管理有限公司旗下基金 2021 年度第二季度报告提示性公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-07-20
9	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金 2021 年非港股通交易日暂停申购及赎回业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-08-23
10	创金合信港股通量化股票型证券投资基金 2021 年中期报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-08-30
11	创金合信基金管理有限公司 旗下基金 2021 年度中期报告提示性公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-08-30
12	创金合信基金管理有限公司旗下部分证券投资基金招募说明书更新提示性公告	公司官网、中国证券报	2021-10-15
13	创金合信港股通量化股票型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-10-27
14	创金合信基金管理有限公司 旗下基金 2021 年度第三季度报告提示性公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-10-27
15	创金合信基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购、定期定额投资最低金额限制的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-11-24
16	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金 2022 年非港股通交易日暂停申购及赎回业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-12-28

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

本基金本报告期末未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 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。股东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 家投资合伙企业构成。秉承“以客户为中心”的文化理念，创金合信基金迅速构建起独特的服务优势和核心竞争力，并在客户数量和规模上取得快速突破。截至 2021 年 12 月 31 日，创金合信基金共管理 79 只公募基金，公募管理规模 829 亿元。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、《创金合信港股通量化股票型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信港股通量化股票型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信港股通量化股票型证券投资基金 2021 年度报告原文。

### 13.2 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

### 13.3 查阅方式

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

创金合信基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日