

创金合信量化核心混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 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 2022 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.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
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.....	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	10
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.....	10
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.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	37
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 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	12,211,614.86 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	8,356,724.48 份	3,854,890.38 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	奚胜田
	联系电话	0755-82820166
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.c om
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	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
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、创金合信量化核心混合 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	122,060.63
本期利润	465,796.23
加权平均基金份额本期利润	0.0564
本期加权平均净值利润率	3.46%
本期基金份额净值增长率	3.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	6,606,398.12
期末可供分配基金份额利润	0.7905
期末基金资产净值	14,963,122.60
期末基金份额净值	1.7905
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	88.19%

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(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	15,873.99
本期利润	151,368.20
加权平均基金份额本期利润	0.0384
本期加权平均净值利润率	2.46%
本期基金份额净值增长率	2.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,730,918.73
期末可供分配基金份额利润	0.7084
期末基金资产净值	6,585,809.11
期末基金份额净值	1.7084
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	79.67%

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	12.27%	1.20%	7.64%	0.86%	4.63%	0.34%
过去三个月	8.95%	1.73%	5.26%	1.14%	3.69%	0.59%
过去六个月	3.04%	1.57%	-6.92%	1.16%	9.96%	0.41%
过去一年	-2.38%	1.32%	-10.39%	1.00%	8.01%	0.32%
过去三年	61.00%	1.23%	17.55%	1.01%	43.45%	0.22%
自基金合同生效起至今	88.19%	1.13%	30.06%	0.99%	58.13%	0.14%

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	12.20%	1.20%	7.64%	0.86%	4.56%	0.34%
过去三个月	8.73%	1.73%	5.26%	1.14%	3.47%	0.59%
过去六个月	2.64%	1.57%	-6.92%	1.16%	9.56%	0.41%
过去一年	-3.16%	1.32%	-10.39%	1.00%	7.23%	0.32%
过去三年	57.14%	1.23%	17.55%	1.01%	39.59%	0.22%
自基金合同生效起至今	79.67%	1.13%	30.06%	0.99%	49.61%	0.14%

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

创金合信量化核心混合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-2022年06月30日)



创金合信量化核心混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年03月27日-2022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。

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		
马超	本基金基金经理	2021 年 12 月 1 日	-	4	马超先生，中国，中国人民大学硕士研究生，2017 年 06 月加入创金合信基金管理有限公司，任量化指数与国际部（原名量化投资部国际投资部）投资经理、量化分析师，2018 年 06 月加入珠海宽德投资管理有限公司，任投资部投资经理，2021 年 10 月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化指数与国际部总监助理、基金经理。
孙悦	本基金基金经理	2021 年 2 月 26 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。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格

控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律、法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A 股市场经历了一季度的调整和第二季度的先抑后扬，上半年主流宽基指数（沪深 300、中证 500、中证 1000、创业板指等）均为收跌状态。相较全球流动性收紧、通胀加剧的宏观环境，国内市场流动性合理充裕，通胀温和，同时财政政策积极，经济增长具有极强的韧性，支撑了股票市场在报告期前四个月受到不确定性冲击后的企稳回升。

本基金以量化模型为依据，主要综合财务报表、估值、事件机会等自下而上对股票做出评价，同时结合风险模型自上而下控制组合整体的收益风险配比，持股分散，力争能够获得长期的超额收益。

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 1.7905 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 3.04%，同期业绩比较基准收益率为-6.92%；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 1.7084 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.64%，同期业绩比较基准收益率为-6.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球收紧流动性的节奏或有边际放缓的可能，但仍需警惕潜在的超预期通胀加剧和衰退对资本市场的影响。从国内来看，中国经济的韧性很强，货币政策较海外更为宽松，流动性合理充裕，对股市有一定的提振作用。行业配置上，均衡的配置相对集

中配置性价比更高，其中基本面有支撑且前期调整较多的医药、消费、芯片，以及长期成长确定性较好的新能源值得关注。

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五千万万元的情形，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本基金 2022 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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	308,226.99	864,281.41
结算备付金		241,300.26	79,347.81
存出保证金		8,868.35	3,937.31
交易性金融资产	6.4.7.2	21,450,572.35	19,707,563.91
其中：股票投资		20,277,553.34	19,043,391.71
基金投资		-	-
债券投资		1,173,019.01	664,172.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		286,744.93	-
应收股利		-	-
应收申购款		38,348.57	7,007.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	10,719.58
资产总计		22,334,061.45	20,672,857.66
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		450,014.79	-
应付清算款		264,918.12	-
应付赎回款		3,233.91	100.20
应付管理人报酬		25,332.78	26,636.77
应付托管费		4,222.15	4,439.47
应付销售服务费		4,150.83	4,630.94
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	33,257.16	72,579.54
负债合计		785,129.74	108,386.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	12,211,614.86	12,001,566.52
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	9,337,316.85	8,562,904.22
净资产合计		21,548,931.71	20,564,470.74
负债和净资产总计		22,334,061.45	20,672,857.66

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，创金合信量化核心混合 A 份额净值 1.7905 元，基金份额总额 8,356,724.48 份；创金合信量化核心混合 C 份额净值 1.7084 元，基金份额总额 3,854,890.38 份；总份额合计 12,211,614.86 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		853,251.16	4,071,535.87
1.利息收入		2,949.99	24,512.10
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,949.99	11,722.60
债券利息收入		-	12,789.50
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		370,523.40	10,859,936.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	237,108.86	11,818,749.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	22,464.64	-17.65
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-1,147,680.00
股利收益	6.4.7.15	110,949.90	188,885.45
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	479,229.81	-6,857,216.25
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	547.96	44,303.17
减：二、营业总支出		236,086.73	767,911.13
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	145,810.35	266,465.92
2.托管费	6.4.10.2.2	24,301.81	44,411.04
3.销售服务费	6.4.10.2.3	24,398.22	49,901.06
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		2,726.56	2,591.44
其中：卖出回购金融资产 支出		2,726.56	2,591.44
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.19	38,849.79	404,541.67
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		617,164.43	3,303,624.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		617,164.43	3,303,624.74
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		617,164.43	3,303,624.74

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	12,001,566.52	-	8,562,904.22	20,564,470.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	12,001,566.52	-	8,562,904.22	20,564,470.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	210,048.34	-	774,412.63	984,460.97
（一）、综合收益总额	-	-	617,164.43	617,164.43
（二）、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）	210,048.34	-	157,248.20	367,296.54
其中：1.基金申购款	1,368,270.02	-	844,308.01	2,212,578.03
2.基金赎回款	-1,158,221.68	-	-687,059.81	-1,845,281.49
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	12,211,614.86	-	9,337,316.85	21,548,931.71
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	53,847,422.32	-	42,827,927.88	96,675,350.20
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	53,847,422.32	-	42,827,927.88	96,675,350.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-37,991,900.95	-	-30,034,037.17	-68,025,938.12
（一）、综合收益总额	-	-	3,303,624.74	3,303,624.74
（二）、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
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	15,855,521.37	-	12,793,890.71	28,649,412.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____苏彦祝____ ____奚胜田____ ____吉祥____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

创金合信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×80%+中债综合财富(总值)指数收益率×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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《创金合信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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日至 2022 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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《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>》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的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》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《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》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产的未来现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金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。本基金未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。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 864,281.41 元、79,347.81 元、3,937.31 元、10,719.58 元和 7,007.64 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 864,377.86 元、79,387.08 元、3,939.18 元、0.00 元和 7,007.64 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 19,707,563.91 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 19,718,145.90 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 100.20 元、26,636.77 元、4,439.47 元、4,630.94 元、23,579.40 元和 0.14 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 100.20 元、26,636.77 元、4,439.47 元、4,630.94 元、23,579.40 元和 0.14 元。

(b) 修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入

价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	308,226.99
等于：本金	308,196.36
加：应计利息	30.63
减：坏账准备	-

定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	308,226.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	19,326,631.70	-	20,277,553.34	950,921.64	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,160,812.00	11,279.01	1,173,019.01	928.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,160,812.00	11,279.01	1,173,019.01	928.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	20,487,443.70	11,279.01	21,450,572.35	951,849.64	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.09
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,121.28
其中：交易所市场	4,121.28
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	29,135.79
合计	33,257.16

6.4.7.7 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,041,299.87	8,041,299.87
本期申购	1,048,781.68	1,048,781.68
本期赎回（以“-”号填列）	-733,357.07	-733,357.07
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	8,356,724.48	8,356,724.48

创金合信量化核心混合 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,960,266.65	3,960,266.65
本期申购	319,488.34	319,488.34
本期赎回（以“-”号填列）	-424,864.61	-424,864.61
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	3,854,890.38	3,854,890.38

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

创金合信量化核心混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	8,734,984.15	-2,803,714.59	5,931,269.56
本期利润	122,060.63	343,735.60	465,796.23

本期基金份额交易产生的变动数	339,673.05	-130,340.72	209,332.33
其中：基金申购款	1,103,623.57	-446,199.07	657,424.50
基金赎回款	-763,950.52	315,858.35	-448,092.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,196,717.83	-2,590,319.71	6,606,398.12

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
本期期初	3,967,412.78	-1,335,778.12	2,631,634.66
本期利润	15,873.99	135,494.21	151,368.20
本期基金份额交易产生的变动数	-93,700.79	41,616.66	-52,084.13
其中：基金申购款	303,968.90	-117,085.39	186,883.51
基金赎回款	-397,669.69	158,702.05	-238,967.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,889,585.98	-1,158,667.25	2,730,918.73

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,103.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,794.98
其他	51.53
合计	2,949.99

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	237,108.86
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	237,108.86

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	161,456,395.67
减：卖出股票成本总额	161,002,626.42

减：交易费用	216,660.39
买卖股票差价收入	237,108.86

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	9,356.37
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	13,108.27
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	22,464.64

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	823,662.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	794,061.40
减：应计利息总额	16,490.20
减：交易费用	2.90
买卖债券差价收入	13,108.27

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	110,949.90
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	110,949.90

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	479,229.81
——股票投资	476,822.61
——债券投资	2,407.20
——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	479,229.81

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	522.29
转换费收入	25.67
合计	547.96

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	114.00
账户维护费	18,000.00
查询服务费	900.00
合计	38,849.79

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	163,194,108.89	50.50%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
-------	------------------------------------	---

	月 30 日		2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	1,586,120.80	76.69%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	6,500,000.00	51.38%	-	-

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	3,440.66	12.43%	1,305.22	31.67%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	145,810.35	266,465.92

其中：支付销售机构的客户维护费	64,805.77	105,122.17
-----------------	-----------	------------

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	24,301.81	44,411.04

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	-	-
中国工商银行	-	12,049.36	12,049.36
合计	-	12,049.36	12,049.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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
中国工商银行	-	27,934.11	27,934.11
合计	-	31,912.12	31,912.12

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

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	308,226.99	1,103.48	427,948.10	3,231.33

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期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期 2022 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 450,014.79 元，于 2022 年 7 月 6 日至 2022 年 7 月 7 日（先后）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同责任，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。

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,173,019.01	606,172.20
合计	1,173,019.01	606,172.20

未评级债券包括国债、政策性金融债、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	58,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	58,000.00

未评级债券包括国债、政策性金融债。

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 2022 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 450,236.85 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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综合持仓集中度指标、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。

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、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	308,226.99	-	-	-	308,226.99
结算备付金	241,300.26	-	-	-	241,300.26
存出保证金	8,868.35	-	-	-	8,868.35
交易性金融资产	1,173,019.01	-	-	20,277,553.34	21,450,572.35
应收申购款	-	-	-	38,348.57	38,348.57
应收清算款	-	-	-	286,744.93	286,744.93
资产总计	1,731,414.61	-	-	20,602,646.84	22,334,061.45
负债					
卖出回购金融资	450,014.79	-	-	-	450,014.79

产款					
应付赎回款	-	-	-	3,233.91	3,233.91
应付管理人报酬	-	-	-	25,332.78	25,332.78
应付托管费	-	-	-	4,222.15	4,222.15
应付销售服务费	-	-	-	4,150.83	4,150.83
应付清算款	-	-	-	264,918.12	264,918.12
其他负债	-	-	-	33,257.16	33,257.16
负债总计	450,014.79	-	-	335,114.95	785,129.74
利率敏感度缺口	1,281,399.82	-	-	20,267,531.89	21,548,931.71
上年度末 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	864,281.41	-	-	-	864,281.41
结算备付金	79,347.81	-	-	-	79,347.81
存出保证金	3,937.31	-	-	-	3,937.31
交易性金融资产	606,172.20	-	58,000.00	19,043,391.71	19,707,563.91
应收利息	-	-	-	10,719.58	10,719.58
应收申购款	-	-	-	7,007.64	7,007.64
资产总计	1,553,738.73	-	58,000.00	19,061,118.93	20,672,857.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	100.20	100.20
应付管理人报酬	-	-	-	26,636.77	26,636.77
应付托管费	-	-	-	4,439.47	4,439.47
应付销售服务费	-	-	-	4,630.94	4,630.94
应付交易费用	-	-	-	23,579.40	23,579.40
其他负债	-	-	-	49,000.14	49,000.14
负债总计	-	-	-	108,386.92	108,386.92
利率敏感度缺口	1,553,738.73	-	58,000.00	18,952,732.01	20,564,470.74

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（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	-1,553.07	-403.53
2.市场利率平行下降相关风险变量的变动 25 个基点	1,558.95	404.82	

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无外汇风险的敏感性分析。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	20,277,553.34	94.10	19,043,391.71	92.60
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	20,277,553.34	94.10	19,043,391.71	92.60

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）

1.业绩比较基准上升 5%	1,262,784.63	1,154,886.49
2.业绩比较基准下降 5%	-1,262,784.63	-1,154,886.49

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	20,277,553.34
第二层次	1,173,019.01
第三层次	-
合计	21,450,572.35

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	20,277,553.34	90.79
	其中：股票	20,277,553.34	90.79
2	固定收益投资	1,173,019.01	5.25
	其中：债券	1,173,019.01	5.25
	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	549,527.25	2.46
7	其他资产	333,961.85	1.50
8	合计	22,334,061.45	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	118,409.00	0.55
B	采矿业	1,300,458.64	6.03
C	制造业	12,824,197.61	59.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	780,232.00	3.62
E	建筑业	113,539.80	0.53
F	批发和零售业	528,663.00	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	441,297.00	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,640,954.00	7.62
J	金融业	2,121,018.60	9.84
K	房地产业	51,546.00	0.24
L	租赁和商务服务业	168,130.69	0.78
M	科学研究和技术服务业	24,180.00	0.11

N	水利、环境和公共设施管理业	8,272.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	143,200.00	0.66
S	综合	13,455.00	0.06
	合计	20,277,553.34	94.10

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	300	613,500.00	2.85
2	603290	斯达半导	1,300	501,670.00	2.33
3	002240	盛新锂能	7,200	434,592.00	2.02
4	300390	天华超净	4,700	410,780.00	1.91
5	300363	博腾股份	5,200	405,548.00	1.88
6	688200	华峰测控	1,100	392,040.00	1.82
7	688099	晶晨股份	3,700	373,700.00	1.73
8	688399	硕世生物	3,200	364,864.00	1.69
9	300170	汉得信息	38,900	350,489.00	1.63
10	603979	金诚信	17,800	343,718.00	1.60
11	601933	永辉超市	78,400	335,552.00	1.56
12	603026	石大胜华	2,300	334,305.00	1.55
13	300432	富临精工	14,600	321,200.00	1.49
14	002460	赣锋锂业	2,100	312,270.00	1.45
15	688008	澜起科技	5,100	308,958.00	1.43
16	002192	融捷股份	2,000	307,400.00	1.43
17	000883	湖北能源	57,700	294,847.00	1.37
18	600211	西藏药业	7,100	294,721.00	1.37
19	002929	润建股份	8,200	294,380.00	1.37
20	002821	凯莱英	1,000	289,000.00	1.34
21	000960	锡业股份	17,000	285,090.00	1.32
22	002810	山东赫达	7,800	283,842.00	1.32
23	601156	东航物流	13,100	259,380.00	1.20
24	002466	天齐锂业	2,000	249,600.00	1.16
25	601077	渝农商行	64,700	239,390.00	1.11
26	002741	光华科技	11,700	233,181.00	1.08

27	002261	拓维信息	36,100	231,401.00	1.07
28	600901	江苏租赁	42,300	216,999.00	1.01
29	603392	万泰生物	1,325	205,772.50	0.95
30	000762	西藏矿业	3,500	195,755.00	0.91
31	002049	紫光国微	1,000	189,720.00	0.88
32	300477	合纵科技	24,100	185,570.00	0.86
33	300661	圣邦股份	1,000	182,020.00	0.84
34	000878	云南铜业	15,000	170,850.00	0.79
35	000935	四川双马	7,000	169,540.00	0.79
36	600811	东方集团	59,800	169,234.00	0.79
37	003816	中国广核	59,000	165,200.00	0.77
38	601187	厦门银行	27,700	165,092.00	0.77
39	600499	科达制造	7,900	163,056.00	0.76
40	601166	兴业银行	8,100	161,190.00	0.75
41	300750	宁德时代	300	160,200.00	0.74
42	600887	伊利股份	4,100	159,695.00	0.74
43	300130	新国都	12,400	152,024.00	0.71
44	002304	洋河股份	800	146,520.00	0.68
45	688016	心脉医疗	700	136,367.00	0.63
46	600060	海信视像	10,900	136,250.00	0.63
47	002594	比亚迪	400	133,396.00	0.62
48	300860	锋尚文化	2,800	132,244.00	0.61
49	300035	中科电气	4,700	131,365.00	0.61
50	000552	靖远煤电	30,444	131,213.64	0.61
51	600905	三峡能源	20,800	130,832.00	0.61
52	600809	山西汾酒	400	129,920.00	0.60
53	002812	恩捷股份	500	125,225.00	0.58
54	300663	科蓝软件	8,000	123,840.00	0.57
55	600738	丽尚国潮	16,700	121,743.00	0.56
56	000726	鲁泰A	17,000	121,550.00	0.56
57	600050	中国联通	34,800	120,408.00	0.56
58	002176	江特电机	4,800	120,192.00	0.56
59	300138	晨光生物	7,600	118,332.00	0.55
60	601818	光大银行	38,600	116,186.00	0.54
61	000968	蓝焰控股	11,100	115,995.00	0.54
62	000001	平安银行	7,500	112,350.00	0.52
63	002142	宁波银行	3,000	107,430.00	0.50
64	600879	航天电子	16,100	104,489.00	0.48
65	688005	容百科技	800	103,552.00	0.48
66	603129	春风动力	900	102,348.00	0.47
67	002344	海宁皮城	21,900	102,273.00	0.47
68	600967	内蒙一机	11,200	102,144.00	0.47
69	600030	中信证券	4,700	101,802.00	0.47

70	603360	百傲化学	7,000	98,210.00	0.46
71	300748	金力永磁	2,600	95,680.00	0.44
72	002413	雷科防务	17,100	94,905.00	0.44
73	603236	移远通信	690	92,225.40	0.43
74	000333	美的集团	1,500	90,585.00	0.42
75	601238	广汽集团	5,900	89,916.00	0.42
76	601288	农业银行	29,700	89,694.00	0.42
77	300803	指南针	1,500	88,170.00	0.41
78	300919	中伟股份	700	86,730.00	0.40
79	600089	特变电工	3,100	84,909.00	0.39
80	002371	北方华创	300	83,136.00	0.39
81	600390	五矿资本	16,600	81,174.00	0.38
82	002850	科达利	500	79,500.00	0.37
83	603989	艾华集团	2,800	78,960.00	0.37
84	002215	诺普信	13,300	74,347.00	0.35
85	603429	集友股份	5,757	74,035.02	0.34
86	000661	长春高新	300	70,026.00	0.32
87	600863	内蒙华电	18,600	67,890.00	0.32
88	600486	扬农化工	500	66,640.00	0.31
89	002714	牧原股份	1,200	66,324.00	0.31
90	600157	永泰能源	41,700	66,303.00	0.31
91	300504	天邑股份	3,700	65,712.00	0.30
92	600648	外高桥	4,800	65,280.00	0.30
93	002966	苏州银行	10,600	64,660.00	0.30
94	601668	中国建筑	11,500	61,180.00	0.28
95	600256	广汇能源	5,800	61,132.00	0.28
96	002756	永兴材料	400	60,884.00	0.28
97	601211	国泰君安	4,000	60,800.00	0.28
98	300628	亿联网络	797	60,691.55	0.28
99	002311	海大集团	1,000	60,010.00	0.28
100	300896	爱美客	100	60,001.00	0.28
101	601901	方正证券	8,800	59,048.00	0.27
102	300481	濮阳惠成	2,500	58,750.00	0.27
103	688981	中芯国际	1,300	58,721.00	0.27
104	300979	华利集团	800	58,464.00	0.27
105	600926	杭州银行	3,900	58,422.00	0.27
106	300171	东富龙	1,700	57,647.00	0.27
107	300900	广联航空	2,100	56,070.00	0.26
108	603713	密尔克卫	400	54,680.00	0.25
109	000733	振华科技	400	54,388.00	0.25
110	601998	中信银行	11,400	54,150.00	0.25
111	601728	中国电信	14,100	52,593.00	0.24
112	600028	中国石化	12,600	51,408.00	0.24

113	000596	古井贡酒	200	49,932.00	0.23
114	300373	扬杰科技	700	49,875.00	0.23
115	000876	新希望	3,200	48,960.00	0.23
116	600428	中远海特	10,000	47,600.00	0.22
117	601665	齐鲁银行	9,700	47,336.00	0.22
118	600018	上港集团	8,100	47,223.00	0.22
119	601658	邮储银行	8,600	46,354.00	0.22
120	300573	兴齐眼药	300	45,996.00	0.21
121	300457	赢合科技	1,600	45,456.00	0.21
122	600604	市北高新	7,700	44,968.00	0.21
123	002151	北斗星通	1,400	44,184.00	0.21
124	603619	中曼石油	2,100	43,197.00	0.20
125	601567	三星医疗	3,200	42,496.00	0.20
126	600053	九鼎投资	2,600	42,406.00	0.20
127	300571	平治信息	1,000	41,300.00	0.19
128	300327	中颖电子	800	39,848.00	0.18
129	688111	金山办公	200	39,424.00	0.18
130	300476	胜宏科技	2,100	38,556.00	0.18
131	002567	唐人神	4,500	38,295.00	0.18
132	300340	科恒股份	2,500	38,275.00	0.18
133	000989	九芝堂	4,200	38,220.00	0.18
134	002947	恒铭达	2,070	38,088.00	0.18
135	002582	好想你	5,000	37,450.00	0.17
136	601318	中国平安	800	37,352.00	0.17
137	600380	健康元	3,000	37,050.00	0.17
138	600415	小商品城	6,600	36,762.00	0.17
139	002124	天邦食品	5,400	36,288.00	0.17
140	002736	国信证券	3,700	35,409.00	0.16
141	300181	佐力药业	3,500	34,790.00	0.16
142	603308	应流股份	2,100	34,188.00	0.16
143	002965	祥鑫科技	1,100	33,319.00	0.15
144	300709	精研科技	1,120	33,140.80	0.15
145	000567	海德股份	2,235	33,078.00	0.15
146	002120	韵达股份	1,900	32,414.00	0.15
147	601208	东材科技	2,200	28,424.00	0.13
148	603799	华友钴业	280	26,773.60	0.12
149	600578	京能电力	8,400	26,292.00	0.12
150	600837	海通证券	2,600	25,506.00	0.12
151	000568	泸州老窖	100	24,654.00	0.11
152	603959	百利科技	2,000	24,240.00	0.11
153	688356	键凯科技	100	24,181.00	0.11
154	300384	三联虹普	1,300	24,180.00	0.11
155	002738	中矿资源	260	24,078.60	0.11

156	601828	美凯龙	3,500	21,210.00	0.10
157	300116	保力新	10,500	21,210.00	0.10
158	300482	万孚生物	500	20,355.00	0.09
159	000983	山西焦煤	1,500	20,085.00	0.09
160	300572	安车检测	1,300	19,461.00	0.09
161	000799	酒鬼酒	100	18,581.00	0.09
162	600172	黄河旋风	2,100	18,312.00	0.08
163	600362	江西铜业	1,000	17,830.00	0.08
164	000627	天茂集团	5,200	17,732.00	0.08
165	002807	江阴银行	3,900	17,667.00	0.08
166	601618	中国中冶	4,700	16,450.00	0.08
167	300346	南大光电	450	16,191.00	0.08
168	300398	飞凯材料	700	16,002.00	0.07
169	002128	电投能源	1,100	15,752.00	0.07
170	300777	中简科技	300	14,460.00	0.07
171	603919	金徽酒	400	13,596.00	0.06
172	601512	中新集团	1,500	13,455.00	0.06
173	300332	天壕环境	1,200	13,440.00	0.06
174	000998	隆平高科	800	13,328.00	0.06
175	300151	昌红科技	700	13,230.00	0.06
176	600643	爱建集团	2,100	12,453.00	0.06
177	002622	融钰集团	3,800	12,160.00	0.06
178	601727	上海电气	2,700	11,097.00	0.05
179	300133	华策影视	2,200	10,956.00	0.05
180	601939	建设银行	1,800	10,908.00	0.05
181	601898	中煤能源	1,000	10,380.00	0.05
182	002085	万丰奥威	1,900	10,203.00	0.05
183	600114	东睦股份	1,200	9,576.00	0.04
184	002375	亚厦股份	1,900	9,519.00	0.04
185	002645	华宏科技	400	8,728.00	0.04
186	300969	恒帅股份	100	8,466.00	0.04
187	002646	天佑德酒	400	7,660.00	0.04
188	600850	电科数字	400	7,464.00	0.03
189	603583	捷昌驱动	200	6,678.00	0.03
190	300947	德必集团	200	6,480.00	0.03
191	600292	远达环保	1,000	6,180.00	0.03
192	000002	万科 A	300	6,150.00	0.03
193	300068	南都电源	400	6,136.00	0.03
194	000034	神州数码	400	6,088.00	0.03
195	600389	江山股份	100	6,073.00	0.03
196	002042	华孚时尚	1,600	6,048.00	0.03
197	600545	卓郎智能	1,500	5,850.00	0.03
198	603520	司太立	200	5,624.00	0.03

199	000598	兴蓉环境	1,100	5,621.00	0.03
200	688020	方邦股份	134	5,224.66	0.02
201	603456	九洲药业	100	5,170.00	0.02
202	603369	今世缘	100	5,100.00	0.02
203	601369	陕鼓动力	500	4,800.00	0.02
204	002545	东方铁塔	400	4,552.00	0.02
205	000543	皖能电力	1,100	4,389.00	0.02
206	603613	国联股份	45	3,987.00	0.02
207	002948	青岛银行	1,100	3,982.00	0.02
208	000848	承德露露	400	3,872.00	0.02
209	000617	中油资本	800	3,848.00	0.02
210	002444	巨星科技	200	3,768.00	0.02
211	002585	双星新材	200	3,618.00	0.02
212	002073	软控股份	500	3,540.00	0.02
213	600938	中国海油	200	3,490.00	0.02
214	600155	华创阳安	400	3,392.00	0.02
215	002497	雅化集团	100	3,265.00	0.02
216	000600	建投能源	700	2,954.00	0.01
217	300238	冠昊生物	200	2,906.00	0.01
218	300087	荃银高科	150	2,469.00	0.01
219	600956	新天绿能	200	2,464.00	0.01
220	603681	永冠新材	100	2,458.00	0.01
221	688166	博瑞医药	100	2,415.00	0.01
222	300421	力星股份	200	2,408.00	0.01
223	601601	中国太保	100	2,353.00	0.01
224	688126	沪硅产业	100	2,298.00	0.01
225	002002	鸿达兴业	600	2,226.00	0.01
226	002204	大连重工	500	2,185.00	0.01
227	603337	杰克股份	100	2,148.00	0.01
228	300867	圣元环保	100	2,092.00	0.01
229	300059	东方财富	80	2,032.00	0.01
230	601319	中国人保	400	2,024.00	0.01
231	002298	中电兴发	300	1,968.00	0.01
232	300057	万顺新材	200	1,894.00	0.01
233	603773	沃格光电	90	1,440.00	0.01
234	605168	三人行	13	1,405.69	0.01
235	000090	天健集团	200	1,378.00	0.01
236	605358	立昂微	20	1,347.60	0.01
237	300065	海兰信	100	1,310.00	0.01
238	601899	紫金矿业	100	933.00	0.00
239	000498	山东路桥	80	772.80	0.00
240	601108	财通证券	80	629.60	0.00
241	000625	长安汽车	30	519.60	0.00

242	600649	城投控股	100	428.00	0.00
243	000970	中科三环	15	281.70	0.00
244	002985	北摩高科	1	58.58	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603290	斯达半导	1,812,694.00	8.81
2	002821	凯莱英	1,624,813.00	7.90
3	300363	博腾股份	1,474,240.72	7.17
4	002240	盛新锂能	1,437,506.00	6.99
5	002738	中矿资源	1,328,402.00	6.46
6	300390	天华超净	1,177,240.00	5.72
7	688200	华峰测控	1,154,132.09	5.61
8	002756	永兴材料	1,138,122.00	5.53
9	300750	宁德时代	1,127,598.00	5.48
10	000762	西藏矿业	1,109,121.00	5.39
11	000552	靖远煤电	1,101,440.36	5.36
12	300661	圣邦股份	1,101,418.00	5.36
13	002466	天齐锂业	1,094,636.00	5.32
14	688399	硕世生物	1,079,603.54	5.25
15	601939	建设银行	1,043,501.00	5.07
16	601187	厦门银行	1,026,697.00	4.99
17	603392	万泰生物	1,025,353.00	4.99
18	600036	招商银行	1,001,615.00	4.87
19	002371	北方华创	993,570.65	4.83
20	002497	雅化集团	975,964.00	4.75
21	300769	德方纳米	975,523.00	4.74
22	600546	山煤国际	964,220.00	4.69
23	002049	紫光国微	907,393.00	4.41
24	688016	心脉医疗	881,695.98	4.29
25	600639	浦东金桥	880,653.40	4.28
26	600211	西藏药业	877,056.00	4.26
27	601881	中国银河	833,628.00	4.05
28	600901	江苏租赁	833,169.00	4.05
29	601156	东航物流	828,373.00	4.03
30	600499	科达制造	824,723.00	4.01
31	688005	容百科技	823,660.89	4.01
32	688202	美迪西	819,211.00	3.98
33	002812	恩捷股份	819,140.00	3.98

34	300170	汉得信息	816,945.00	3.97
35	603259	药明康德	792,443.00	3.85
36	300919	中伟股份	791,055.54	3.85
37	300803	指南针	749,247.00	3.64
38	601998	中信银行	747,196.00	3.63
39	600519	贵州茅台	718,756.00	3.50
40	002460	赣锋锂业	713,623.00	3.47
41	601665	齐鲁银行	701,829.00	3.41
42	002050	三花智控	698,507.00	3.40
43	002929	润建股份	695,424.00	3.38
44	601166	兴业银行	692,592.00	3.37
45	603713	密尔克卫	686,175.00	3.34
46	601288	农业银行	685,618.00	3.33
47	688012	中微公司	684,947.24	3.33
48	000032	深桑达 A	677,349.00	3.29
49	003816	中国广核	668,381.00	3.25
50	300759	康龙化成	667,639.00	3.25
51	605358	立昂微	665,832.00	3.24
52	000970	中科三环	663,451.90	3.23
53	688099	晶晨股份	650,044.61	3.16
54	605376	博迁新材	645,366.00	3.14
55	002344	海宁皮城	638,296.04	3.10
56	002850	科达利	634,716.00	3.09
57	300861	美畅股份	634,674.00	3.09
58	002597	金禾实业	618,414.00	3.01
59	600050	中国联通	618,193.00	3.01
60	000625	长安汽车	615,519.00	2.99
61	000935	四川双马	606,300.00	2.95
62	600030	中信证券	604,335.40	2.94
63	603979	金诚信	602,131.00	2.93
64	002151	北斗星通	597,222.00	2.90
65	600718	东软集团	594,654.00	2.89
66	688981	中芯国际	594,650.53	2.89
67	601318	中国平安	594,344.00	2.89
68	000883	湖北能源	589,773.00	2.87
69	300347	泰格医药	583,738.00	2.84
70	002709	天赐材料	582,387.00	2.83
71	601009	南京银行	582,248.00	2.83
72	603799	华友钴业	581,979.00	2.83
73	000001	平安银行	581,119.00	2.83
74	603308	应流股份	572,942.00	2.79
75	603236	移远通信	572,214.00	2.78
76	300973	立高食品	567,309.00	2.76

77	603659	璞泰来	566,622.00	2.76
78	600284	浦东建设	564,963.00	2.75
79	000333	美的集团	552,022.00	2.68
80	000878	云南铜业	545,222.00	2.65
81	601898	中煤能源	536,194.00	2.61
82	600460	士兰微	535,791.00	2.61
83	600529	山东药玻	531,940.00	2.59
84	002192	融捷股份	531,830.00	2.59
85	603989	艾华集团	531,592.00	2.59
86	600967	内蒙一机	528,488.00	2.57
87	601238	广汽集团	528,093.00	2.57
88	600109	国金证券	527,897.00	2.57
89	688318	财富趋势	523,208.61	2.54
90	002573	清新环境	517,884.00	2.52
91	601211	国泰君安	517,170.00	2.51
92	601988	中国银行	516,705.00	2.51
93	300504	天邑股份	514,756.00	2.50
94	002142	宁波银行	512,981.00	2.49
95	600887	伊利股份	509,819.00	2.48
96	000090	天健集团	504,079.00	2.45
97	300496	中科创达	495,607.00	2.41
98	300037	新宙邦	488,599.00	2.38
99	000968	蓝焰控股	487,296.00	2.37
100	600648	外高桥	483,626.00	2.35
101	002741	光华科技	479,054.00	2.33
102	688289	圣湘生物	478,140.78	2.33
103	603026	石大胜华	477,689.00	2.32
104	002261	拓维信息	477,653.00	2.32
105	600705	中航产融	468,941.00	2.28
106	002183	怡亚通	463,409.00	2.25
107	600104	上汽集团	462,722.00	2.25
108	600168	武汉控股	462,304.00	2.25
109	000039	中集集团	461,057.00	2.24
110	600155	华创阳安	458,948.00	2.23
111	600885	宏发股份	453,701.00	2.21
112	603686	福龙马	450,189.00	2.19
113	600909	华安证券	448,133.00	2.18
114	000728	国元证券	447,878.00	2.18
115	300224	正海磁材	447,622.00	2.18
116	300476	胜宏科技	443,100.00	2.15
117	300035	中科电气	441,571.00	2.15
118	000166	申万宏源	439,550.00	2.14
119	300745	欣锐科技	432,534.00	2.10

120	002042	华孚时尚	431,297.00	2.10
121	000598	兴蓉环境	426,299.00	2.07
122	000661	长春高新	424,167.00	2.06
123	600060	海信视像	420,835.00	2.05
124	601688	华泰证券	420,822.00	2.05
125	300346	南大光电	419,659.20	2.04
126	002176	江特电机	418,950.00	2.04
127	300457	赢合科技	418,242.00	2.03
128	000877	天山股份	417,884.00	2.03
129	600888	新疆众和	417,111.00	2.03
130	300748	金力永磁	412,677.00	2.01
131	002948	青岛银行	412,638.00	2.01
132	600497	驰宏锌锗	411,317.00	2.00

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	300750	宁德时代	1,682,887.00	8.18
2	600519	贵州茅台	1,488,911.00	7.24
3	603290	斯达半导	1,427,632.00	6.94
4	600036	招商银行	1,419,238.00	6.90
5	002738	中矿资源	1,379,614.00	6.71
6	002821	凯莱英	1,343,991.00	6.54
7	300769	德方纳米	1,137,514.00	5.53
8	002240	盛新锂能	1,134,722.00	5.52
9	002756	永兴材料	1,130,009.00	5.49
10	300363	博腾股份	1,123,807.60	5.46
11	600546	山煤国际	1,118,481.00	5.44
12	002371	北方华创	1,094,815.00	5.32
13	000552	靖远煤电	1,070,062.00	5.20
14	601166	兴业银行	1,061,071.00	5.16
15	002466	天齐锂业	1,038,091.00	5.05
16	601939	建设银行	1,031,299.00	5.01
17	603259	药明康德	989,762.40	4.81
18	000762	西藏矿业	980,922.00	4.77
19	002497	雅化集团	968,015.00	4.71
20	300661	圣邦股份	958,473.00	4.66
21	688005	容百科技	920,711.13	4.48
22	603392	万泰生物	920,676.00	4.48
23	600639	浦东金桥	908,888.00	4.42
24	688202	美迪西	906,480.72	4.41

25	300390	天华超净	900,873.00	4.38
26	002049	紫光国微	840,180.00	4.09
27	688200	华峰测控	835,117.08	4.06
28	601881	中国银河	814,482.75	3.96
29	601187	厦门银行	814,192.00	3.96
30	300059	东方财富	808,250.40	3.93
31	002142	宁波银行	805,670.00	3.92
32	601318	中国平安	802,732.14	3.90
33	688016	心脉医疗	781,272.95	3.80
34	300803	指南针	780,659.00	3.80
35	000333	美的集团	749,622.62	3.65
36	300347	泰格医药	736,463.37	3.58
37	300919	中伟股份	732,560.00	3.56
38	002460	赣锋锂业	726,418.00	3.53
39	000625	长安汽车	723,931.00	3.52
40	601688	华泰证券	721,270.00	3.51
41	603799	华友钴业	712,709.00	3.47
42	600030	中信证券	709,229.40	3.45
43	002812	恩捷股份	708,363.00	3.44
44	688399	硕世生物	706,571.16	3.44
45	002050	三花智控	697,588.00	3.39
46	601998	中信银行	687,509.00	3.34
47	300759	康龙化成	681,275.00	3.31
48	300861	美畅股份	676,586.00	3.29
49	603713	密尔克卫	667,618.00	3.25
50	688012	中微公司	663,118.50	3.22
51	601898	中煤能源	654,988.00	3.19
52	600887	伊利股份	652,704.00	3.17
53	000001	平安银行	648,670.00	3.15
54	601665	齐鲁银行	644,313.00	3.13
55	600901	江苏租赁	639,633.68	3.11
56	300450	先导智能	639,190.00	3.11
57	000032	深桑达 A	638,172.00	3.10
58	000970	中科三环	637,551.50	3.10
59	600211	西藏药业	633,146.00	3.08
60	000858	五粮液	622,434.56	3.03
61	002850	科达利	619,245.00	3.01
62	688981	中芯国际	613,720.60	2.98
63	603659	璞泰来	609,946.00	2.97
64	002597	金禾实业	604,994.00	2.94
65	000661	长春高新	599,787.00	2.92
66	601288	农业银行	595,898.00	2.90
67	002151	北斗星通	595,638.00	2.90

68	600718	东软集团	584,294.00	2.84
69	605358	立昂微	581,300.00	2.83
70	002709	天赐材料	581,250.00	2.83
71	601009	南京银行	580,225.00	2.82
72	600499	科达制造	579,345.00	2.82
73	600284	浦东建设	568,766.00	2.77
74	601156	东航物流	561,363.00	2.73
75	603308	应流股份	559,587.00	2.72
76	002344	海宁皮城	550,734.60	2.68
77	600460	士兰微	543,550.00	2.64
78	605376	博迁新材	540,160.00	2.63
79	300973	立高食品	526,083.00	2.56
80	601988	中国银行	515,595.00	2.51
81	300745	欣锐科技	515,121.00	2.50
82	002573	清新环境	507,495.00	2.47
83	600109	国金证券	506,475.00	2.46
84	601186	中国铁建	505,078.00	2.46
85	003816	中国广核	504,165.00	2.45
86	603236	移远通信	497,526.00	2.42
87	600050	中国联通	494,303.70	2.40
88	000090	天健集团	493,072.00	2.40
89	000568	泸州老窖	491,237.00	2.39
90	000935	四川双马	487,248.00	2.37
91	002410	广联达	486,422.00	2.37
92	300496	中科创达	483,766.00	2.35
93	300037	新宙邦	481,714.42	2.34
94	600529	山东药玻	480,998.00	2.34
95	600705	中航产融	479,062.00	2.33
96	300170	汉得信息	472,481.76	2.30
97	688289	圣湘生物	469,682.19	2.28
98	603989	艾华集团	467,994.00	2.28
99	002183	怡亚通	467,344.00	2.27
100	600155	华创阳安	459,216.00	2.23
101	600967	内蒙一机	458,692.00	2.23
102	600168	武汉控股	458,433.00	2.23
103	000039	中集集团	453,492.00	2.21
104	601658	邮储银行	452,196.00	2.20
105	002929	润建股份	451,941.00	2.20
106	600104	上汽集团	450,575.00	2.19
107	688318	财富趋势	448,942.75	2.18
108	300504	天邑股份	448,777.00	2.18
109	601211	国泰君安	445,534.00	2.17
110	000155	川能动力	441,263.00	2.15

111	300476	胜宏科技	439,790.00	2.14
112	000968	蓝焰控股	439,745.00	2.14
113	300158	振东制药	439,695.00	2.14
114	601238	广汽集团	438,793.00	2.13
115	600885	宏发股份	436,784.04	2.12
116	000598	兴蓉环境	436,237.00	2.12
117	000166	申万宏源	435,483.00	2.12
118	600585	海螺水泥	432,745.00	2.10
119	600909	华安证券	432,642.00	2.10
120	300896	爱美客	432,349.00	2.10
121	300224	正海磁材	428,534.00	2.08
122	300346	南大光电	426,706.40	2.07
123	600497	驰宏锌锗	415,976.00	2.02
124	600888	新疆众和	414,736.00	2.02
125	000728	国元证券	414,669.00	2.02
126	300696	爱乐达	413,626.00	2.01
127	603686	福龙马	412,528.00	2.01
128	600648	外高桥	412,016.00	2.00

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	161,759,965.44
卖出股票收入（成交）总额	161,456,395.67

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	1,173,019.01	5.44
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	1,173,019.01	5.44

7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019666	22 国债 01	11,600	1,173,019.01	5.44

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

2021 年 7 月 6 日，重庆博腾制药科技股份有限公司（下称“博腾股份”，股票代码：300363.SZ）收到涪陵海关行政处罚决定书（关简罚字〔2021〕0005 号），其中认定该公司于 2021 年 1 月 14 日向海关申报一票出口货物时，由于制单人员疏忽导致申报价格录入错误，严重影响海关统计准确性，根据《中华人民共和国海关行政处罚实施条例》第十五条第（一）项、《中华人民共和国行政处罚法》第二十七条第（四）项之规定构成违反海关监管规定的行为。但公司在海关发现其违法行为之前，自查发现主要违法事实，并于 2021 年 6

月 7 日向涪陵海关提交主动披露报告，主动报明其在出口申报过程中存在的价格申报错误的违规行为，具有减轻情节，最终被中华人民共和国涪陵海关罚款人民币 500 元整。

本基金投研人员分析认为，公司能够自查发现申报错误的行为，并主动向涪陵海关报告，积极面对错误，对于后续的申报具有警示作用。且处罚金额对公司的基本面影响有限。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对博腾股份进行了投资。

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	8,868.35
2	应收清算款	286,744.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	38,348.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	333,961.85

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	548	15,249.50	-	-	8,356,724.48	100.00%

A						
创金合信量化核心混合 C	751	5,133.01	-	-	3,854,890.38	100.00%
合计	1,247	9,792.79	-	-	12,211,614.86	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	715,625.07	8.56%
	创金合信量化核心混合 C	11.92	0.00%
	合计	715,636.99	5.86%

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	50~100
	创金合信量化核心混合 C	0
	合计	50~100

§ 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	8,041,299.87	3,960,266.65

本报告期基金总申购份额	1,048,781.68	319,488.34
减：报告期基金总赎回份额	733,357.07	424,864.61
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,356,724.48	3,854,890.38

§ 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

本基金本报告期内基金管理人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金的基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			额的比例			
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	109,219,555.77	33.80%	2,816.06	10.17%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
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	50,752,123.38	15.70%	21,429.47	77.40%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	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	-	-	-	-	-
五矿证券	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	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券	2	-	-	-	-	-
第一创业 证券	3	163,194,108.89	50.50%	3,440.66	12.43%	-
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。

本基金报告期内退租中金财富 2 个交易单元、中信证券 2 个交易单元，新增五矿证券 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	-	-	-	-	-	-
东北证券	221,510.00	10.71%	6,150,000.00	48.62%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	260,474.60	12.59%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	1,586,120.80	76.69%	6,500,000.00	51.38%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
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	创金合信基金管理有限公司 旗下基金 2021 年度第四季度报告提示性公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
2	创金合信量化核心混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
3	创金合信量化核心混合型证券投资基金 2021 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-30
4	创金合信量化核心混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
5	创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金转换业务规则说明的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-10

§ 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

本基金本报告期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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

创金合信基金成立于 2014 年 7 月，是第一家成立时即实现员工持股的基金公司。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 2022 年 6 月 30 日，创金合信基金共管理 84 只公募基金，公募管理规模 1027.19 亿元。2022 年 7 月，创金合信基金荣获证券时报第十七届“明星基金公司成长奖”。

§ 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 2022 年中期报告原文。

12.2 存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日